

安信中证 500 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：2021 年 3 月 5 日

送出日期：2021 年 3 月 12 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	安信中证 500 指数增强	基金代码	005965
下属基金简称	安信中证 500 指数增强 A	下属基金交易代码	005965
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	基金托管人	宁波银行股份有限公司
基金合同生效日	2018 年 11 月 29 日	上市交易所及上市日期	-
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	徐黄玮	开始担任本基金基金经理的日期	2018 年 11 月 29 日
		证券从业日期	2007 年 07 月 18 日

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

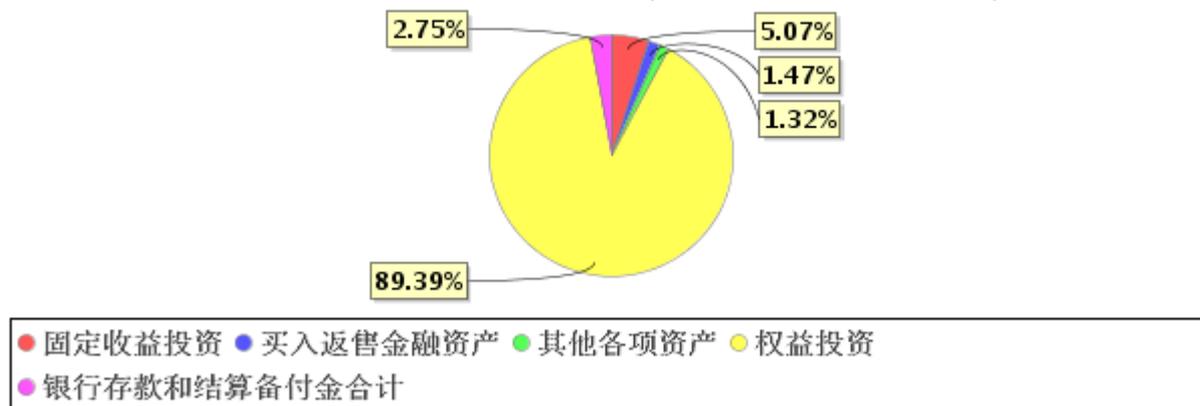
投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资范围	<p>本基金的标的指数为中证 500 指数。</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、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）。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：本基金投资于股票资产的比例占基金资产的 80%-95%，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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。</p> <p>如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。</p>

<p>主要投资策略</p>	<p>本基金为增强型指数基金，在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数基础上通过数量化模型进行投资组合优化，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。指数化被动投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整。量化增强策略主要采用超额收益模型、风险模型和成本模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，产出投资组合，以追求超越标的指数表现的业绩水平。在股指期货投资方面，将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。在债券投资方面，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期，进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。此外，本基金还将采用资产配置策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。</p>

注: 详见《安信中证 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”。

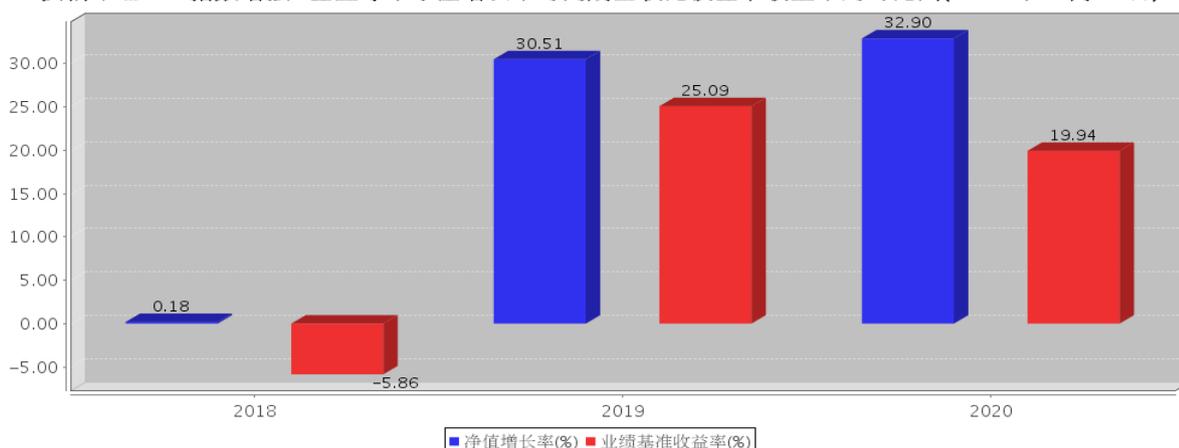
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2020年12月31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

