

招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新

编制日期: 2024 年 12 月 16 日

送出日期: 2024 年 12 月 20 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	招商中证 500 等权重 指数增强	基金代码	009726
下属基金简称	招商中证 500 等权重 指数增强 A	下属基金代码	009726
基金管理人	招商基金管理有限 公司	基金托管人	中信证券股份有限 公司
基金合同生效日	2020 年 12 月 23 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	王岩	开始担任本基金基 金经理的日期	2021 年 9 月 16 日
		证券从业日期	2011 年 11 月 18 日
其他	-		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资者可阅读本基金《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况。

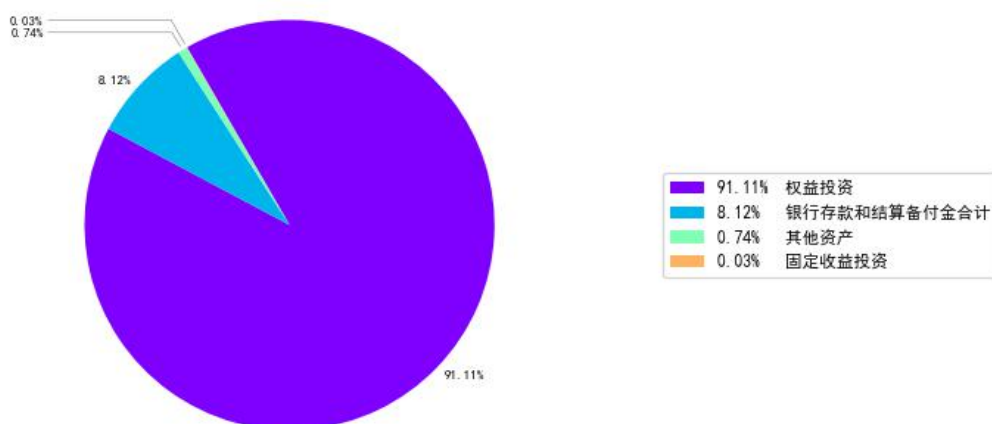
投资目标	本基金通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束, 力求实现超越标的指数的业绩表现, 谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%, 年化跟踪误差不超过 7.75%。
------	---

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和存托凭证 (包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许投资的股票和存托凭证)、债券 (包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债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, 以及法律法规或中
------	---

	<p>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>本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和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的其他品种，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>本基金投资于股票资产、存托凭证的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份券及其备选成份券的资产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和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例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、应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行相应程序后，以变更后的规定为准。</p> <p>标的指数：中证 500 等权重指数</p>
主要投资策略	<p>大类资产配置策略：本基金作为增强指数型基金，以跟踪中证 500 等权重指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。</p> <p>其他投资策略包括：(1) 股票投资策略；(2) 债券投资策略；(3) 股指期货投资策略；(4) 国债期货投资策略；(5) 资产支持证券投资策略；(6) 参与融资及转融通证券出借业务策略。</p>
业绩比较基准	中证 500 等权重指数收益率*95%+中国人民银行人民币活期存款利率(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高于债券型基金及货币市场基金。

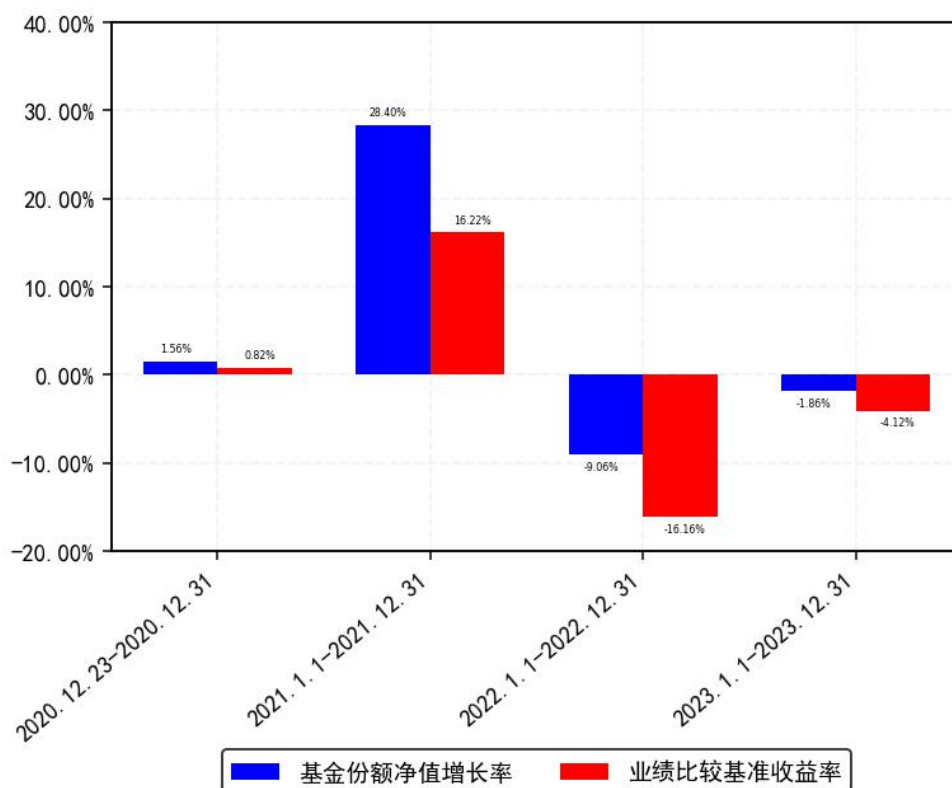
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图 (2024年9月30日)



