

前海开源沪深 300 指数型证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 05 月 22 日

送出日期：2024 年 06 月 26 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	前海开源沪深 300 指数	基金代码	000656
基金简称 A	前海开源沪深 300 指数 A	基金代码 A	000656
基金简称 C	前海开源沪深 300 指数 C	基金代码 C	015671
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2014 年 06 月 17 日	基金类型	股票型
上市交易所	暂未上市	上市日期	-
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	梁溥森	开始担任本基金基金经理的日期	2020 年 08 月 12 日
		证券从业日期	2014 年 07 月 01 日

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

详见《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金招募说明书》第九章“基金的投资”。

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深 300 指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以沪深 300 指数的成份股及其备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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)。</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：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 85%；本基金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后，应当保持不</p>

低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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。

主要投资策略

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

本基金的投资策略主要有以下六方面内容：1、大类资产配置。2、股票投资策略。3、存托凭证投资策略。4、债券投资策略。5、权证投资策略。6、股指期货投资策略。

业绩比较基准

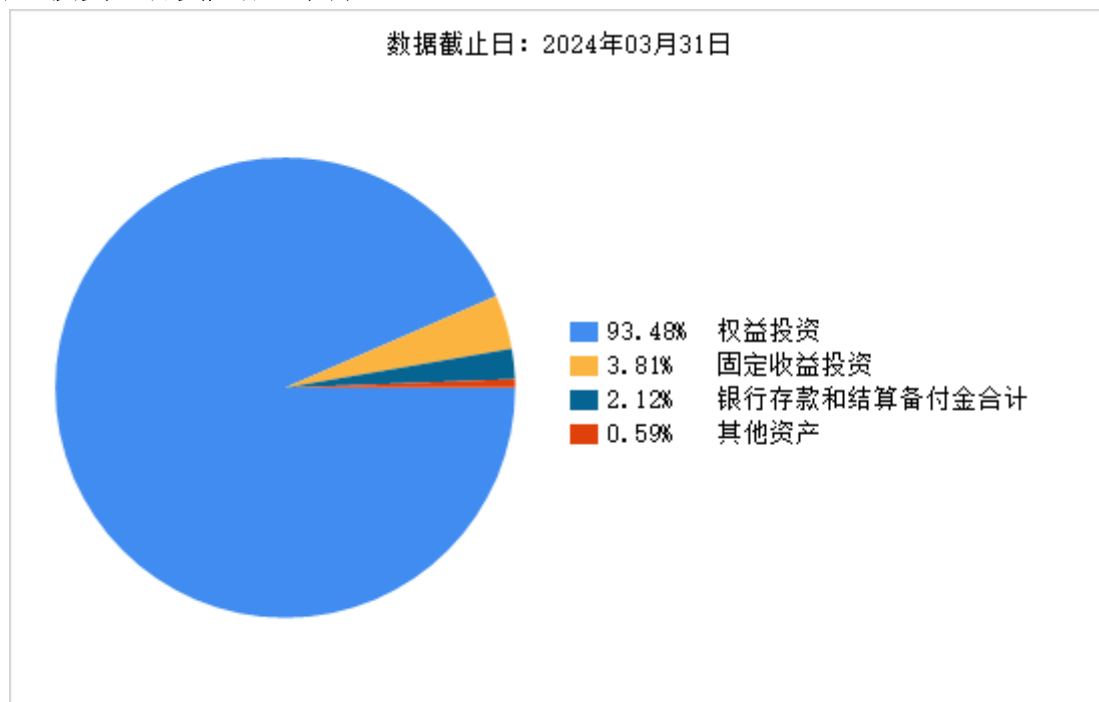
沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

