

# 同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 27 日

送出日期：2024 年 6 月 28 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	同泰沪深 300 量化增强	基金代码	012911
下属基金简称 A	同泰沪深 300 量化增强 A	下属基金代码 A	012911
下属基金简称 C	同泰沪深 300 量化增强 C	下属基金代码 C	012912
基金管理人	同泰基金管理有限公司	基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金合同生效日	2021-07-23	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	马毅	开始担任本基金基金经理的日期	2024-01-23
		证券从业日期	2008-07-15

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，结合量化投资方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资范围	<p>本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股，非标的指数成份股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证及港股通标的股票)、债券(包括国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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)。</p> <p>本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，在履行适当程序后，本基金可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 80%-95%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 20%，每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴</p>

纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，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、国债期货、股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的标的指数为：沪深 300 指数。

**主要投资策略**

本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金力争使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 8.0%。具体策略包括：（1）大类资产配置策略；（2）股票投资策略；（3）债券投资策略；（4）可转换债券和可交换债券投资策略；（5）资产支持证券投资策略；（6）股指期货投资策略；（7）国债期货投资策略；（8）股票期权投资策略；（9）融资及转融通证券出借业务投资策略。

**业绩比较基准**

沪深 300 指数收益率×90%+恒生综合指数收益率×5%+银行活期存款利率(税后)×5%

**风险收益特征**

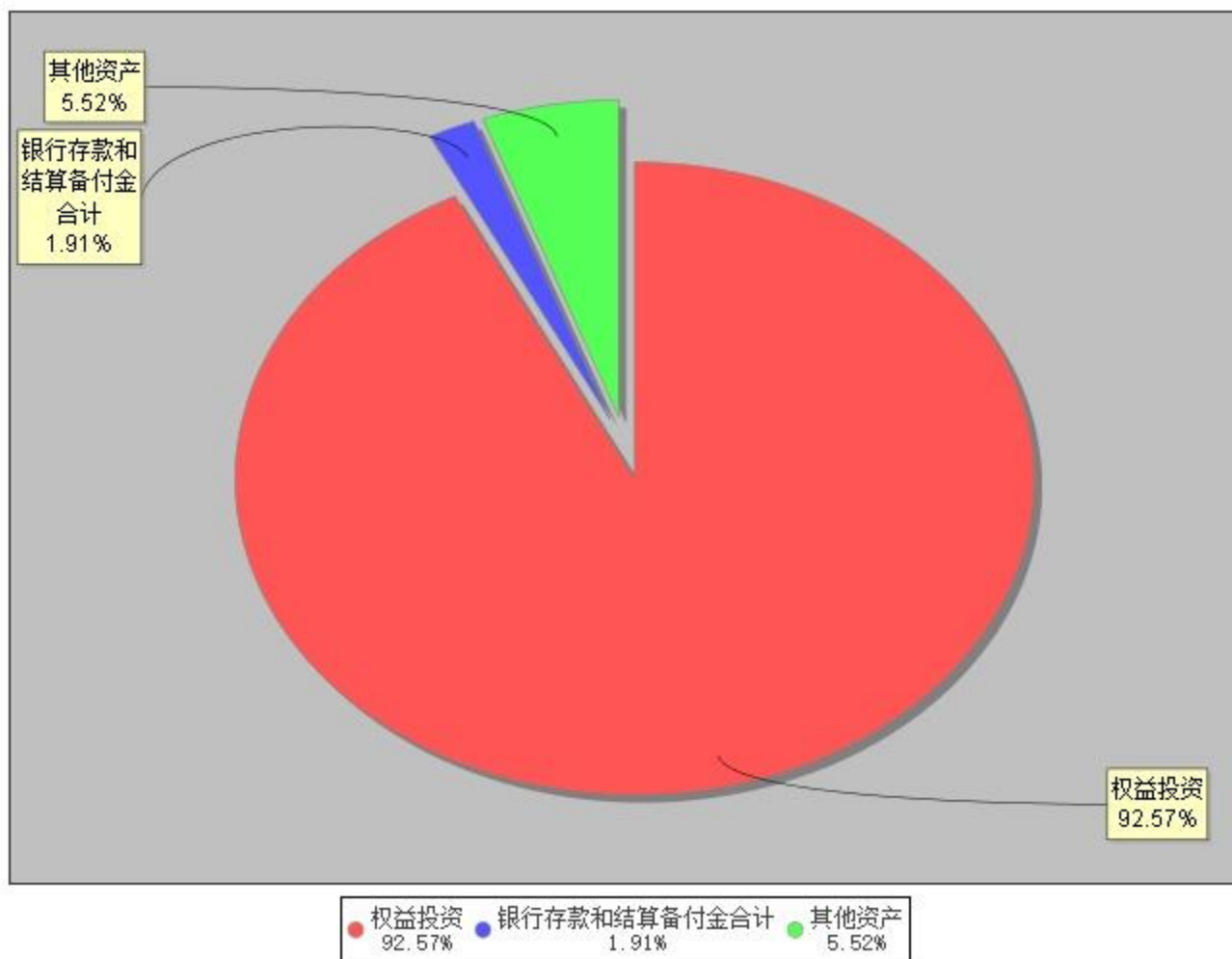
本基金为股票型基金，长期平均风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

