

# 新华沪深300指数增强型证券投资基金（新华沪深300指数增强C）基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024年6月25日

送出日期：2024年6月26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	新华沪深300指数增强	基金代码	005248
下属基金简称	新华沪深300指数增强C	下属基金代码	008184
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2019-12-18		
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	邓岳	开始担任本基金基金经理的日期	2019-12-18
		证券从业日期	2008-07-01

注：《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并6个月内召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

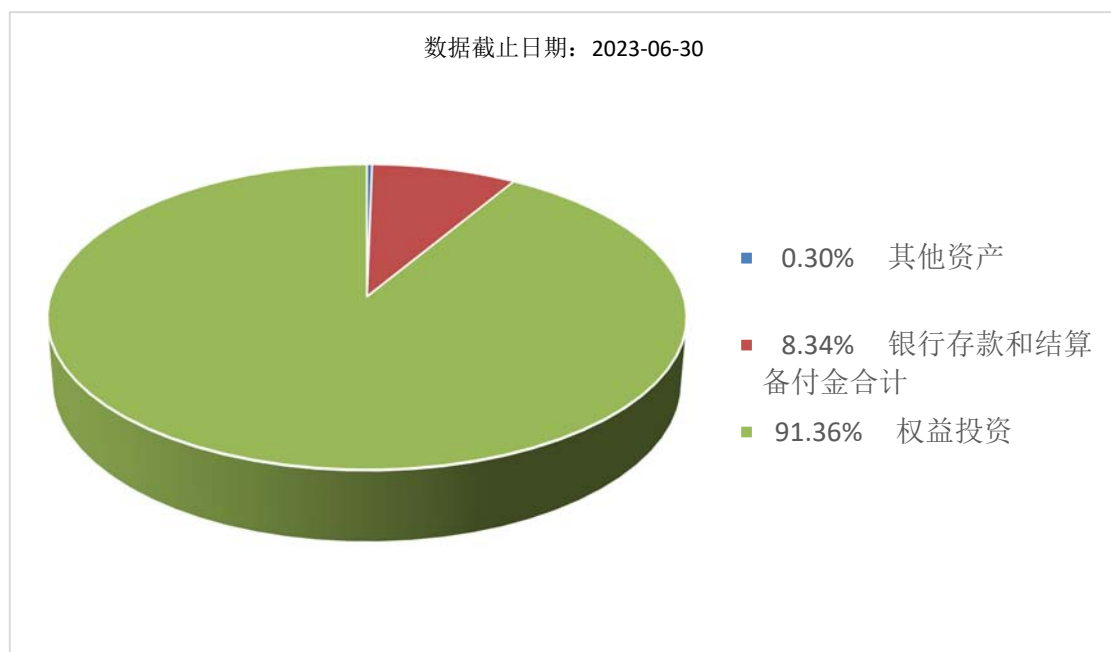
投资者可阅读《招募说明书》第九章了解详细情况。

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本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%、年跟踪误差不超过7.75%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资范围	本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成分股、备选成分股（含存托凭证）、其他国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（国债、政府债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、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、同业存单、银行存款、货币市场工具、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相关规定）。 本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的资产占非现金基金资产的比例不低于80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴

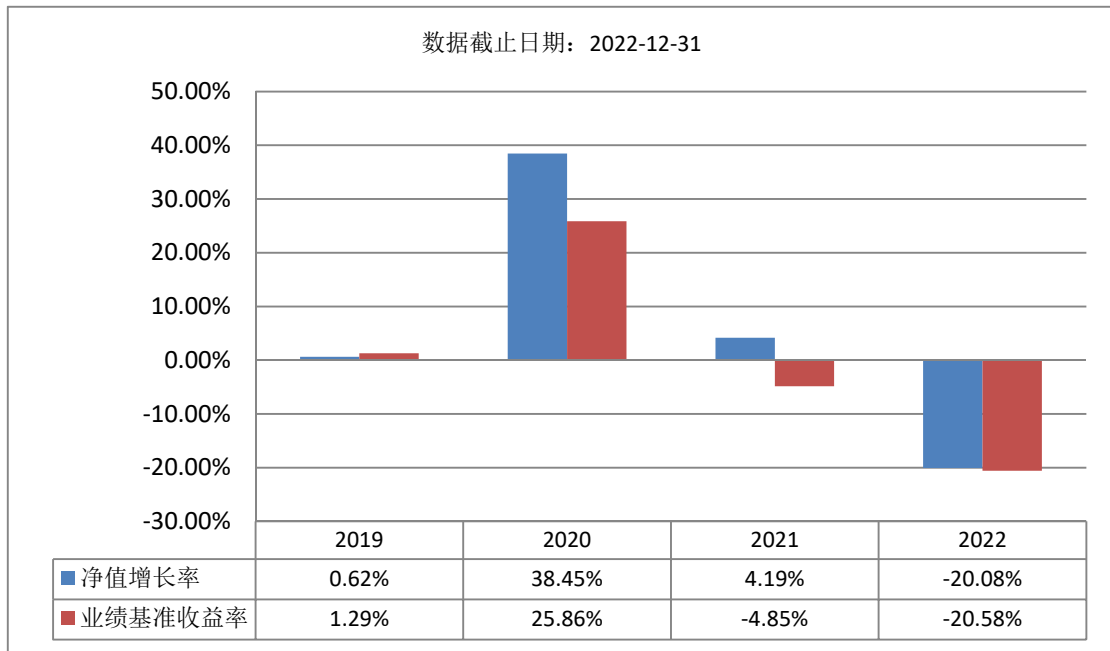
	<p>纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。</p> <p>如果法律法规或中国证监会变更基金投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p> <p>本基金跟踪的标的指数为沪深300指数。</p>
<b>主要投资策略</b>	<p>本基金为指数增强基金，股票（含存托凭证）投资比例为基金资产的80%以上，因此主要资产配置为股票资产，可少量投资于合同约定的其他资产类别。在保证股票投资比例符合合同要求的基础上，结合风险、流动性、基金申购赎回、分红等因素，对其他各类可投资资产类别的配置进行微调。本基金的股票投资策略以指数化被动投资策略为基础策略，结合量化的选股模型、风险控制模型、流动性控制模型而形成综合的量化指数增强策略体系。</p>
<b>业绩比较基准</b>	<p>沪深300指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%。</p>
<b>风险收益特征</b>	<p>本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</p> <p>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



