上证综指交易型开放式指数证券投资基金
基金产品资料概要更新

2024 年 08 月 20 日（信息截至：2024 年 08 月 19 日）

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、 产品概况

基金简称	上证综指 ETF	基金代码	510210
场内简称	上证指数 ETF(综指 ETF)		
上市交易所	上海证券交易所	上市日期	2011 年 3 月 25 日
基金管理人	富国基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2011 年 01 月 30 日	基金类型	股票型
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
交易币种	人民币		
基金经理	方旻	任职日期	2014 年 11 月 19 日
		证券从业日期	2010 年 02 月 10 日
基金经理	王保合	任职日期	2011 年 03 月 03 日
		证券从业日期	2006 年 07 月 01 日

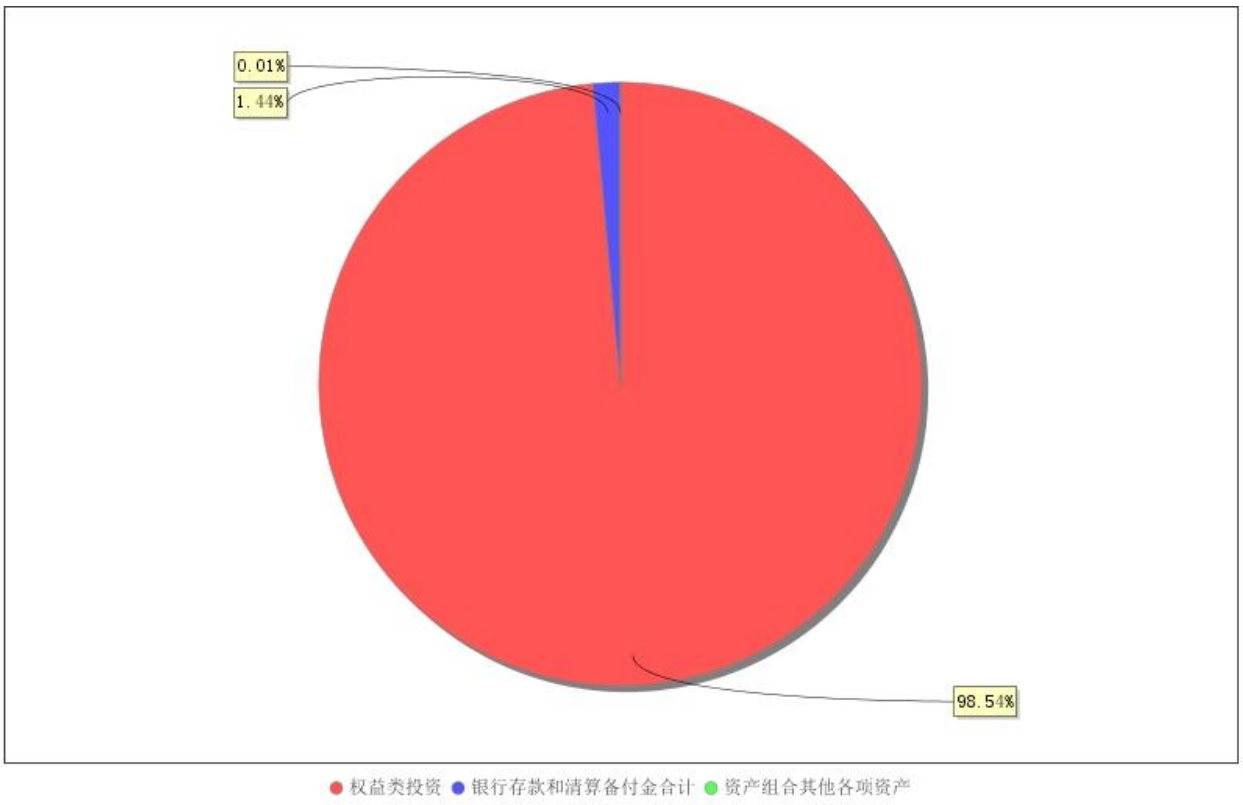
二、 基金投资与净值表现

（一） 投资目标与投资策略

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的标的指数为上证综合指数。
投资范围	本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回清单内现金替代、现金差额、基金规模或市场变化等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于存托凭证、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
主要投资策略	本基金采用最优化抽样复制标的指数。最优化抽样依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型，使用“跟踪误差最小化”的最优化方式创建目标组合，从而实现对标的指数的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的最优化目标组合的构建、存托凭证的投资策略、其他金融工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	上证综合指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数型基金，跟踪上证综合指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

