

# 贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新（2024 年第 1 号）

编制日期：2024 年 11 月 27 日

送出日期：2024 年 11 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	贝莱德沪深300指数增强	基金代码	022366
下属基金简称	贝莱德沪深300指数增强A	下属基金代码	022366
基金管理人	贝莱德基金管理有限公司	基金托管人	中信证券股份有限公司
基金合同生效日	2024年11月26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	王晓京	开始担任本基金基金经理的日期	2024年11月26日
		证券从业日期	2010年9月13日
其他	基金合同生效后，连续50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，基金管理人应当终止基金合同，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。 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，如更换基金标的指数、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《招募说明书》之“第九部分 基金的投资”了解详细情况。

**投资目标** 本基金为指数增强型基金，通过量化选择股票的投资方法与严格的投资纪律约束，平衡预期收益、风险以及成本，优化管理组合，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，追求基金资产的长期增值。

**投资范围** 本基金的标的指数为沪深300指数及其未来可能发生的变更。  
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（国债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品等）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具，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业务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（含存托凭证）资产占基金资产的比例不低于

80%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。每个交易日终在扣除国债期货合约、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的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、应收申购款等。

**主要投资策略**

1、资产配置策略

本基金作为指数增强型基金，以跟踪标的指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。

2、股票投资策略

3、债券投资策略

4、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券投资策略

5、资产支持证券投资策略

6、金融衍生品投资策略

7、参与融资、转融通证券出借业务策略

**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**

本基金为股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。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。

本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

**(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表**

注：无

**(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**

注：无

**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：

贝莱德沪深 300 指数增强 A				
费用类型	金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率 (非养老金客 户)	收费方式/费率(养 老金客户)	备注
认购费	M < 300 万元	1.00%	0.10%	
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.60%	0.06%	
	M ≥ 500 万元	按笔收取， 1000 元/笔	按笔收取，1000 元/ 笔	
申购费（前收 费）	M < 300 万元	1.20%	0.12%	
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.60%	0.06%	
	M ≥ 500 万元	按笔收取， 1000 元/笔	按笔收取，1000 元/ 笔	
赎回费	N < 7 日		1.50%	100% 归入基 金资产

N≥7日

0%

注：上述适用差别化费率的养老金客户是指通过基金管理人直销中心认购或申购份额的养老金客户。

## （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	0.80%	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	-	销售机构
审计费用	0.00元	会计师事务所
信息披露费	20,000.00元	规定披露报刊 相关服务机构
其他费用	基金合同生效后与本基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用、基金的银行汇划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。	

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。

## 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。

投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、管理风险、流动性风险、特有风险、操作或技术风险、交易对手风险、合规性风险、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、启用侧袋机制的风险、其他风险等。

本基金特有风险如下：

（1）本基金为指数增强基金，主要策略为跟踪标的指数并选择性进行增强投资，可能存在策略失效，无法战胜指数收益的风险。

根据本基金的投资策略，股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股。这种以量化投资策略进行个股的选择以及权重的优化的投资策略，最终结果仍然存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

- （2）标的指数的风险。
- （3）跟踪误差控制未达约定目标的风险。
- （4）指数编制机构停止服务的风险。
- （5）成份股暂停上市、摘牌或违约的风险。
- （6）股指期货投资风险。
- （7）股票期权投资风险。
- （8）国债期货投资风险。
- （9）参与融资交易风险。
- （10）参与转融通证券出借业务的风险。
- （11）港股通标的股票的投资风险。
- （12）存托凭证投资风险。
- （13）资产支持证券投资风险。
- （14）信用衍生品投资风险。
- （15）投资新股的风险。

- (16) 终止清盘风险。
- (17) 受到强制赎回、冻结或销户等相应措施的风险。
- (18) 证券经纪商交易结算模式的风险。
- (19) 委托基金服务机构提供份额登记、估值核算等服务的外包风险。

## (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、调解未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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。

基金管理人深知个人信息对投资者的重要性，致力于投资者个人信息的保护。基金管理人承诺按照法律法规和相关监管要求的规定处理投资者的个人信息，包括通过基金管理人直销、销售机构或场内经纪机构购买贝莱德基金管理有限公司旗下基金产品的所有个人投资者。基金管理人需处理的机构投资者信息中可能涉及其法定代表人、受益所有人、经办人等个人信息，也将遵守上述承诺进行处理。

详情请关注基金合同第七部分“基金合同当事人及权利义务”的相关内容及基金管理人官方网站（[www.blackrock.com.cn](http://www.blackrock.com.cn)）不时披露的个人信息处理相关政策。

基金管理人有权对可购买本基金的投资者资质予以规定并不时调整，详情请关注《贝莱德基金管理有限公司公开募集证券投资基金登记业务制度》及基金管理人于公司网站披露的相关规则，以及基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资者知悉并接受基金管理人为订立、履行基金合同所必需、为提供产品或服务所必需或为履行国家法律法规及行业主管部门有关规定的义务或职责(包括但不限于反洗钱客户尽职调查、非居民金融账户涉税信息尽职调查)，在遵守法律法规的前提下及在必要的情况下，可向相关接收方（包括但不限于会计师事务所、律师事务所、份额登记机构等第三方服务机构）提供个人信息。如您对前述安排有异议或需要更多信息方可作出购买本基金的决定，请先联系基金管理人或基金销售机构。基金投资者依据《基金合同》、《招募说明书》的规定提交本基金的认购/申购申请，即表示基金投资者自愿接受上述安排。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见本基金管理人网站 网址[[www.blackrock.com.cn](http://www.blackrock.com.cn)]

客服电话：400-002-6655（免长途话费）

- 1、《贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》、《贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》、《贝莱德沪深300指数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