

# 浦银安盛沪深 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：2024 年 07 月 03 日

送出日期：2024 年 07 月 19 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    | 浦银安盛沪深 300 指数增强   | 基金代码           | 519116           |
| 下属基金简称  | 浦银安盛沪深 300 指数增强 A | 下属基金交易代码       | 519116           |
| 下属基金简称  | 浦银安盛沪深 300 指数增强 C | 下属基金交易代码       | 019210           |
| 基金管理人   | 浦银安盛基金管理有限公司      | 基金托管人          | 中国建设银行股份有限公司     |
| 基金合同生效日 | 2010 年 12 月 10 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    | 罗雯                | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022 年 11 月 11 日 |
|         |                   | 证券从业日期         | 2007 年 10 月 9 日  |

注：自 2023 年 8 月 28 日起，本基金增加 C 类份额。

### 二、基金投资与净值表现

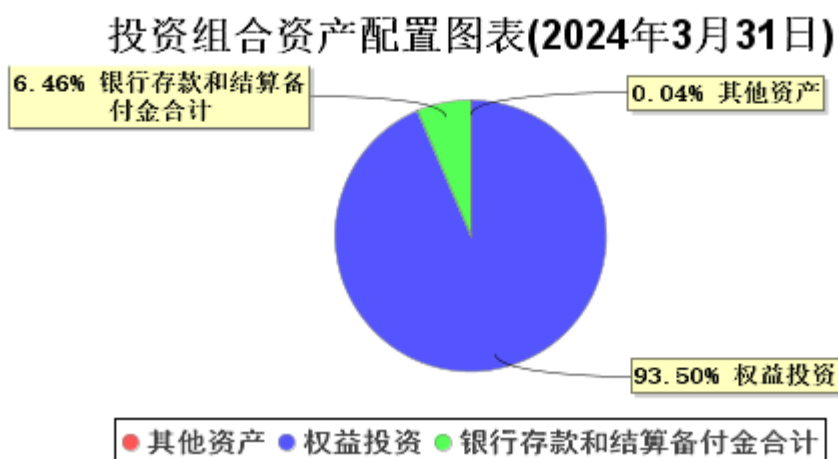
#### (一) 投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》第九章了解详细情况

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | <p>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，主要通过数量化模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。</p> <p>本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：力争使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%。</p>  |
| 投资范围 | <p>本基金资产投资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、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产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%—10%，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%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证及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。</p> <p>本基金可根据相关法律法规，参与转融通证券出借业务。</p> |

|                      |  |
|----------------------|--|
| <p><b>主要投资策略</b></p> | <p>本基金以沪深 300 指数为目标指数，采用“指数化投资为主、增强型策略为辅”的投资策略。在有效复制目标指数的基础上，通过公司自有量化增强模型，优化股票组合配置结构，一方面严格控制投资组合的跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在跟踪目标指数的同时，力争获得超越业绩比较基准的收益。</p> |
| <p><b>业绩比较基准</b></p> | <p>沪深 300 指数收益率×95%+1%（指年收益率，评价时按期间累计天数折算）</p>   |
| <p><b>风险收益特征</b></p> | <p>本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p>  |

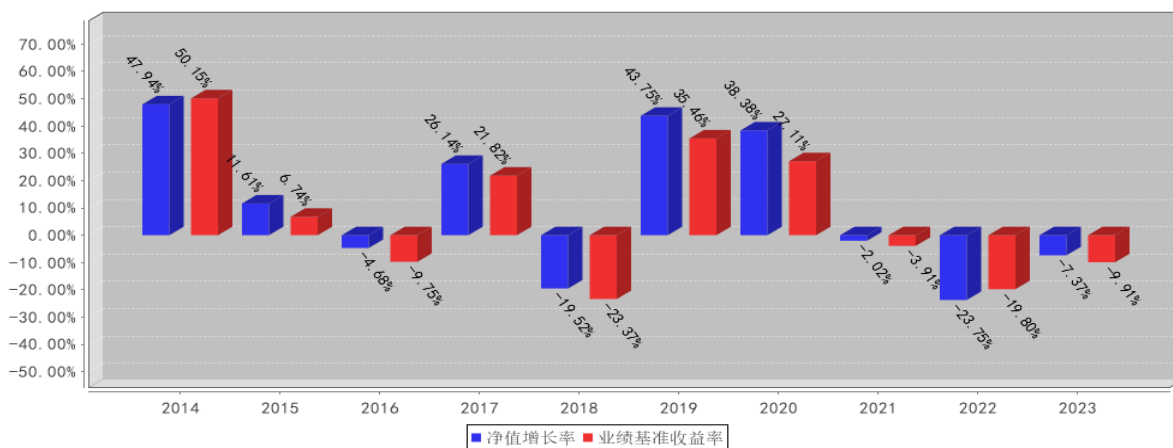
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



