

富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

基金产品资料概要更新

2020 年 08 月 28 日 (信息截至: 2020 年 08 月 27 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
场内简称	富国 500		
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	李笑薇	任职日期	2011-10-12
		证券从业日期	2003-01-23
基金经理	徐幼华	任职日期	2011-10-12
		证券从业日期	2001-07-01
基金经理	方旻	任职日期	2014-11-19
		证券从业日期	2010-02-10

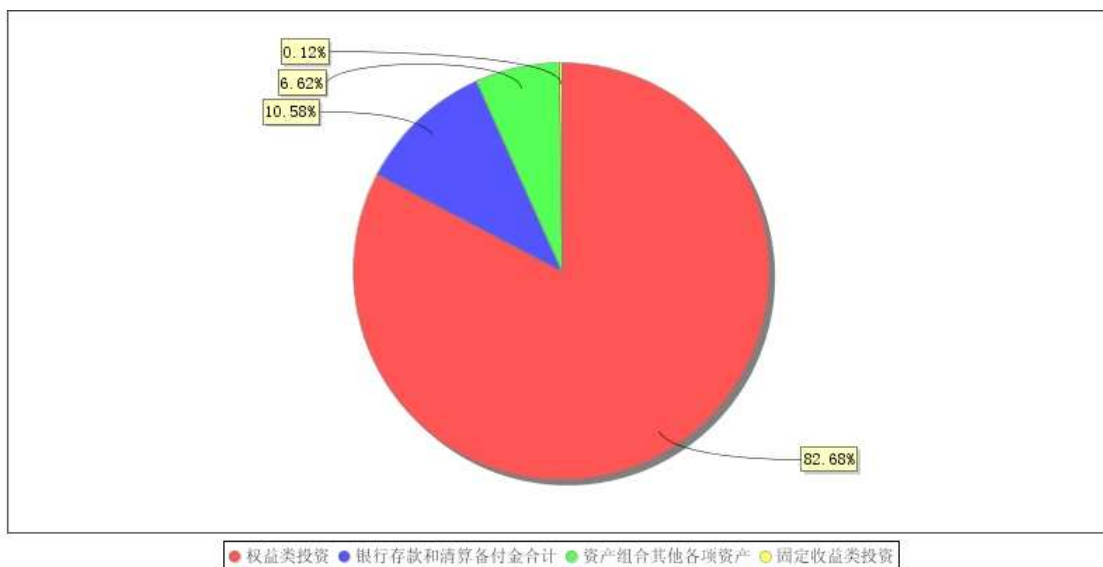
二、基金投资与净值表现

(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)、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。股票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、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%×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, 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 2020 年 06 月 30 日。

(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：本基金合同生效日 2011 年 10 月 12 日。业绩表现截止日期 2019 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

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%	0.15%
	100 万 ≤ M < 500 万	1.2%	0.12%
	M ≥ 500 万	1000 元/笔	1000 元/笔
申购费 (后端)	N ≤ 1 年	1.6%	
	1 年 < N ≤ 3 年	1.0%	
	3 年 < N ≤ 5 年	0.5%	
	N > 5 年	0	

赎回费	N<7 天	1.5%
	N≥7 天	0.5%
赎回费 (后端)	N<7 天	1.5%
	7 天≤N≤730 天	0.6%
	2 年<N≤3 年	0.3%
	N>3 年	0

注：前端申购费用在投资者申购基金过程中收取，后端申购费用及赎回费用在投资者赎回基金过程中收取，特定客户的具体含义请见《招募说明书》相关内容。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

费用类别	年费率/收费方式
管理费	1.00%
托管费	0.15%
指数许可使用费	0.016%

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。

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、基金投资组合回报与目标指数回报偏离的风险

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，产生跟踪误差：①标的指数调整成份股或变更编制方法；②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；③成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过标的指数收益率；④成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本；⑤基金应对日常赎回保留的少量现金、投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在；⑥本基金为指数增强型基金，采用复制目标指数基础上的有限度个股调整策略，因此对指数跟踪进行修正与适度增强可能会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对目标指数的跟踪程度。⑦其他因素：如因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动。

4、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。

(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