

银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要

编制日期：2024 年 9 月 6 日

送出日期：2024 年 9 月 7 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 | A500ETF | 基金代码 | 159339 |
| 基金管理人 | 银华基金管理股份有限公司 | 基金托管人 | 中信建投证券股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | - | 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 | 交易型开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 马君女士 | 开始担任本基金基金经理的日期 | - |
| | | 证券从业日期 | 2008 年 7 月 1 日 |
| 基金经理 | 谭跃峰先生 | 开始担任本基金基金经理的日期 | - |
| | | 证券从业日期 | 2011 年 7 月 1 日 |
| 其他 | 场内简称：A500ETF。 因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，本基金将终止基金合同并进行基金财产清算，且无需召开基金份额持有人大会审议。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，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，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，本基金将终止基金合同并按照基金合同约定程序进行基金财产清算。 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

详见本基金招募说明书的“基金的投资”章节。

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常市场情况下，本基金力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。 |
| 投资范围 | 本基金标的指数为中证 A500 指数及其未来可能发生的变更。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证，下同）。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产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、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。 |

| | |
|---------------|---|
| | <p>同时，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括主板股票、创业板股票、科创板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券资产（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券（含分离交易可转债的纯债部分，下同）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券）、银行存款（包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款）、资产支持证券、债券回购、同业存单、货币市场工具、现金、衍生工具（股指期货、股票期权）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。</p> <p>本基金可以根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或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，可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例，新纳入的投资品种的投资原则及投资比例限制按法律法规或监管机构的相关规定执行。</p> |
| 主要投资策略 | 本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为中证 A500 指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数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

注：暂无。

(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：暂无。

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 |
|------|--|---------------|
| 认购费 | $S < 500,000$ 份 | 0.80% |
| | $500,000 \text{ 份} \leq S < 1,000,000$ 份 | 0.50% |
| | $S \geq 1,000,000$ 份 | 按笔收取，1000 元/笔 |

注：场内交易费用以证券公司实际收取为准。

认购费

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购（若本基金在募集期限内开通网下股票认购业务）时可以按照不高于上表所示费率收取认购费用，在发售机构允许的条件下，投资人可选择以现金或基金份额的方式支付相关认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购（若本基金在募集期限内开通网下股票认购业务）时可参照上述费率结构收取一定的佣金。认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金资产。投资人在一天之内如果有多笔网下现金认购，适用费率按单笔分别计算。

申购费

投资人在申购基金份额时，申购代理券商可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记

机构等收取的相关费用。

赎回费

投资人在赎回基金份额时，赎回代理券商可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

(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 | 0.15% | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.05% | 基金托管人 |
| 其他费用 | 其他费用详见本基金招募说明书或其更新的“基金的费用与税收”章节。 | 相关服务机构 |

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。

本基金的特定风险包括：1、指数化投资的风险。2、标的指数波动的风险。3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险。4、基金交易价格与基金份额净值发生偏离的风险。5、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险。6、基金份额赎回对价的变现风险。7、退市风险。8、终止基金合同风险。9、投资人申购失败的风险。10、投资人赎回失败的风险。11、套利风险。12、申购赎回清单差错风险。13、二级市场流动性风险。14、第三方机构服务的风险。15、投资股指期货的风险：（1）基差风险；（2）保证金风险；（3）合约展期风险。16、投资资产支持证券的风险。17、投资股票期权风险：（1）流动性风险；（2）价格风险；（3）操作风险。18、存托凭证投资风险。19、参与融资交易的风险：（1）杠杆效应放大风险；（2）担保能力及限制交易风险；（3）强制平仓风险。20、参与转融通证券出借业务的风险：（1）流动性风险；（2）信用风险；（3）市场风险。21、跟踪误差控制未达约定目标的风险。22、非深市成份证券申赎处理规则带来的风险。23、成份股停牌风险。24、标的指数不符合要求或指数编制机构停止服务的风险。25、参与债券回购的风险。26、标的指数变更的风险。27、投资科创板股票的风险：（1）市场风险；（2）流动性风险；（3）信用风险；（4）集中度风险；（5）系统性风险；（6）政策风险。

此外，本基金还将面临市场风险、基金运作风险、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、其他风险等。

(二) 重要提示

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。

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，应将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，

仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

争议处理期间，基金管理人和基金托管人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同约定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同受中国法律（为基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖，并按其解释。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.yhfund.com.cn]；客服电话[400-678-3333、010-85186558]

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