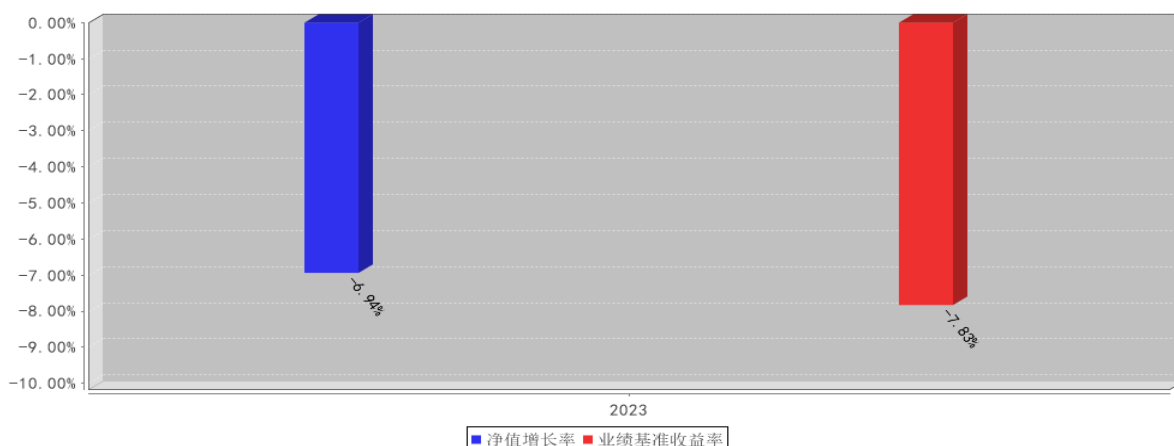
注：由于四舍五入原因，上述各类资产市值占资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

(三) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

浦银安盛沪深300指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2023年12月31日）



浦银安盛沪深300指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2023年12月31日）



注：1、业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

2、自 2023 年 8 月 28 日起，本基金增加 C 类份额，生效当年非完整自然年度，按实际存续期计算。业绩表现截止日期 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

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

##### 浦银安盛沪深 300 指数增强 A

| 费用类型         | 份额 (S) 或金额 (M)<br>/持有期限 (N) | 收费方式/费率   |
|--------------|-----------------------------|-----------|
| 申购费<br>(前收费) | M < 100 万元                  | 1.2%      |
|              | 100 万元 ≤ M < 300 万元         | 0.8%      |
|              | 300 万元 ≤ M < 500 万元         | 0.3%      |
|              | M ≥ 500 万元                  | 1,000 元/笔 |
| 赎回费          | N < 7 天                     | 1.5%      |
|              | 7 天 ≤ N < 1 年               | 0.5%      |
|              | 1 年 ≤ N < 2 年               | 0.25%     |
|              | N ≥ 2 年                     | 0%        |

##### 浦银安盛沪深 300 指数增强 C

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M)<br>/持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|------|-----------------------------|---------|
| 赎回费  | N < 7 天                     | 1.5%    |
|      | N ≥ 7 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/年费率或金额 | 收取方        |
|------|-------------|------------|
| 管理费  | 1.0%        | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费  | 0.15%       | 基金托管人      |

|         |                   |                        |        |
|---------|-------------------|------------------------|--------|
| 销售服务费   | 浦银安盛沪深 300 指数增强 C | 0.40%                  | 销售机构   |
| 审计费用    | 60,000.00 元       |                        | 会计师事务所 |
| 信息披露费   | 120,000.00 元      |                        | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费 | 0.016%            | 年下限金额：<br>200,000.00 元 | 指数编制公司 |
| 其他费用    | 律师费等              |                        |        |

注：1. 本基金交易证券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、信息披露费金额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：

浦银安盛沪深 300 指数增强 A

|      | 基金运作综合费率（年化） |
|------|--------------|
| 持有期间 | 1.24%        |

浦银安盛沪深 300 指数增强 C

|      | 基金运作综合费率（年化） |
|------|--------------|
| 持有期间 | 1.64%        |

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）、指数许可使用费为基金现行费率，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。指数许可使用费使用下限金额计算。

## 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。

投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资策略所特有的风险等等。

1、本基金特有风险如下：

本基金的投资运作主要是围绕两方面展开，一方面是跟踪指数的被动投资策略；另一方面是为获得超额收益的指数增强型投资策略。

1.1 跟踪指数的被动投资策略面临的风险

(1) 目标指数回报与股票市场平均回报偏离风险

目标指数并不能完全代表整个股票市场，目标指数成份股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) 目标指数变更风险

根据基金合同规定，如出现变更目标指数的情形，本基金将变更目标指数。基于原目标指数的投资组合将随之调整，基金的风险收益特征将与新的目标指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成

本。

(3) 跟踪偏离风险

- ①由于目标指数成份股的定期或不定期调整带来跟踪偏离风险。
- ②由于基金运作、交易成本以及基金流动性需求带来跟踪偏离风险。

(4) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

(5) 指数编制机构停止服务的风险

(6) 成份股停牌的风险

1.2 指数增强型投资策略面临的风险

本基金投资采用的成份股多因子量化  $\alpha$  增强策略和非成份股优选增强策略由于对目标指数的适度增强可能对本基金的收益产生影响。

1.3 本基金投资科创板股票风险，主要存在以下几个方面：

- (1) 市场风险 (2) 流动性风险 (3) 信用风险 (4) 集中度风险 (5) 系统性风险 (6) 政策风险

1.4 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) 信用风险 (2) 市场风险 (3) 其他风险

1.5 存托凭证投资风险

2、开放式基金共有的风险如管理风险、流动性风险和其他风险。

3、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。

## (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的核准，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。

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，对各方当事人均有约束力。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见本基金管理人网站 网址[[www.py-axa.com](http://www.py-axa.com)]

客服电话：400-8828-999 或 (021) 33079999

《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》、《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》、《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》

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