

海富通沪深300指数增强型证券投资基金（海富通沪深300增强C）基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月14日

送出日期：2024年6月25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 | 海富通沪深300增强 | 基金代码 | 004512 |
| 下属基金简称 | 海富通沪深300增强C | 下属基金代码 | 004512 |
| 基金管理人 | 海富通基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2019-10-09 | | |
| 基金类型 | 股票型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 朱斌全 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2019-10-15 |
| | | 证券从业日期 | 2007-04-02 |
| | 林立禾 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023-11-23 |
| | | 证券从业日期 | 2018-08-20 |
| 基金转型情况说明 | 海富通沪深300指数增强型证券投资基金由海富通富睿混合型证券投资基金转型而来。 海富通富睿混合型证券投资基金经2016年5月30日中国证券监督管理委员会【2016】1173号文准予注册募集，基金合同于2017年5月10日正式生效。2019年8月22日至2019年9月16日，海富通富睿混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会表决通过了海富通富睿混合型证券投资基金的转型议案。自2019年10月9日起，《海富通沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》生效，《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。 | | |

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资者可阅读本基金《招募说明书》“第九部分、基金的投资”了解详细情况。

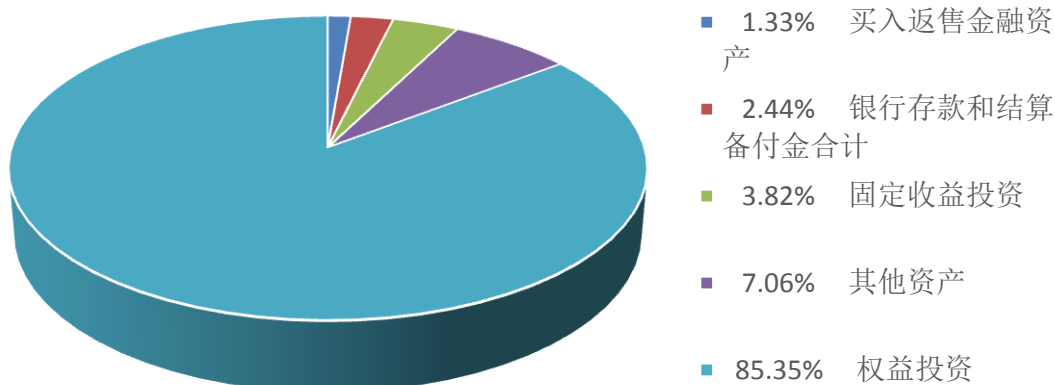
投资目标 本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资策略模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

| | |
|---------------|---|
| 投资范围 | <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许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）。基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的80%，投资于标的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%；本基金在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，保持不低于基金资产净值5%的现金或者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、存出保证金及应收申购款等。法律法规或监管机构日后允许本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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金为增强型股票指数基金，以沪深 300 指数为标的指数。本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在跟踪目标指数的基础上一定程度地调整投资组合，力争控制基金净值增长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 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。</p> <p>本基金投资策略：</p> <p>1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、流动性受限资产投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>沪深300指数收益率×95%+ 银行人民币活期存款利率×5%（税后）</p> |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，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。</p> |

