博道沪深300指数量化增强型证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2026年11月05日

送出日期：2026年11月06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	博道沪深300指数量化增强	基金代码	022866
基金简称A	博道沪深300指数量化增强A	基金代码A	022866
基金简称C	博道沪深300指数量化增强C	基金代码C	022867
基金管理人	博道基金管理有限公司	基金托管人	浙商证券股份有限公司
基金合同生效日	2025年01月21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	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
杨梦	2025年01月21日		2011年07月15日
刘兆阳	2026年06月15日		2022年07月04日
其他	《基金合同》生效后的存续期内，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进行表决。 未来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除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当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。		

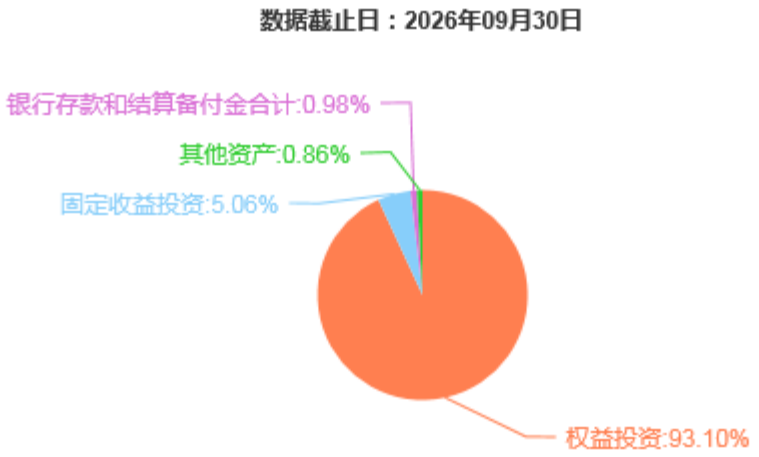
二、 基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

请投资者阅读最新的《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况。

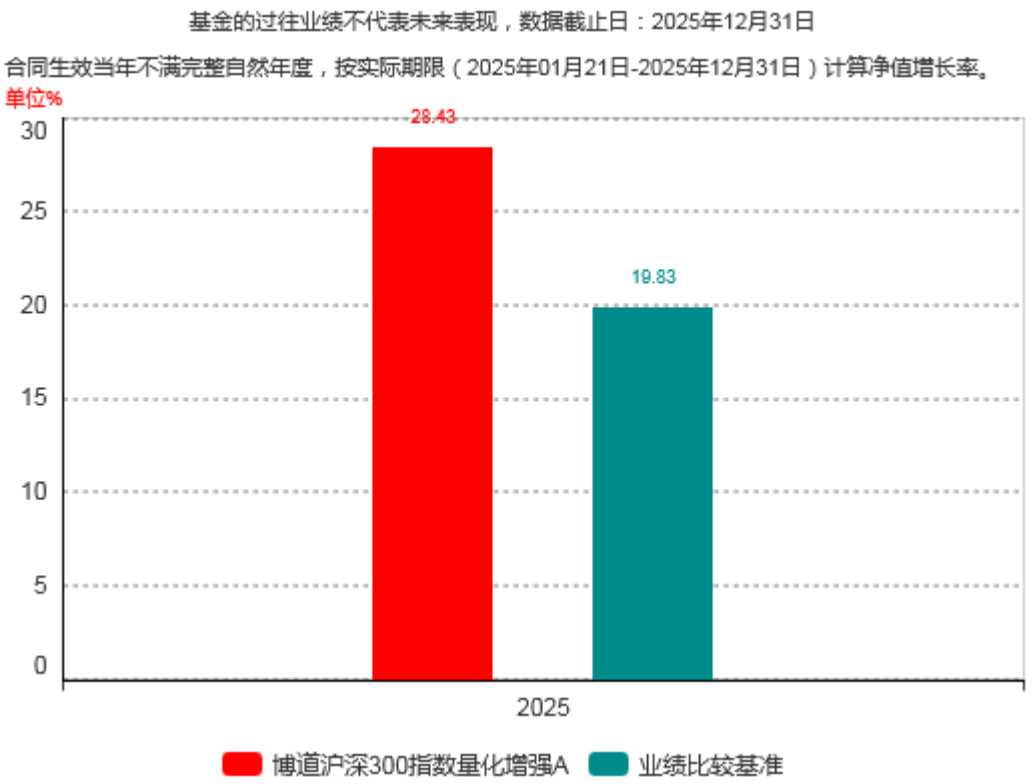
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。
投资范围	本基金的标的指数为沪深300指数。本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货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）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。 基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于标的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%。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以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
主要投资策略	本基金为股票指数增强型基金，以沪深300指数为标的指数，通过量化选股模型构建股票组合，在控制跟踪误差的基础上力求获得超越标的指数的业绩表现。首先，综合考虑股票的市值、盈利情况、风险情况等因素，筛选出满足一定基本面要求的股票，构建备选股票池。然后，综合考虑股票的估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子，对股票进行综合评价后，挑选符合一定标准的股票用于构建股票组合。最后，利用投资组合优化工具，结合行业配置模型对行业的综合评价结果对行业偏离度进行控制，在控制跟踪偏离过大风险的同时，最大化组合的预期收益，以此来确定个股的投资权重。其中，投资于标的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%。股票组合构建完成后，本基金管理人将对组合运作绩效持续跟踪，根据市场的变化及时调整投资组合。本基金的股指期货投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。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。

