

光大保德信沪深300指数增强型证券投资基金（光大保德信沪深300指数增强A）基金产品资料概要更新

编制日期：2026年3月18日

送出日期：2026年4月1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	光大保德信沪深 300 指数增强	基金代码	023607
下属基金简称	光大保德信沪深 300 指数增强 A	下属基金代码	023607
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2025-05-16		
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	朱剑涛	开始担任本基金基金经理的日期	2025-05-16
		证券从业日期	2008-07-14

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

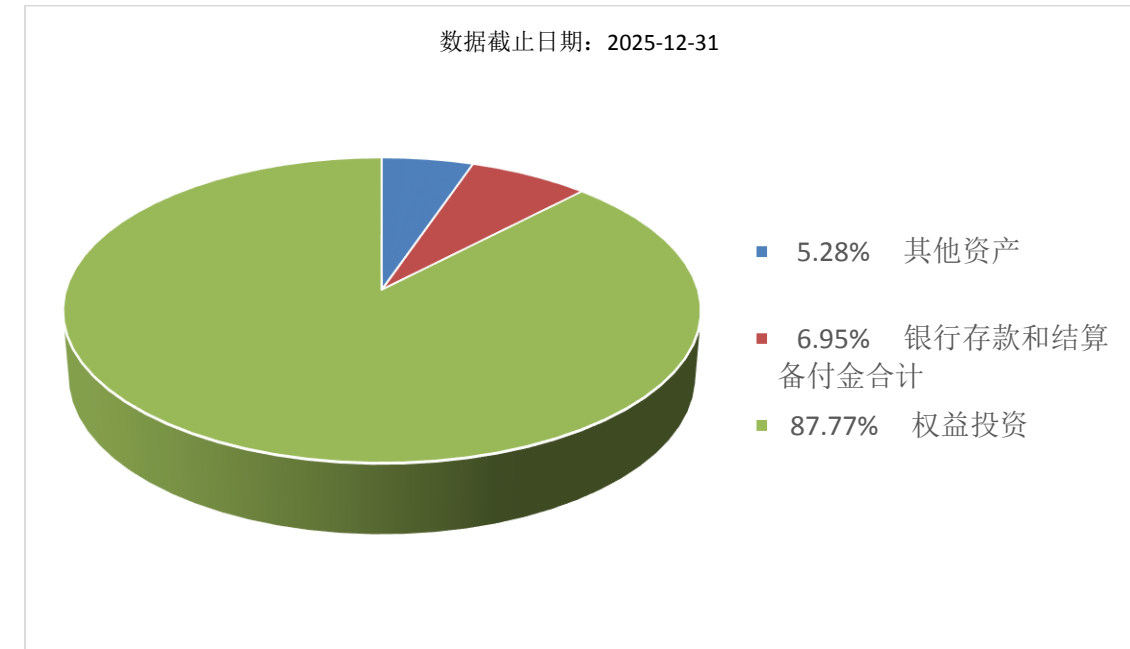
投资目标	本基金力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、中央银行票据、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、超短期融资券、短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金管理人根据相关法律法规可以参与融资及转融通证券出借业务。 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。 基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为80%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的

	10%)；投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同）的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终，扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者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上述投资品种的比例限制，基金管理人将在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。
主要投资策略	本基金投资策略包括：1、股票（含存托凭证）投资策略（指数化投资策略、指数增强投资策略）、债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、融资及转融通证券出借业务的投资策略、其他品种投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为指数增强型股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见本招募说明书“风险揭示”部分。

