

海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金 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 | 海富通中证港股通科技ETF | 基金代码 | 513860 |
| 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 | 2021-06-17 | 上市交易所及上市日期 | 上海证券交易所 2021-07-02 |
| 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 | 纪君凯 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023-08-04 |
| | | 证券从业日期 | 2016-07-01 |
| | 杜晓海 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023-10-10 |
| | | 证券从业日期 | 1998-04-01 |

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》“十一、基金的投资”了解详细情况。

投资目标
本基金采用被动指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年化跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

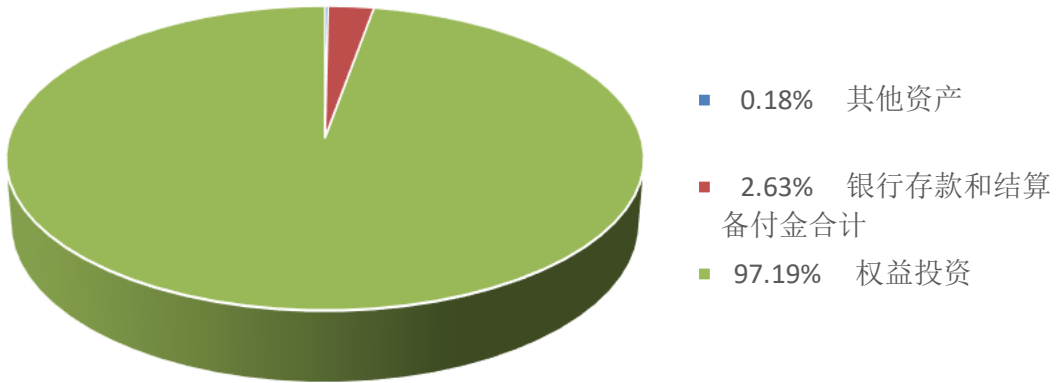
投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、国债期货、股指期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金将根据法律法规的

| | |
|---------------|--|
| | <p>规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、股票期权和国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。另外，本基金投资策略还包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资及转融通证券出借、存托凭证投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>中证港股通科技指数收益率</p> |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金，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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证港股通科技指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金主要通过港股通机制投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> |

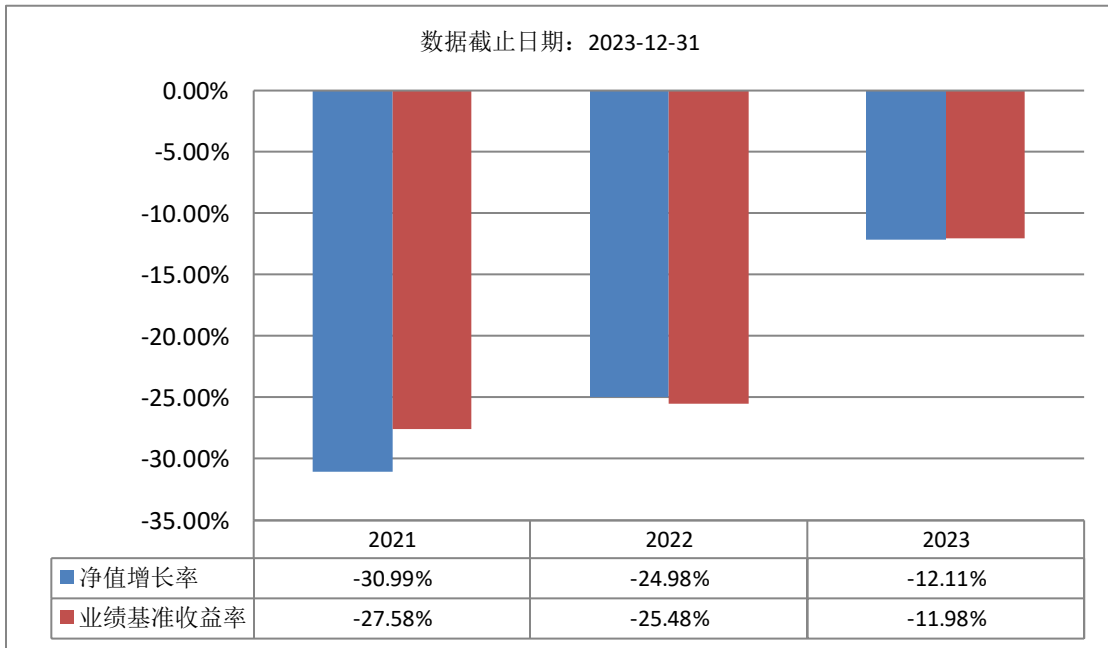
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

