

广发沪深300指数增强型发起式证券投资基金(广发沪深300指数增强Y) 基金产品资料概要更新

编制日期：2025年10月27日
送出日期：2025年10月29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	广发沪深 300 指数增强	基金代码	006020
下属基金简称	广发沪深 300 指数增强 Y	下属基金代码	025882
基金管理人	广发基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2018-06-29		
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	赵杰	开始担任本基金基金经理的日期	2018-06-29
		证券从业日期	2008-07-03
其他	《基金合同》生效后，连续二十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 5,000 万元人民币情形的，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当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，并召开基金份额持有人大会进行表决。 法律法规另有规定时，从其规定。		

注：本基金自 2025 年 10 月 30 日起增设 Y 类份额。

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，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（沪深300指数）成份股及其备选成份股（含存托凭证）、其他股票（含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证），权证、股指期货、债券（包括国内依法发行上市的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券（包括超短期融资券）以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券）、

	债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具（含同业存单）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的相关规定）。 本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。 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：股票资产占基金资产的比例不低于80%，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货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；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。
主要投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金力争使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8.0%。具体策略包括： （1）股票投资策略；（2）债券投资策略；（3）资产支持证券投资策略；（4）金融衍生品投资策略；（5）融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后) × 5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

注：详见《广发沪深300指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新文件中“基金的投资”。

（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

无

（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

无

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 < 100 万元	1.50%	
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.90%	
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%	

	M ≥ 500 万元	1000 元/笔
赎回费	N < 7 日	1.50%
	N ≥ 7 日	-

注：1、本基金的申购费用由申购人承担，可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。

2、本基金销售机构可以豁免Y类基金份额的申购费用，也可针对Y类基金份额实施费率优惠。

（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	0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	72,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、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、基金相关账户的开户及维护费用等费用，以及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。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。	相关服务机构

注：1、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。

2、审计费用、信息披露费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（金额单位为人民币元）。

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。

Y类基金份额是本基金针对个人养老金投资基金业务设立的单独份额类别，Y类基金份额的申赎安排、资金账户管理等事项还应同时遵守关于个人养老金账户管理的相关规定。除另有规定外，投资者购买Y类基金份额的款项应来自其个人养老金资金账户，基金份额赎回等款项也需转入个人养老金资金账户，投资人未达到领取基本养老金年龄或者政策规定的其他领取条件时不可领取个人养老金。

个人养老金可投资的基金产品需符合《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》要求的相关条件，具体名录由中国证监会确定，每季度通过相关网站及平台等公布。本基金运作过程中可能出现不符合相关条件从而被移出名录的情形，届时本基金将暂停办理Y类基金份额的申购，投资者由此可能面临无法继续投资Y类基金份额的风险。

1、本基金特有的风险

投资者赎回本基金Y类基金份额，其赎回款项将被划入其对应的个人养老金资金账户。

- （1）跟踪指数偏离风险
- （2）标的指数变更的风险
- （3）跟踪误差控制未达约定目标的风险
- （4）指数编制机构停止服务的风险

- (5) 成份券停牌的风险
- (6) 指数增强型策略风险
- 2、投资于中小企业私募债券的风险
- 3、投资股指期货的风险
- 4、投资权证的风险
- 5、投资资产支持证券的风险
- 6、投资科创板股票的风险
- 7、投资流通受限证券的风险
- 8、投资存托凭证的风险
- 9、开放式基金的共有风险

(1) 市场风险；(2) 管理风险；(3) 职业道德风险；(4) 流动性风险；(5) 合规性风险；(6) 投资管理风险；(7) 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等。

10、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。

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及定期报告等。

如投资者对基金合同有争议的，争议解决处理方式详见基金合同“争议的处理和适用的法律”部分或相关章节。

五、其他资料查询方式

以下资料详见广发基金官方网站 [www.gffunds.com.cn] [客服电话：95105828 或 020-83936999]

- (1) 《广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- (2) 《广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- (3) 《广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》
- (4) 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- (5) 基金份额净值
- (6) 基金销售机构及联系方式
- (7) 其他重要资料