

# 华宝中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金

## 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    | 华宝中证信息技术应用创新产业ETF | 基金代码           | 562030                 |
| 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           |
| 基金合同生效日 | 2023年09月26日       | 上市交易所及上市时间     | 上海证券交易所<br>2023年10月12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    | 张放                | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023年09月26日            |
|         |                   | 证券从业日期         | 2011年07月01日            |
| 其他      | 场内简称：信创ETF基金      |                |                        |

### 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的最小化。<br>本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。<br>为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国内依法发行的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、货币市场工具、股指期货、资产支持证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）。 |
| 投资范围   | 本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。<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>本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。<br>本基金的标的指数为中证信息技术应用创新产业指数。  |
| 主要投资策略 | 本基金主要采取完全复制法，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。

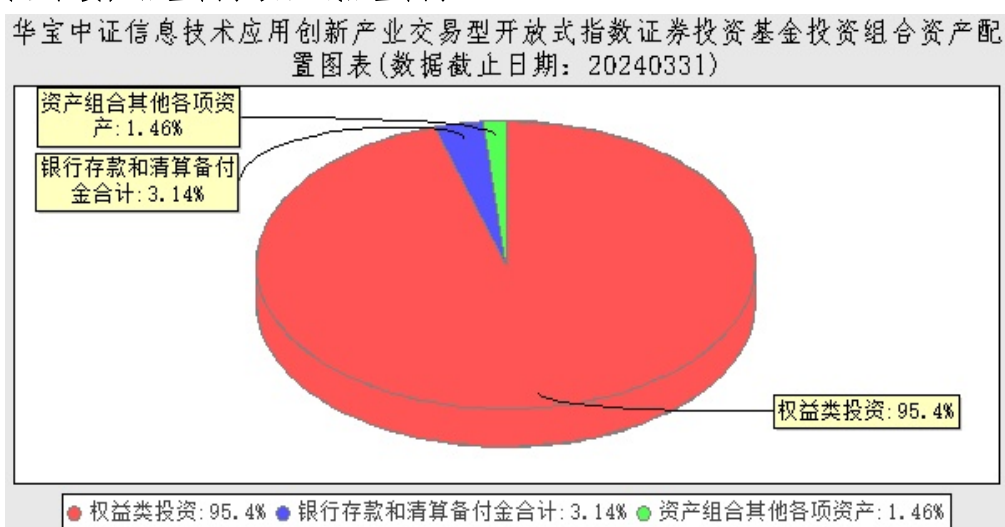
对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

**业绩比较基准** 中证信息技术应用创新产业指数收益率

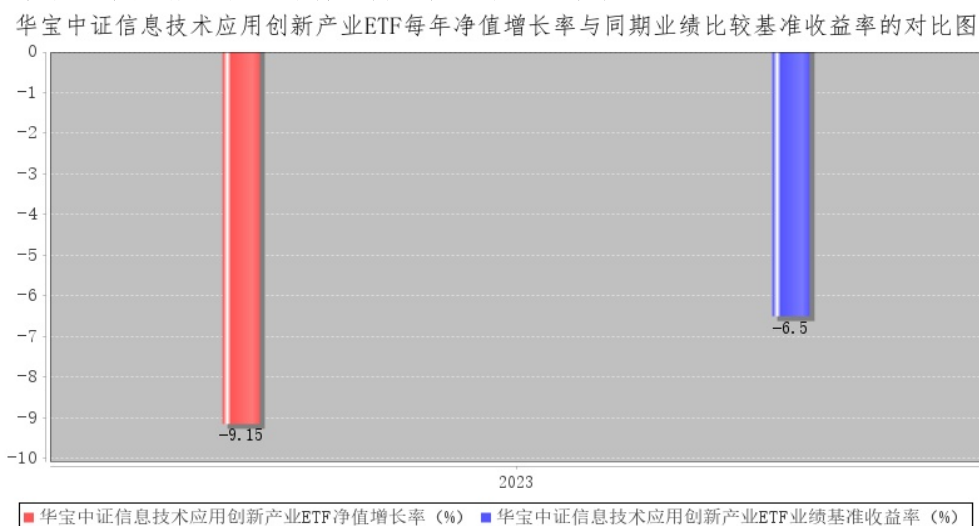
本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

