

# 中融央视财经50交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期:2021年03月22日

退出日期:2021年03月30日

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。  
作出投资决策前,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	央视50	基金代码	159965
基金管理人	中融基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2019年03月19日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所2019年04月24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	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
	赵华	2008年08月01日	
	陈鹏羽	2015年08月01日	

## 二、基金投资与净值表现

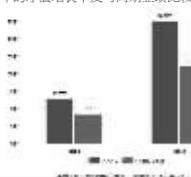
### (一)投资目标与投资策略

投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资范围	标的指数,央视财经50指数。本基金主要投资于标的指数即央视财经50指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于法律法规允许上市交易的权证(包括国债及金融债(中国证监会核准上市)、债券(包括国债及央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等)、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、权证、股指期货及法律法规和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)。 基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%,且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保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,权证、股指期货及其他金融工具的投资占基金资产净值的比例符合监管机构的有关规定。 基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券及转融通证券出借交易,以优化投资组合及进行风险管理。 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	1.投资管理流程和程序 2.股票投资组合管理 3.债券投资策略 4.股指期货投资策略
业绩比较基准	央视财经50指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### (二)投资组合资产配置图/区域配置图



### (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



注:本基金合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

## 三、投资本基金涉及的费用

### (一)基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取:

注:(1)投资者在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理机构可按照不超过0.5%的标准收取佣金。(2)场内交易费用以证券公司实际收取为准。

### (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	费率	收费方式/年费率
管理费	0.50%	
托管费	0.10%	
基金的指数许可使用费	0.03%	
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事务所、律师事务所、仲裁费;基金份额持有人大会费用;基金估值费用;基金销售服务费;基金开户费用、账户维护费用;基金上市费及年费;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:(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)指数许可使用费收取的年限金额为每季度(自然季度)35,000元。就每个计费季度而言,如当季度日均基金资产净值小于或等于人民币5,000万元的,每个计费季度的指数许可使用费应按合同约定的计费公式按照基金当季存续天数计算。

## 四、风险揭示与重要提示

### (一)风险提示

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仔细阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1. 本基金的特定风险。(1)本基金跟踪指数的股票型基金,标的指数为央视财经50指数,在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险:1)系统性风险。2)指数复制风险。3)标的指数回报与行业平均回报偏离风险。标的指数并不能完全代表整个股票市场,标的指数的回报率与整个股票市场的整体回报率可能存在偏差。4)标的指数变更风险。5)基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险。A)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。B)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。C)标的指数成份股派发现金红利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。D)由于成份股停牌、停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。E)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的跟踪偏离度与跟踪误差。F)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,都会对本基金的投资产生影响,从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。G)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跟踪误差;因基金申购和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。6)基金份额二级市场交易价格折溢价的风险。7)参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险。8)退市风险。9)跟踪误差控制未达约定目标的风险。在正常市场情况下,力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差率不超过2%,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较大偏离。10)标的指数值计算出错的风险。尽管指数编制机构将采取一切必要措施以确保指数的准确性,但不对此作任何保证,亦不因指数的任何错误对任何人负责。因此,如果标的指数值出现错误,投资人参考指数值进行投资决策,则可能导致损失。11)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相关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,基金合同自动终止。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解决方案确定并实施前,基金管理人应参照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息继续基金申购赎回业务,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。12)成份股停牌或退市的风险。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,当标的指数成份股停牌或发生明显负面事件面临退市时,可能出现导致本基金的跟踪偏离度和跟踪误差扩大的风险。

(2)本基金投资股指期货,股指期货交易采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,存在潜在损失可能成倍放大的风险。基金管理人以套期保值为目的,在控制风险的前提下,谨慎适当参与股指期货的投资。(3)本基金投资资产支持证券,主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种,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。

2. 系统性风险。主要包括:(1)政策风险、(2)经济周期风险、(3)利率风险、(4)购买力风险、(5)汇率风险、(6)其他风险。

3. 非系统性风险。主要包括:(1)管理风险、(2)交易风险、(3)流动性风险、(4)运营风险、(5)道德风险。

### (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,如能及时、准确地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

以下资料详见中融基金官方网站(www.zrfunds.com.cn)客服电话:400-160-6000;010-56517299]

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

争议解决方式: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该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁的地点为北京市,仲裁裁决是终局的并对相关各方均有约束力。除非仲裁裁决另有规定,仲裁费用由败诉方承担。