

国泰君安沪深300指数增强型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要

编制日期：2023年04月12日

送出日期：2023年04月13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	国泰君安沪深300指数增强发起	基金代码	018257
基金简称C	国泰君安沪深300指数增强发起C	基金代码C	018258
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金合同生效日		上市交易所及上市日期	无
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	胡崇海	开始担任本基金基金经理的日期	
		证券从业日期	2011-05-03
其他	<p>《基金合同》生效之日起3年后的对应日，若基金资产净值低于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基金合同期限。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>《基金合同》生效满三年后，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5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续30个工作日、连续40个工作日及连续45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5000万元情形的，基金管理人将对可能触发基金合同终止情形的情况发布提示性公告；连续50个工作日出现前述情形之一的，本基金将依据《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

(敬请投资者仔细阅读《国泰君安沪深300指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》

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，在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
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

	<p>成份券（包括存托凭证、下同）、备选成份券（包括存托凭证、下同）、其他国内依法发行上市的股票和存托凭证（包括主板、创业板和其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含可分离交易可转换债）、可交换债、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据等）、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债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）。本基金可以参与融资和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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的80%，投资于沪深300指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行适当程序后，以变更后的规定为准。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>本基金为增强型指数产品，在标的指数成份券权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争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%，年化跟踪误差不超过7.75%，在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>本基金的投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、资产支持证券投资策略、参与股指期货交易策略、参与国债期货交易策略、融资及转融通证券出借业务投资策略。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>沪深300指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</p> <p>本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数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

暂不适用

（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

暂不适用

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

费用类型	金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
赎回费	N<7日	1.50%	
	7日≤N<30日	0.50%	
	30日≤N	0	

本基金 C 类份额不收取认购费、申购费。

（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	1.00%
托管费	0.15%
销售服务费	0.40%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货交易费用；基金的银行汇划费用；基金相关账户的开户及维护费用；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：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。

本基金包括市场风险、流动性风险、信用风险、管理风险、启用侧袋机制的风险、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、其他风险及特有风险。本基金特有风险包括但不限于：

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份券的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2、标的指数波动的风险

标的指数成份券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券或变更编制方法、标的指数成份券发生配股或增发等行为导致成份券在标的指数中的权重发生变化、成份券派发现金红利、新股市值配售、成份券摘牌、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

本基金力争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%，年化跟踪误差不超过 7.75%。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，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、成份券停牌的风险

标的指数成份券可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份券停牌时可能面临如下风险：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。

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券的权重、替换或者增加一些非成份券。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、本基金将股指期货、国债期货纳入到投资范围中，股指期货、国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。同时，股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金净值带来重大损失。

9、资产支持证券投资风险

资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

10、参与转融通证券出借业务的风险

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：（1）流动性风险：面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险；（2）信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；（3）市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

11、参与融资业务的主要风险

（1）市场风险

1）可能放大投资损失的风险：融资业务具有杠杆效应，它在放大投资收益的同时也必然放大投资风险。将股票作为担保品进行融资交易时，既需要承担原有的股票价格下跌带

来的风险，又得承担融资买入股票带来的风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

2) 利率变动带来的成本加大风险：在从事融资交易期间，如中国人民银行规定的同期贷款基准利率调高，证券公司将相应调高融资利率，投资成本也因为利率的上调而增加，将面临融资成本增加的风险。

3) 强制平仓风险：融资交易中，投资组合与证券公司间除了普通交易的委托买卖关系外，还存在着较为复杂的债权债务关系，以及由于债权债务产生的信托关系和担保关系。证券公司为保护自身债权，对投资组合信用账户的资产负债情况实时监控，在一定条件下可以对投资组合担保资产执行强制平仓，且平仓的品种、数量、价格、时机将不受投资组合的控制，平仓的数额可能超过全部负债，由此给投资组合带来损失。

4) 外部监管风险：在融资交易出现异常或市场出现系统性风险时，监管部门、证券交易所和证券公司都将可能对融资交易采取相应措施，例如提高融资保证金比例、维持担保比例和强制平仓的条件等，以维护市场平稳运行。这些措施将可能给本金带来杠杆效应降低、甚至提前进入追加担保物或强制平仓状态等潜在损失。

(2) 流动性风险

融资业务的流动性风险主要指当基金不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动导致担保物价值与融资债务之间的比例低于平仓维持担保比例，且不能按照约定的时间追加担保物时面临强制平仓的风险。

(3) 信用风险

信用风险主要指交易对手违约产生的风险。一方面，如果证券公司没有按照融资合同的要求履行义务可能带来风险；另一方面，若在从事融资交易期间，证券公司融资业务资格、融资业务交易权限被取消或被暂停，证券公司可能无法履约，则投资组合可能会面临一定的风险。

12、存托凭证的投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，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。

13、基金合同提前终止的风险

(1) 未来若出现标的指数不符合要求（因成份券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，基金管理人将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。因而，本基金存在着无法存续的风险。

(2) 本基金为发起式基金，《基金合同》生效之日起3年后的对应日，若基金资产净值低于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基金合同期限；《基金合同》生效满三年后，连续50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5000万元情形的，本基金将依据《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止。因此，投资人将面临《基金合同》可能终止的不确定性风险。

（二）重要提示

中国证监会对国泰君安沪深300指数增强型发起式证券投资基金的注册，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本基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

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。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站，网址：www.gtjazg.com，客服电话：95521

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

关于争议的处理：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，则任何一方有权将争议提交上海国际仲裁中心进行仲裁，仲裁地点为上海市，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，仲裁费由败诉方承担。