

新华中证环保产业指数证券投资基金

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024年8月7日

送出日期：2024年8月8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 | 新华中证环保产业指数 | 基金代码 | 164304 |
| 基金管理人 | 新华基金管理股份有限公司 | 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2020-12-03 | | |
| 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 | 邓岳 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2017-08-07 |
| | | 证券从业日期 | 2008-07-01 |

注：场内简称：新华环保

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

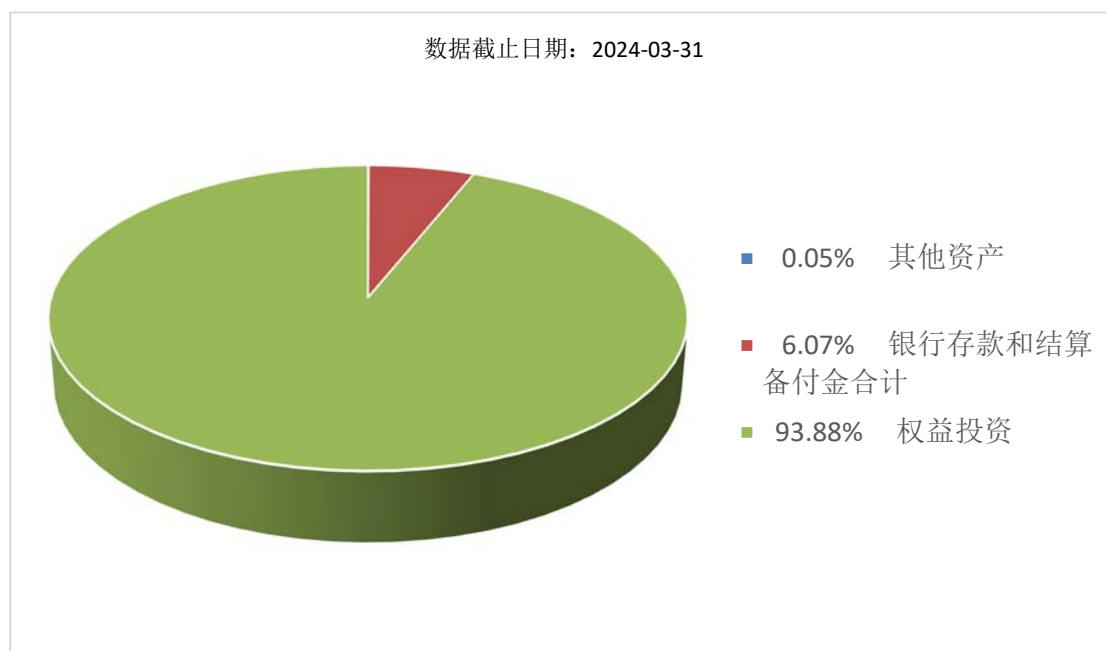
投资者可阅读《招募说明书》第九章了解详细情况。

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金采用被动式指数化投资方法，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以实现对标指数的有效跟踪。在正常市场情况下，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。 |
| 投资范围 | 本基金的标的指数是中证环保产业指数。 本基金可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等股票（包括中小板、创业板以及其它经中国证监会核准上市的股票、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（但须符合中国证监会的相关规定）。 此外，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。 基金的投资组合比例为：本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例范围为90—95%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的90%，投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的组合比例不低于非现金基金资产的80%。现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。 如果法律法规或中国证监会变更基金投资品种的投资比例限制，基金 |

