

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)

(A类份额)

基金产品资料概要(更新)

编制日期: 2020年09月04日

送出日期: 2020年09月07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 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数基金主代码 | 501310 |
| 下属基金简称 | 华宝标普沪港深中国增强价值指数下属基金代码 | 501310 |
| 基金管理人 | 华宝基金管理有限 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 | 2018年10月25日 | 上市交易所 及上市时间 上海证券交易所 2018年11月22日 |
| 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 | 周晶 | 开始担任本基金 基金经理的日期 2018年10月25日 证券从业日期 2004年05月01日 |
| 其他 | 场内简称: 价值基金LOF | |

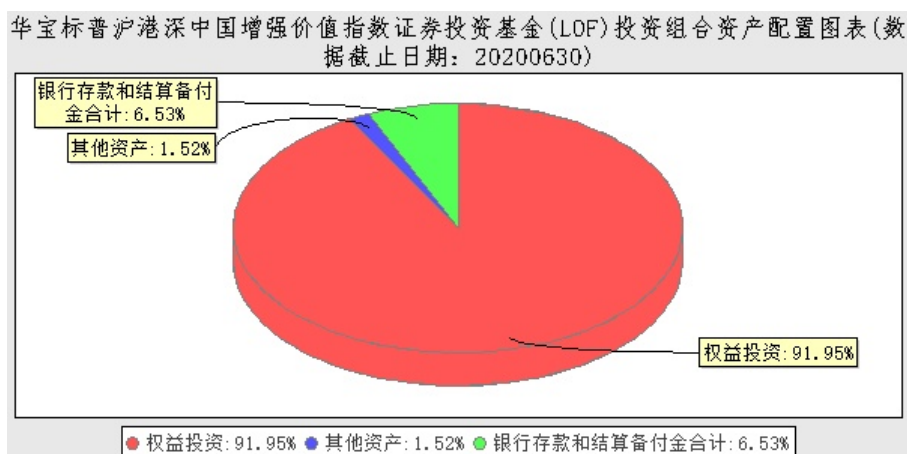
二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。正常情况下,本基金力争控制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5%。 |
| 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,包括标的指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他股票、债券、债券回购、资产支持证券、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)。 本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且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%。本基金标的指数为标普沪港深中国增强价值指数。 |
| 主要投资策略 | 本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况,导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将通过投资成 |

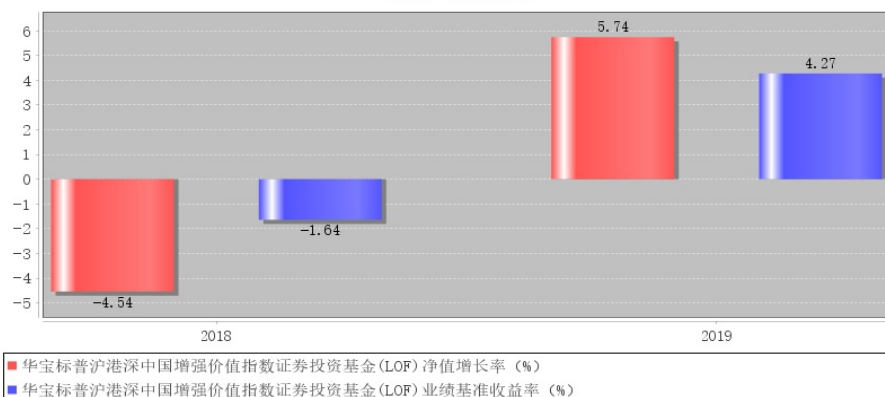
| | |
|--------|---|
| | 份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为标普沪港深中国增强价值指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将通过港股通投资香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。 |

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表



（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同期业绩比较基准的比较图

华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金 (LOF) 每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：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

以下费用在申购/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 |
|----------|---------------------|---------|
| 申购费(前收费) | M < 100万 | 1.20% |
| | 100万 ≤ M < 200万 | 0.60% |
| | 200万 ≤ M | 每笔1000元 |
| 赎回费 | N < 7日 | 1.50% |

| | |
|-----------|-------|
| 7日≤N<180日 | 0.50% |
| 180日≤N<1年 | 0.25% |
| 1年≤N | 0.00% |

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 |
|------|----------|
| 管理费 | 0.75% |
| 托管费 | 0.15% |

注：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。

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。

投资者应及时关注基金管理人出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必然一致，基金管理人的适当性匹配意见并不表明对基金的风险和收益做出实质性判断或者保证。基金合同中关于基金风险收益特征与基金风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应了解基金的风险收益情况，结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险，不应采信不符合法律法规要求的销售行为及违规宣传推介材料。

1、本基金的特定风险

(1) 指数化投资的风险。(2) 上市交易风险。(3) 投资港股通股票存在的风险。(4) 股指期货等金融衍生品投资风险。(5) 基金参与融资与转融通业务的风险。(6) 资产支持证券的风险。

2、市场风险：证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险。主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险等。

3、本基金还将面临开放式基金共有的风险，如流动性风险、管理风险、信用风险、操作或技术风险、合规性风险、以及其他风险。

(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。

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、准确获得基金的相关信息，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

以下资料详见华宝基金管理有限公司官方网站 [www.fsfund.com] [客服电话：400-700-5588、400-820-5050、021-38924558]

《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)托管协议》、《华宝标普沪港深中国增强价值指数证券投资基金(LOF)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