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

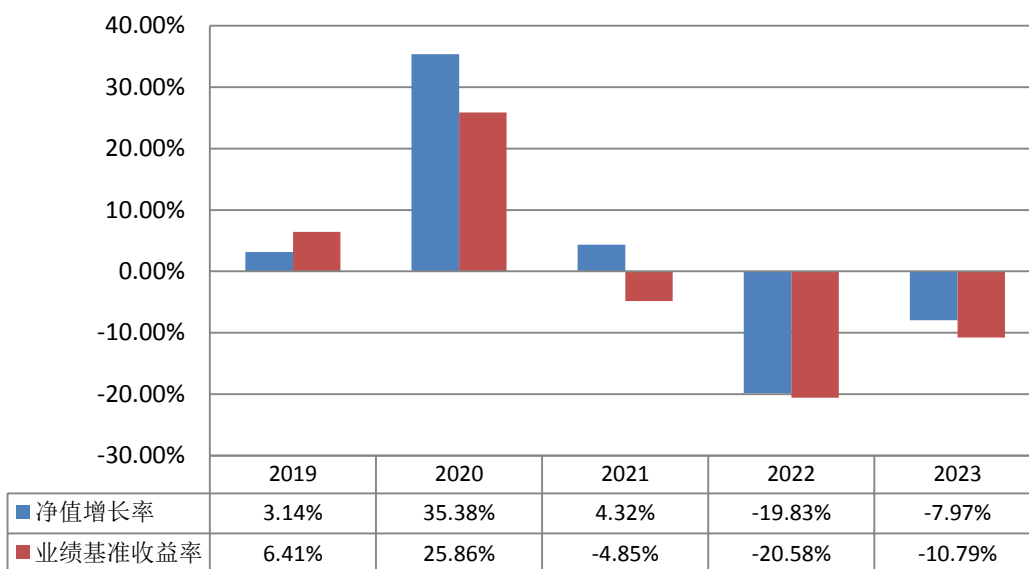
投资组合资产配置图表

数据截止日期：2024-03-31



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

数据截止日期：2023-12-31



注：原海富通富睿混合型证券投资基金于2019年10月9日转型为海富通沪深300指数增强型证券投资基金。图中列示的2019年度基金净值增长率期间为2019年10月9日起至2019年12月31日止。

基金的过往业绩不代表未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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：

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|------|-----------------------------|---------|----|
|------|-----------------------------|---------|----|

| | | |
|-----|--------------|-------|
| | N < 7天 | 1.50% |
| 赎回费 | 7天 ≤ N < 30天 | 0.50% |
| | N ≥ 30天 | - |

(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/年费率或金额 | 收取方 |
|---------|---|------------|
| 管理费 | 0.80% | 基金管理人、销售机构 |
| 托管费 | 0.18% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 0.10% | 销售机构 |
| 审计费用 | 45,000.00 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费 | 年费率 0.016%，收取下限为每自然季度 5 万元(合计年下限为 20 万元)，若计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。 | 指数编制公司 |
| 其他费用 | 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。 | |

注：1、本基金费用的种类、计提标准和支付方式详见本基金的《招募说明书》。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。

2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

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下表：

| |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 1.33% |

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）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。指数许可使用费若适用固定费率的，使用现行费率直接计算；若已适用下限金额的，计算方法参照其他运作费用。

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。

投资于本基金的主要风险

(一) 本基金特有的风险

1、基金组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率：①由于基金投资过程中会产生证券交易成本，以及基金管理费和托管费等费用和税收的存在，而标的指数编制过程中不考虑上述成本，这将导致基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪

误差。

②指数成份股派发现金红利、新股市值配售收益等因素将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

③当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

④投资者申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遭遇标的指数成份股停牌、摘牌或流动性差等情形时，基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

⑤在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金收益产生影响，从而影响基金跟踪偏离度和跟踪误差。

⑥其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

2、量化策略风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，本基金可参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合，采用量化投资模型对投资组合进行优化，但不基于量化策略进行频繁交易。

量化模型投资方法有别于传统的价值分析投资方法。一方面，面对不断变换的市场环境，量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中；另一方面，在量化模型的实际运用中，核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性；最后，定量模型存在对历史数据的依赖。因此，量化模型存在失效的风险，在实际运用过程中，遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上可能无法达到预期的投资效果。

3、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争使基金净值增长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0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

4、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，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

5、指数编制机构停止服务的风险

6、基金合同终止的风险

7、标的指数变更的风险

如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

8、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而可能使得基金收益水平发生变化，产生风险。

(二) 市场风险：1.政策风险。2.经济周期风险。3.利率风险。4.上市公司经营风险。5.购买力风险。(三) 信用风险；(四) 管理风险；(五) 流动性风险；(六) 操作和技术风险；(七) 合规性风险；(八) 收益率曲线风险；(九) 杠杆放大风险；(十) 资产支持证券风险；(十一) 存托凭证风险；(十二) 股指期货风险；(十三) 投资流通受限证券的风险；(十四) 其他风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金的变更注册，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。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因本基金产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方有权根据基金合同的约定提交至仲裁机构进行仲裁。具体仲裁机构和仲裁地点详见本基金合同的具体约定。

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

以下资料详见海富通基金管理有限公司网站 (<http://www.hftfund.com>) (客服电话：40088-40099)。

- 本基金基金合同、托管协议、招募说明书
- 本基金定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 本基金基金份额净值
- 本基金基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料