注：投资者可阅读《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

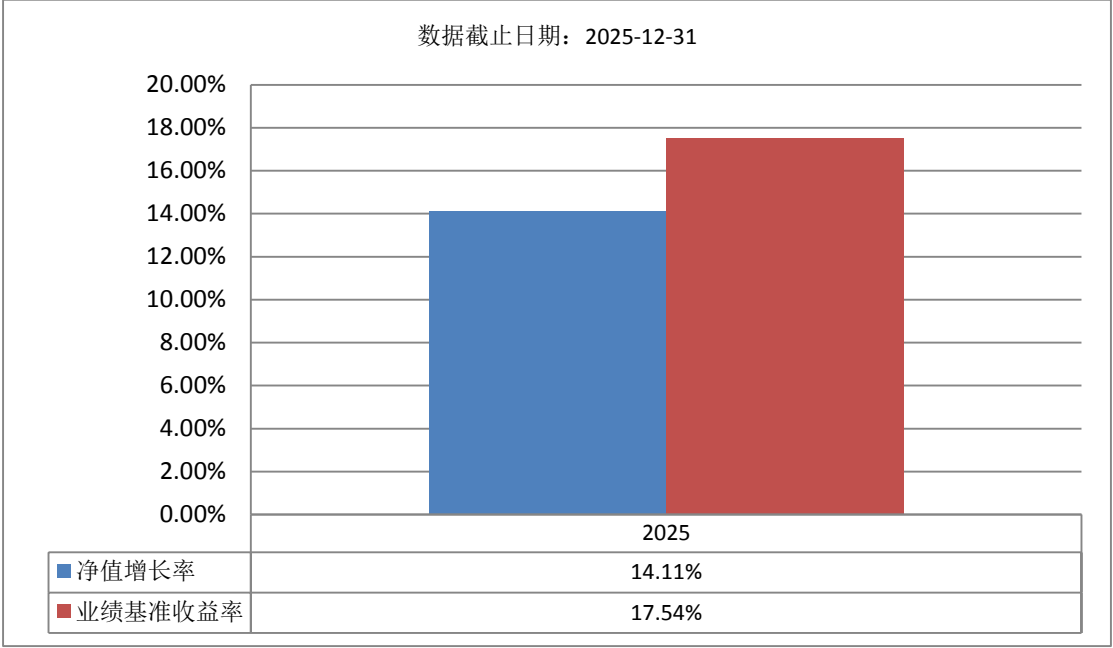
投资组合资产配置图表



区域配置图表

无

(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、本基金成立于2025年5月16日，截止至2025年12月31日，成立未满一年。
2、本基金的过往业绩不代表未来表现。合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

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	备注
申购费（前收费）	M < 100 万元	1.20%	
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%	
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔	
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	按日计提 0.80%	基金管理人、销售机构
托管费	按日计提 0.15%	基金托管人
审计费用	30,000.00	会计师事务所

信息披露费	80,000.00	规定披露报刊
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。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。	相关服务机构

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。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者申购本基金份额，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）
1.01%

注：基金管理费、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

本基金的风险主要包括：市场风险、管理风险、流动性风险（包括但不限于巨额赎回风险、启用摆动定价或侧袋机制等流动性风险管理工具带来的风险等）、股指期货的风险、股票期权的风险、资产支持证券的风险、存托凭证的风险、流通受限证券的风险、参与融资及转融通证券出借业务的风险。

此外，参与投资本基金可能面临的特定风险包括：

（1）标的指数收益率与股票市场平均偏离风险、标的指数波动的风险、基金投资组合收益率与标的指数收益率偏离的风险、标的指数变更风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、采用量化增强策略进行投资管理可能引致的特定风险、投资港股通标的股票的风险等。

采用量化增强策略进行投资管理可能引致的特定风险主要体现为：本基金在一定的跟踪误差约束范围内，追求超越业绩比较基准的投资回报。为此，本基金可能在一定幅度内减少或增加部分标的指数成份股的投资比例，甚至从投资组合中剔除个别标的指数成份股，或在标的指数成份股之外进行投资。由于量化增强策略的表现存在不确定性，本基金进行增强投资的结果既可能超越业绩比较基准，也可能落后于业绩比较基准。

（2）本基金采用证券公司交易模式和结算模式，该种交易结算模式可能存在信息系统风险、操作风险、效率降低风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险等风险。

（3）若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的增强策略交易型开放式指数基金（ETF），本基金经履行适当程序可转型为ETF联接基金，该联接基金具体投资范围及比例等将依据届时有效的法律法规或监管机构要求确定并相应修改基金合同，但不需召开基金份额持有人大会审议。因此，基金份额持有人可能面临基金自动转型的风险。

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。本基金的特定风险及一般风险详见本基金招募说明书的“风险揭示”部分。

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册或核准,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。

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,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照该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,对各方当事人均有约束力,仲裁费用由败诉方承担,除非仲裁裁决另有决定。

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

以下资料详见光大保德信基金管理有限公司官方网站：www.epf.com.cn，客服热线：4008-202-888。

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