

前海开源中证500等权重 交易型开放式指数证券投资基金

发行档期：10月28日-11月08日

认购代码：515593

跟踪标的——中证500等权重指数

- 中证500等权重指数与中证500指数拥有相同的成份股，综合反映中国A股市场中一批**中小市值公司**的股票价格表现，采用**等权重加权**。
- 中证500等权重成份股选取标准：
 - 1、去头：全部A股中剔除沪深300指数成份股及总市值排名前300名的股票
 - 2、掐尾：将剩余股票按照最近一年（新股为上市以来）的最近一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的股票；
 - 3、将剩余股票按照最近一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前500名的股票组成中证500指数样本股。

指数简称	指数代码	成份股总市值 (亿)	PE (TTM)	PB	成份股只数
500等权	000982.SH	81932	25.27	1.87	500

来源：Wind，截至20190918 过往数据不代表未来表现 基金投资需谨慎

中盘成长风格 行业覆盖新经济和成长

- 中证500等权重指数成份股行业覆盖面广，主要覆盖医药生物、电子、化工、传媒等成长新经济行业，市值偏中小盘，成长属性突出。

表：中证500等权重指数成份股行业分布

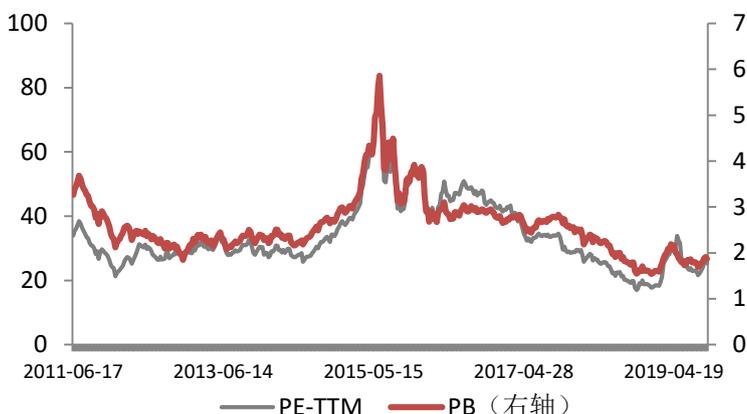
排序	申万一级行业	成份股数量	排序	申万一级行业	成份股数量
1	医药生物	48	11	汽车	20
2	电子	39	12	商业贸易	19
3	化工	32	13	有色金属	18
4	传媒	31	14	非银金融	16
5	电气设备	26	15	钢铁	16
6	房地产	26	16	食品饮料	14
7	计算机	26	17	采掘	13
8	公用事业	25	18	建筑装饰	12
9	机械设备	23	19	通信	12
10	交通运输	22	20	国防军工	11

表：中证500等权重指数成份股总市值分布

总市值	成份股数量
小于100亿	123
100-199亿	248
200-299亿	94
300-399亿	24
400-499亿	6
500亿以上	5

来源：Wind，截至20190918 过往数据不代表未来表现 基金投资需谨慎

低估值高成长 等权重表现更优



- **估值低位**：从历史数据来看，中证500等权重指数PE的中位数为30.43，而当前市盈率仅为**25.27**，**低于历史中位数水平**。
- **等权重更优**：从历史表现来看，自2005年初至2019年9月18日，中证500等权重指数涨幅为**511.71%**，中证500指数涨幅仅为**415.82%**，中证500等权重指数表现更优。

拟任基金经理：陶曙斌



- 工作经历：3年审计业工作经验，10年基金业工作经验。
- 教育背景：中山大学管理学学士，北京大学经济学硕士。
- 2005年6月加盟德勤会计师事务所，担任审计员、项目经理；
- 2008年4月加盟南方基金管理有限公司，担任运作保障部高级经理、ETF业务主管。
- 2016年1月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司量化投资部副总监。
- 对（沪\深\单\跨）ETF、QDII ETF、沪港通ETF、RQFII ETF等各种ETF业务形态有深厚的投资运营背景。先后负责基金业内多种类型首只ETF产品的投资开发运营工作。

产品名片

基金全称	前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金	认购代码	515593
基金类型	被动指数型基金	发行日期	10月28日-11月08日
基金管理人	前海开源基金管理有限公司	基金托管人	中国银河证券股份有限公司
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。		
投资范围及比例	本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、政府支持机构债券、政府支持债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。 在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。 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。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证500等权重指数。		
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。		

产品费率

费用项	单笔金额M (元) (含认购费)	认购费率
认购费率	M < 50万份	0.80%
	50万份 ≤ M < 100万份	0.50%
	M ≥ 100万份	每笔1000元
管理费率	0.15% (年)	
托管费率	0.05% (年)	
指数许可使用费	0.03% (年)	

注：基金管理人办理网下现金认购按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构，按照不高于0.80%的标准收取一定的佣金。

网下股票认购以单只股票股数申报，用于认购的股票必须是标的指数成份股和已公告的备选成份股（具体名单以发售公告为准）。单只股票最低认购申报股数为1,000股，超过1,000股的部分须为100股的整数倍。投资人应以A股账户认购，可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。