(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

招商中证500等权重指数增强A每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1.基金合同生效当年按实际期限计算，不按整个自然年度进行折算。
2.基金的过往业绩不代表未来表现。

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
申购费(前收费)	M < 100 万元	1.5%	-
	100 万元 ≤ M < 200 万元	1%	-
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.6%	-
	500 万元 ≤ M	每笔 1000 元	-
赎回费	N < 7 天	1.5%	-
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%	-
	30 天 ≤ N < 180 天	0.5%	-
	180 天 ≤ N	0%	-

注：基金管理人可以针对特定投资人(如养老金客户等)开展费率优惠活动，详见基金管理人发布的相关公告。

(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	年费率: 1.20%	基金管理人和销售机构
托管费	年费率: 0.20%	基金托管人
销售服务费	-	销售机构
审计费用	年费用金额: 45,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	年费用金额: 120,000.00 元	规定披露报刊
指数许可使用费	年费率: 0.016% 年下限金额: 200,000.00 元	指数编制公司
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、基金相关账户的开户及维护费用等费用, 以及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其他费用。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。	

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、信息披露费和指数许可使用费(若有)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:

	基金运作综合费率 (年化)
-	1.44%

注: 基金管理费率、托管费率、销售服务费率(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。

一) 本基金特定风险如下:

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份券的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2、标的指数波动的风险

标的指数成份券的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动,导致指数波动,从而使基金收益水平发生变化,产生风险。

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于标的指数调整成份券或变更编制方法、标的指数成份券发生配股或增发等行为导致成份券在标的指数中的权重发生变化、成份券派发现金红利、新股市值配售、成份券摘牌、流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时,本基金将建立专门的风险预算控制模型,力争控制本基金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%,年化跟踪误差不超过 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,本基金净值表现与业绩比较基准之间可能发生较大偏离。

5、指数编制机构停止服务的风险

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内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,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,基金合同终止。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并实施前,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。

6、成份券停牌的风险

标的指数成份券可能因各种原因临时或长期停牌,发生成份券停牌时,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。

7、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,如在一定幅度内降低或提高成份券的权重、替换或者增加一些非成份券。调整投资组合的决策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。

8、股指期货、国债期货等金融衍生品投资风险

金融衍生品是一种金融合约,其价值取决于一种或多种基础资产或指数,其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、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。并且由于衍生品定价相当复杂,不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

股指期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,股价指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

国债期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当相应期限国债收益率出现不利变动时,可能会导致投资者权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

9、本基金的投资范围包含资产支持证券，可能带来以下风险：

(1) 信用风险：基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

(2) 利率风险：市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

(3) 流动性风险：受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。

(4) 提前偿付风险：债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使基金资产面临再投资风险。

10、参与转融通证券出借业务的风险

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：(1) 流动性风险：面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险；(2) 信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；(3) 市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

11、存托凭证的投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与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。

二) 本基金面临的其他风险如下：

1、证券市场风险，主要包括：(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) 购买力风险；

2、流动性风险，主要包括：(1) 基金申购、赎回安排；(2) 拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估；(3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施；(4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响；

3、信用风险；

4、债券回购风险；

5、管理风险；

6、启用侧袋机制的风险；

7、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；

8、其他风险，主要包括：(1) 操作风险；(2) 技术风险；(3) 法律风险；(4) 其他风险。

具体内容详见本基金《招募说明书》。

(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》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，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，中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

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.cmfcchina.com 客服电话：400-887-9555

- 《招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》、
- 《招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金托管协议》、
- 《招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

六、其他情况说明

无