

# 华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF) (A类份额)

## 基金产品资料概要(更新)

编制日期: 2024年06月27日

送出日期: 2024年06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	华宝标普香港上市中国中小盘指数(LOF)	基金主代码	501021
下属基金简称	华宝标普香港上市中国中小盘指数(LOF)	下属基金代码	501021
基金管理人	华宝基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
境外投资顾问	-	境外托管人	道富银行
基金合同生效日	2016年06月24日	上市交易所及上市时间	上海证券交易所 2016年07月06日
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	杨洋	开始担任本基金基金经理的日期	2021年05月11日
		证券从业日期	2010年08月01日
基金经理	周晶	开始担任本基金基金经理的日期	2016年06月24日
		证券从业日期	2004年05月01日
其他	场内简称: 香港中小 LOF		

### 二、基金投资与净值表现

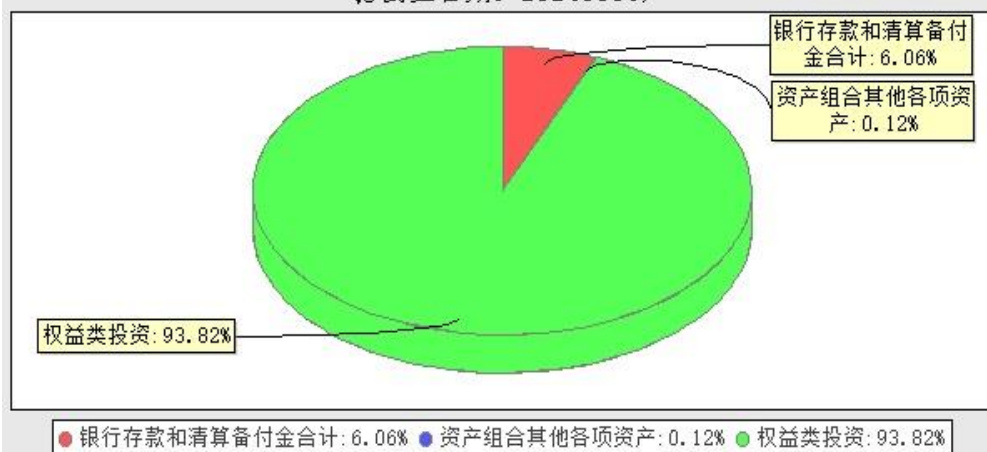
#### (一) 投资目标与投资策略

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。正常情况下,本基金力争控制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5%。
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,包括标的指数成分股、备选成分股、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、回购、证券借贷、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品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

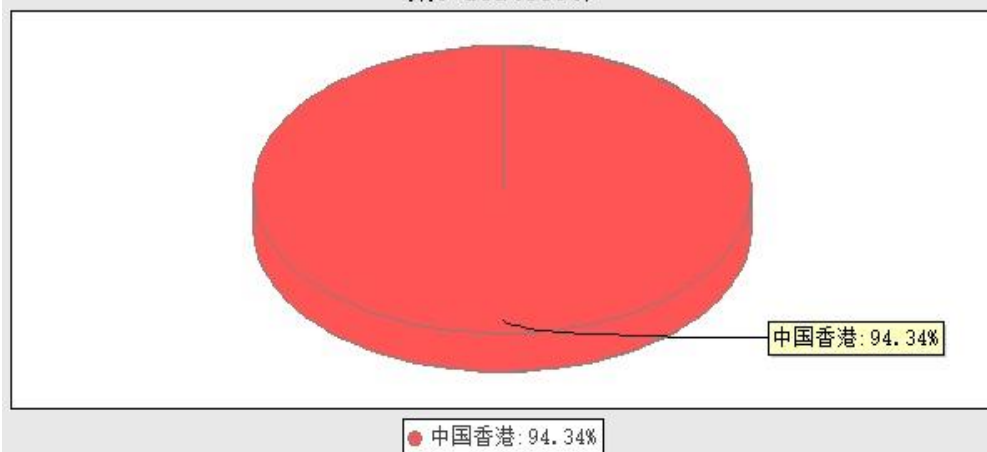
	定)。 投资于标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产的80%。 本基金标的指数为标普香港上市中国中小盘指数。
主要投资策略	本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的标普香港上市中国中小盘指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金，跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金可能通过港股通投资香港证券市场，会面临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及区域配置图表

