

九泰中证 500 指数量化增强型证券投资基金（九泰中证 500 指数增强 C 份额）

基金产品资料概要

编制日期：2021 年 7 月 19 日

送出日期：2021 年 7 月 20 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	九泰中证500指数增强	基金代码	011519
下属基金简称	九泰中证500指数增强C	下属基金代码	011520
基金管理人	九泰基金管理有限公司	基金托管人	中国光大银行股份有限公司
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	孟亚强	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2009-07-01
其他	1、未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当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，本基金合同终止。2、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期间，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。		

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资者可阅读《招募说明书（更新）》“基金的投资”章节了解详细情况

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在对中证500指数进行有效跟踪的基础上，通过定量投资模型综合考虑市场环境和股票特性构建投资组合，同时有效控制组合风险，力争获取长期超越标的指数的收益，追求基金资产的长期稳定增值。
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，以中证500指数的成份股与备选成份股为主要投资对象。为更好的实现投资目标，本基金还可以投资国内依法发行上市交易的其他股票（包含主板、中小板、创业板及其他中国证监会核准或注册发行的股票）、债券（含国债、金融债、地方政府债、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）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货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相关规定）。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。

本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%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产比例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合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的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、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会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。本基金的标的指数为中证500指数，及其未来可能发生的变更。

主要投资策略 本基金采用指数增强型投资策略，以中证500指数作为本基金的标的指数。在跟踪标的指数的基础上根据定量投资模型对行业配置、个股选择及权重等进行主动调整，力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。本基金主要通过指数被动策略对中证500指数进行跟踪，有效控制与标的指数间的跟踪误差。同时运用量化增强策略综合考虑市场环境和股票特性，在有效控制风险的前提下，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，以追求超越标的指数表现的业绩水平。本基金的投资策略还包括大类资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略等。

业绩比较基准 中证500指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%

风险收益特征 本基金为股票型基金，其预期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。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

注：本基金法律文件披露的风险收益特征系基于基金投资方向与策略特点的概括性表述，根据《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构可适时调整对本基金的风险等级结果。请投资者及时关注基金管理人和销售机构对风险评级结果的调整情况，审慎做出投资决策。

（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/最近十年（孰短）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：

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日	1.50%	-

7日 \leq N $<$ 30日	0.50%	-
N \geq 30日	0	-

认购费：本基金C类份额不收取认购费用。

申购费：本基金C类份额不收取申购费用。

（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
管理费	1.00%
托管费	0.15%
销售服务费	0.40%
基金标的指数许可使用费	0.016%
其他费用	基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货交易费用；基金的银行汇划费用；证券、期货等账户开户费用、账户维护费用、银行间账户开立、查询及交易费用等；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。

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。

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。

本基金投资过程中面临的主要风险包括市场风险（经济周期风险、利率风险、公司经营风险、通货膨胀风险及财务风险等）、流动性风险、信用风险、管理风险、政策风险、其他风险（基金管理人职责终止风险、操作风险、技术风险及其他风险等）、本基金特有风险及本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险等级评价结果表述可能不一致的风险等。

本基金特有风险：

1、指数化投资风险

（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可能与整个股票市场的平均回报率存在偏离。

（2）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) 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) 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) 标的指数成份股派发现金红利、送配等所获收益导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4) 由于标的指数成份股和备选成份股停牌或流动性不足等因素，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。

5) 本基金投资过程中所产生的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等，可能导致本基金在跟

踪标的指数时产生收益上的偏离。

6) 在本基金的指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪标的指数的水平、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。

7) 本基金为增强型股票指数基金，在跟踪标的指数的基础上可以根据定量投资模型对行业配置、个股选择及权重等进行主动调整。因此本基金在控制跟踪误差的基础上对投资组合进行的修正与适度增强可能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。

8) 本基金投资运作过程中可能因其他因素导致基金投资组合回报与标的指数回报产生偏离。

(3) 标的指数成份股和备选成份股停牌的风险

本基金持有的标的指数成份股和备选成份股可能因重大事项等原因停牌，在某些市场环境下，以上两类成份股中停牌股票的比例可能比较大。由于停牌股票在停牌期间的流动性受限，无法及时变现，加之标的指数成份股和备选成份股可能被摘牌或出现流动性较差等情形，这些情形可能会导致本基金的流动性风险增加以及跟踪误差扩大。