**风险收益特征** 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

## （二）投资组合资产配置图表及区域配置图表



## （三）基金每年的净值增长率及同期业绩比较基准的比较图



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

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过0.5%的标准收取佣金。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   | 0.50%   | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费   | 0.10%   | 基金托管人      |
| 审计费用  | 36,000  | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 50,000  | 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：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 | 0.71%        |

## 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、指数化投资的风险

（1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险。（2）标的指数波动的风险。（3）标的指数编制和计算的风险。（4）跟踪误差控制未达约定目标的风险。（5）标的指数变更的风险。（6）指数编制机构停止服务的风险。

#### 2、ETF运作的风险

（1）可接受股票认购导致的风险。（2）基金份额二级市场交易价格折溢价风险。（3）参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险。（4）成份股停牌的风险。（5）投资者申购失败的风险。（6）投资者赎回失败的风险。（7）申购赎回清单差错风险。（8）申购赎回清单标识设置不合理的风险。（9）基金份额赎回对价的变现风险。（10）套利风险。（11）第三方机构服务的风险。（12）退市风险。

#### 3、本基金投资特定品种及参与特定业务的特有风险

##### （1）股指期货风险

本基金可参与股指期货交易，可能面临如下风险：

1）杠杆风险：因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

2）基差风险：在利用股指期货对冲市场系统风险时，基金资产可能因为股指期货合约

与标的指数价格变动方向不一致而承担基差风险。因存在基差风险，在股指期货合约展期操作时，基金资产可能因股指期货合约之间价差的异常变动而遭受展期风险。

3) 股指期货展期时的流动性风险：本基金持有的股指期货头寸需要进行展期操作，平仓持有的股指期货合约，换成其它月份股指期货合约，当股指期货市场流动性不佳、交易量不足时，将会导致展期操作执行难度提高、交易成本增加，从而可能对基金资产造成不利的影 响。

4) 期货盯市结算制度带来的现金管理风险：股指期货采取保证金交易制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，资金管理要求高。当市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，如果未能在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金资产带来超出预期的损失。

5) 到期日风险：股指期货合约到期时，本基金的账户如仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将账户持有的合约进行现金交割，因此无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

6) 对手方风险：基金管理人运用基金资产参与股指期货交易时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金资产遭受损失。

7) 连带风险：为基金资产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，基金资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

8) 未平仓合约不能继续持有风险：由于国家法律、法规、政策的变化、中金所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，基金资产持有的未平仓合约可能无法继续持有，基金资产必须承担由此导致的损失。

(2) 资产支持证券投资风险：本基金的投资范围包括资产支持证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

### (3) 存托凭证投资风险

本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

### (4) 参与融资业务的风险

本基金可参与融资业务。融资业务存在信用风险、投资风险和合规风险等风险。具体而言，信用风险是指本基金在融资业务中，因交易对手方违约无法按期偿付本金、利息等证券相关权益，导致基金资产损失的风险。投资风险是指本基金在融资业务中，因投资策略失败、对投资标的预判失误等导致基金资产损失的风险。合规风险是指由于违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管机关规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阈值等。

### (5) 参与转融通证券出借业务的风险

本基金可参与转融通证券出借业务。转融通证券出借业务的风险包括但不限于流动性风险、信用风险和市场风险。流动性风险是指本基金面临大额赎回时可能因转融通证券出借的原因，发生无法及时变现并支付赎回款项的风险。信用风险是指本基金进行转融通证券出借的对手方可能无法及时归还出借证券、无法及时支付权益补偿及相关费用等导致基金资产损失的风险。市场风险是指本基金持有的证券出借后，可能出现出借期间无法及时处置证券，而证券价格持续下跌导致基金资产损失的风险。

4、市场风险：证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险。主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险等。

5、本基金还将面临开放式基金共有的风险，如流动性风险、基金合同终止的风险、管

理风险、操作或技术风险、合规性风险、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]

《华宝中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华宝中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》、《华宝中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

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