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)投资组合资产配置图表(数据截止日期: 20240331)

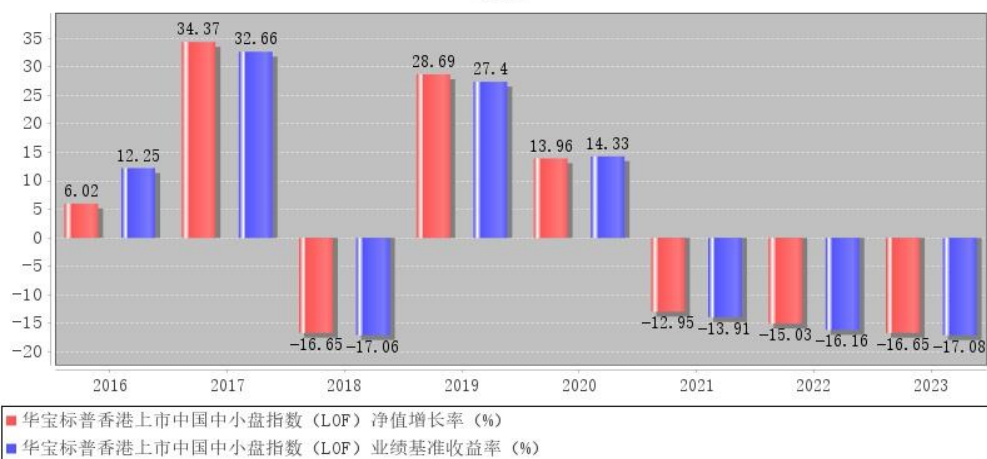


华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)区域配置图(数据截止日期: 20240331)



## （三）基金每年的净值增长率及同期业绩比较基准的比较图

华宝标普香港上市中国中小盘指数（LOF）每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：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

以下费用在申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率
申购费(前收费)	M < 100 万元	1.00%
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.60%
	200 万元 ≤ M	每笔 1000 元
赎回费	N < 7 日	1.50%
	7 日 ≤ N < 180 日	0.50%
	180 日 ≤ N < 1 年	0.25%
	1 年 ≤ N	0.00%

场内交易费用以证券公司实际收取为准。

#### （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	1.00%	基金管理人和销售机构
托管费	0.25%	基金托管人
审计费用	60,000	会计师事务所
信息披露费	120,000	规定披露报刊
指数许可使用费	0.05%/30000 美元	指数编制公司
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、基金相关账户的开户及维护费用等费用，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	相关服务机构

金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。

注：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。

### （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：

基金运作综合费率（年化）	
持有期	1.36%

## 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。

投资者应及时关注基金管理人出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必然一致，基金管理人的适当性匹配意见并不表明对基金的风险和收益做出实质性判断或者保证。基金合同中关于基金风险收益特征与基金风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应了解基金的风险收益情况，结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险，不应采信不符合法律法规要求的销售行为及违规宣传推介材料。

#### 1、本基金的特定风险

本基金的特定风险包括指数化投资的风险、目标指数波动的风险、基金投资组合回报与目标指数回报偏离的风险、目标指数变更的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、股指期货投资的风险、其他衍生品投资的风险、上市交易风险及其他风险等。

2、海外投资的风险，包括政治风险、海外市场风险、投资港股通股票存在的风险、政府管制风险、汇率风险、法律风险、境外上市公司经营风险和税务风险。

3、本基金的一般风险包括：管理风险、操作或技术风险、合规性风险、流动性风险、交易对手的信用风险、会计核算风险、大宗交易风险、证券借贷、正回购/逆回购风险、交易结算风险、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险以及其他风险。

### （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。

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、准确获得基金的相关信息，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

以下资料详见华宝基金管理有限公司官方网站 [www.fsfund.com] [客服电话：400-700-5588、400-820-5050]

《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)托管协议》、《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金

金 (LOF) 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