

# 农银汇理沪深 300 指数证券投资基金

## 基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021 年 3 月 30 日

送出日期：2021 年 3 月 31 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    | 农银沪深300指数    | 基金代码           | 660008       |
| 下属基金简称  | 农银沪深300指数A   |                | 农银沪深300指数C   |
| 下属基金代码  | 660008       |                | 005152       |
| 基金管理人   | 农银汇理基金管理有限公司 | 基金托管人          | 中国工商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2011-04-12   | 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    | 契约型开放式       | 开放频率           | 每个开放日        |
| 基金经理    | 宋永安          | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2012-08-03   |
|         |              | 证券从业日期         | 2007-07-01   |

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

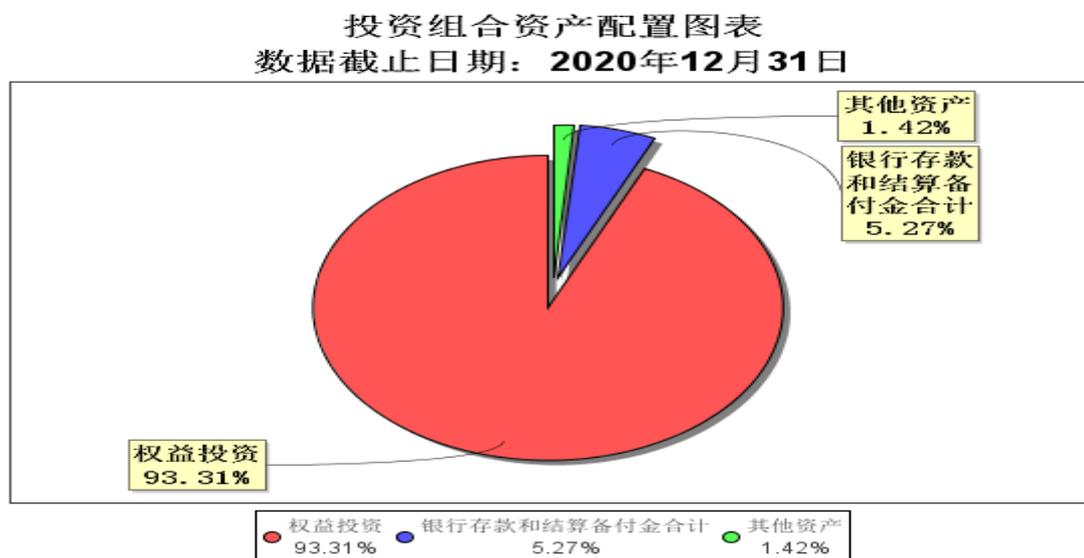
|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金为被动化投资的指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风控管理，力争将基金净值对标的指数的年跟踪误差控制在4%以内，日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，以实现沪深300指数的有效跟踪。   |
| 投资范围   | 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股和新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币及剩余期限在一年以内的政府债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。其中：股票投资比例范围为基金资产的90%—95%，其中投资于标的指数成份股的比例不低于股票投资的80%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的5%—10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券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。 |
| 主要投资策略 | 本基金的大类资产由股票组合和现金组合构成。其中股票组合为全复制沪深300指数的成份股组合，现金组合由现金和到期日在一年以内的政府债券组成。本基金为全被动的指数型基金，其主要资产都将用于跟踪组合的构建，且不得低于基金资产的90%。原则上将采用全样本复制的方式，基金资产将按照标的指数的成份股及其权重配比进   |