风险收益特征

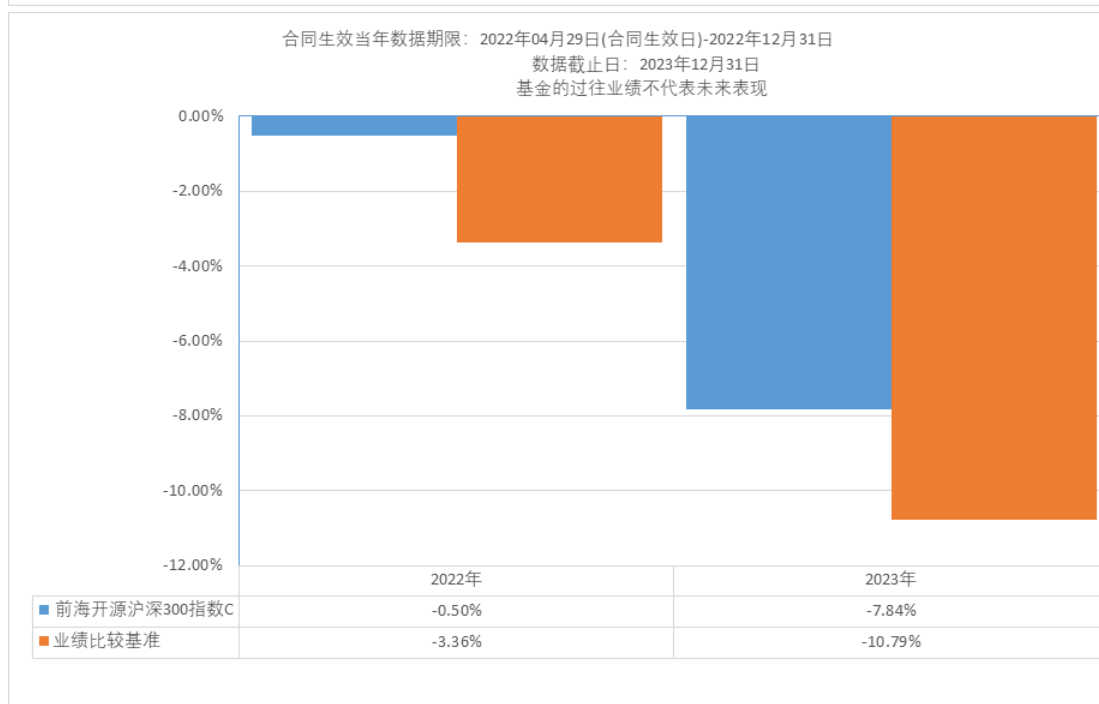
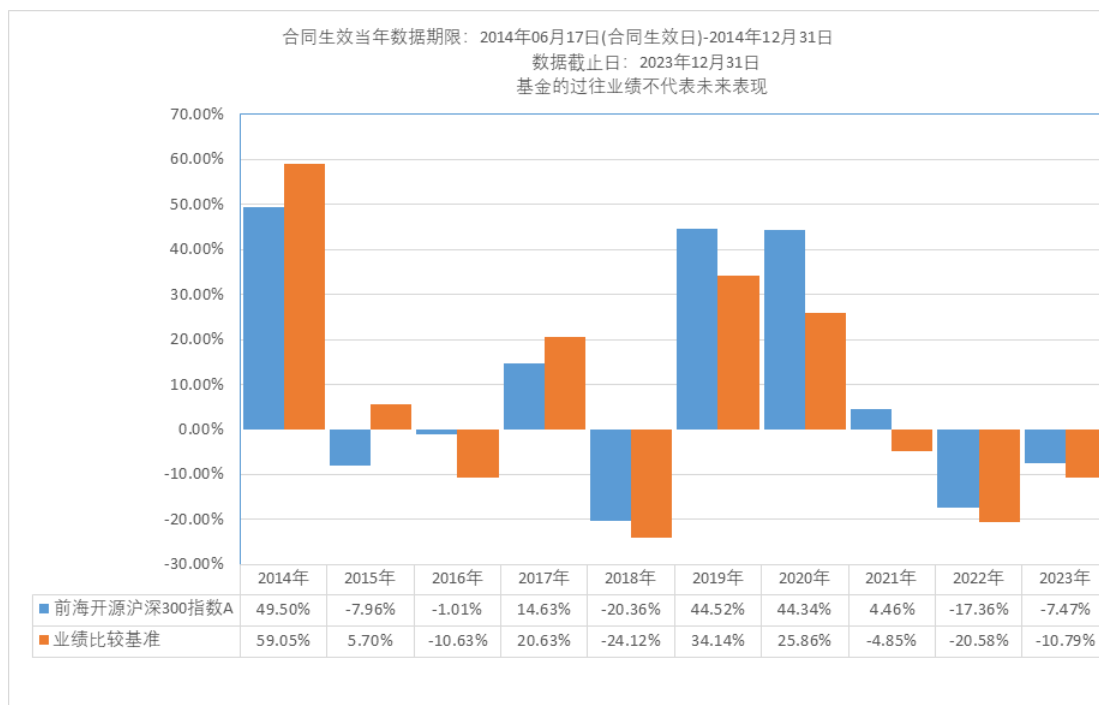
本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。

