

海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金（海富通创业板增强A）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	海富通创业板增强	基金代码	005287
下属基金简称	海富通创业板增强 A	下属基金代码	005288
基金管理人	海富通基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2018-04-08		
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	杜晓海	开始担任本基金基金经理的日期	2018-04-09
		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》“九、基金的投资”了解详细情况。

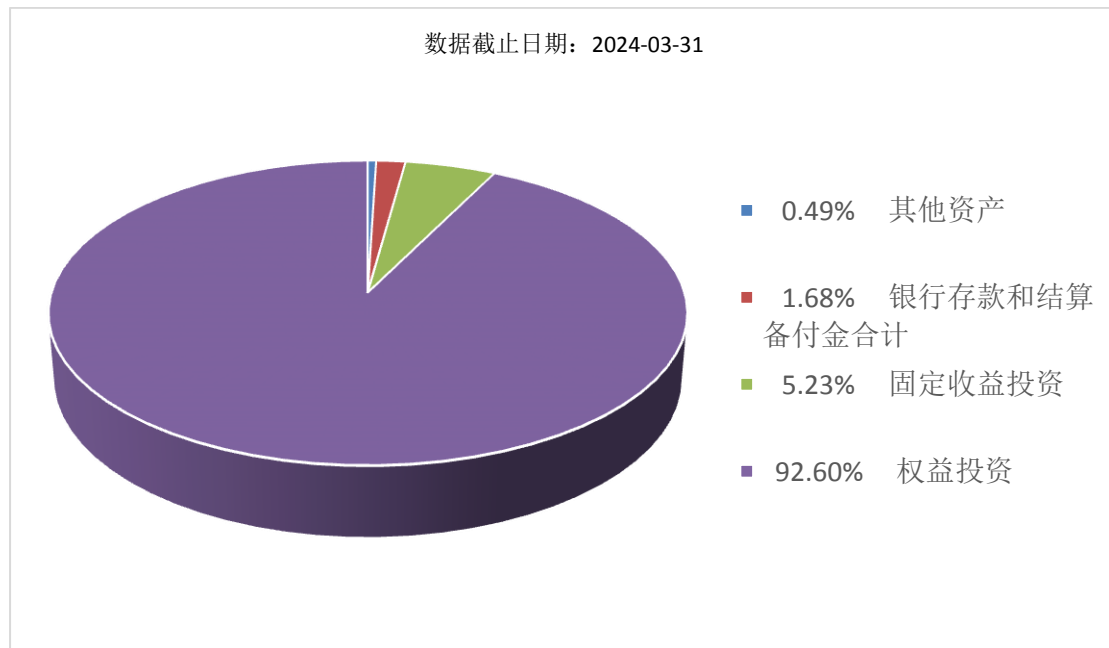
投资目标
本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资策略模型精选创业板优质股票，力争将本基金净值增长率与业绩基准涨跌幅的日均偏离度控制在0.5%以内、年化跟踪误差控制在7.5%以内，同时力求使基金的业绩超越创业板综合指数表现。

投资范围
本基金的标的指数为创业板综合指数。
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、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、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、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的90%，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。如以后法律法规及中国

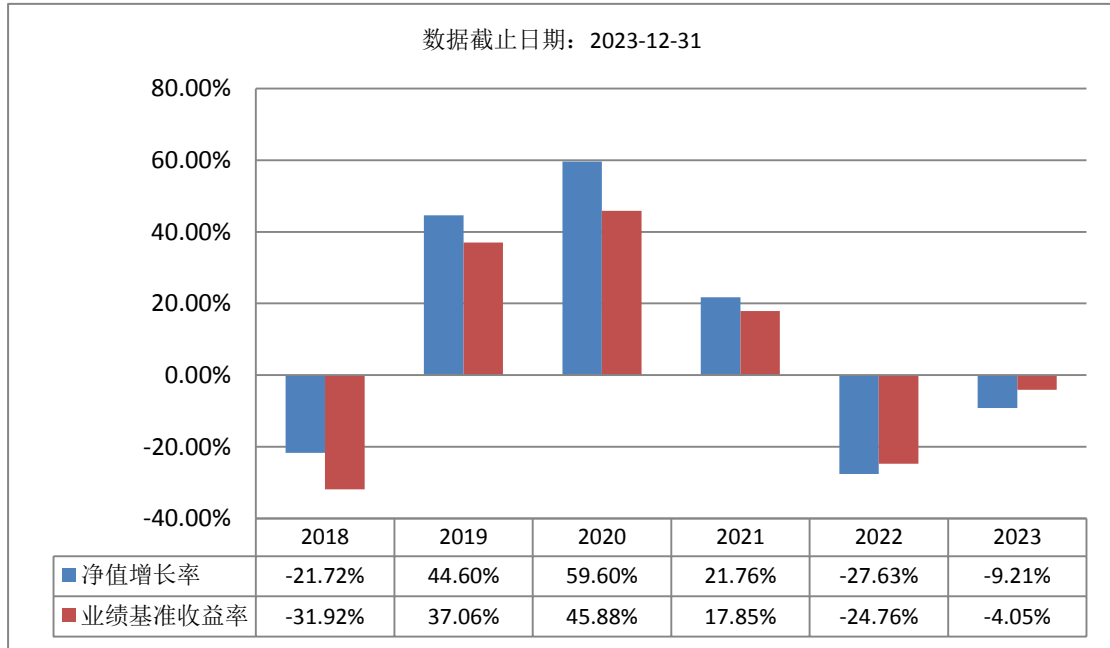
	证监会允许基金投资上述品种之外的其他金融工具，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
主要投资策略	<p>本基金为增强型指数基金，对指数投资部分将采用抽样复制标的指数投资方法，利用成熟的量化技术模型实现对创业板综合指数的紧密跟踪。本基金对主动投资部分采取积极配置策略，力争在跟踪误差控制范围内，使基金的业绩超越创业板综合指数表现。</p> <p>当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p> <p>本基金投资策略包括： 1、资产配置；2、股票组合构建；3、股票组合调整；4、存托凭证投资策略；5、债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、股指期货投资策略；8、权证投资策略。</p>
业绩比较基准	创业板综合指数收益率×95% + 银行人民币活期存款利率×5%(税后)
风险收益特征	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，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