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



注：图中列示的2021年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期6月17日（基金合同生效日）起至12月31日止计算。

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

投资人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0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

本基金场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(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 | 0.50% | 基金管理人、销售机构 |
| 托管费 | 0.10% | 基金托管人 |
| 审计费用 | 55,000.00 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 按照国家有关规定和《基金合同》约定可列支的其他费用。 | |

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） |
|--------------|
| 0.65% |

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。

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。

投资于本基金的风险主要包括：

一、市场风险：1、政策风险；2、经济周期风险；3、利率风险；4、购买力风险；5、债券收益率曲线变动风险；6、再投资风险；7、信用风险。

二、基金管理风险；三、流动性风险；

四、投资于本基金的特有风险

1、投资港股通标的股票的风险

本基金将会投资于法律法规规定范围内的香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险、香港交易市场制度或规则不同带来的风险、港股通制度限制或调整带来的风险等。

2、指数下跌风险

本基金采取指数化投资策略，被动跟踪标的指数。当指数下跌时，基金不会采取防守策略，由此可能对基金资产价值产生不利影响。

3、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%，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

本基金的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,本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,本基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前,基金管理人应依照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作,该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异,影响投资收益。

6、基金合同终止的风险

本基金出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,本基金合同终止。故投资人将面临基金合同将终止的风险。

7、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

基金管理人可以委托其他机构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。由于计算公式、汇率数据来源及来源时间不同,IOPV与实时的基金份额净值可能存在差异,与投资者申购赎回的实际结算价格也可能存在差异,IOPV计算还可能出现错误,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。

8、投资人赎回失败的风险

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位,由此可能导致投资人按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额,可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回。

9、基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价目前包括现金替代、现金差额及其他对价。在组合证券变现过程中,由于市场变化、部分成份股流动性差等因素,导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异,存在变现风险。

10、基金管理人代理申赎投资人买券卖券的风险

因涉及香港市场股票的买卖,在投资人申购、赎回本基金时,本基金组合证券中全部或部分证券需以一定数量的现金进行现金替代,并由基金管理人按照招募说明书规定代理申赎投资人进行相关证券买卖,投资人承受买入证券的结算成本和卖出证券的结算金额的不确定性(含汇率波动风险)。按照目前的证券代理买卖规则,正常情况下,对于T日确认成功的申购或赎回申请,基金管理人正常情况下将在T日当天代理申赎投资人进行相关证券买卖,而对于当天未买入或未卖出的部分证券,基金管理人将按该证券T日收盘价(折算为人民币,若当日在证券交易所无交易的,取最近交易日的收盘价;交易日无收盘价的,取最后成交价)进行结算,因此投资人需承受可能当天无法完成所有证券买卖、未完成买卖部分按收盘价结算等风险;发生特殊情况时,基金管理人将调整交收日期,存在交收日期变动的风险。此外,基金管理人可根据运作情况调整代理申赎投资人买券卖券的相关规则,存在相关规则变动带来的风险。

11、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

本基金收益分配原则为使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不以弥补亏损为前提,收益分配后可能存在基金份额净值低于面值的风险。

12、标的指数变更的风险

尽管可能性很小,但根据基金合同规定,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可能改变,投资组合需随之调整,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。

- 13、第三方机构服务的风险
 - 14、投资资产支持证券风险
 - 15、参与融资及转融通证券出借业务的风险
 - 16、投资股指期货风险
 - 17、投资国债期货风险
 - 18、投资股票期权的风险
 - 19、投资存托凭证的风险
 - 20、操作或技术风险
 - 21、退市风险
- 五、不可抗力

(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。

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