

农银汇理中证 500 指数证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 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	农银中证 500 指数	基金代码	660011
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	基金托管人	交通银行股份有限公司
基金合同生效日	2011 年 11 月 29 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	宋永安	开始担任本基金基金经理的日期	2014 年 2 月 10 日
		证券从业日期	2007 年 7 月 1 日

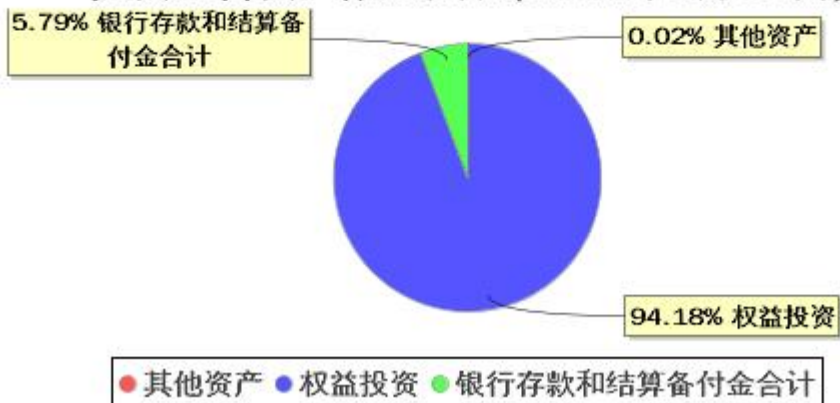
二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金为被动化投资的指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风控管理，力争将基金净值对业绩比较基准的年跟踪误差控制在 4% 以内，日平均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，以实现对标指数的有效跟踪。
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，包括标的指数成份股及备选成份股和新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行后上市的股票）、货币及剩余期限在一年以内的政府债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。 本基金投资于标的指数成份股和备选股的比例不低于基金资产的 90%；除股票以外的其他资产投资比例范围为基金资产的 5%—10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
主要投资策略	本基金将把资产按照标的指数的成份股及其权重配比进行投资以拟合标的指数的业绩表现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 95%×中证 500 指数+5%×同期银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型基金产品，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

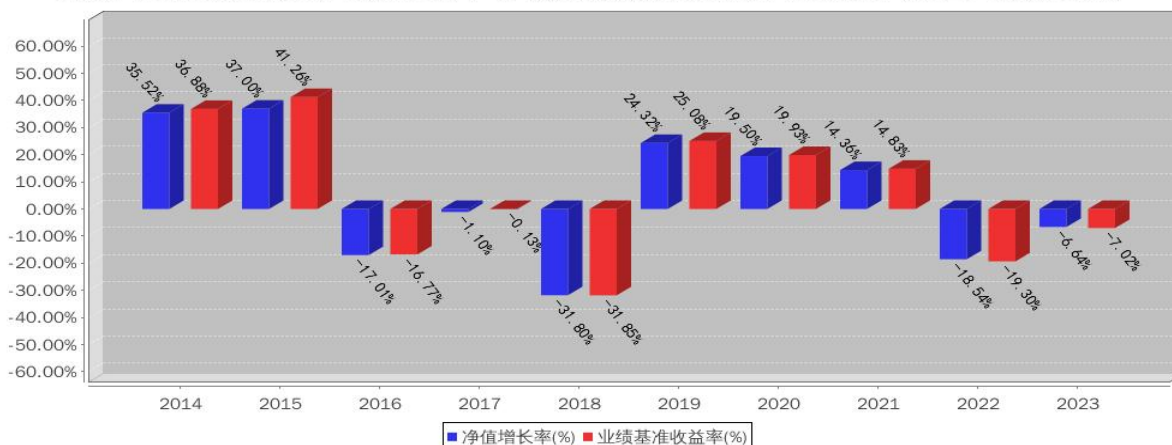
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2024年3月31日)



(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

农银中证500指数基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2023年12月31日)



注：业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日。基金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
申购费 (前收费)	M < 500,000	1.5%
	500,000 ≤ M < 1,000,000	1.0%
	1,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.8%
	M ≥ 5,000,000	1,000 元/笔
赎回费	N < 7 天	1.5%
	7 天 ≤ N < 1 年	0.5%
	1 年 ≤ N < 2 年	0.25%
	N ≥ 2 年	0%

注：通过本公司直销中心柜台申购本基金的养老金客户适用的申购费率为对应申购金额所适用的原申购费率的 10%；申购费率为固定金额的，则按原费率执行，不再享有费率折扣。

(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	0.75%		基金管理人和销售机构
托管费	0.15%		基金托管人
审计费用	50,000.00 元		会计师事务所
信息披露费	80,000.00 元		规定披露报刊
指数许可使用费	0%	年下限金额： 200,000.00 元	指数编制公司

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中扣除。

2、本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。

3、审计费用、信息披露费用、指数许可使用费为由基金整体承担的年费用金额，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：

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	1.50%

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**

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。

本基金为指数型股票型基金，其风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金所面临的投资组合风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险和特定风险等。除投资组合风险以外，本基金还面临操作风险、管理风险、道德风险和合法合规风险等一系列风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的核准，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。

本基金的募集申请经中国证监会 2011 年 8 月 1 日证监许可【2011】1207 号文核准。

本基金标的指数为中证 500 指数，标的指数相关信息如下：

1、指数样本空间

中证 500 指数样本空间由同时满足以下条件的沪深 A 股组成：

1) 非创业板股票：上市时间超过一个季度，除非该股票自上市以来日均 A 股总市值在全部沪深 A 股

(非创业板股票) 中排在前 30 位;

创业板股票: 上市时间超过三年。

2) 非 ST、*ST 股票, 非暂停上市股票。

2、选样方法

1) 在样本空间中剔除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票;

2) 将剩余股票按照最近一年(新股为上市以来)日均成交金额由高到低排名, 剔除排名后 20% 的股票;

3) 将剩余股票按照最近一年日均总市值由高到低进行排名, 选取排名在前 500 名的股票组成中证 500 指数样本股。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站, 网址: www.csindex.com.cn。

本基金投资于证券市场, 基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动, 投资人根据所持有份额享受基金的收益, 但同时也要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括: 因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险, 个别证券特有的非系统性风险, 由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险, 基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险, 某一基金的特定风险等。本基金为股票型基金, 其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。投资有风险, 投资人认购(申购)基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本基金为指数基金, 投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌或退市等潜在风险, 详见本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

招募说明书在编制完成后, 将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地, 供公众查阅。投资人在支付工本费后, 可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。投资者也可在规定网站上进行查阅。

以下资料详见基金管理人网站(www.abc-ca.com), 客户服务热线: 4006895599、021-61095599

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