

## 中泰中证500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2024年05月15日

送出日期：2024年05月17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500指数增强	基金代码	008112
基金简称A	中泰中证500指数增强A	基金代码A	008112
基金简称C	中泰中证500指数增强C	基金代码C	008113
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2019年12月11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	
邹巍	2019年12月11日	2004年06月28日	
李玉刚	2022年01月04日	2001年09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	本基金为中证500指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资范围	本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证500指数成份股及其备选成份股、其他依法发行上市的股票（含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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交易。 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，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和应收申购款等。

主要投资策略	本基金为增强型指数基金，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。
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	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。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，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。

(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024年03月31日



(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

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日  
单位%



基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日  
单位%



基金合同生效当年不满完整自然年度，按实际期限（2019年12月11日-2019年12月31日）计算净值增长率。

### 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：

中泰中证500指数增强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
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500指数增强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
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:投资人重复申购,须按每笔申购金额所对应的费率档次分别计费。

A类基金份额的申购费用由申购A类基金份额的投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

## (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	0.50%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
C类基金份额销售服务费	0.40%	销售机构
审计费用	40,000.00	会计师事务所
信息披露费	80,000.00	规定披露报刊
指数许可使用费	0.016%; 年下限金额: 200,000.00	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、诉讼费和仲裁费;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;基金的开户费用、账户维护费用;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、指数许可使用费收取下限为每季度5万元;

2、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;

3、审计费用、信息披露费、指数许可使用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;

4、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。

## (三) 基金运作综合费用测算

若投资者申购本基金份额,在持有期间,投资者需支出的运作费率如下表:

中泰中证500指数增强A

	基金运作综合费率(年化)
持有期	1.06%

中泰中证500指数增强C

	基金运作综合费率(年化)

持有期	1.46%
-----	-------

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率为基金现行费率，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、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、成份股停牌的风险以及量化选股模型失效的风险。

2、本基金可投资于股指期货、存托凭证等特定投资品种，将面临投资上述品种所产生的特定风险，可能给基金净值带来不利影响或损失。

3、本基金可参与转融通出借业务，可能面临因参与该业务导致的流动性风险、信用风险和市场风险。

4、基金合同终止的风险：基金合同生效后，连续50个工作日，基金资产净值低于5000万元，或基金份额持有人数量不满200人时，基金管理人应当按照《基金合同》约定的程序进行清算并直接终止《基金合同》。

5、本基金采用证券公司交易模式和结算模式，可能存在信息系统风险、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。

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