

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）（华安标普全球石油指数（LOF）

A)

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年5月21日

送出日期：2024年6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 | 华安标普全球石油指数（LOF） | 基金代码 | 160416 |
| 下属基金简称 | 华安标普全球石油指数（LOF）A | 下属基金交易代码 | 160416 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 境外投资顾问 | - | 境外托管人 | 美国道富银行 State Street Bank and Trust Company |
| 基金合同生效日 | 2012年3月29日 | 上市交易所及上市日期 | 深圳证券交易所 2012年5月2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 | 倪斌 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2018年9月10日 |
| | | 证券从业日期 | 2010年7月1日 |
| 其他 | 场内简称 | | 石油基金 LOF |

注：华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）自2022年2月22日起新增C类基金份额。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金为股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。 |
| 投资范围 | 本基金投资于标普全球石油指数成分股、备选成分股，与石油行业相关的公募基金、上市交易型基金、固定收益类证券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。 本基金投资于标普全球石油指数成分股、备选成分股的比例不低于基金资产净值的 |

80%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的 20%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例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。

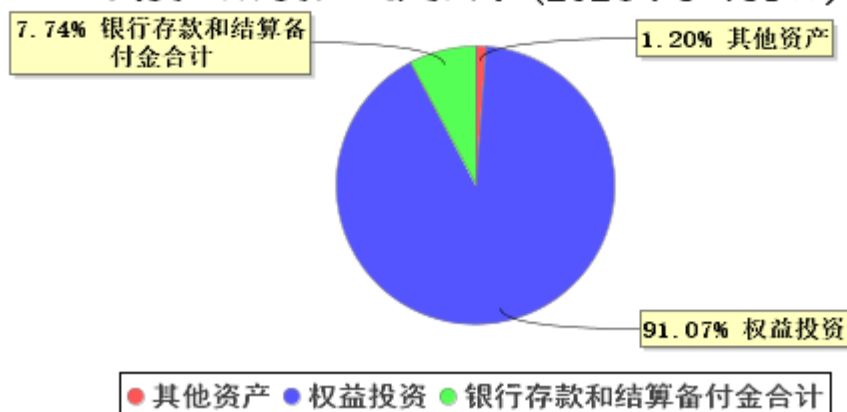
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。

本基金标的指数为标普全球石油指数。

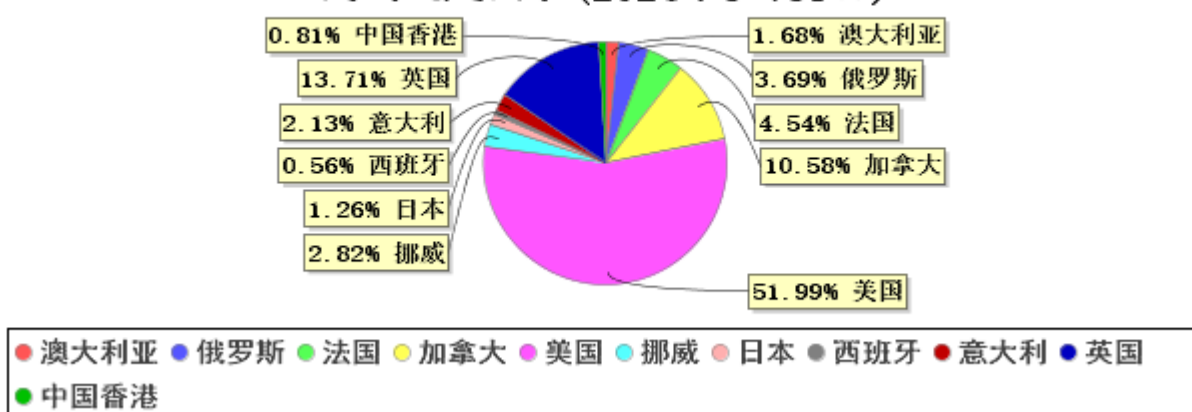
| | |
|--------|--|
| 主要投资策略 | 本基金以标普全球石油指数成分股构成及其权重等指标为基础构建指数化投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 标普全球石油净总收益指数收益率 (S&P Global Oil Index Net Total Return) |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

