

## 中泰中证A500指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2025年02月24日

送出日期：2025年02月26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	中泰中证A500指增发起	基金代码	022781
基金简称A	中泰中证A500指增发起A	基金代码A	022781
基金简称C	中泰中证A500指增发起C	基金代码C	022782
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	基金托管人	交通银行股份有限公司
基金合同生效日	——	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	普通开放式	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
李玉刚	——		2001年09月01日
邹巍	——		2004年06月28日

## 二、基金投资与净值表现

## (一) 投资目标与投资策略

投资者欲了解详细情况，请阅读招募说明书第九部分“基金的投资”。

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，主要通过运用量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资范围	本基金的标的指数为中证A500指数。 本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，以标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于其他依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券以及中国证监会允许投资的其他债券）、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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）。

	<p>本基金可根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务。</p> <p>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。</p> <p>本基金投资于股票及存托凭证资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或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、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构变更上述投资品种的比例限制，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。</p>
主要投资策略	<p>本基金为股票增强型指数基金，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，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。</p> <p>指数化被动投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整。本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对其进行适时调整。此外，基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股，将采用合理方法进行适当的替代。由于受到各项投资比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，此时基金将会采用合理方法进行适当的替代。</p> <p>本基金通过构建多因子量化增强模型来实现量化增强策略。</p>
业绩比较基准	中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为股票指数增强型基金，通过跟踪标的指数表现，理论上具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场组合相似的风险收益特征。</p> <p>本基金投资于港股通标的股票时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

### 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：

中泰中证A500指增发起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
认购费	M<100万	0.80%	
	100万≤M<500万	0.40%	
	M≥500万	1000.00元/笔	

申购费（前收费）	M<100万	1.00%	
	100万≤M<500万	0.50%	
	M≥500万	1000.00元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	0.75%	
	30天≤N<180天	0.50%	
	N≥180天	0.00	

## 中泰中证A500指增发起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
认购费			本基金C类基金份额不收取认购费
申购费（前收费）			本基金C类基金份额不收取申购费
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	0.50%	
	N≥30天	0.00	

注：投资人重复认购、申购，须按每笔认购、申购金额所对应的费率档次分别计费。

本基金A类基金份额的认购、申购费用由认购、申购A类基金份额的投资人承担，在投资人认购、申购A类基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

**（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
C类基金份额销售服务费	0.40%	销售机构
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券/期货/期权交易费用；基金的银行汇划费用；基金的开户费用、账户维护费用；因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；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。	相关机构

注：1、本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除；

2、上表中“其他费用”类别列示的费用项目，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### 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。

本基金投资运作过程中面临的主要风险包括市场风险、信用风险、运作管理风险、流动性风险、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、启用侧袋机制的风险、本基金特定风险及其他风险等。

本基金特定风险：

1、本基金为股票指数增强型基金，存在标的指数编制方法本身不成熟导致的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合收益率与标的指数收益率偏离的风险、基金投资组合收益率与股票市场平均收益率偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、标的指数变更的风险、成份股停牌或退市的风险和指数增强型投资策略面临的风险。

2、本基金可投资于股指期货、股票期权、国债期货、港股通标的股票、存托凭证、流动性受限资产等特定投资品种，也可参与融资和转融通证券出借业务，将面临因上述投资所产生的特定风险，可能给基金净值带来不利影响或损失。

3、基金合同提前终止的风险：

本基金为发起式基金，《基金合同》生效之日起3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，本基金将根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

《基金合同》生效满3年后继续存续的，连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当按照《基金合同》约定的程序进行清算并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。

4、本基金采用证券公司交易模式和结算模式带来的信息系统风险、操作风险、效率降低风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险等。

##### （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。

因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应经友好协商解决。如经友好协商未能解决的，则任何一方有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁裁决是终局的。

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：<https://www.ztzqzg.com/> 客服电话：400-821-0808

- 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。

## 六、 其他情况说明

无