# 安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金(C 类份额)

# 基金产品资料概要更新

编制日期：2026 年 10 月 16 日

送出日期：2026 年 10 月 19 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** | 安信量化沪深 300 增强 | **基金代码** | 003957 |
| **下属基金简称** | 安信量化沪深 300 增强 C | **下属基金交易代码** | 003958 |
| **基金管理人** | 安信基金管理有限责任公司 | **基金托管人** | 中国工商银行股份有限公司 |
| **基金合同生效日** | 2019 年 5 月 7 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** | 施荣盛 | **开始担任本基金基金经理的日期** | 2023 年 08 月 24 日 |
| | | **证券从业日期** | 2013 年 07 月 02 日 |
| **其他** | 2019 年 3 月 26 日至 2019 年 4 月 22 日，安信新起点灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会表决通过了《关于安信新起点灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，同意安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、基金估值、基金费用等事项，修订基金合同，并同意将“安信新起点灵活配置混合型证券投资基金”更名为“安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。<br>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，本基金合同终止。 | | |

## 二、基金投资与净值表现

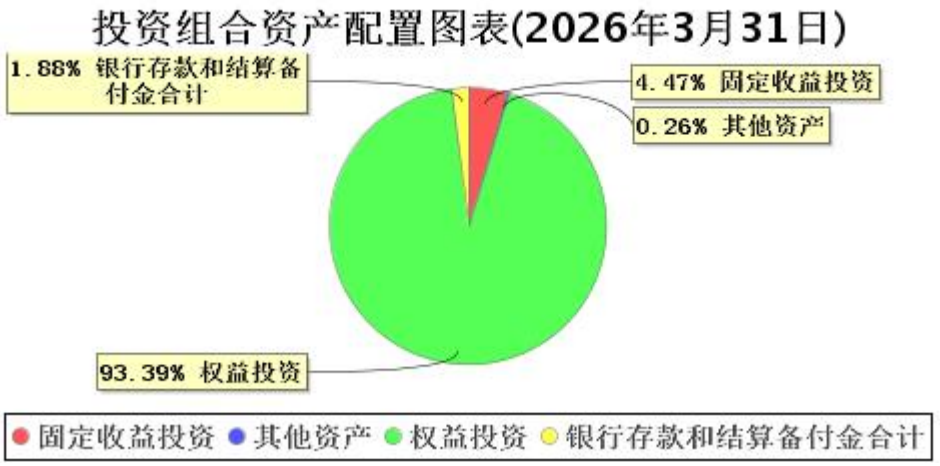
### (一) 投资目标与投资策略

| | |
|---|---|
| **投资目标** | 本基金为股票指数增强型基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的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%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法，力争实现基金资产的长期增值。 |
| **投资范围** | 本基金的标的指数是沪深 300 指数。<br>本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市 |

