

# 易方达中证500指数量化增强型证券投资基金（易方达中证500量化增强A）基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月21日

送出日期：2024年6月24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	易方达中证 500 量化增强	基金代码	012080
下属基金简称	易方达中证 500 量化增强 A	下属基金代码	012080
基金管理人	易方达基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2021-06-15		
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	官泽帆	开始担任本基金基金经理的日期	2021-06-15
		证券从业日期	2010-09-01
	刘文贵	开始担任本基金基金经理的日期	2023-11-09
		证券从业日期	2012-07-02

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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（含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通股票”）、债券、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可以将其纳入投资范围。 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为80%-95%；投资于标的指数（中证500指数）成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终，扣除股指期货、

股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

### 主要投资策略

本基金属于指数增强型股票基金,力求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%;同时通过量化策略进行投资组合管理,力争实现超越业绩比较基准的投资回报,谋求基金资产的长期增值。股票投资方面,本基金指数化投资以标的指数的构成为基础,通过对各成份股权重偏离的控制,实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型预测股票超额回报,在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合,其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主,同时适当投资于非成份股,并根据定量投资模型在全市场优先选择综合评估较高的股票,对投资组合构成及权重进行优化调整。债券投资方面,本基金将密切跟踪市场动态变化,选择合适的介入机会,并通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择等方面进行积极主动的债券投资管理。

### 业绩比较基准

中证500指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%

### 风险收益特征

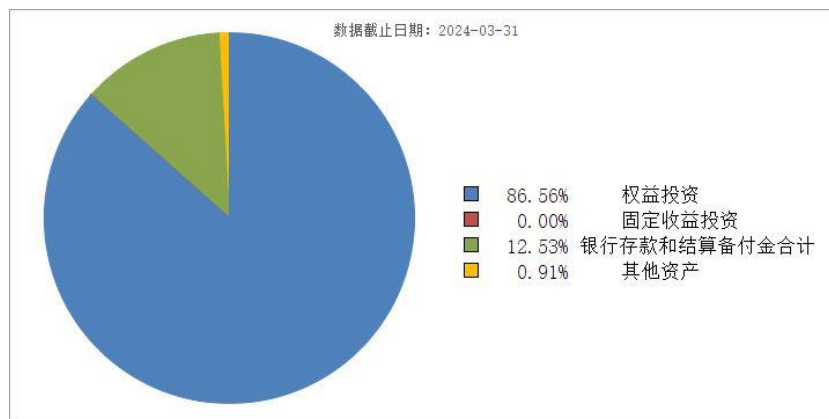
本基金为股票基金,理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上,力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看,本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。

本基金可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,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书“风险揭示”部分。

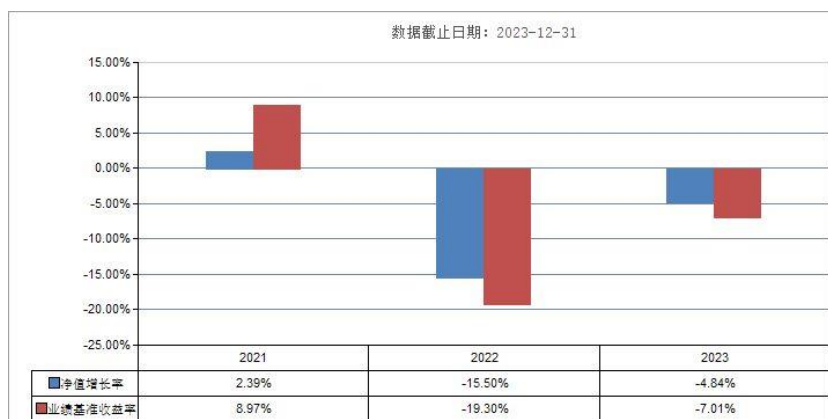
注:投资者可阅读《招募说明书》基金的投资章节了解详细情况。

### (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

#### 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及与同期业绩比较基准的比较图



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
申购费 (前 收费)	M < 100 万元	0.15%	通过本公司直销中心申 购的全国社会保障基 金、依法设立的基本养 老保险基金、依法制定 的企业年金计划筹集的 资金及其投资运营收益 形成的企业补充养老保 险基金 (包括企业年金 单一计划以及集合计 划) 可以投资基金的其 他社会保险基金、以及 依法登记、认定的慈善 组织；将来出现的可以 投资基金的住房公积 金、享受税收优惠的个 人养老账户、经养老基 金监管部门认可的新的 养老基金类型
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.12%	同上
	M ≥ 500 万元	按笔收 取, 100 元/笔	同上
	M < 100 万元	1.5%	其他投资者
	100 万元 ≤ M < 500 万元	1.2%	同上
	M ≥ 500 万元	按笔 收取, 1,000 元/ 笔	同上

	0天 < N ≤ 6天	1.50%
	7天 ≤ N ≤ 29天	0.75%
	30天 ≤ N ≤ 89天	0.50%
<b>赎回费</b>	90天 ≤ N ≤ 179天	0.50%
	180天 ≤ N ≤ 364天	0.50%
	365天 ≤ N ≤ 729天	0.25%
	N ≥ 730天	0.00%

注：如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

## (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 0.80%	基金管理人、销售机构
托管费	年费率 0.15%	基金托管人
审计费用	年费用金额 60,000.00 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
其他费用	详见招募说明书的基金费用与税收章节。	

注：1.上表中年费用金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

2.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。

## (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：

基金运作综合费率（年化）
0.99%

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化）。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。

## 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。

投资本基金可能遇到的特有风险包括：(1) 与指数化投资相关的特定风险（包括标的指数波动的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、成份股停牌的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数编制方案带来的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险等）；(2) 采用量化增强策略进行投资管理可能引致的特定风险（包括量化增强策略的风险、数据错误风险、模型风险）；(3) 通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于港股通股票的风险；(4) 本基金投资范围包括股指期货、股票期权等金融衍生品以及资产支持证券等特殊品种而面临的其他额外风险；(5) 本基金的投资范围包括存托凭证，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；(6) 参与转融通证券出借业务的风险。此外，本基金还将面临市场风险、流动性风险（包括但不限于特定投资标的流动性较差风险、巨额赎回风险、启用摆动定价或侧袋机制等流动性风险管理工具带来的风险等）、管理风险、税收风险、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险等其他一般风险。

## **(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投资价值、市场前景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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资者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。**各方当事人因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议应尽量通过协商、调解途径解决，如经友好协商未能解决的最终将通过仲裁方式处理，详见《基金合同》。**

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.efunds.com.cn](http://www.efunds.com.cn)][客服电话:4008818088]

- 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