本基金可投资港股通标的股票，会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。

注：详见本基金招募说明书第九部分“基金的投资”。

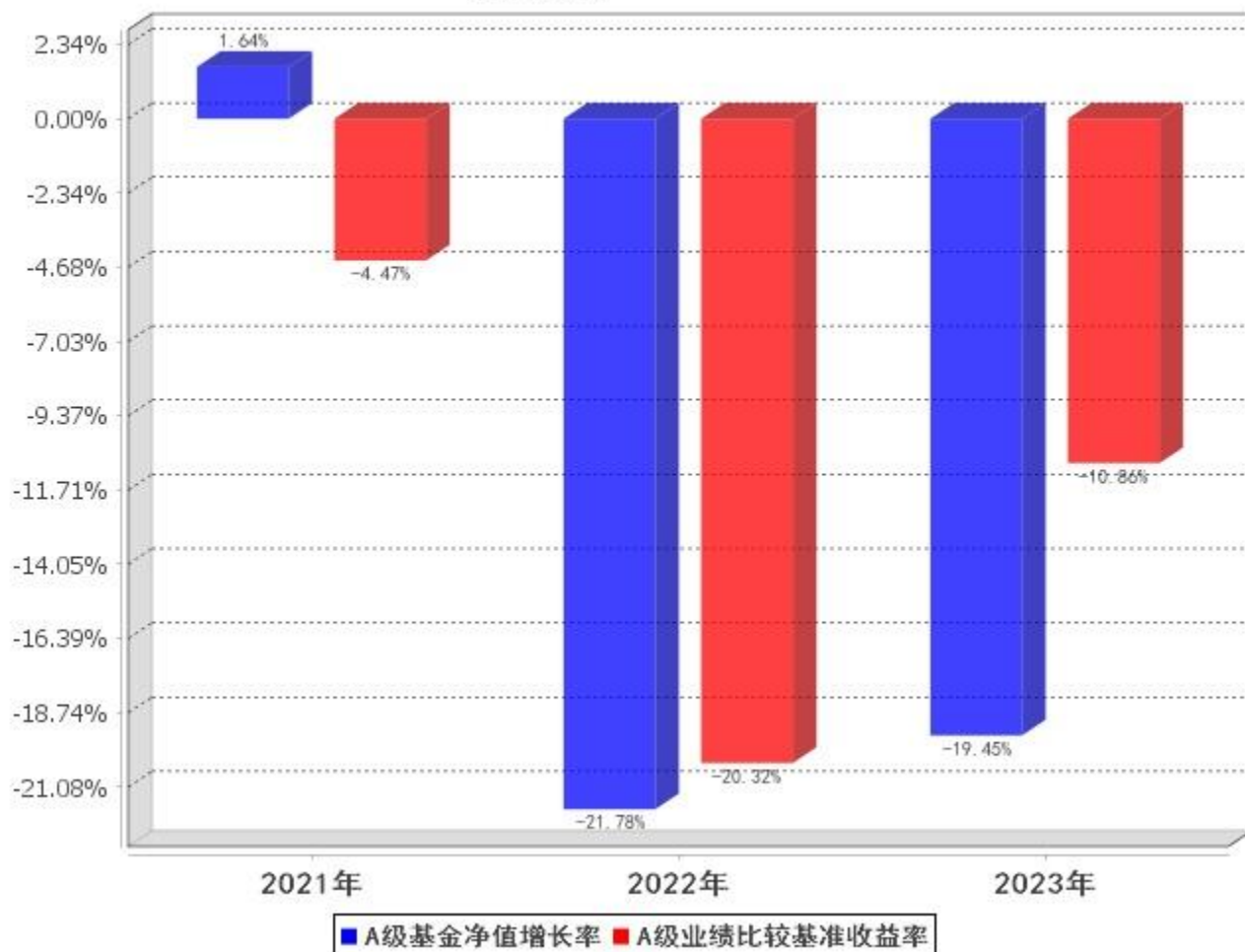
**(二) 投资组合资产配置图表**

**报告期末资产组合情况-截止日期:2024-03-31**

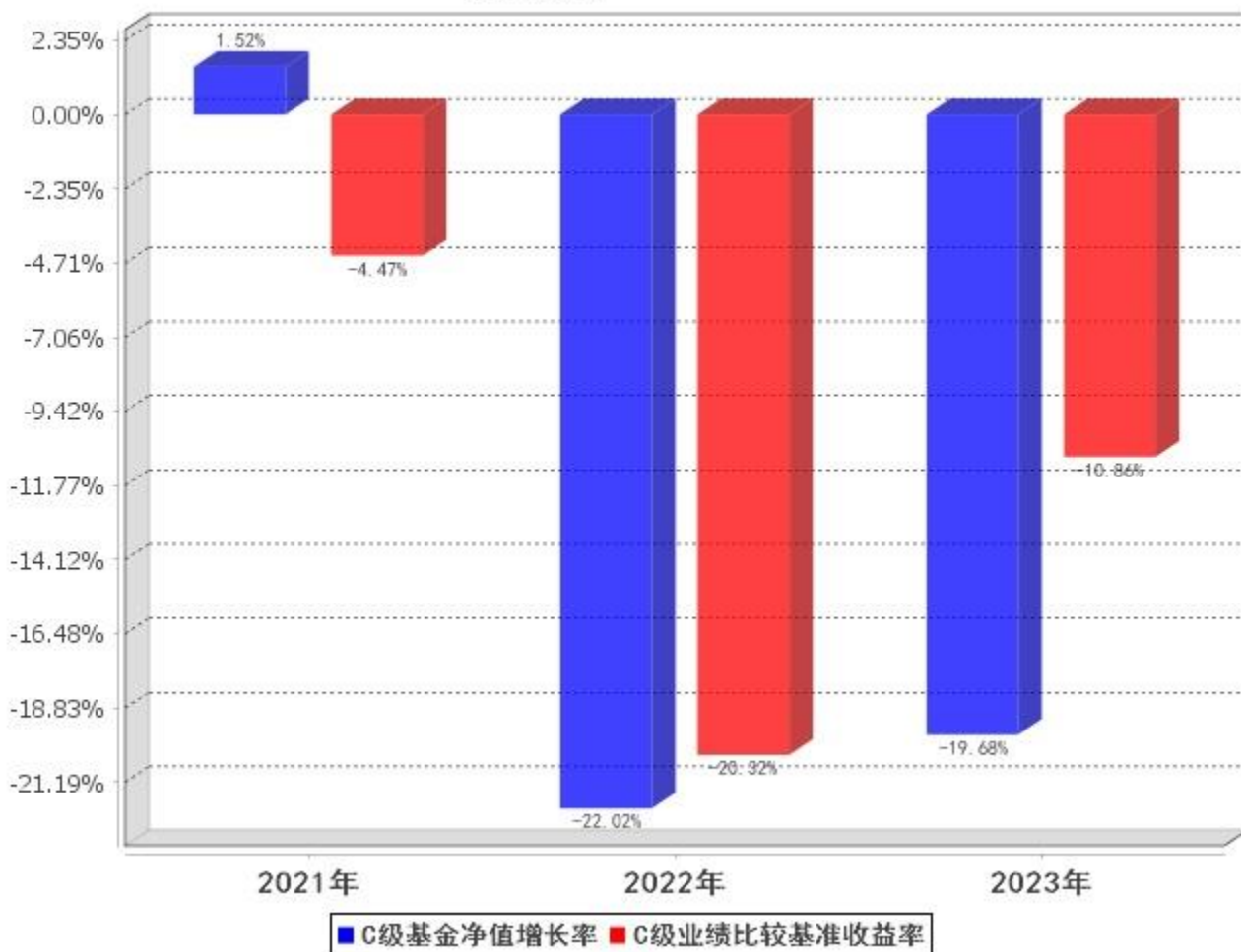


(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图  
截止日期: 2023-12-31



**C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**  
截止日期：2023-12-31



注：本基金合同生效日为2021年7月23日，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。基金的过往业绩不代表未来表现。数据截止日期为2023年12月31日。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### （一）基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取：

同泰沪深 300 量化增强 A

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)	$M < 1,000,000$	1.20%	-
	$1,000,000 \leq M < 2,000,000$	0.60%	-
	$2,000,000 \leq M < 5,000,000$	0.40%	-
	$M \geq 5,000,000$	1,000 元/笔	-
赎回费	$N < 7$ 天	1.50%	-
	$7 \text{ 天} \leq N < 30$ 天	0.10%	-
	$N \geq 30$ 天	0.00%	-

同泰沪深 300 量化增强 C

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