## (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：1、本基金于2019年12月18日成立，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

2、基金的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

C类基金份额不收取认/申购费。

以下费用在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
赎回费	N < 7天	1.50%	
	7天 ≤ N < 30天	0.50%	
	N ≥ 30天	0	

#### (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	收费方
管理费	1.00%	基金管理人、销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
销售服务费	0.30%	销售机构
审计费用	80,000.00	会计师事务所
信息披露费	80,000.00	规定披露报刊
指数许可使用费	200,000.00	指数编制公司
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的 会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费； 基金份额持有人大会费用；基	相关服务机构

金的证券、期货交易费用；基金的银行汇划费用；证券账户开户费用和账户维护费；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。审计费用、信息披露费用为由基金整体承担的年费用金额，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；  
2、标的指数使用费为0.016%。标的指数使用费的收取下限为每季度人民币5万元（即不足5万元部分按照5万元收取）。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

### （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）
1.76%

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。

#### 1、本基金的主要风险

本基金的主要风险包括：市场风险、流动性风险、信用风险、交易对手违约风险、管理风险、资产配置风险、本基金的特定风险、不可抗力风险及其他风险。

#### 2、本基金的特定风险

（1）标的指数收益率与股票市场平均收益率偏离的风险：沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制的反映 A 股市场整体走势的指数，该指数从上海和深圳证券交易所中选取 300 只交易活跃、代表性强的 A 股作为成份股，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强且公信力较好的股票指数，但并不能完全代表整个股票市场。所以，标的指数的收益率与整个股票市场的平均收益率可能存在偏离。

（2）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、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

（3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险：由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停牌或摘牌、股流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（4）跟踪误差控制未达约定目标的风险：本基金的风险控制目标是力争在控制本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%、年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，追求获得超越标的指数的回报，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。

（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。

(6) 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,发生成份股停牌时,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。本基金运作过程中,当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则,综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响,据此制定成份股替代策略,并对投资组合进行相应调整。由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(7) 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一些优化调整,如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。调整投资组合的决策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有可能低于指数收益率。

(8) 股指期货投资风险: 1) 基差风险: 在使用股指期货对冲市场风险的过程中,基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险; 2) 系统性风险: 组合现货的 $\beta$ 可能不足或者过高,组合风险敞口过大,股指期货空头头寸不能完全对冲现货的风险,组合存在系统性暴露的风险; 3) 保证金风险: 产品的期货头寸,如果未预留足够现金,在市场出现极端情况时,可能遭遇保证金不足而被强制平仓的风险; 4) 合约展期风险: 组合持有的主力合约交割日临近,需要更换合约进行展期,如果合约的基差不利或流动性不足,展期会面临风险。

(9) 资产支持证券投资风险: 本基金投资于资产支持证券,与股票和一般债券不同,资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权,而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

(10) 本基金投资于可转换债券,可转换债券的条款相对于普通债券和股票而言更为复杂,对这些条款研究不足导致的事件可能为本基金带来损失。例如,当可转换债券的价格明显高于其赎回价格时,若本基金未能在可转换债券被赎回前转股或卖出,则可能产生不必要的损失。

(11) 本基金投资于非公开发行股票等流通受限证券。流通受限证券指由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,具有一定的流动性风险、法律风险、道德风险和操作风险等各种风险。基金管理人将制订严格的投资决策流程和风险控制制度及相关流动性风险处置预案。请基金份额持有人关注包括投资流通受限证可能导致的流动性风险、法律风险、道德风险和操作风险在内的各项风险。

(12) 基金参与融资业务的风险: 本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务,可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资业务特有风险。

(13) 本基金投资于存托凭证的风险: 本基金的投资范围包括存托凭证,除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外,可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与存托凭证发行机制相关的风险,包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险;存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险;存托协议自动约束存托凭证持有人的风险;因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险;存托凭证持有人权益被摊薄的风险;存托凭证退市的风险;已在境外上市的基础证券发行人,在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险;境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

## **(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。

相关各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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.ncfund.com.cn](http://www.ncfund.com.cn)][4008198866]

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

## **六、其他情况说明**

无。