

中加中证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12月05日

送出日期：2024年12月05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	中加中证500指数增强	基金代码	010153
下属基金份额类别	中加中证500指数增强A	下属基金份额类别代码	010153
下属基金份额类别	中加中证500指数增强C	下属基金份额类别代码	010154
基金管理人	中加基金管理有限公司	基金托管人	中信建投证券股份有限公司
基金合同生效日	2020年09月27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
钟伟	2020年09月27日		2009年07月01日

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

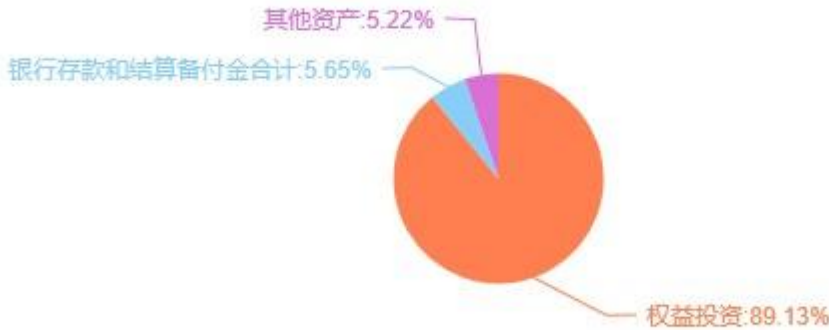
投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资范围	<p>本基金投资范围主要为标的指数成份股（含存托凭证）及备选成份股（含存托凭证）。此外，为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的其他股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及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的相关规定）。</p> <p>本基金可以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。</p> <p>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。</p>

	<p>基金的投资组合比例为：本基金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及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。</p> <p>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。</p> <p>标的指数：中证500指数</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。具体策略包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、同业存单投资策略；4、股指期货投资策略；5、国债期货投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、股票期权投资策略；8、融资及转融通证券出借业务投资策略；9、现金管理策略。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金属于股票型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>

注：详见《中加中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024年09月30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



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



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：

中加中证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	0.60%	
	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%	

中加中证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）			C类份额不收取申购费
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	0.50%	
	N≥30天	0.00%	

（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	0.80%	基金管理人和销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
销售服务费C	0.30%	销售机构
审计费用	25,000.00	会计师事务所
信息披露费	0.00	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	会计费、律师费等，详见招募说明书基金的费用与税收章节。	

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。本基金运作相关费用年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。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/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：

中加中证500指数增强A

基金运作综合费率（年化）
1.45%

注：基金管理费率、托管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。

中加中证500指数增强C

基金运作综合费率（年化）
1.75%

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。

1、本基金的特定风险

（1）标的指数波动的风险。本基金为增强型股票指数基金，标的指数成份股及备选成份股的价格可能受各种因素影响而波动，导致指数波动，从而对本基金的收益水平产生影响。在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

（2）主动增强投资的风险。本基金采用指数增强投资策略，投资收益率可能高于标的指数收益率但也有可能低于标的指数收益率，存在与标的指数的收益率发生偏离的风险。

（3）跟踪误差控制未达约定目标。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过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发生较大偏离。

（4）指数编制机构停止服务。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，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日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。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至解决方案确定期间，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。

（5）成份股停牌的风险。标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

(6) 基金投资组合收益率与股票市场平均收益率偏离的风险。本基金以中证500指数作为标的指数，中证500指数综合反映中国A股市场中一批中小市值公司的股票价格表现，并不能完全代表整个股票市场，因此可能存在基金投资组合收益率与股票市场平均收益率偏离的风险。

(7) 量化选股模型失效的风险。本基金通过量化选股模型进行股票投资价值定量分析，并在此基础上构建股票投资组合。存在由于量化选股模型失效导致基金业绩表现不佳的风险。

(8) 投资股指期货、国债期货的风险。本基金可投资于股指期货和国债期货，股指期货和国债期货作为一种金融衍生品，存在一些特有的风险，包括保证金风险、基差风险、市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。

(9) 本基金投资资产支持证券，由于资产支持证券一般都针对特定机构投资人发行，且仅在特定机构投资人范围内流通转让，该品种的流动性较差，且抵押资产的流动性较差，因此，持有资产支持证券可能给组合资产净值带来一定的风险。

(10) 投资股票期权的风险。本基金参与股票期权交易以套期保值为主要目的，投资股票期权的主要风险包括股票期权价格波动带来的市场风险；因保证金不足、备兑证券数量不足或持仓超限而导致的强行平仓风险；股票期权具有高杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动可能会使投资人权益遭受较大损失；对手方风险和连带风险在内的第三方风险；以及各类操作风险。

(11) 融资交易投资风险。本基金可参与融资交易，风险主要包括流动性风险、信用风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

(12) 参与转融通证券出借业务而面临的流动性风险、信用风险和市场风险等风险。

(13) 投资科创板风险。本基金投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于公司治理风险、流动性风险、投资集中风险、经营风险、退市风险、股价波动较大风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

(14) 投资存托凭证的风险。本基金的投资范围包括存托凭证，如果投资，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制和交易机制相关的风险。

2、本基金的其他风险主要包括：市场风险（主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险）、管理风险、信用风险、流动性风险（包括但不限于部分投资标的流动性较差的风险、巨额赎回风险、启用侧袋机制等流动性风险管理工具带来的风险）、操作和技术风险、合规性风险、模型风险、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和其他风险。

（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。

各方当事人同意，因《基金合同》的订立、内容、履行和解释或与《基金合同》有关的一切争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国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，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

争议处理期间，各方当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

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.bobbns.com、电话：400-00-95526

- 1、《中加中证500指数增强型证券投资基金基金合同》、《中加中证500指数增强型证券投资基金托管协议》、《中加中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 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。