		期限 (N)	
赎回费	N < 7 天	1.50%	-
	7 天 ≤ N < 30 天	0.10%	-
	N ≥ 30 天	0.00%	-

注：金额单位为人民币元。

## (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/年费率或金额	收取方
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 C	0.30%	销售机构
审计费用	30,000	会计师事务所
信息披露费	120,000	规定披露报刊
-	-	-

注：1、其他费用详见本基金基金合同、招募说明书及相关公告。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：

同泰沪深 300 量化增强 A	
<b>基金运作综合费率（年化）</b>	
1.31%	
同泰沪深 300 量化增强 C	
<b>基金运作综合费率（年化）</b>	
1.61%	

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化）。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。

本基金的特定风险

1、本基金股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 80%-95%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 20%。因此，内地与香港股票市场、债券市场的变化均会影响到基金业绩表现，基金净值表现因此可能受到影响。

2、指数投资风险

本基金为指数增强型基金，主要投资标的为沪深 300 指数成份股，本基金的资产净值会随标的指数的波动而波动。包括：（1）标的指数跟踪误差风险和跟踪误差控制未达约定目标的风险；（2）标的指数变更风险及指数编制机构停止服务的风险；（3）标的指数终止风险；（4）与指数增强策略相关的特定风险；

（5）成份股停牌的风险。

3、投资港股通标的股票的风险

- 4、投资存托凭证的风险
- 5、投资流通受限证券的风险
- 6、投资资产支持证券的风险
- 7、投资股指期货的风险
- 8、投资股票期权的风险
- 9、投资国债期货的风险
- 10、参与融资业务风险
- 11、参与转融通证券出借业务的风险

12、本基金收益分配方式有现金分红和红利再投资两种，对于选择红利再投资的投资者，其因红利再投资所得的份额自确认之日起开始计算持有时间，并于该份额赎回时按照本基金相关法律文件的约定选择适用的赎回费率并计算赎回费，敬请投资者留意。

本基金的其他风险包括：市场风险、开放式基金共有的风险、基金管理人职责终止风险、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、流动性风险等。

## （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投资价值和市场前景做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资产，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。

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，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为深圳市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人均具有约束力。仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有规定。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见同泰基金官方网站[[www.tongtaiamc.com](http://www.tongtaiamc.com)] [客服电话：400-830-1666]

本基金基金合同、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、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。