富荣中证500指数量化增强型证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2026年11月03日

送出日期：2026年11月06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	富荣中证500指数量化增强	基金代码	027307
基金简称A	富荣中证500指数量化增强A	基金代码A	027307
基金简称C	富荣中证500指数量化增强C	基金代码C	027308
基金管理人	富荣基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2026年11月03日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
李响	2026年11月03日		2010年07月21日

二、 基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

（投资者可以通过阅读《招募说明书》第九章了解详细情况）

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。
投资范围	本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及备选成份股（均含存托凭证，下同），其他国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、公开发行的次级债以及法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权、信用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的相关规定）。 本基金可根据法律法规的规定参与融资、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%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	本基金为指数增强型股票基金，在控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，对投资组合进行积极的管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金力争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8%。1、股票投资策略：（1）指数化投资策略、（2）指数增强型策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转债和可交债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、衍生品投资策略：（1）参与股指期货交易策略、（2）参与国债期货交易策略、（3）股票期权投资策略、（4）信用衍生品投资策略；7、参与融资和转融通证券出借业务的投资策略
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%
风险收益特征	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。本基金为股票型指数增强基金，跟踪中证500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／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

无

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：

富荣中证500指数量化增强A

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	0.30%	
	100万≤M<300万	0.20%	
	M≥300万	100.00元/笔	

赎回费	N<7天	1.50%	个人投资者
	N≥7天	0.00%	个人投资者
	N<7天	1.50%	除个人投资者以外的投资者
	7天≤N<30天	1.00%	除个人投资者以外的投资者
	30天≤N<180天	0.50%	除个人投资者以外的投资者
	N≥180天	0.00%	除个人投资者以外的投资者

注：1、上表适用于投资者通过其他销售机构认购/申购本基金A类基金份额。

2、通过直销机构认购/申购本基金A类基金份额不收取认购费/申购费。

3、投资者赎回基金份额产生的赎回费，全额计入基金财产。

富荣中证500指数量化增强C

费用类型	份额（S）或金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
赎回费	N<7天	1.50%	个人投资者
	N≥7天	0.00%	个人投资者
	N<7天	1.50%	除个人投资者以外的投资者
	7天≤N<30天	1.00%	除个人投资者以外的投资者
	30天≤N<180天	0.50%	除个人投资者以外的投资者
	N≥180天	0.00%	除个人投资者以外的投资者

注：1、投资者认购/申购本基金C类基金份额不收取认购费/申购费。

2、投资者赎回基金份额产生的赎回费，全额计入基金财产。

（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（元）	收取方
管理费	0.80%	基金管理人和销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
销售服务费C	0.20%	销售机构
审计费用	0.00	会计师事务所
信息披露费	0.00	规定披露报刊
其他费用	详见招募说明书的基金费用与税收章节	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、信息披露费用为当年度预估年费用金额，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。

3、上表中的销售服务费适用于投资者通过其他销售机构持有的持续持有期限未超过一年的C类基金份额。对于投资者持续持有期限超过一年的C类基金份额被继续计提的销售服务费，以及投资者通过直销机构持有C类基金份额被计提的销售服务费，都将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。

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。

主要风险：

投资于本基金的主要风险：1、市场风险：政策风险、经济周期风险、利率风险、通货膨胀风险、再投资风险；2、信用风险；3、流动性风险；4、操作风险；5、管理风险；6、合规风险。

特有风险：

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的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标的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：

（1）由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；

（2）由于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，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；

（3）由于成份股停牌、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而产生跟踪偏离度和跟踪误差；

（4）由于基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，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差；

（5）在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度；

（6）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；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；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

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，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的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标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

5、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金的风险控制目标是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%，年跟踪误差不超过8.0%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

6、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定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。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

7、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

8、主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。这种基于对基本面的深度研究作出优化调整投资组合的决策，最终结果仍然存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

9、投资科创板股票的风险

本基金资产可投资于科创板，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于如下特殊风险：

（1）股价波动风险：科创板对个股每日涨跌幅限制为20%，且新股上市后的前5个交易日不设置涨跌幅限制，股价可能表现出比沪深交易所主板市场更为剧烈的波动。

（2）流动性风险：由于科创板股票的投资者门槛较高，股票流动性弱于沪深交易所主板市场，投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期，因此在基金持有股票无法正常交易的风险。

（3）退市风险：科创板的退市标准将比沪深交易所主板市场更加严格，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市等环节，因此上市公司退市风险更大，可能给基金净值带来不利影响。

（4）投资集中风险：科创板上市企业主要属于科技创新成长型企业，其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似，因此基金难以通过分散投资来降低风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值波动。

（5）监管规则变化的风险：科创板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，导致基金投资运作产生相应调整变化。

10、股指期货等金融衍生品投资风险

金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资

标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价、指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

11、资产支持证券投资风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券（ABS）或资产支持票据（ABN）是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等。

12、存托凭证投资风险

基金资产可投资于存托凭证，会面临与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等差异带来的特有风险，包括但不限于创新企业业务持续能力和盈利能力等经营风险，存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托凭证退市的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及受境外市场影响交易价格大幅波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险等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。

13、参与融资业务的风险

本基金可参与融资交易，可能面临杠杆风险、强制平仓风险、违约风险、交易被限制的 风险等，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

14、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，若参与，面临的风险包括但不限于：

（1）流动性风险：指面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎 回款项的风险；

（2）信用风险：指证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及 借券费用的风险；

（3）市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险；

（4）其他风险，如宏观政策变化、证券市场剧烈波动、个别证券出现重大事件、交易 对手方违约、业务规则调整、信息技术不能正常运行等风险。

15、证券经纪机构交易结算模式的风险

本基金采用证券经纪机构交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经纪机构进行场内交易和结算，该种交易结算模式可能存在操作风险、资金使用效率降低的风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险、无法完成当日估值等风险。

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。

其他风险：

在投资基金的过程中有可能出现技术风险、法律风险和其他不可抗力因素导致的资金资产损失，投资者在投资基金时应知悉其利益存在受损可能。

（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。

本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因本基金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仲裁。仲裁地点为北京市。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站www.furamc.com.cn 或拨打客服电话4006855600

基金合同、托管协议、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

六、 其他情况说明

1、投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

2、基金管理人与基金销售机构不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。