安信中证500指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2020年12月31日)



注:基金合同生效当年期间的相关数据按实际存续期计算。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

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	M<1,000,000	1.00%	-
	1,000,000≤M<5,000,000	0.60%	-
	5,000,000≤M	1,000.00 元/笔	-
申购费 (前收费)	M<1,000,000	1.20%	-
	1,000,000≤M<5,000,000	0.80%	-
	5,000,000≤M	1,000.00 元/笔	-
赎回费	N<7 天	1.50%	100%归入基金资产
	7 天≤N<30 天	0.75%	100%归入基金资产
	30 天≤N<180 天	0.50%	30 天≤N<90 天, 75% 归入基金资产; 90 天 ≤N<180 天, 50% 归入基金资产;
	180 天≤N<365 天	0.10%	25%归入基金财产
	N≥365 天	0.00%	-

注:投资人重复认/申购,须按每次认/申购所对应的费率档次分别计费。

认/申购费用由认/申购人承担,不列入基金资产,认/申购费用用于本基金的市场推广、注册登记和销售。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

本基金针对养老金客户的相关费率政策及在销售机构开展的费率优惠活动,详见本基金招募说明书或销售机构的公告。

(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
------	----------

管理费	0.80%
托管费	0.10%
其他费用	标的指数许可使用费、会计师费、律师费、信息披露费等

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。

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。

一) 本基金投资运作过程中面临的主要风险有:

1、市场风险;2、管理风险;3、职业道德风险;4、流动性风险;5、合规性风险;6、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;7、税负增加风险;8、其他风险。

二) 本基金的特定风险

(1) 与标的指数偏离风险

本基金的运作目标是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%。但由于以下原因可能造成两者间偏离度增加的风险:

1) 标的指数成份股的调整以及指数计算方法的变更;

2) 受到最低买入股数的限制,基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同;

3) 当基金投资组合中按基准权重投资的资产类别或单个证券超过规定比例限制时进行的被动性卖出调整;因债券投资比例限制,在债券或股票资产净值变动较大时造成的被动仓位调整;

4) 基金持有股票/债券的增发、分红送配造成基金组合的比例变动;

5) 标的指数成份股中停牌、摘牌等突发因素;

6) 基金买卖股票时产生的交易冲击成本;

7) 申购赎回资金变动带来的跟踪误差增加;

8) 基金资产中需扣除管理费用和托管费用;

9) 标的指数选择所带来的系统性风险。

(2) 基金价格变动风险

本基金为指数增强型基金,原则上将以基金资产中 80%-95%比例投资于股票,因此,本基金因股票资产投资比例较大,当所追踪的标的指数因市场原因出现大幅下跌时,会造成基金份额净值的相应下跌,产生跌破基金发行价的风险。

(3) 股指期货特有的风险

1、杠杆风险;2、基差风险;3、股指期货展期时的流动性风险;4、期货盯视结算制度带来的现金管理风险;5、到期日风险;6、对手方风险;7、连带风险;8、未平仓合约不能继续持有风险。

(4) 资产支持证券投资风险

资产支持证券的风险主要包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险等。

(5) 国债期货的投资风险

国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。

(二) 重要提示

安信中证 500 指数增强型证券投资基金的募集申请于 2018 年 3 月 16 日经中国证监会证监许可[2018]490 号文注册。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证

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。

除监管规定信息发生重大变更外，基金管理人每年更新一次资料概要。因此，本文件内容可能存在一定的滞后性，敬请投资者同时关注基金管理人发布的临时公告。

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，如经友好协商未能解决的，则任何一方有权将争议提交华南国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为深圳市，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁。

五、其他资料查询方式

以下资料详见安信基金官方网站 [www.essencefund.com] [客服电话：4008-088-088]

- 1、《安信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》、
《安信中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》、
《安信中证 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