

# 汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金

## 基金产品资料概要（更新）

编制日期：2020 年 12 月 28 日

送出日期：2020 年 12 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        | 汇安沪深300增强                                                                                                                                                                        | 基金代码           | 003884         |
| 下属分级基金的基金简称 | 汇安沪深300增强A                                                                                                                                                                       |                | 汇安沪深300增强C     |
| 下属分级基金的基金代码 | 003884                                                                                                                                                                           |                | 003885         |
| 基金管理人       | 汇安基金管理有限责任公司                                                                                                                                                                     | 基金托管人          | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日     | 2018-07-03                                                                                                                                                                       | 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           | 每个交易日          |
| 基金经理        | 朱晨歌                                                                                                                                                                              | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2018-08-22     |
|             |                                                                                                                                                                                  | 证券从业日期         | 2014-07-01     |
| 其他          | 汇安沪深300指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）由汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金通过基金转型变更而来。自2018年7月3日起《汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》生效，《汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。                                                    |                |                |
| 其他          | 《基金合同》生效后，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，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。 |                |                |

### 二、基金投资与净值表现

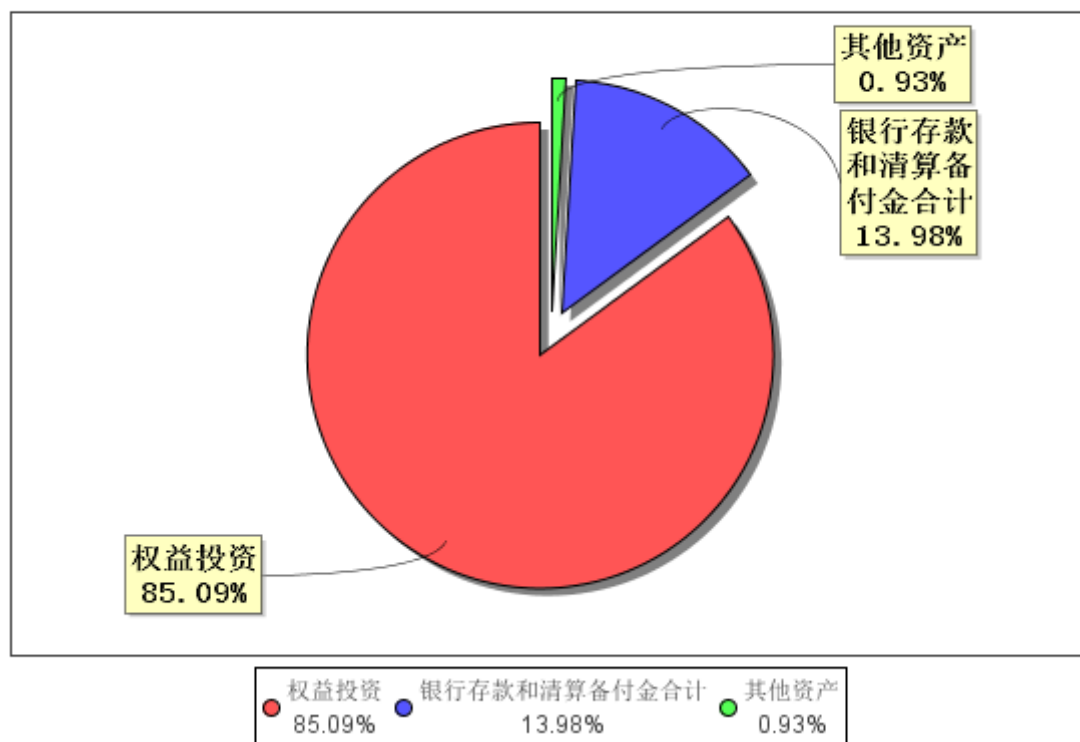
#### （一）投资目标与投资策略

|      |                                                                                          |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金为增强型股票指数基金，在严格控制对沪深300指数跟踪误差的基础上，通过量化投资方式进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越沪深300指数的投资收益和基金财产的长期增值。 |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------|

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|---------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>投资范围</b>   | <p>本基金投资于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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债等）、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）、权证、资产支持证券、股指期货、国债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）。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于沪深300指数成分股及其备选成分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、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，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、国债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。</p> <p>如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。</p> |
| <b>主要投资策略</b> | <p>本基金为增强型股票指数基金，在目标指数成分股权重的基础上根据量化模型优化投资组合，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越目标指数的投资收益。</p> <p>本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略等。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| <b>业绩比较基准</b> | 沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| <b>风险收益特征</b> | <p>本基金为股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。</p> <p>本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

