

华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要 (更新)

编制日期: 2024 年 06 月 27 日

送出日期: 2024 年 06 月 28 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	基金主代码	003876
下属基金简称	华宝沪深 300 增强 C	下属基金代码	007404
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	2016 年 12 月 09 日	上市交易所 及上市时间	-
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	徐林明	开始担任本基金 基金经理的日期	2016 年 12 月 09 日
		证券从业日期	2002 年 07 月 01 日
基金经理	王正	开始担任本基金 基金经理的日期	2020 年 01 月 02 日
		证券从业日期	2012 年 07 月 02 日

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

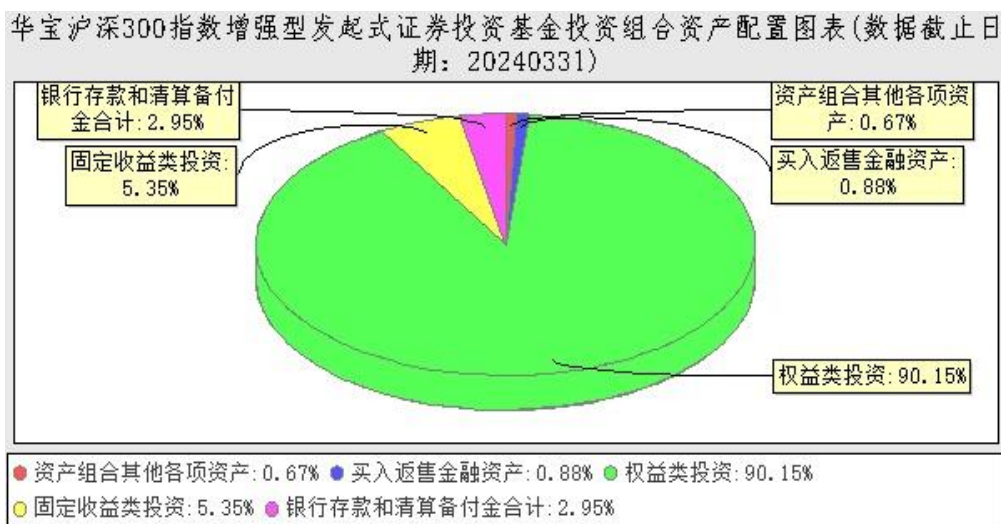
投资目标	本基金为沪深 300 指数增强型基金, 在实现对沪深 300 指数有效跟踪的基础上, 通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理, 力争实现稳定的优于标的指数的投资收益, 追求基金资产的长期增值。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票 (包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会相关规定)。 本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。 本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%, 其中投资于沪深 300 指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金的标的指数为沪深 300 指数。
主要投资策略	本基金主要投资于沪深 300 指数成分股及备选股票。同时, 基于流动性管理及策略性投资的需要, 本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。本基金主要采用量化行业配置模型和

量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合，在控制跟踪偏离度的前提下力争实现超额表现。

业绩比较基准 沪深 300 指数收益率×95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）

风险收益特征 本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

（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

华宝沪深300增强C每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：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
赎回费	N < 7 日	1.50%
	7 日 ≤ N < 30 日	0.50%
	30 日 ≤ N	0.00%

本基金份额类别不收取申购费。

（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	收取方
管理费	1.00%	基金管理人和销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
销售服务费	0.40%	销售机构
审计费用	55,000	会计师事务所
信息披露费	120,000	规定披露报刊
指数许可使用费	0.016%/40000 元	指数编制公司
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：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	1.6%

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然一致，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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金作为指数增强型基金的特定风险等。

（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。

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 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》、《华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》、《华宝沪深 300 指数增强型发起式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