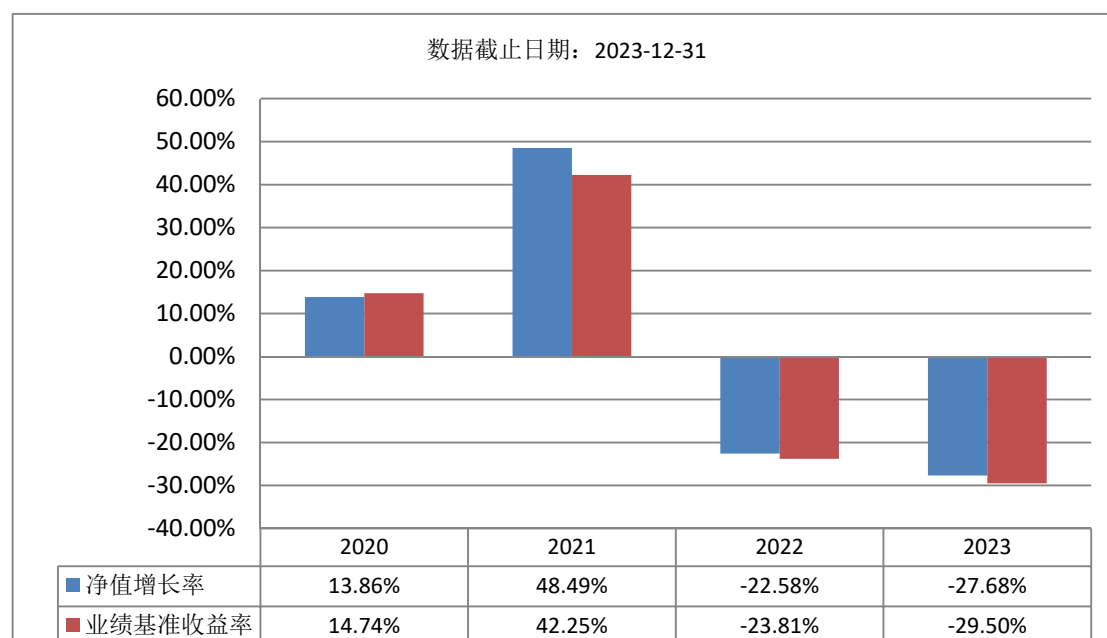
| | |
|---------------|--|
| | 管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。 |
| 主要投资策略 | 本基金按照成份股在中证环保产业指数中的基准权重构建指数化投资组合，原则上采用完全复制法，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对实际投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。 本基金的标的指数是中证环保产业指数。 |
| 业绩比较基准 | 95%×中证环保产业指数收益率 + 5%×商业银行活期存款利率（税后）。 |
| 风险收益特征 | 本基金是指数型基金，具有较高预期收益、较高预期风险的特征。预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表



(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



- 1、本基金于2020年12月3日成立，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。
- 2、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 < 50 万元 | 1.00% | |
| | 50 万元 ≤ M < 100 万元 | 0.60% | |
| | M ≥ 100 万元 | 1000 元/笔 | |
| 赎回费 | N < 7 天 | 1.50% | |
| | 7 天 ≤ N < 365 天 | 0.50% | |
| | 365 天 ≤ N < 730 天 | 0.20% | |
| | N ≥ 730 天 | 0.00% | |

申购费：

场内申购费率：

场内申购费率由基金销售机构比照场外申购费率执行。

赎回费：

场内赎回费率：

| 持有期 (记为 T) | 场内赎回费率 |
|------------|--------|
| T < 7 天 | 1.50% |
| T ≥ 7 天 | 0.50% |

(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 | 收费方 |
|---------|-------------|------------|
| 管理费 | 1.00% | 基金管理人、销售机构 |
| 托管费 | 0.20% | 基金托管人 |
| 审计费用 | 80,000.00 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费 | 160,000.00 | 指数编制公司 |

| | | |
|------|---|--------|
| 其他费用 | 《基金合同》生效后与基金相关的 会计师费、律师费和诉讼费；基金份 额持有人大会费用；基金的证券交 易费用；基金的银行汇划费用；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 | 相关服务机构 |
|------|---|--------|

注：1、标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元（大写：伍万元整），目前按八折收费即下限为每季度人民币4万元（大写：肆万元整）。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

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。审计费用、信息披露费用为由基金整体承担的年费用金额，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：

| |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 1.46% |

注：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。

1、本基金的主要风险

本基金的主要风险包括：市场风险、流动性风险、信用风险、交易对手违约风险、管理风险、资产配置风险、本基金的特定风险、不可抗力风险及其他风险。

2、本基金的特定风险

（1）指数投资风险：1）目标指数回报与股票市场平均回报偏离的风险：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）目标指数波动的风险：目标指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者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目标指数回报偏离的风险：以下因素可能使基金投资组合的收益率与目标指数的收益率发生偏离：①由于目标指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪误差；②由于目标指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在目标指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪误差；③成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过目标指数收益率，产生跟踪误差；④由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪误差；⑤由于基金应对日常赎回保留的少量现金、投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与目标指数产生跟踪误差；⑥其他因素产生的跟踪误差。如因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动。

4）目标指数变更的风险：尽管可能性很小，但根据基金合同规定，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目标和投资策略可能会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险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。

5) 跟踪误差控制未达约定目标的风险: 本基金的风险控制目标是力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不超过 0.35%, 年跟踪误差不超过 4%, 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。

6) 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, 本基金合同终止。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。

7) 成份股停牌的风险: 标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌, 发生成份股停牌时, 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。本基金运作过程中, 当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险, 且指数编制机构暂未作出调整的, 基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则, 综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响, 据此制定成份股替代策略, 并对投资组合进行相应调整。由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(2) 本基金投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证, 除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外, 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。

(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。

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, 应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。

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[www.ncfund.com.cn][4008198866]

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
无。