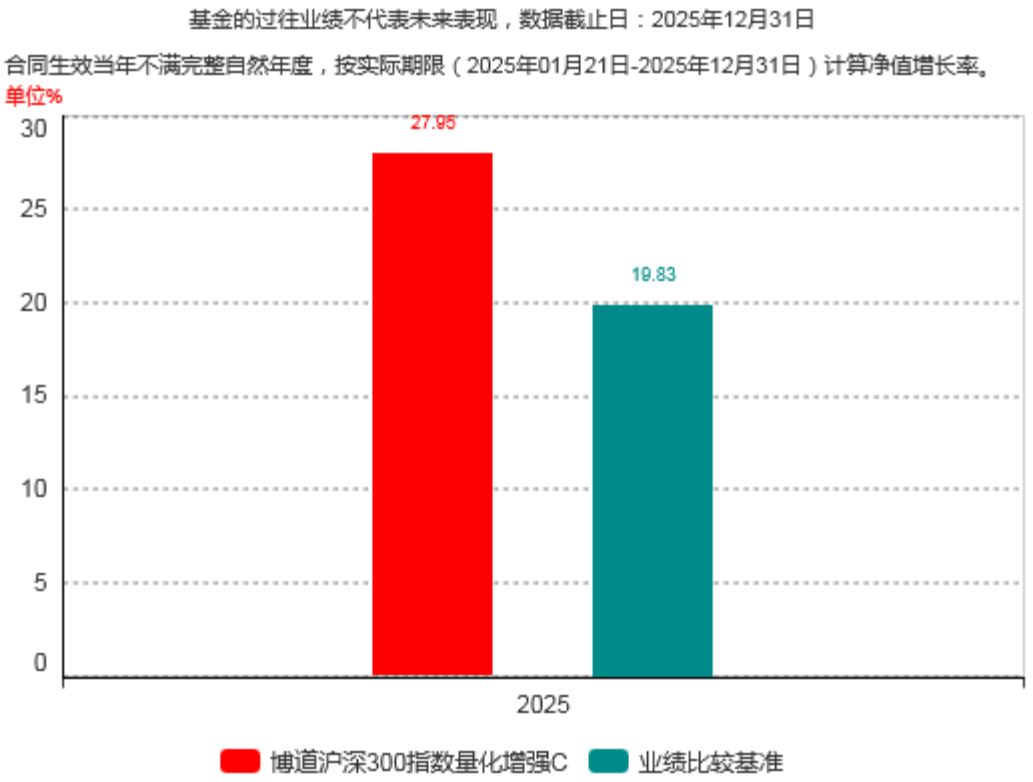
（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表