行投资以拟合标的指数的业绩表现。

**业绩比较基准** 95%×沪深300指数+5%×同期银行活期存款利率

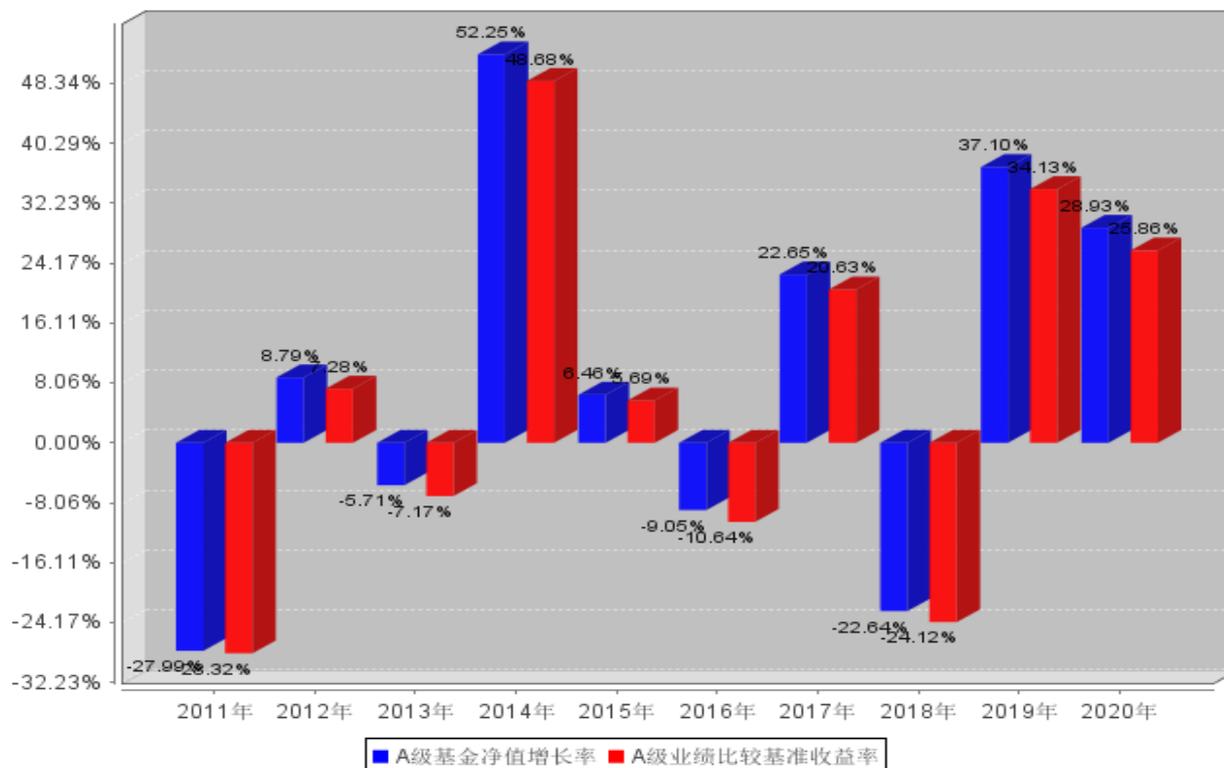
**风险收益特征** 本基金为较高风险、较高收益的股票型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

