

# 富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF) (Y 类份额) 基金产品 资料概要更新

2024 年 12 月 13 日 (信息截至: 2024 年 12 月 12 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	富国中证 500 指数增强(LOF)	基金代码	161017
份额简称	富国中证 500 指数增强(LOF) Y	份额代码	022953
场内扩位简称	500 增强 LOF		
上市交易所	深圳证券交易所	上市日期	2011 年 10 月 21 日
基金管理人	富国基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2011 年 10 月 12 日	基金类型	股票型
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
交易币种	人民币		
基金经理	方旻	任职日期	2014 年 11 月 19 日
		证券从业日期	2010 年 02 月 10 日
基金经理	徐幼华	任职日期	2011 年 10 月 12 日
		证券从业日期	2001 年 07 月 01 日
基金经理	李笑薇	任职日期	2011 年 10 月 12 日
		证券从业日期	2003 年 01 月 23 日

注: 本基金于 2021 年 8 月 19 日起增加 C 类基金份额。

## 二、 基金投资与净值表现

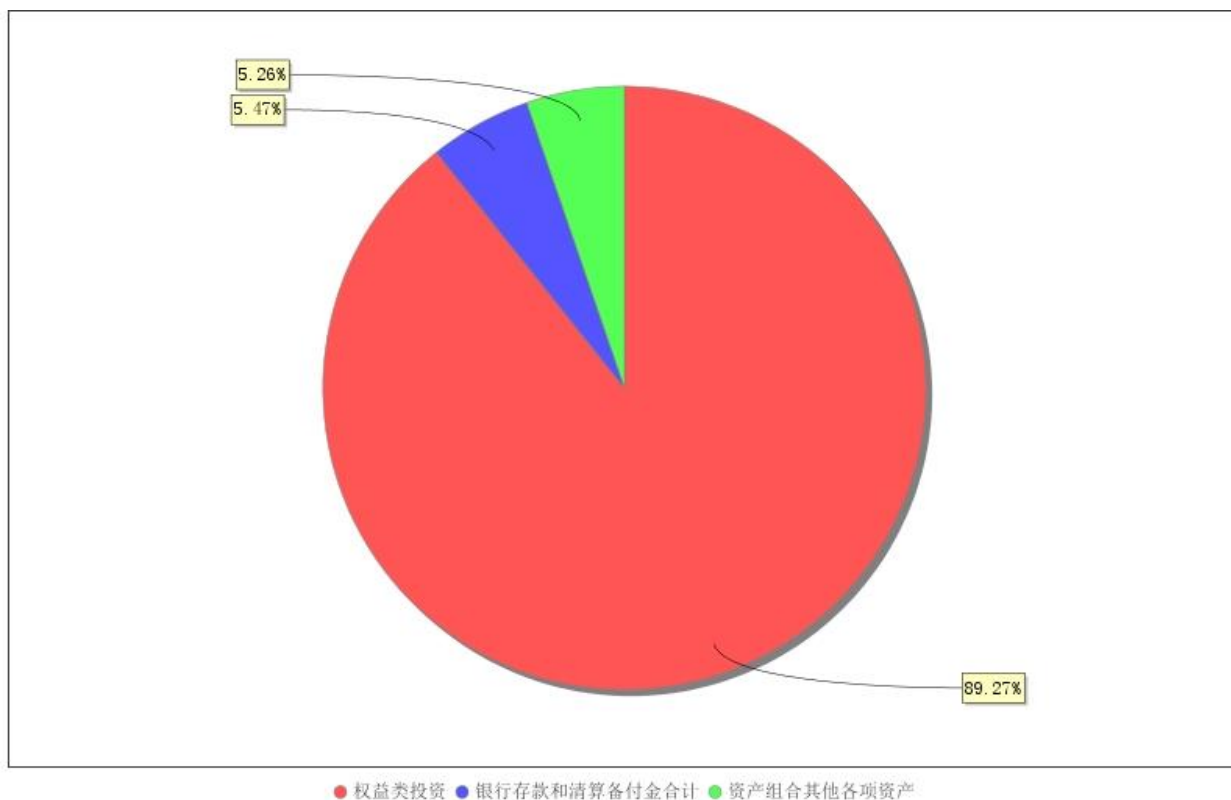
### (一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金为增强型股票指数基金, 在力求对中证 500 指数进行有效跟踪的基础上, 通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制, 力争实现超越目标指数的投资收益, 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, 包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券、权证以及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。其中, 股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的 90%, 投资于中证 500 指数成份股和备选成份股(均含存托凭证)的资产不低于股票资产的 80%。
主要投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”, 主要策略为复制目标指数, 即投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础, 利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。本基金对标的指数的跟踪目标是: 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%。本基金的标的指数、对目标指数的跟踪调整、存托凭证投资策略、债券投资策略、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 1\%$ (指年收益率, 评价时按期间折算)。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金, 属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种, 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。

注：详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

## （二）投资组合资产配置图表



注：截止日期 2024 年 09 月 30 日。

## 三、投资本基金涉及的费用

### （一）基金销售相关费用

费用类型	金额 (M) / 持有期限 (N)	费率 (普通客户)	费率 (特定客户)
申购费 (前端)	M < 100 万	1.5%	—
	100 万 ≤ M < 500 万	1.2%	—
	M ≥ 500 万	1000 元/笔	—
赎回费	N < 7 天	1.5%	
	N ≥ 7 天	0	

注：以上费用在投资者申购基金过程中收取，赎回费用在投资者赎回基金过程中收取。Y 类基金份额可以豁免申购费用，详见更新的招募说明书或有关公告。Y 类基金份额针对个人养老金投资基金业务单独设立，申赎安排、资金账户管理等事项应同时遵守关于个人养老金账户管理的相关规定。

### （二）基金运作相关费用

费用类别	年费率/收费方式	收取方
管理费	0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	0.075%	基金托管人
审计费用	68,000.00 元/年	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元/年	规定披露报刊
指数许可使用费	本基金指数许可使用费率年费率为 0.016%。指数许可	指数编制公司

	使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元。	
--	-----------------------	--

注：以上费用将从基金资产中扣除；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。除上述费用外的其他运作费用，详见《招募说明书》中的“基金费用与税收”章节。若本基金触发基金合同中关于“基金份额持有人数量和资产规模”的预警情形，基金管理人可决定是否承担本基金项下相关固定费用，最终实际情况以基金定期报告披露为准。

### （三）基金运作综合费用测算

基金运作综合费率（年化）
0.59%

注：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上表所示。基金管理费率、托管费率、指数许可使用费为基金现行费率，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。

本基金投资中的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险等。

本基金的特定风险包括：（1）目标指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

目标指数并不能完全代表整个股票市场。目标指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

#### （2）目标指数波动的风险

目标指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

#### （3）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，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

[1]基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

[2]若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

[3]在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的现金，由此基金管理人可能采取暂停赎回等流动性风险控制措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

#### （4）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金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）目标指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更目标指数的情形，本基金将变更目标指数。基于原目标指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的目标指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### （6）指数编制机构停止服务的风险

除以上风险外，本基金还可能存在投资科创板股票投资风险、存托凭证投资风险等特有风险。

#### (7) 投资于 Y 类基金份额的特有风险

Y 类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，个人养老金可投资的基金产品需符合法律法规要求的相关条件，具体名录由中国证监会确定。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 类份额的申购，投资者由此可能面临无法继续投资 Y 类份额的风险。

## (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册/核准，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。

因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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、定期公告等披露文件。

## 五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站(www.fullgoal.com.cn)，客户服务热线：95105686，4008880688（全国统一，免长途话费）

- 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