

# 富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金

## 基金产品资料概要(更新)

编制日期: 2023 年 6 月 5 日

送出日期: 2023 年 6 月 27 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	国富沪深 300 指数增强	基金代码	450008
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2009 年 09 月 03 日	上市交易所及上市日期	-
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	张志强	开始担任本基金基金经理的日期	2013 年 03 月 21 日
		证券从业日期	2002 年 10 月 09 日

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

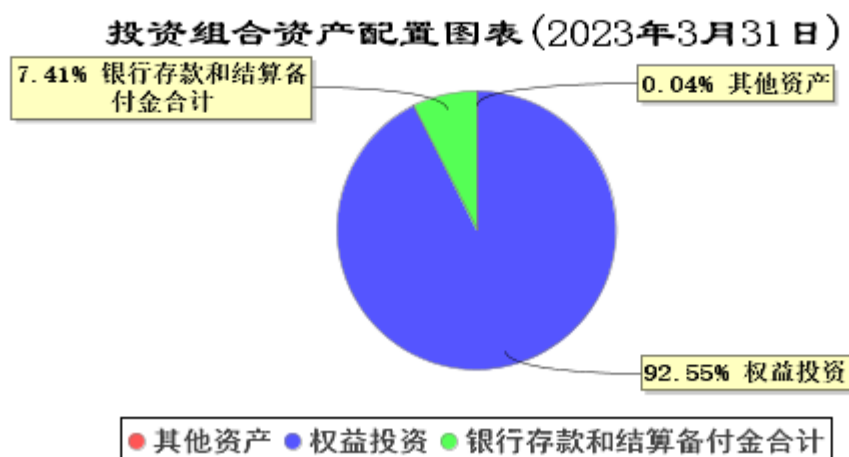
请投资者阅读《招募说明书》第十章了解详细情况。

投资目标	本基金采用指数增强投资策略。通过量化风险管理方法, 控制基金投资组合与标的指数构成的偏差, 同时结合主动投资方法, 在严格控制跟踪偏离风险的基础上, 力争获得超越业绩比较基准标的的投资收益, 追求基金资产的长期增值。在正常市场情况下, 本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过 8%。
投资范围	本基金投资范围限于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(含存托凭证)、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他证券品种, 基金管理人在履行适当的程序后, 可以将其纳入投资范围。 本基金投资于股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例为 85%-95%, 投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-15%, 其中现金或者到期日在一年以内的政府债券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。权证占基金资产净值的比例不高于 3%。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。 本基金除投资于目标指数的成份股票, 包括沪深 300 指数的成份股和备选成份股以外, 还可适当投资一级市场申购的股票(包括新股与增发), 以在不增加额外风险的前提下提高收益水平。
主要投资策略	1、资产配置策略; 2、股票投资策略; 3、债券投资策略; 4、存托凭证投资策略。

业绩比较基准 95%X 沪深 300 指数+5%X 银行同业存款利率

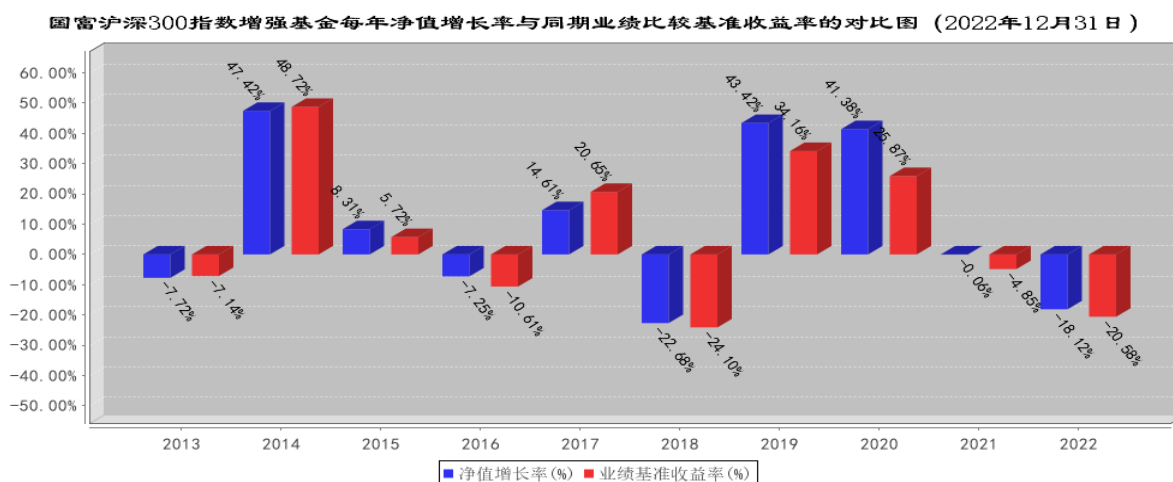
风险收益特征 本基金是股票指数增强型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



