中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金（LOF）
基金产品资料概要

编制日期：2020 年 12 月 31 日

送出日期：2021 年 01 月 01 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	中信保诚中证 TMT	基金主代码	165522
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2021 年 01 月 01 日	基金类型	股票型
上市交易所	-	上市日期	-
运作方式	开放式	开放频率	每个开放日
交易币种	CNY		
基金经理简介	姓名	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期
	黄稚	2019 年 09 月 04 日	2011 年 07 月 15 日
其他条目	其他条目名称	其他条目内容	

注：本基金由信诚中证 TMT 产业主题指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来。

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金进行数量化指数投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，实现对中证 TMT 产业主题指数的有效跟踪，为投资者提供一个有效的投资工具。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括股票、债券、债券回购、中期票据、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%－100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 TMT 产业主题指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当

	保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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	本基金采用数量化指数投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重为基础，以抽样复制的策略构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	95%×中证 TMT 产业主题指数收益率+5%×金融同业存款利率。
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

（二）投资组合资产配置图表

注：无

（三）自基金合同生效以来/最近十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：无

三、 投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

认购金额费	M<500000.00	0.80%	场内,场外
	500000.00<=M<1000000.00	0.50%	场内,场外
	1000000.00<=M	1000.00 元/笔	场内,场外
申购前端金额费	M<500000.00	1.00%	场内,场外
	500000.00<=M<1000000.00	0.60%	场内,场外
	1000000.00<=M	1000.00 元/笔	场内,场外
赎回费	N<7 天	1.50%	场内
	N<7 天	1.50%	场外
	7 天<=N<365 天	0.50%	场外
	365 天<=N<730 天	0.25%	场外
	730 天<=N	0.00%	场外
	7 天<=N	0.50%	场内

申购费：M：申购金额；单位：元

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	1.00%
托管费	0.22%

其它费用	信息披露费用、会计师费、律师费等

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除

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。

1.市场风险：（1）经济周期风险（2）政策风险（3）利率风险（4）信用风险（5）再投资风险（6）购买力风险（7）上市公司经营风险（8）期货市场波动风险。2.管理风险：（1）管理风险（2）新产品创新带来的风险。3.估值风险。4.流动性风险评估及流动性风险管理工具：a. 流动性风险：（1）市场整体流动性问题（2）市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险。b.基金申购、赎回安排 c.本基金拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估 d.巨额赎回情形下的流动性风险管理措施 e.实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响。

5.指数投资的特有风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，标的指数为中证 TMT 产业主题指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险：

（1）系统性风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，基金资产主要投资于中证 TMT 产业主题指数的成份股及其备选成份股，因此中证 TMT 产业主题指数的市场表现将影响到基金业绩的表现，当中证 TMT 产业主题指数出现收益变动、波动提高时，本基金的收益可能会受到影响。

（2）指数复制风险

本基金采用抽样复制的方式来跟踪中证 TMT 产业主题指数，能否有效地复制指数并将跟踪误差控制在可接受范围内，对本基金的收益将产生影响。当复制方法由于市场条件受到限制或者替代股的选择存在错误时，本基金的收益可能会受到影响。

（3）标的指数回报与行业平均回报偏离风险

标的指数的样本空间为中证 TMT 产业主题指数成分股及备选成分股，其并不能完全代表整个 TMT 行业，标的指数的回报率与 TMT 行业股票的整体回报率可能存在偏离。

（4）标的指数变更风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

（5）基金运作的特有风险

在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人可根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。本基金在深圳证券交易所挂牌上市的，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖本基金上市交易份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足而产生流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在终止上市的可能。

6.其他风险：（1）技术风险（2）大额申购/赎回风险（3）顺延或暂停赎回风险（4）其他风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，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。
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等。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 www.citicprufunds.com.cn，客服电话 400-666-0066
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

六、 其他情况说明

无