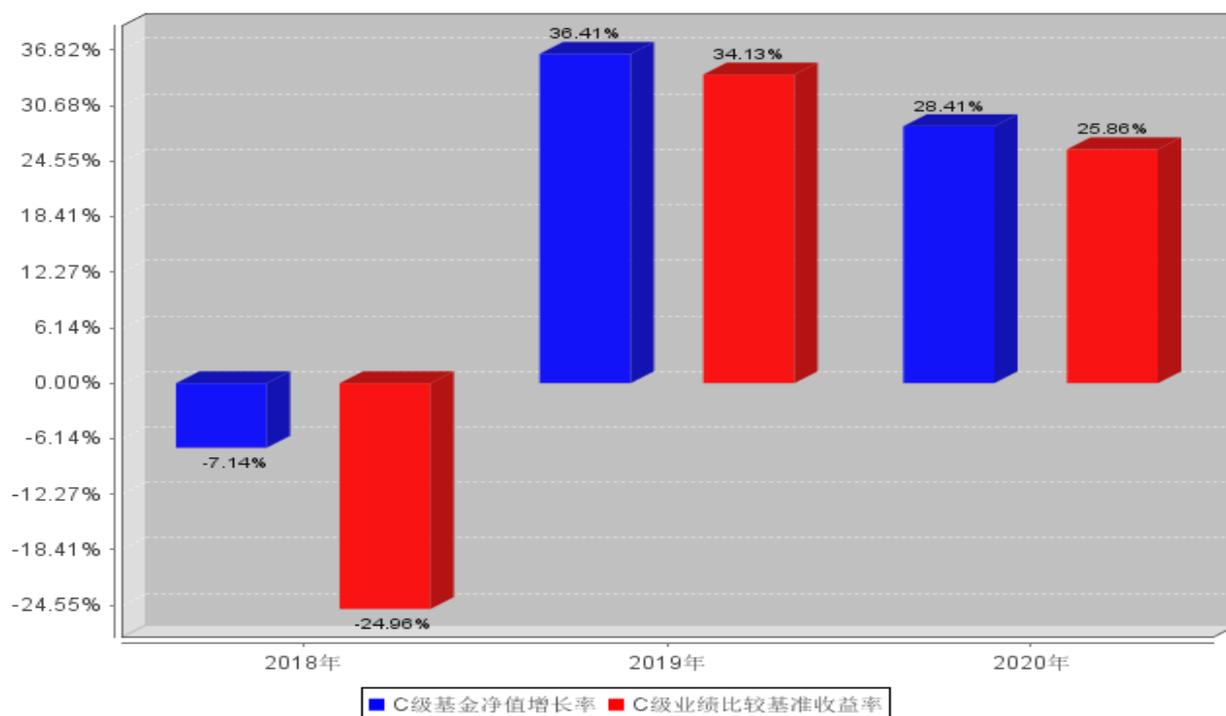


(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

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



业绩表现截止日期2020年12月31日。基金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：农银沪深 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<1,000,000           | 1.2%    | -  |
|          | 1,000,000≤M<5,000,000 | 0.8%    | -  |
|          | M≥5,000,000           | 1000元/笔 | -  |
| 赎回费      | N<7天                  | 1.5%    | -  |
|          | 7天≤N<365天             | 0.5%    | -  |
|          | 365天≤N<730天           | 0.25%   | -  |
|          | N≥730天                | 0%      | -  |

#### 农银沪深 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 |
|------|---------------------|---------|----|
| 赎回费  | N<7天                | 1.5%    | -  |
|      | N≥7天                | 0%      | -  |

通过本公司直销中心柜台申购本基金的养老金客户适用的申购费率为对应申购金额所适用的原申购费率的10%；申购费率为固定金额的，则按原费率执行，不再享有费率折扣。

#### （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  | 0.60%    |
| 托管费  | 0.15%    |

|     |            |       |
|-----|------------|-------|
| 销售服 | 农银沪深300指数A | -     |
| 务费  | 农银沪深300指数C | 0.40% |

#### 四、风险揭示与重要提示

##### （一）风险揭示

本基金为指数型股票型基金，其风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金所面临的投资组合风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险和特定风险等。除投资组合风险以外，本基金还面临操作风险、管理风险、道德风险和合法合规风险等一系列风险。

##### （二）重要提示

本基金的募集申请经中国证监会2011年1月21日证监许可【2011】125号文核准。本基金的基金合同于2011年4月12日正式生效。本基金于2018年3月21日，增设收取销售服务费的C类份额，基金合同及托管协议名称及有关条款亦做相应变更。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金标的指数为沪深300指数，标的指数相关信息如下：

##### 1、指数样本空间

沪深 300 指数样本空间由同时满足以下条件的沪深 A 股组成：1）非创业板股票：上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来日均 A 股总市值在全市场 A 股（非创业板股票）中排在前 30 位；创业板股票：上市时间超过三年。2）非 ST、\*ST 股票，非暂停上市股票。

##### 2、选样方法

沪深 300 指数样本是按照以下方法选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题、股票价格无明显异常波动或市场操纵的公司：

1、计算样本空间内股票最近一年（新股为上市第四个交易日以来）的 A 股日均成交金额与 A 股日均总市值；2、对样本空间股票在最近一年的 A 股日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 50% 的股票；3、对剩余股票按照最近一年 A 股日均总市值由高到低排名，选取前 300 名股票作为指数样本。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：

<http://www.csindex.com.cn>。

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。

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，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化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，由于基金份额持有人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，某一基金的特定风险等。本基金为开放式股票型基金，属证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。投资有风险，投资者认购（申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险，详见本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

#### 五、其他资料查询方式

招募说明书在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件或复印件。投资者也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。