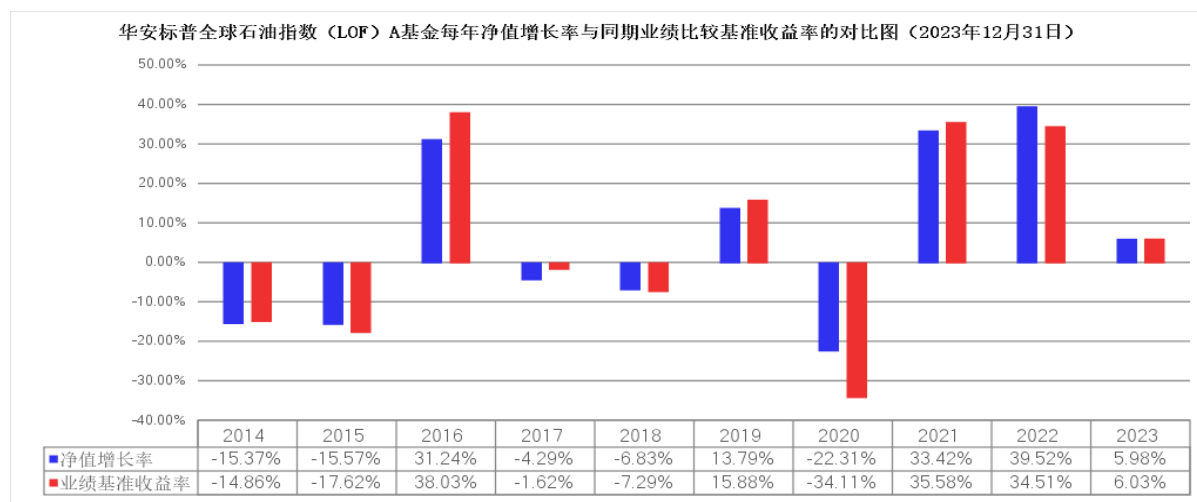
投资组合资产配置图表 (2024年3月31日)



区域配置图表 (2024年3月31日)



(三) 最近十年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：基金合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率，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

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 < 100 万元 | 1.20% | - | 非养老金客户、场外份额 |
| | 100 万元 ≤ M < 300 万元 | 0.80% | - | 非养老金客户、场外份额 |
| | 300 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.40% | - | 非养老金客户、场外份额 |
| | M ≥ 500 万元 | - | 每笔 1000 元 | 非养老金客户、场外份额 |
| | - | - | 每笔 500 元 | 养老金客户、场外份额（直销） |
| 赎回费 | N < 7 天 | - | 1.50% | 场外份额 |
| | 7 天 ≤ N < 365 天 | - | 0.50% | 场外份额 |
| | 365 天 ≤ N < 730 天 | - | 0.25% | 场外份额 |
| | N ≥ 730 天 | - | 0.00% | 场外份额 |

申购费

本基金 A 类基金份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。详情请查阅基金管理人发布的相关公告。

赎回费

本基金 A 类基金份额的场内赎回费率固定为 0.5%，但对于持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费。

（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 | 1.00% | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.28% | 基金托管人 |
| 审计费用 | 66,000.00 元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 元 | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费 | 本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法计提指数许可使用费。若一个支付周期累计计提指数使用费金额 / 该支付周期最后一日（如为节假日取最近一日）中国人民银行或其授权机构公布的汇率中间价小于指数使用许可协议规定的费用下限，则基金于该支付周期最后一日补提指数使用费至指数使用许可协议规定的费用下限。 | 指数编制公司 |
| 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、基金的相关账户的开户费用、账户维护费用等费用，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。 | |

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：

华安标普全球石油指数（LOF）A

| 基金运作综合费率（年化） |
|--------------|
| 1.44% |

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。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

（一）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。

（二）本基金投资于海外证券市场，基金净值会因为所投资证券市场波动等因素产生波动。本基金投资中出现的风险主要分为四类，一是本基金特有风险；二是与指数相关的风险，包括指数的授权、编制、差错风险，金融模型风险和跟踪误差风险；三是境外投资风险；四是开放式基金投资的一般风险，包括流动性风险、信用风险、利率风险等。

