国泰中证A500增强策略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：2025年5月21日

送出日期：2025年5月22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	国泰中证 A500 增强策略 ETF	**基金代码**	159226
基金管理人	国泰基金管理有限公司	**基金托管人**	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2025-05-20		
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	梁杏	**开始担任本基金基金经理的日期**	2025-05-20
		证券从业日期	2007-07-01
	刘昉元	**开始担任本基金基金经理的日期**	2025-05-21
		证券从业日期	2020-08-24
场内简称	中证 A500 增强 ETF		

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“第十一部分 基金的投资”。

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股及优化组合管理，在注重风险控制的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期增值。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、货币市场工具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）。 本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。 基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资股指期权等其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围及投资比例规定。 本基金的标的指数为中证A500指数及其未来可能发生的变更。
主要投资策略	1、股票投资策略 本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，控制跟踪误差，达到对标的指数的跟踪目标。在复制标的指数的基础上，综合运用超额收益模型、风险模型、成本模型选择具有较高投资价值的股票构建投资组合。本基金个股选择范围包括标的指数成份股及备选成份股、预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成份股中流动性良好、基本面优质或者与标的指数成份股相关度高的股票等。在坚持模型驱动的纪律性投资的基础上，遵循精细化的投资流程，严格控制组合在多维度上的风险暴露，并不断精进模型的修正和组合的优化，系统性地挖掘股票市场的投资机会，力求在有效跟踪标的指数的基础上获取超越标的指数的投资回报。在正常市场情况下，本基金追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过6.50%。 （1）超额收益模型：该模型通过构建多因子量化系统，综合评估各证券之间的定价偏差。定价偏低的资产具有投资价值，定价过高的资产应当考虑回避。 其中，多因子量化系统基于对证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据的实证检验，选取价值因子、盈利质量因子、成长性因子、技术因子、流动性因子、分析师因子等多类对股票超额收益具有较强解释能力的因子进行构建。 （2）风险模型：该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括行业偏离度、风格偏离度、波动率等，力求将主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内。 （3）成本模型：该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等预测本基金的交易成本，以减少交易对业绩造成的负影响。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、金融衍生品投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证A500指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

（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

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
认购费	S < 50 万份	0.80%	
	50 万份 ≤ S < 100 万份	0.50%	
	S ≥ 100 万份	100 元/笔	按笔收取

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时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

申购费：

投资人在申购基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.50%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，申购赎回代理券商可按照不超过 0.50%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（元）	收取方
管理费	0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	38,000.00	会计师事务所
信息披露费	80,000.00	规定披露报刊
其他费用	其他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费用	相关服务机构

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、上表中年费用金额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。

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。

本基金面临的主要风险有市场风险、管理风险、流动性风险、法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险、本基金特有风险及其他风险等。本基金特有风险包括 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离及跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数变更

的风险、指数编制机构停止服务的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、成份股停牌的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、基金退市风险、投资人申购失败的风险、基金份额持有人赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、申购赎回清单差错风险、申购赎回清单标识设置风险、申购赎回的代理买卖风险、操作或技术风险、套利风险、第三方机构服务的风险、增强策略失效风险、潜在抢先交易风险、投资资产支持证券的风险、投资股指期货的风险、投资国债期货的风险、投资股票期权的风险、投资存托凭证的风险、参与融资业务的风险、参与转融通证券出借业务的风险等。本基金的一般风险及特有风险详见招募说明书的“风险揭示”部分。

（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投资价值、市场前景和收益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。

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，则任何一方有权按《基金合同》的约定提交仲裁，仲裁机构见《基金合同》。

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 www.gtfund.com 或咨询客服电话：400-888-8688

1、基金合同、托管协议、招募说明书及更新

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