

华泰保兴中证 A500 指数增强型证券投资基金管理

基金产品资料概要更新（2025 年第 1 号）

编制日期：2025 年 06 月 26 日

送出日期：2025 年 06 月 30 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	华泰保兴中证 A500 指数增 强	基金代码	023516
基金简称 A	华泰保兴中证 A500 指数增 强 A	基金代码 A	023516
基金简称 C	华泰保兴中证 A500 指数增 强 C	基金代码 C	023517
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2025 年 05 月 30 日	基金类型	股票型
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
交易币种	人民币		
基金经理	姓名	开始担任本基金 基金经理的日期	证券从业日期
	赵旭照	2025 年 05 月 30 日	2014 年 07 月 01 日
	王恺铖	2025 年 06 月 26 日	2018 年 06 月 30 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	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过基本面及定量分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资范围	<p>本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）。为了更好地实现投资目标，本基金还可以投资于依法发行上市的非成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、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、政府支持机构债券、政府支持债券等）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他存款）、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货、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的相关规定）。</p> <p>本基金可根据法律法规和基金合同的约定，参与融资融券业务中的融资业务及转融通证券出借业务。</p> <p>法律法规或监管机构日后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p>

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于 80%，其中投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如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。

本基金标的指数：中证 A500 指数及其未来可能发生的变更。

主要投资策略	本基金采用指数增强投资策略，在有效复制标的指数、控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，有限度地调整成份股或者各成份股在标的指数中权重的偏离，力求投资收益能够有效跟踪并适度超越目标指数。 本基金可以将标的指数成份股及备选成份股之外的股票纳入基金股票池，并构建主动型投资组合。 在正常市场情况下，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 0.50%，年跟踪误差不超过 8%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率 *95%+ 银行活期存款利率(税后) *5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期风险收益水平理论上高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 本基金为股票指数增强型基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 本基金若投资港股通标的股票，则还会面临港股交易失败风险、汇率风险、境外市场等特有风险。

注：投资者可阅读招募说明书中基金的投资章节了解详细情况。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

无。

(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

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：

华泰保兴中证 A500 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 万元	1. 20%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0. 80%	非养老金客户
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0. 40%	非养老金客户
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔	非养老金客户
赎回费	N < 7 天	1. 50%	场外份额
	N ≥ 7 天	0. 00%	场外份额

华泰保兴中证 A500 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
赎回费	N<7 天	1. 50%	场外份额
	N≥7 天	0. 00%	场外份额

申购费：投资者申购本基金 C 类基金份额不收取申购费。通过基金管理人直销柜台申购本基金 A 类基金份额的养老金客户享受申购费率（含固定申购费）零折优惠。

（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. 20%	基金托管人
华泰保兴中证 A500 指数增强 C 销售服务费	0. 40%	销售机构
审计费用	50,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	80,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	详见招募说明书及其更新“基金的费用与税收”章节	相关机构

注：1、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。

2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别（若有）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。

基金份额持有人须了解并承受以下风险：（一）市场风险；（二）管理风险；（三）流动性风险；（四）信用风险；（五）操作风险；（六）本基金的特有风险：

1、指数化投资风险

（1）标的指数波动的风险；（2）跟踪误差控制未达约定目标的风险；（3）标的指数变更的风险；（4）指数编制机构停止服务的风险；（5）成份股停牌的风险；（6）成份股退市的风险

2、主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。这种基于对基本面的深度研究作出优化调整投资组合的决策，最终结果仍然存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

3、股票型基金特有风险

本基金是一只股票型基金，股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于80%，其中投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%，如果股票市场和债券市场同时出现下跌，本基金将不能完全抵御两个市场同时下跌的风险，基金净值将出现下降。此外，本基金在调整资产配置比例时，可能由于基金经理的预判与市场的实际表现存在较大差异，出现资产配置不合理的风险，从而对基金收益造成不利影响。

4、股指期货投资风险

本基金可投资于股指期货，因此存在因投资股指期货而带来的风险：

（1）市场风险：由于标的价格变动而产生的衍生品的价格波动。

（2）市场流动性风险：当基金交易量大于市场可报价的交易量而产生的风险。

(3) 结算流动性风险：基金保证金不足而无法交易衍生品，或因指数波动导致保证金低于维持保证金而必须追缴保证金的风险。

(4) 基差风险：期货市场价格与标的价格不一致所产生的风险。

(5) 信用风险：交易对手不愿或无法履行契约的风险。

(6) 作业风险：因交易过程、交易系统、人员疏失、或其他不可预期事件所导致的损失。

5、国债期货投资风险

本基金的投资范围包括国债期货，参与国债期货交易可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。

6、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的存托凭证（“中国存托凭证”），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相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

7、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场股票的特定风险

本基金的投资范围包括港股通标的股票（本基金可以投资港股通标的股票，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%），除与其他投资于股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临以下特有风险，包括但不限于：

(1) 投资于香港证券市场的特有风险；(2) 通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的特有风险；(3) 其他可能的风险；(4) 本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股，存在不对港股进行投资的可能。

8、参与转融通证券出借业务的风险

(1) 信用风险；(2) 市场风险；(3) 提前或延迟了结风险；(4) 跟踪误差风险；(5) 法律合规风险。

9、参与融资业务的风险

本基金可参与融资业务。融资业务除具有普通证券交易所具有的政策风险、市场风险、信用风险、系统风险等各种风险外，因融资业务的杠杆效应，本基金的净值可能表现出更大的波动性，投资者有机会获得较大的收益，也有可能蒙受巨大损失。

10、股票期权投资风险

本基金可投资股票期权，股票期权的风险主要包括市场风险、保证金风险、信用风险和操作风险等。

11、投资可转换债券和可交换债券的特定风险

可转换债券和可交换债券是指持有人可以在约定的时间内按照约定的价格将持有的债券转换为普通股票的债券，是兼具债券性质和权益性质的投资工具。可转换债券和可交换债券既面临发行人无法按期偿付本息的信用风险，也面临二级市场价格波动的风险。另外，可转债和可交换债一般具有强制赎回等条款，可能会增加相应的风险。

12、投资资产支持证券的特定风险

本基金可投资资产支持证券，资产支持证券是指在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的、符合相关法规规定的信贷资产支持证券和企业资产支持证券类品种。资产支持证券在国内市场处于发展初期阶段，可能具有低流动性、高收益性的特征，并存在一定的投资风险，包括：信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

(七) 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；(八) 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、勤勉谨慎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。

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（网址：www.ehuataifund.com）（客户热线电话：400-632-9090（免长途话费））

- 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。