(4) 标的指数波动的风险

标的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。

(5) 标的指数数据计算出错的风险

尽管指数编制机构将采取一切必要措施以确保标的指数相关数据的准确性，但指数编制机构不对此作任何保证，亦不因标的指数相关数据的任何错误对任何人负责。因此，如果标的指数数据计算出现错误，本基金参考标的指数数据进行投资决策，则可能导致基金资产损失。

(6) 标的指数变更的风险

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，在履行适当程序后，本基金可以变更标的指数。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，基金的风险收益特征将与新的标的指数保持一致，投资者必须承担此项调整带来的风险与成本。

(7) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%。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因此发生较大偏离。

(8) 标的指数不符合要求、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，或因指数编制机构的原因导致标的指数不再符合指数编制方案和/或基金合同约定的投资策略（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外），基金管理人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。投资人将面临基金标的指数变更、基金转换运作方式、基金与其他基金合并或者基金合同终止等风险。

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期间，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。

(9) 采用定量投资模型的风险

本基金为增强型股票指数基金，在对中证500指数进行有效跟踪的基础上，通过定量投资模型综合考虑市场环境和股票特性构建投资组合，同时有效控制组合风险，力争获取长期超越标的指数的收益，追求基金资产的长期稳定增值。因此投资过程中的多个环节将依赖于量化模型，可能存在数据错误的风险和模型失效的风险，导致其优选出的组合收益率不一定持续为正或持续高于业绩比较基准的收益率，

从而存在基金业绩表现不佳的风险。

1) 数据错误的风险。本基金的量化模型以广泛覆盖各类型信息的数据库为基础，包括宏观经济数据、行业经济数据、证券与期货交易行情数据、上市公司财务数据等，这些数据规模庞大，在搜集、采集、预处理等过程中均可能出现错误，从而影响量化模型的输出结果。

2) 模型失效的风险。本基金基于量化模型进行投资决策，模型的有效性在一定程度上也会影响本基金的业绩表现。一方面，面对不断变换的市场环境，建立量化模型的假设前提、变量因子有可能改变，理论和工具也存在适用性的问题，从而影响模型整体效果的稳定性；另一方面，量化模型存在对历史数据的依赖，在实际运用过程中，市场环境的变化可能导致遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

2、基金投资股指期货的风险

本基金可以投资股指期货，可能面临基差风险、合约品种差异造成的风险、标的物风险和保证金风险等风险。标的股票指数价格与股指期货价格之间的价差被称为基差。在股指期货交易中因基差波动的不确定性而导致的风险被称为基差风险。合约品种差异造成的风险，是指类似的合约品种，在相同因素的影响下，价格变动不同。表现为两种情况：1) 价格变动的方向相反；2) 价格变动的幅度不同。类似合约品种的价格，在相同因素作用下变动幅度上的差异，也构成了合约品种差异的风险。标的物风险是由于投资组合与股指期货的标的指数的结构不完全一致，导致投资组合特定风险无法完全锁定所带来的风险。股指期货采用保证金交易制度，具有明显的杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能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。

3、基金投资资产支持证券的风险

本基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券，本公司将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但由于资产支持证券具有一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险等风险，可能导致包括基金净值波动在内的各项风险。

4、本基金可以投资科创板股票，投资风险包括：

(1) 市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

(2) 流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在50万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

(3) 科创板企业退市风险

科创板有更为严格的退市标准，且不设暂停上市、恢复上市和重新上市制度，科创板上市企业退市风险更大，可能给本基金带来不利影响。

(4) 集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

(5) 系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

(6) 政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

本基金可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于科创板或选择不将基金资产投资于科创板，基金资产并非必然投资于科创板。

（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。

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，任何一方均有权将争议提交北京仲裁委员会，按照北京仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有规定。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站【<http://www.jtamc.com>】【客服电话：4006280606】

- 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

本基金无其他情况说明。