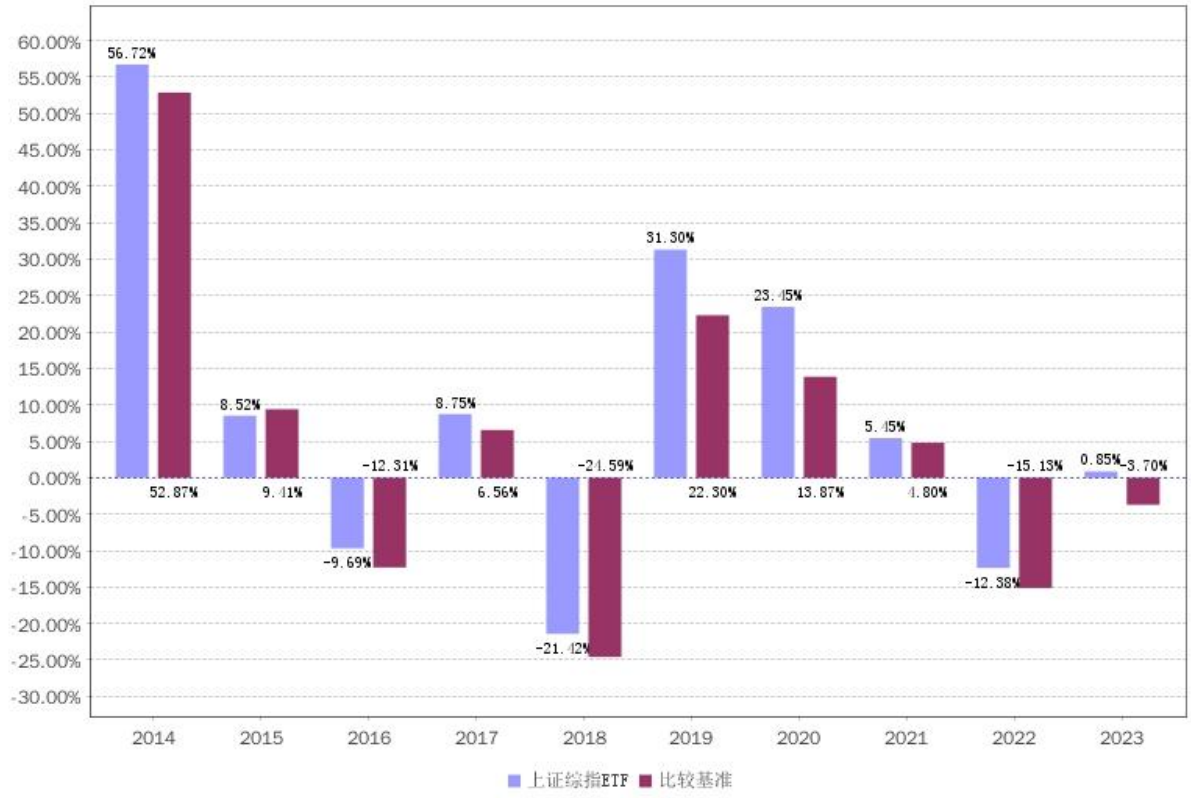
注：详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

（二） 投资组合资产配置图表



注：截止日期 2024 年 06 月 30 日。

（三） 最近 10 年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：本基金合同生效日 2011 年 01 月 30 日。业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

三、 投资本基金涉及的费用

（一） 基金销售相关费用

注：投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额 0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用。

（二） 基金运作相关费用

费用类别	年费率/收费方式	收取方
管理费	0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	68,000.00 元/年	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元/年	规定披露报刊
指数许可使用费	本基金指数许可使用费年费率为 0.03%。就每个计费季度而言，如当季度日均基金资产净值（日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数，下同）大于人民币 5000 万元的，指数许可使用费的收取下限金额为每季度人民币 35,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算；如当季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元的，指数许可使用费不设下限。	指数编制公司

注：以上费用将从基金资产中扣除；本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。除上述费用外的其他运作费用，详见《招募说明书》中的“基金费用与税收”章节。

（三） 基金运作综合费用测算

基金运作综合费率（年化）
0.63%

注：若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如上表所示。基金管理费率、托管费率、指数许可使用费为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、 风险揭示与重要提示

（一） 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金的特有风险包括：

1、指数化投资的风险：ETF 作为股票指数基金，在投资管理中会至少维持 95%的股票投资比例，具有对股票市场的系统性风险，不能规避市场下跌的风险和个股风险。

2、跟踪误差控制未达约定目标的风险：以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：（1）标的指数成份股的配股、增发、分红等公司行为；（2）标的指数成份股的调整；（3）基金现金资产的拖累；（4）基金的管理费和托管费带来的跟踪误差；（5）指数成份股停牌、摘牌，成份股涨、跌停板等因素带来的偏差；（6）由于缺少衍生金融工具，基金建仓期间无法实现

对指数的有效跟踪所带来的偏差；（7）本基金采用最优化抽样复制方法，该方法相较完全复制法，有可能加大跟踪误差。

3、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，当成份股发生停牌等流动性约束情形时，本基金可能面临踪偏离度和跟踪误差扩大等风险。

4、指数编制机构停止服务的风险

本基金标的指数的编制机构为中证指数有限公司，标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护。

5、二级市场折溢价风险

ETF 二级市场的价格受供需关系的影响，可能高于或低于基金的份额净值，形成溢价交易或折价交易。

6、二级市场流动性风险

ETF 可在二级市场进行买卖，因此也可能面临因市场交易量不足而造成的流动性问题，带来基金在二级市场的流动性风险。

7、套利风险：由于证券市场的交易机制和技术约束，完成套利需要一定的时间，因此套利存在一定风险。

8、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

证券交易所在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

除以上风险外，本基金还可能存在基金投资存托凭证的风险、科创板股票投资风险、集合申购业务的风险等基金运作的特有风险。

（二） 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册/核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

与本基金或基金合同相关的一切争议将提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁，仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告、定期公告等披露文件。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站（www.fullgoal.com.cn），客户服务热线：95105686，4008880688（全国统一，免长途话费）

1、基金合同、托管协议、招募说明书

2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

3、基金份额净值

4、基金销售机构及联系方式

5、其他重要资料