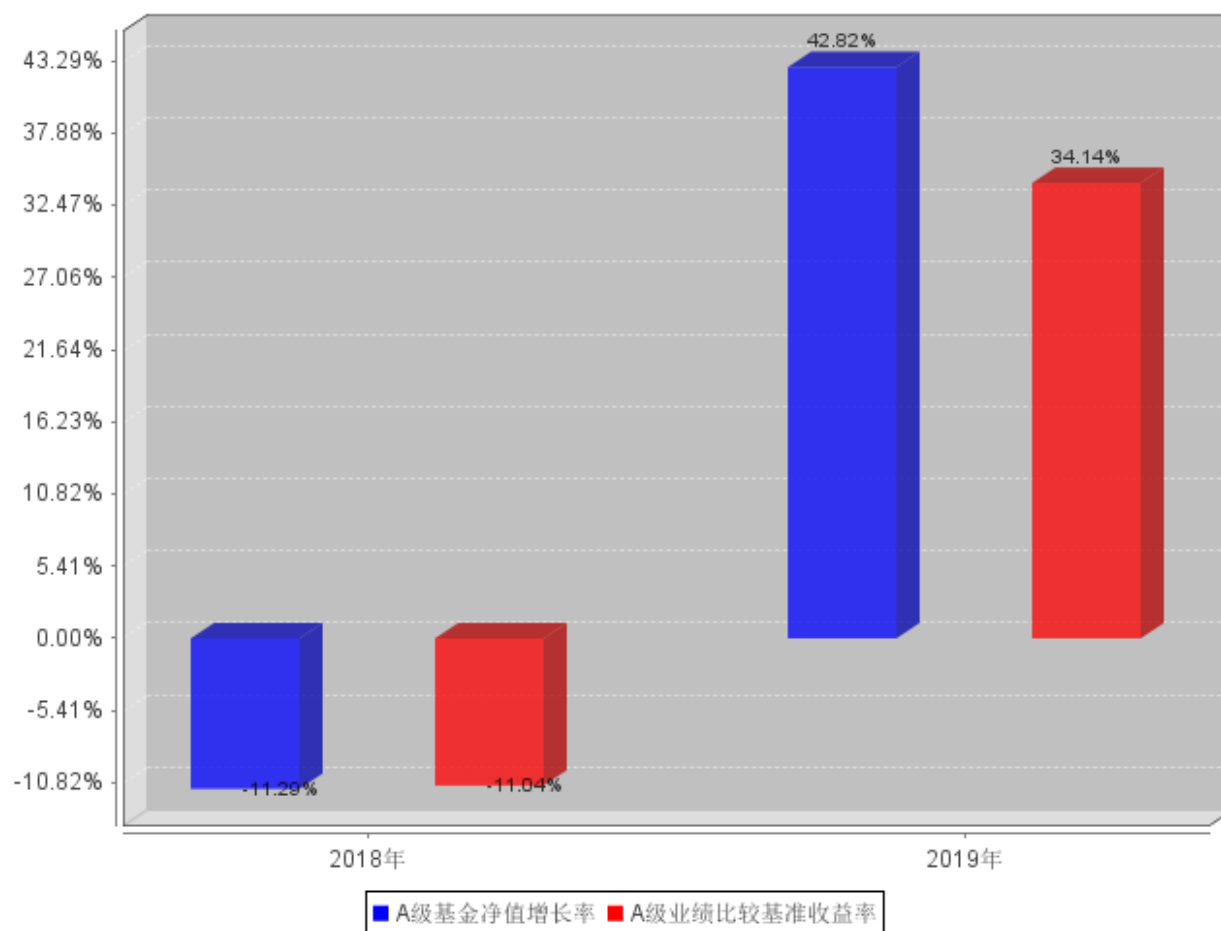
## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表  
数据截止日期：2020年9月30日