注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

（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：

博道沪深300指数量化增强A

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	1.20%	非养老金客户
	100万≤M<200万	0.80%	非养老金客户
	200万≤M<500万	0.40%	非养老金客户
	M≥500万	1000.00元/笔	非养老金客户
	M<100万	0.12%	养老金客户
	100万≤M<200万	0.08%	养老金客户
	200万≤M<500万	0.04%	养老金客户
	M≥500万	1000.00元/笔	养老金客户
赎回费	N<7天	1.50%	

	N≥7天	0.00%	

博道沪深300指数量化增强C

费用类型	份额（S）或金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
赎回费	N<7天	1.50%	
	N≥7	0.00%	

申购费C：本基金C类份额无申购费。

（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（元）	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
销售服务费C	0.40%	销售机构
审计费用	27,000.00	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、诉讼费和仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券/期货等交易费用；基金的银行汇划费用；基金的开户费用、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。	相关服务机构

注：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。审计费用、信息披露费为基金整体承担的年费用金额，非单个份额类别费用。年费用金额为预估值，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：

博道沪深300指数量化增强A

基金运作综合费率（年化）
0.94%

注：基金管理费率、托管费率为基金现行费率，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。

博道沪深300指数量化增强C

基金运作综合费率（年化）
1.34%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率为基金现行费率，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、投资本基金可能遇到的风险包括：

（1）因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险；基金管理人在基金管理运作过程中产生的基金管理风险；因基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资产净值产生不利影响造成的流动性风险；交易对手违约或债券发行人违约产生的信用风险；本基金投资策略所特有的风险；投资可转换债券和可交换债券的特定风险；投资股指期货的特定风险；投资资产支持证券的特定风险；参与融资及转融通证券出借业务的特定风险，本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资及转融通证券出借业务，可能面临杠杆投资风险和对手方交易风险等融资及转融通证券出借业务的特有风险；投资科创板股票的特定风险；投资流通受限证券的特定风险；投资存托凭证的特定风险；基金管理人职责终止风险；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；投资本基金的其他风险等等。

（2）当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书"侧袋机制"等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。

2、本基金投资策略所特有的风险：

（1）基金投资组合收益率与标的指数收益率偏离的风险

本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现，在运用量化选股模型构建投资组合过程中，因模型有效性、现金留存等各种原因，其投资收益率可能高于标的指数收益率但也有可能低于标的指数收益率，存在与标的指数的收益率发生偏离的风险。

（2）基金投资组合收益率与股票市场平均收益率偏离的风险

本基金采用指数增强投资策略，以沪深300指数作为标的指数，对标的指数成份股和备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的80%，上述主要投资标的波动会造成本基金份额净值的波动。沪深300指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的300只证券组成，以反映沪深市场上市公司证券的整体表现，并不能完全代表整个股票市场，因此可能存在基金投资组合收益率与股票市场平均收益率偏离的风险。

（3）标的指数变更的风险

根据基金合同的约定，如出现变更本基金标的指数的情形，经基金份额持有人大会同意，本基金将变更标的指数，若发生此情形，基于原标的指数的投资策略将会改变，基金的投资组合将随之调整，本基金的风险收益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。

（4）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。

（5）标的指数成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时本基金可能面临因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差未达约定目标的风险。

（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。

（二）重要提示

博道沪深300指数量化增强型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可〔2024〕1717号文准予募集注册。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等。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.bdfund.cn][客服电话：400-085-2888]

1、《博道沪深300指数量化增强型证券投资基金基金合同》、《博道沪深300指数量化增强型证券投资基金托管协议》、《博道沪深300指数量化增强型证券投资基金招募说明书》

2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

3、基金份额净值

4、基金销售机构及联系方式

5、其他重要资料

六、 其他情况说明

无。