注: 以上为报告期末各资产占基金总资产的比例。

## (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



注: 业绩表现截止日期 2022 年 12 月 31 日。基金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 < 1,000,000	1.20%	金额 (M) 单位: 元
	1,000,000 ≤ M < 2,000,000	1.00%	-
	2,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.70%	-

	M $\geq$ 5,000,000	1,000 元/笔	-
	N $<$ 7 天	1.50%	-
赎回费	7 天 $\leq$ N $<$ 365 天	0.50%	-
	365 天 $\leq$ N $<$ 730 天	0.25%	-
	N $\geq$ 730 天	0.00%	-

## (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	0.850%
托管费	0.150%
指数许可使用费	0.016%

注：1、基金的指数许可使用费从基金财产中列支。根据《中证指数公司指数使用许可协议》，在通常情况下，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.016%的年费率计提。每日计算，逐日累计。计算方法如下： $H=E\times 0.016\%\div$ 当年天数，H 为每日应付的指数许可使用费，E 为前一日的基金资产净值。自基金合同生效日起，指数许可使用费每季度支付一次，指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元整（即不足 5 万元时按照 5 万元收取）。当年基金合同生效不足一个季度的，按照一个季度收费。

2、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。

投资于本基金的主要风险：1. 指数化投资的风险（包括与业绩基准偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构变更或停止服务的风险、成分股停牌的风险）；2. 流动性风险；3. 市场风险（系统风险）；4. 操作风险；5. 技术系统风险；6. 网络安全风险；7. 合规性风险；8. 不可抗力风险；9. 投资者认知风险；10. 存托凭证投资风险；11. 其他风险；以及

12. 科创板股票的特定风险：

(1) 公司治理风险。科创板股票发行实行注册制，上市条件与主板不同，科创板上市公司的股权激励制度更为灵活，可能存在表决权差异安排。

(2) 流动性风险：由于参与科创板投资有一定的门槛要求，科创板的投资者可能以机构投资者为主。机构投资者在投资决策上具有一定的趋同性，将会造成市场的流动性风险。科创板可能采用摇号抽签方式对于参与网下申购中签的账户进行获配股份的一定时间内的锁定机制，锁定期间获配的股份无法进行交易，存在流动性风险。

(3) 退市风险。科创板退市的标准、程序和执行较主板更为严格：1) 退市情形更多。当上市公司出现新增市值低于规定标准、信息披露或者规范运作存在重大缺陷的情形，将直接导致退市；2) 退市时间更短。因科创板取消了暂停上市和恢复上市程序，因此存在对应当退市的企业直接终止上市的情形；3) 执行标准更严。当上市公司明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入时，可能会直接导致退市。(4) 股价波动风险。科创板竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%。

(5) 境外企业风险。在境外注册的红筹企业可以发行股票或存托凭证在科创板上市，其在信息披露、分红派息等方面可能与境内上市公司存在差异。

(6) 系统性风险。科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋

同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

(7) 政策风险。国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

## (二) 重要提示

富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2009 年 7 月 20 日证监基金字【2009】652 号文核准募集。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。

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

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、定期公告等披露文件。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：[www.ftsfund.com](http://www.ftsfund.com)，客户服务热线：400-700-4518。

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

## 六、其他情况说明

-