(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



(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2018年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期4月8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

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
申购费 (前收费)	M < 100 万元	1.50%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 200 万元	1.20%	非养老金客户
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%	非养老金客户
	M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔	非养老金客户
	M < 100 万元	0.30%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.24%	养老金客户
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.16%	养老金客户
赎回费	M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔	养老金客户
	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%	

30 天 ≤ N < 180 天	0.50%
N ≥ 180 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	1.20%	基金管理人、销售机构
托管费	0.20%	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
指数许可使用费	指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。自基金成立之日的下一季度（自然季度）起，指数许可使用费收取下限为每季度（自然季度）5 万元，合计年下限为 20 万元。基金成立日所在季度，当季指数许可使用费的计算方法如下：当季指数许可使用费 = max (50000 元 × 基金当季存续天数 ÷ 当季天数，当季累计计提的指数许可使用费)。	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，可以在基金资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）
1.57%

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。

一、投资于本基金的主要风险有：

（一）本基金特有的风险

1、本基金的主要投资标的是创业板综合指数成份股和备选成份股，投资面临创业板的特殊风险，包括但不限于：

(1) 规则差异风险

创业板市场发行、上市等业务规则与现有的主板、中小企业板市场的相关业务规则存在一定的差别。

(2) 上市公司经营风险

与主板市场上市公司相比，创业板市场上市公司一般处于发展初期，经营历史较短，规模较小，经营稳定性相对较低，抵抗市场风险和行业风险的能力相对较弱。创业板市场上市公司发展潜力虽然可能巨大，但新技术的先进性与可靠性、新模式的适用面与成熟度、新行业的市场容量与成长空间等都具有较大不确定性，投资者对创业板市场上市公司高成长的预期并不一定会实现，风险较主板大。

(3) 上市公司退市的风险

创业板市场上市公司具有业绩不稳定、经营风险较高、退市风险相对较大等特点。由于本基金主要投资于创业板综合指数成份股，如果创业板综合指数成份股公司退市，本基金基金资产可能遭受损失。

(4) 上市公司技术失败风险

创业板市场上市公司高科技转化为现实的产品或劳务具有不确定性，相关产品和技術更新换代较快，存在出现技术失败而造成损失的风险。

(5) 标的指数成份股公司股价大幅波动风险

以下原因可能导致创业板市场上市公司股价发生大幅波动：

1) 公司经营历史较短，规模较小，抵抗市场风险和行业风险的能力相对较弱，股价可能会由于公司业绩的变动而大幅波动；

2) 公司流通股本较少，盲目炒作会加大股价波动，也相对容易被操纵；

3) 公司业绩可能不稳定，传统的估值判断方法可能不尽适用，投资者的价值判断可能存在较大差异。

(6) 基金投资组合收益率与标的指数收益率偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数收益率发生偏离：

1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；

2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；

3) 由于标的指数成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过目标指数收益率，产生跟踪误差；

4) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生的跟踪偏离度和跟踪误差；

5) 由于基金为应对日常赎回保留的少量现金、投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费、基金托管费和基金销售服务费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差；

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券中可能不完全相同；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；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(7) 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基准涨跌幅的日均偏离度控制在 0.5% 以内、年化跟踪误差控制在 7.5% 以内，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。

(8) 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。

(9) 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,基金管理人应按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。

(10) 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,基金合同终止。故投资人将面临基金合同将终止的风险。

(11) 主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略,为了获得超越指数的投资回报,可以在被动跟踪指数的基础上进行优化调整,通过数量化的投资策略模型精选创业板优质股票。这种基于量化投资模型的投资决策,最终结果仍然存在一定的不确定性,其投资收益率可能高于指数收益率但也可能低于指数收益率。

(12) 巨额赎回的风险

本基金在开放日可能出现巨额赎回,导致基金资产变现困难,出现延期赎回或暂停赎回的风险。

(13) 发起式基金清盘的风险

本基金为发起式基金,规定《基金合同》生效之日起三年后的对应日,若基金资产规模低于2亿元,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。

2、科创板特有风险

3、基金投资存托凭证的风险

本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外,还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

(二) 股指期货风险;(三) 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。(四) 信用风险;(五) 管理风险;(六) 流动性风险;(七) 操作和技术风险;(八) 合规性风险;(九) 资产支持证券风险;(十) 本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险;(十一) 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。

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