

华泰紫金中证500指数增强型发起式 证券投资基金基金产品资料概要更新

更新日期:2026年1月23日
公告日期:2026年2月1日

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。详尽的信息请阅读完整的招募说明书和销售文件。

作出投资决定前,请阅读完整的招募说明书和销售文件。

二、产品概况

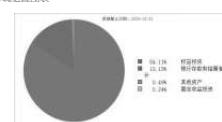
基金简称	华泰紫金中证500指数增强发起	基金代码	016865
下属基金简称	华泰紫金中证500指数增强发起	下属基金代码	016865
基金管理人	华泰证券(上海)资产管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2023-02-22	交易币种	人民币
基金类型	股票型	开放频率	每个开放日
运作方式	普通开放式	开始担任本基金基金经理日期	2023-02-22
基金经理	毛甜	证券从业日期	2010-07-12

三、基金投资与净值表现

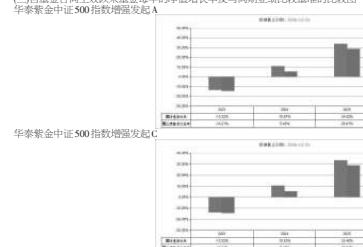
(一)投资目标与投资策略

投资目标	本基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制,力争在控制本基金净值增长率为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8%的基础上,追求获得超越标的指数的回报。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板股票、存托凭证及其他中国证监会允许发行上市的股票),港股通标的股票,债券(包括国债、地方政府债、政策性金融机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、公募基金(含ETF)、商品期货、商品期权、权证、股指期货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的相关规定)。本基金可根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。 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.股票投资策略 本基金为指数增强型基金,以中证500指数为标的指数,指数化投资策略参照标的指数的成份股,精选成分股及其权重,初步构建投资组合,并按照标的指数的调整规则作出调整,力争使本基金的净值与业绩比较基准之间的跟踪偏离度。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行同期存款利率(税后)×5%
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高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为股票型指数增强基金,跟踪中证500指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场的平均的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票,还可能面临港股通机制下因投资环境、投资者的市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

(二)投资组合资产配置图表



(三)自基金合同生效以来基金每年的净值增长率与同期业绩比较基准的比较图
华泰紫金中证500指数增强发起A



注:1.本基金成立于2023年2月22日;2.基金的过往业绩不代表未来表现;3.2023年数据非完整年度数。

(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:

华泰紫金中证500指数增强发起A

费用类型	份额(S)或金额(M) /持有一个期限(N)	收费方式/费率	备注
申购费(前收费)	M < 100万元	1.00%	
	100万元 ≤ M < 500万元	0.60%	
	M ≥ 500万元	1000元/笔	
赎回费	N < 7日	1.50%	
	7日 ≤ N < 30日	0.50%	
	N ≥ 30日	0.00%	

以下费用在申购赎回基金过程中收取:

华泰紫金中证500指数增强发起C

费用类型	份额(S)或金额(M) /持有一个期限(N)	收费方式/费率	备注
申购费(前收费)	-	不收取申购费	
	N < 7日	1.50%	
赎回费	7日 ≤ N < 30日	0.00%	
	N ≥ 30日	0.00%	

(二)基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

华泰紫金中证500指数增强发起C

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.8%	基金管理人、销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
销售服务费(华泰紫金中证500指数增强发起C)	0.4%	销售机构
审计费	30,000.00	会计师事务所
信息披露费	50,000.00	规定披露报刊

注:1.本基金交易证券,基金(如有)等产生的费用由买方承担,赎回费由赎回基金份额的持有人承担,基金定投报告披露为准。
2.披露相关费用金额为基金整体承担费用,非单个份额类费用,且年金额为预估值,单位为元,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

投资者申购本基金时,在持有期间,投资者需支付的运作费率如下表:

华泰紫金中证500指数增强发起A

基金运作综合费率(年化)
1.05%

注:基金管理费、托管费率、销售服务费(若有)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础计算。

(四)风险揭示与重要提示

本基金提供任何保证,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》。

本基金文件是投资基金的主要风险揭示。

1.政策风险;(2)经济周期风险;(3)利率风险;(4)上市公司经营风险;(5)流动性风险;(6)操作风险;(7)本基金的信用风险,主要包括:(1)基金投资组合收益率与标的指数收益率差额及跟踪误差差额未达约定目标的风险;(2)基金投资组合收益率与股票市场价格平均收益率偏离的风险;(3)标的指数收益率的变化的风险以及指数编制机构停止服务的风险;(4)成份股停牌停售的风险;(5)股指期货投资风险;(6)国债期货投资风险;(7)股票期权投资风险;(8)资产支持证券投资风险;(9)港股通标的股票的投资风险;(10)存托凭证的投资风险;(11)与融资交易的风险;(12)参与跨境证券出售业务的风险;(13)基金合同终止的风险。

(五)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。

基金管理人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。

五、其他资料查阅办法

以下资料详见基金管理人网站 <https://htscame.com>,客服电话:4008895597

● 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

● 基金销售机构及联系方式

● 其他重要资料