

# 海富通中证A500指数增强型发起式证券投资基金 (海富通中证A500指数增强A) 基金产品资料概要

编制日期：2025年2月20日

送出日期：2025年2月21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

<b>基金简称</b>	海富通中证 A500 指数增强	<b>基金代码</b>	023367
<b>下属基金简称</b>	海富通中证 A500 指数增强 A	<b>下属基金代码</b>	023367
<b>基金管理人</b>	海富通基金管理有限公司	<b>基金托管人</b>	上海浦东发展银行股份有限公司
<b>基金合同生效日</b>	-		
<b>基金类型</b>	股票型	<b>交易币种</b>	人民币
<b>运作方式</b>	普通开放式	<b>开放频率</b>	每个开放日
<b>基金经理</b>	林立禾	<b>开始担任本基金基金经理的日期</b>	-
		<b>证券从业日期</b>	2018-08-20
	朱斌全	<b>开始担任本基金基金经理的日期</b>	-
		<b>证券从业日期</b>	2007-04-02
<b>其他</b>	基金合同生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产净值低于 2 亿元的，本基金应当按照基金合同的约定程序进行清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的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，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。 《基金合同》生效满三年后继续存续的，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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

投资者可阅读本基金《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，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资策略模型进行积极的指数组合管理与风险控制，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%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

---

## 投资范围

本基金的标的指数为中证A500指数。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据相关法律法规的规定，参与融资和转融通证券出借业务。

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，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票资产及存托凭证占基金资产的比例为不低于80%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

---

## 主要投资策略

### 1、股票投资策略

(1) 标的指数：本基金股票资产跟踪的标的指数为中证A500指数。

### (2) 量化增强策略

本基金一方面采用指数化被动投资策略以追求有效跟踪标的指数，避免大幅偏离标的指数；另一方面采用量化模型调整投资组合，力求实现高于标的指数的投资收益。本基金运用的量化投资模型借鉴国际一流定量分析的应用经验，利用多因子alpha模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。主要包括多因子alpha模型——股票超额回报预测、风险估测模型——有效控制风险预算、交易成本模型——控制成本并保护业绩和投资组合优化模型。

2、债券投资策略；3、可转换债券和可交换债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、国债期货投资策略；7、股票期权投资策略；8、融资及转融通证券出借策略；9、存托凭证投资策略。

---

## 业绩比较基准

中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

---

## 风险收益特征

本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数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  
 (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

### 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
认购费	M < 100 万元	1.00%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.60%	非养老金客户
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.20%	非养老金客户
	M ≥ 500 万元	按笔收取, 1000 元/笔	非养老金客户
	M < 100 万元	0.10%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.06%	养老金客户
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.02%	养老金客户
	M ≥ 500 万元	按笔收取, 1000 元/笔	养老金客户
申购费 (前收费)	M < 100 万元	1.20%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.80%	非养老金客户
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.40%	非养老金客户
	M ≥ 500 万元	按笔收取, 1000 元/笔	非养老金客户
	M < 100 万元	0.12%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.08%	养老金客户
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.04%	养老金客户
	M ≥ 500 万元	按笔收取, 1000 元/笔	养老金客户
赎回费	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.50%	
	N ≥ 30 天	-	

注：以上费用在认购/申购/赎回基金过程中收取，养老金客户、非养老金客户的具体含义请见《招募说明书》相关内容。

## (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	0.80%	基金管理人、销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、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、股票期权等交易费用；基金的银行汇划费用；基金的账户开户费用、账户维护费用；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：本基金费用的种类、计提标准和支付方式详见本基金的《招募说明书》。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。

投资于本基金的风险主要包括：

#### (一) 本基金特有的风险

##### 1、基金组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率：①由于基金投资过程中会产生证券交易成本，以及基金管理费、托管费和销售服务费等费用和税收的存在，而标的指数编制过程中不考虑上述成本，这将导致基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。②指数成份股派发现金红利、新股市值配售收益等因素将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。③当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。④投资者申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遭遇标的指数成份股停牌、摘牌或流动性差等情形时，基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。⑤在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金收益产生影响，从而影响基金跟踪偏离度和跟踪误差。⑥其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；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；因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

##### 2、标的指数变更的风险

如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

##### 3、指数增强型策略风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，本基金可在参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合，在基于数量化投资分析及基本面研究等方法对投资组合进行优化，以争取实现指数增强型的目标；存在因分析方法或主观判断失误，而不能

达成指数增强型的风险。

#### 4、标的指数波动的风险

标的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,从而可能使得基金收益水平发生变化,产生风险。

#### 5、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金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%,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、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,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、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期间,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。

#### 8、基金合同终止的风险

基金合同生效之日起三年后的对应日(若无对应日则顺延至下一日),若基金资产净值低于2亿元的,本基金应当按照基金合同的约定程序进行清算并终止,无需召开基金份额持有人大会审议,并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的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,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。

本基金若出现标的指数不符合要求(因成份股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以及法律法规、监管机构另有规定的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人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。故投资人可能面临基金合同终止的风险。

#### 9、参与融资及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流动性风险、信用风险、市场风险、其他风险等。

此外,本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务,可能存在杠杆风险和对手方交易风险等融资业务特有风险。

#### 10、投资资产支持证券风险

本基金可投资于资产支持证券品种,由于资产支持证券一般都针对特定机构投资人发行,且仅在特定机构投资人范围内流通转让,该品种的流动性较差,且抵押资产的流动性较差,因此,持有资产支持证券可能给组合资产净值带来一定的风险。另外,资产支持证券还面临提前偿还和延期支付的风险。

#### 11、投资科创板股票的相关风险

本基金资产可投资于科创板股票,可能面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有特有风险,其中包括但不限于退市风险、市场风险、流动性风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

#### 12、投资股指期货风险

本基金可投资于股指期货。投资于股指期货需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于股指期货通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于股指期货定价复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。股指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，股价指数微小的变动就可能使投资人权益遭受较大损失。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，可能给投资带来损失。

### 13、投资国债期货风险

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，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债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，可能给投资带来重大损失。

### 14、投资股票期权的风险

本基金的投资范围包括股票期权，股票期权的风险主要包括市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

### 15、投资存托凭证的风险

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

16、基金管理人有权决定本基金是否转型为基金管理人同时管理的跟踪同一标的指数的增强交易型开放式指数证券投资基金（ETF）联接基金并相应修改基金合同，如决定以ETF联接基金模式运作，则在履行适当程序后须提前公告。投资者还有可能面临基金转型的风险。

另外，投资于本基金的风险还包括市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险、收益率曲线风险、杠杆放大风险、投资流动性受限资产的风险、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、其他风险等。

## **(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。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因本基金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，任何一方应根据基金合同的约定提交至仲裁机构进行仲裁。具体仲裁机构和仲裁地点详见基金合同的具体约定。

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**

以下资料详见海富通基金管理有限公司网站（<http://www.hftfund.com>）（客服电话：40088-40099）。

- 本基金基金合同、托管协议、招募说明书
- 本基金定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 本基金基金份额净值
- 本基金基金销售机构及联系方式

- 其他重要资料