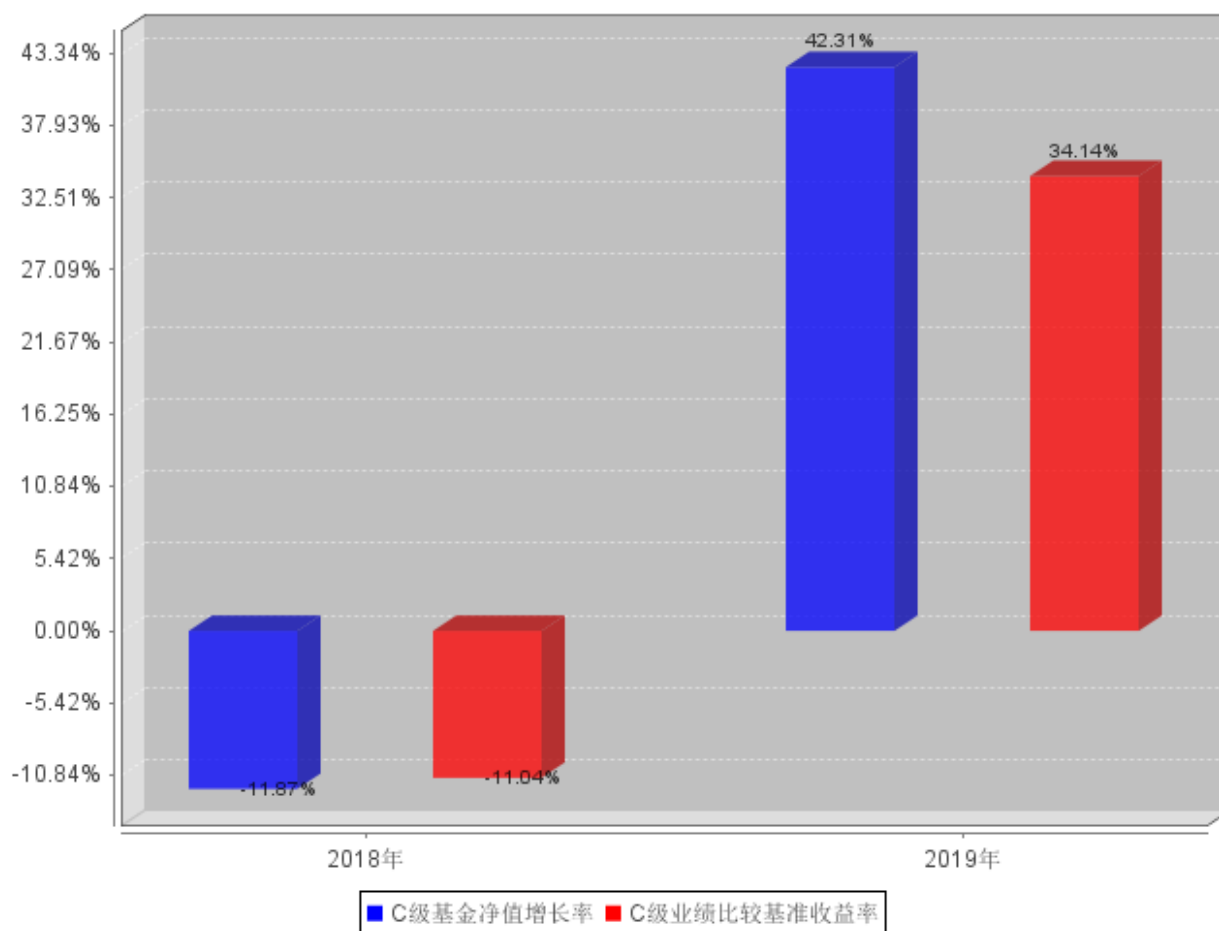


（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

**A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：①本基金合同生效日为2018年7月3日。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

②本基金的业绩表现截止日期为2019年12月31日，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

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

汇安沪深 300 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 |
|----------|-----------------------|---------|----|
| 认购费      | M<500,000             | 1.2%    | -  |
|          | 500,000≤M<2,000,000   | 0.8%    | -  |
|          | 2,000,000≤M<5,000,000 | 0.5%    | -  |
|          | M≥5,000,000           | 1000元/笔 | -  |
| 申购费（前收费） | M<500,000             | 1.2%    | -  |
|          | 500,000≤M<2,000,000   | 0.8%    | -  |
|          | 2,000,000≤M<5,000,000 | 0.4%    | -  |
|          | M≥5,000,000           | 1000元/笔 | -  |
| 赎回费      | N<7日                  | 1.5%    | -  |

|            |       |   |
|------------|-------|---|
| 7日≤N<30日   | 0.75% | — |
| 30日≤N<180日 | 0.5%  | — |
| N≥180日     | 0%    | — |

## 汇安沪深 300 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日                | 1.5%    | —  |
|      | 7日≤N<30日            | 0.5%    | —  |
|      | N≥30日               | 0%      | —  |

## （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 |
|------------|----------|
| 管理费        | — 1.00%  |
| 托管费        | — 0.10%  |
| 销售服务费      | — 0.00%  |
| 汇安沪深300增强A | — 0.40%  |
| 汇安沪深300增强C | — 0.02%  |
| 标的指数许可使用费  | — 0.02%  |

注：1、本基金以下费用，按实际发生额从基金资产扣除：

- （1）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （2）《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；
- （3）基金份额持有人大会费用；
- （4）基金的证券、期货交易费用；
- （5）基金的银行汇划费用；
- （6）基金的相关账户的开户及维护费用；
- （7）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。

## 2、基金标的指数许可使用费

本基金需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数许可使用费。指数许可使用费自本基金转型后的合同生效日起累计，累计计提的指数许可使用费取以下A)、B)中的孰高者：

A) 按照指数使用许可协议规定的费率，以前一日基金资产净值为基础计算并进行计提金额的累计值：

$$H = E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的标的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

B) 按照指数使用许可协议规定的每季度指数许可使用费收取下限，即人民币5万元，均摊到每日的累计值。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

标的指数许可使用费每日计提，逐日累计，每季支付一次，由基金管理人向基金托管人发送标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年1月、4月、7月、10月的前十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用费。

如果标的指数使用许可协议约定的标的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法、费率和支付方式计算标的指数许可使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

## 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、投资于本基金的主要风险有：市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规风险、本基金的特有风险、基金管理人职责终止风险、启用侧袋机制的风险和其他风险。

2、本基金特有风险包括：科创板股票投资风险、金融衍生品投资风险、中小企业私募债投资风险和资产支持证券投资风险。

### （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当事人。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[[www.huianfund.cn](http://www.huianfund.cn)] [010-56711690]

- 1、基金合同、托管协议、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。