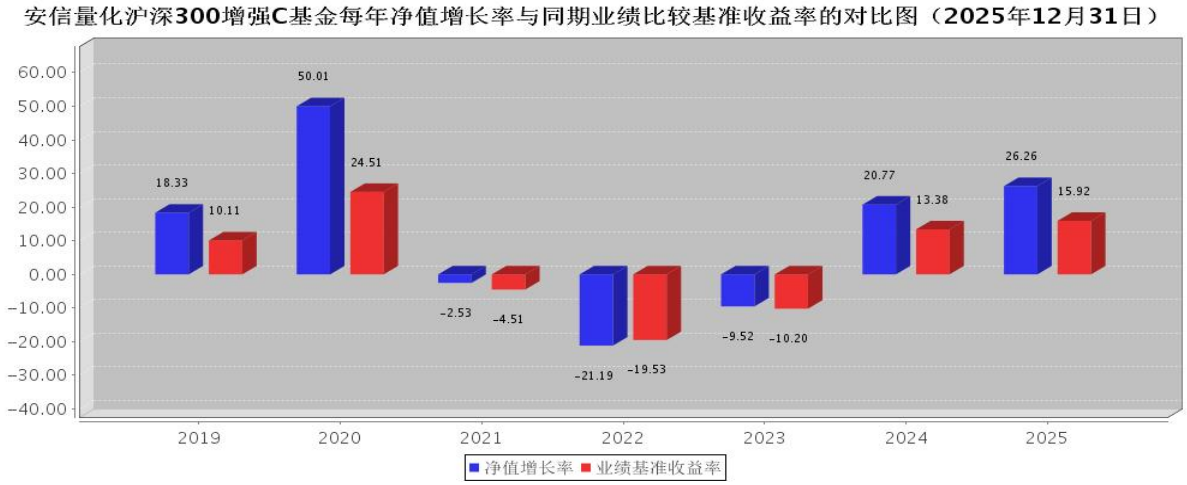
| | |
|---|---|
| | 的股票、存托凭证），债券（包括国债、金融债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、权证、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融资产（但须符合中国证监会的相关规定）。<br>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。<br>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金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、应收申购款等。 |
| **主要投资策略** | 本基金为增强型指数基金，在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数的基础上，通过数量化模型进行投资组合优化，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。本基金将参考标的指数成分股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。 |
| **业绩比较基准** | 沪深 300 指数收益率*90%+活期存款基准利率*10% |
| **风险收益特征** | 本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。 |

注：详见《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

**(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**




注：基金合同生效当年期间的相关数据按实际存续期计算，基金的过往业绩并不代表其未来表现。

## 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：

| 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≥0 | 0.00% | 本基金C类份额无申购费 |
| 赎回费 | N＜7 天 | 1.50% | 100%归入基金资产 |
| | 7 天≤N＜30 天 | 0.50% | 100%归入基金资产 |
| | N≥30 天 | 0.00% | - |

注：本基金 C 类份额不收取申购费。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

### (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 | 0.10% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 0.20% | 销售机构 |
| 审计费用 | 50,000.00 元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 元 | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 律师费、银行间账户维护费、银行划款费等，详见招募说明书的基金费用与税收章节。 | |

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。相应费用年金额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：

安信量化沪深 300 增强 C

| 基金运作综合费率（年化） |
| --- |
| 1.11% |

注：基金管理费率、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（未包含指数使用费）。

## 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。

一）本基金投资运作过程中面临的主要风险有：

1、市场风险；2、管理风险；3、职业道德风险；4、流动性风险；5、合规性风险；6、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；7、其他风险。

二）本基金的特有风险

（1）跟踪标的指数的风险

1、高仓位风险；2、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险；3、标的指数波动的风险；4、标的指数变更的风险；5、标的指数编制方案变更的风险；6、标的指数成份股权重较大的风险；7、标的指数成份股停牌的风险；8、跟踪误差控制未达约定目标的风险；9、基金净值增长率与业绩比较基准偏离的风险；10、指数编制机构停止服务的风险；11、标的指数值计算出错的风险等。

（2）基金价格变动风险

本基金为指数增强型基金，原则上将以基金资产中 80%-95%比例投资于股票，因此，本基金因股票资产投资比例较大，当所追踪之标的指数因市场原因出现大幅下跌时，会造成基金份额净值的相应下跌，产生跌破基金发行价的风险。

（3）股指期货特有的风险

（4）资产支持证券投资风险

资产支持证券的风险主要包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险等。

（5）国债期货的投资风险

（6）量化投资方法相关的特定风险

（7）投资于存托凭证的风险

（8）投资于 Y 类基金份额的特有风险

### (二) 重要提示

安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金由原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2019]375 号文批准变更注册而来。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更为本基金的注册，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。

除监管规定信息发生重大变更外，基金管理人每年更新一次资料概要。因此，本文件内容可能存在一定的滞后性，敬请投资者同时关注基金管理人发布的临时公告。

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《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，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。**

**仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费及律师费由败诉方承担。**

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见安信基金官方网站［www.essencefund.com］［客服电话：4008-088-088］

1、《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》、
《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》、
《安信量化精选沪深 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