

华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要

编制日期：2025 年 11 月 21 日

送出日期：2025 年 11 月 22 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	华宝沪深 300 增强策略 ETF	基金代码	562070
基金管理人	华宝基金管理有 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	—	上市交易所 及上市时间	上海证券交易所
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	王正	开始担任本基金 基金经理的日期	—
		证券从业日期	2012 年 07 月 02 日
基金经理	徐林明	开始担任本基金 基金经理的日期	—
		证券从业日期	2002 年 07 月 01 日
其他	场内简称：沪深 300 指增 ETF		

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资目标	在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的组合管理与严格的风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资范围	本基金的投资范围为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、其他国内依法发行或上市的股票、存托凭证、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具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相关规定）。 本基金可根据法律法规的规定参与融资及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。 本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于沪深 300

	指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金投资股指期货、股票期权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。 如果法律法规或中国证监会变更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。 本基金的标的指数为沪深 300 指数。
主要投资策略	本基金为增强型指数基金，主要投资于沪深 300 指数成份股及备选股票。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于沪深 300 指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。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及区域配置图表

（三）基金每年的净值增长率及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
认购费	M<50 万元	0.80%
	50 万元≤M<100 万元	0.50%
	100 万元≤M	每笔 1000 元

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金。场内交易费用以证券公司实际收取为准。

（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%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	—	会计师事务所
信息披露费	—	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的证券、期货、期权交易费用、基金的银行汇划费用、基金相关账户的开、销户及维护费用、基金上市费及年费、注册登记费用、IOPV 计算与发布费用、收益分配中发生的费用等费	相关服务机构

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。

注： 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。

（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）	
持有期	暂无

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。

投资者应及时关注基金管理人出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必一致，基金管理人的适当性匹配意见并不表明对基金的风险和收益做出实质性判断或者保证。基金合同中关于基金风险收益特征与基金风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应了解基金的风险收益情况，结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险，不应采信不符合法律法规要求的销售行为及违规宣传推介材料。

1、指数化投资的风险

（1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险。（2）标的指数波动的风险。（3）标的指数编制和计算的风险。（4）跟踪误差的风险。（5）指数编制机构停止服务的风险。

2、ETF 运作的风险

（1）可接受股票认购导致的风险。（2）基金份额二级市场交易价格折溢价风险。（3）参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险。（4）成份股停牌的风险。（5）投资者申购失败的风险。（6）投资者赎回失败的风险。（7）申购赎回清单差错风险。（8）申购赎回清单标识设置不合理的风险。（9）基金份额赎回对价的变现风险。（10）套利风险。（11）第三方机构服务的风险。（12）退市风险。

3、本基金投资特定品种及参与特定业务的特有风险

（1）股指期货交易风险

本基金可参与股指期货交易，可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、期货或股票期权价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。

（2）股票期权投资风险

本基金可投资股票期权，股票期权的风险主要包括市场风险、保证金风险、信用风险和操作风险等。市场风险指由于标的价格变动而产生的衍生品的价格波动。

（3）资产支持证券投资风险

本基金的投资范围包括资产支持证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

（4）存托凭证投资风险

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

（5）参与融资业务的风险

本基金可参与融资业务。融资业务存在信用风险、投资风险和合规风险等风险。具体而言，信用风险是指本基金在融资业务中，因交易对手方违约无法按期偿付本金、利息等证券相关权益，导致基金资产损失的风险。投资风险是指本基金在融资业务中，因投资策略失败、对投资标的预判失误等导致基金资产损失的风险。合规风险是指由于违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管机关规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阈值等。

（6）参与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。转融通证券出借业务的风险包括但不限于流动性风险、信用风险和市场风险。流动性风险是指本基金面临大额赎回时可能因转融通证券出借的原因，发生无法及时变现并支付赎回款项的风险。信用风险是指本基金进行转融通证券出借的对手方可能无法及时归还出借证券、无法及时支付权益补偿及相关费用等导致基金资产损失的风险。市场风险是指本基金持有的证券出借后，可能出现出借期间无法及时处置证券，而证券价格持续下跌导致基金资产损失的风险。

（7）采用指数增强型投资策略进行投资管理可能引致的特定风险

1）增强策略失效风险。2）潜在抢先交易风险。3）申赎成本增加风险。4）数据错误风险。5）模型风险。

4、市场风险：证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险。主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险等。

5、本基金还将面临开放式基金共有的风险，如流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、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以及其他风险。

（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、准确获得基金的相关信息，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

以下资料详见华宝基金管理有限公司官方网站 [www.fsfund.com] [客服电话：400-700-5588、400-820-5050]

《华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》、《华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数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