（三）本基金特有的风险

1、油价波动风险

本基金主要投资于石油行业股票，业绩表现受国际油价波动影响较大。由于石油是一种特殊的国际性战略商品，国际石油市场上垄断与竞争并存，影响石油价格波动的因素包括自然和行业因素（投资、炼油能力、库存等）、经济因素以及政治因素等等。影响因素的多样性和变动性造成了油价的剧烈波动。石油市场的国际性、多样性以及商品的特殊地位，使得石油衍生市场吸引了大量投机者参与其中。投机资本的盛行增加了石油市场风险，对冲基金频繁的做多、做空加上巨大的金融杠杆效应造成石油价格走势可能会偏离供求关系，进而进一步加大油价的波动。油价的大幅波动致使石油行业上市公司的股价经常会随着公司盈利预期的变化而出现较大幅度的波动，进而影响基金净值的表现。

2、地缘政治风险

石油具有独特的地缘政治属性。

3、汇率风险

本基金主要投资于全球范围内的石油企业股票。由于原油贸易以美元作为计价货币，美元相对人民币的持续走弱将对本基金的业绩造成不利影响。但是，自 1973 年以来国际原油价格就与美元走势呈现较强的负相关关系，这在一定程度上抵消了上述汇率风险。

4、石油行业风险

石油股票的价值受到石油行业所特有的风险因素影响。

5、新兴市场风险

本基金持有一定比重的在发达国家上市的新兴市场大型石油企业的存托凭证(ADR, GDR)。该类企业的销售和利润来源主要在新兴市场，持有这类股票也使本基金间接承担新兴市场投资所可能承担的政治稳定性、法律健全性、市场机制、证券交易、汇率波动等风险。

6、存托凭证风险

7、上市交易及外汇额度限制引致的特殊风险

（四）与指数相关的风险

1、指数的授权、编制、差错风险

指数的授权、编制、差错风险是指标的指数提供商 Standard & Poor's Financial Services LLC 依据合作协议的相关条款停止编制发布标的指数或取消对本基金使用标的指数的授权，以及标的指数在编制发布和调整过程中发生人为或系统性差错的风险。

当标的指数提供商 Standard & Poor's Financial Services LLC 停止标的指数的编制发布或取消对本基金使用标的指数的授权等非因本基金管理人原因导致本基金无法继续使用标的指数的情形时，基金管理人按照维护基金份额持有人合法权益的原则，依据具体情况分析拟采用的标的指数变更方案是否会对基金份额持有人利益产生实质性不利影响，由此决定是否采用召开基金份额持有人大会的方式决定标的指数变更事宜。

2、金融模型风险

本基金为指数基金。指数基金的管理人会借用一定的金融模型来进行投资决策。然而任何金融模型都是建立在一定理论假设的基础之上，理论假设是对现实情况的高度抽象，这使得金融模型在实际运用当中可能会产生偏差。此外，在实际运作中，可能因市场结构、投资者行为模式等条件发生变动，导致有关模型出现重大偏离的问题，从而引起基金资产损失的风险。

3、跟踪误差控制未达约定目标的风险

指数基金的跟踪误差是指指数基金的收益率与业绩比较基准之间的偏差。在跟踪指数的过程中，跟踪误差来源主要有：实际组合与标准指数组合构成的差异，指数成分股分红、配股、增发，指数成分股的调整以及上述过程中发生的交易成本、基金的管理费、申购赎回带来的调整成本等。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.5% 以内，年跟踪误差控制在 6%（以美元资产计价）以内，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。

4、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，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

(1) 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。

(2) 停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

(3) 在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回款项，由此基金管理人可能设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

5、成份股退市的风险

指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

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内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，基金合同终止。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。

(五) 境外投资风险

(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做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、诚实守信、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，也不得保证最低收益。

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，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据当时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。

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等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：www.huaan.com.cn；客户服务电话：40088-50099

- (一) 基金合同、托管协议、招募说明书
- (二) 定期报告、包括基金季度报告、中期报告、年度报告
- (三) 基金份额净值
- (四) 基金销售机构及联系方式
- (五) 其他重要资料