注：不同的销售机构采用的评价方法不同，本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，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

(二) 投资组合资产配置图表



(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



注：1、本基金的基金合同于2014年6月17日生效，2014年本基金A类份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率按其实际存续期计算。

2、本基金自2022年4月29日起，增加C类基金份额并设置对应基金代码，原前海开源沪深300指数基金份额自动转换为前海开源沪深300指数A类基金份额。2022年本基金C类份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率按其实际存续期计算。

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：

前海开源沪深 300 指数 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<50 万元	1.20%	-
	50 万元≤M<250 万元	0.80%	-
	250 万元≤M<500 万元	0.30%	-
赎回费	M≥500 万元	1000 元/笔	-
	N<7 天	1.50%	-
	7 天≤N<366 天	0.50%	-
	366 天≤N<731 天	0.25%	-
	N≥731 天	0.00%	-

前海开源沪深 300 指数 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
申购费 (前收费)	-	-	本基金 C 类份额无申购费
赎回费	N<7 天	1.50%	-
	N≥7 天	0.00%	-

(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	0.50%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	6.00 万元	会计师事务所
信息披露费	12.00 万元	规定披露报刊
指数许可使用费	年费率:0.02%, 年下限金额:16.00 万元	指数编制公司
前海开源沪深 300 指数 C 销售服务费	0.40%	销售机构
其他费用	本基金其他费用详见基金合同或招募说明书费用章节, 按实际发生金额从基金资产扣除。	-

注: 1、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。

2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用, 非单个份额类别费用, 且年金额为预估值, 最终实际金额以基金定期报告披露为准。

3、指数使用费为基金整体承担费用, 非单个份额类别费用。指数使用费每季度下限为 4 万元, 年度合计下限为 16 万元。

(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:

前海开源沪深 300 指数 A:

基金运作综合费率 (年化)
0.69%

前海开源沪深 300 指数 C:

基金运作综合费率 (年化)

1.09%

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化），其中，基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用（含已适用下限的指数许可使用费）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、 本基金特有的风险

（1） 市场系统风险

本基金为股票型基金，重点投资于沪深 300 指数成份股及其备选成份股。在具体投资管理中，本基金可能面临沪深 300 指数成份股以及备选股所具有的特有风险，也可能由于跟踪标的为市场代表性指数而面临较高的系统性风险。

（2） 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

本基金的跟踪组合的构建和日常管理，以对标的指数尽可能小的跟踪误差为投资目标，因此也具有普通股票型基金所不具备的特有风险。以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

1) 由于标的指数调整成份股及其权重或变更编制方法，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3) 成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率与标的指数收益率偏离，产生跟踪偏离度。

4) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

5) 由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等费用的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

6) 在基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金的收益产生影响，从而影响基金对标的指数的跟踪程度。

7) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购、赎回与转换带来的现金变动；因基金保留部分现金资产造成的跟踪误差；如果本基金采取成份股替代策略，基金投资组合与标的指数构成的差异可能导致基金收益率与标的指数收益率产生偏离；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（3） 跟踪误差控制未达约定目标的风险

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本基金约定范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

（4） 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数编制机构可能停止该指数的服务，从而会对基金投资运作造成不利影响。此外，根据基金合同的约定，出现指数发布机构变更或停止指数发布等情形，基金可能变更标的指数，从而可能面临标的指数变更的风险。

（5） 成份券停牌或违约的风险

本基金的标的指数成份券可能出现停牌或违约，从而使基金的部分资产无法变现或出现大幅折价，存在对基金净值产生冲击的风险。此外，根据相关规定，本基金运作过程中，当指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后可对相关成份券进行调整，从而可能产生跟踪偏离、跟踪误差控制未达约定目标的风险。

（6）标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的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。

（7）投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、存托凭证发行机制以及交易机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

2、市场风险。3、信用风险。4、管理风险。5、流动性风险。6、操作和技术风险。7、合规性风险。8、启用侧袋机制的风险。9、其他风险。10、本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。

（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。

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点为北京市，仲裁裁决是终局的，并对各方当事人均有约束力。

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，基金管理人至少每年更新一次。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.qhkyfund.com][客服电话：4001-666-998]

- 《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》、《前海开源沪深 300 指数型证券投资基金托管协议》、《前海开源沪深 300 指数型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

六、 其他情况说明

无。