

# 建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金(A 类份额)

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2026 年 6 月 8 日

送出日期：2026 年 6 月 26 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	建信中证 500 指数量化增强	基金代码	016267
下属基金简称	建信中证 500 指数量化增强发起 A	下属基金交易代码	016267
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	基金托管人	交通银行股份有限公司
基金合同生效日	2022 年 12 月 23 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	刘明辉	开始担任本基金基金经理的日期	2022 年 12 月 23 日
		证券从业日期	2015 年 7 月 16 日
基金经理	叶乐天	开始担任本基金基金经理的日期	2022 年 12 月 23 日
		证券从业日期	2008 年 5 月 12 日
其他	基金合同生效满三年后的对应日，若本基金资产净值低于两亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。 基金合同生效后继续存续的，基金存续期内，若连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，本基金将自动进行基金财产清算并终止，而无需召开基金份额持有人大会。		

### 二、基金投资与净值表现

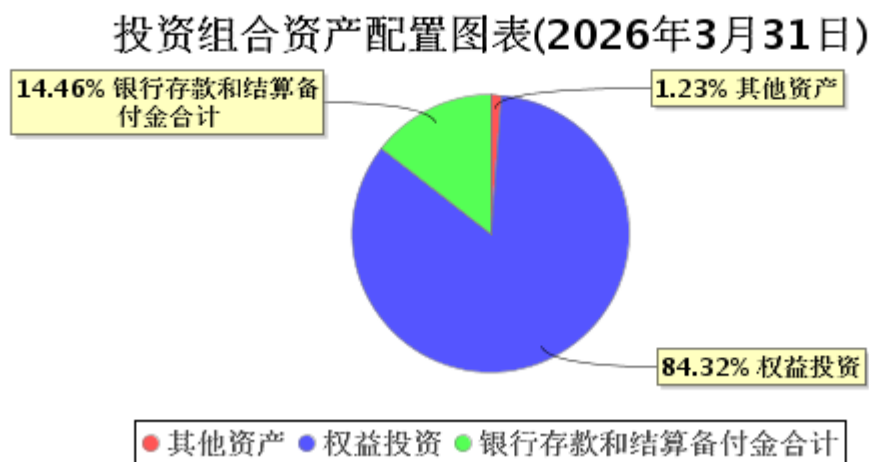
#### (一) 投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》请投资者阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况 了解详细情况

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
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（包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券（含超短期融资券）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、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相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参

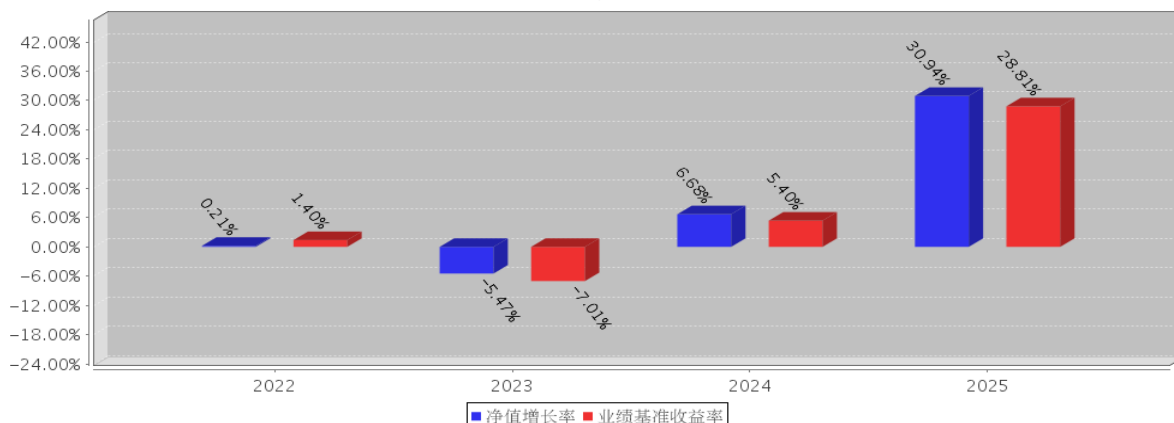
	<p>与融资及转融通证券出借业务。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
主要投资策略	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以标的指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，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%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。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，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	<p>本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



## (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

建信中证500指数量化增强发起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（2025年12月31日）



注：基金的过往业绩不代表未来表现。基金合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

### 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	
认购费	M < 100 万元	1.0%	-
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.6%	-
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%	-
	M ≥ 500 万元	1,000 元	每笔
申购费 (前收费)	M < 100 万元	1.20%	-
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.80%	-
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.4%	-
	M ≥ 500 万元	1,000 元	每笔
赎回费	N < 7 日	1.5%	-
	7 日 ≤ N < 30 日	0.5%	-
	N ≥ 30	0	-

#### (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	1.00%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	22,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊
其他费	本基金其他费用详见本基金合同或招募说明书	相关服务机构

用	费用章节。	
---	-------	--

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、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：

建信中证 500 指数量化增强发起 A

基金运作综合费率（年化）
1.23%

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。

#### 1、被动跟踪指数的风险

##### （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。标的指数成份股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）替代投资风险

在某些情况下（包括指数成份股投资受限制、市场流动性不足等）导致本基金无法投资或者获得足够数量的某种或几种股票时，基金管理人将运用替代投资策略，如买入同行业指数成份股、备选成份股或非成份股等，力求降低基金跟踪偏离度，但无法消除由此引起的基金收益率与业绩比较基准之间的偏离及相应的风险。

##### （3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

#### 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、以及投资股指期货进行套期保值等。这种基于对宏观面、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。

本基金采用量化模型构造股票投资组合，但并不基于量化策略进行频繁交易。本基金投资过程中多个环节将依赖于量化模型，存在量化模型失效导致基金业绩表现不佳的风险。

3、本基金可能遇到的风险还包括在套期保值过程中有可能出现的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、转融通证券出借风险、投资资产支持证券风险、投资存托凭证的风险、股票期权投资风险、国债期货投资风险、参与融资交易风险、投资港股通标的股票的风险、作为发起式基金存在的风险、《基金合同》自动终止风险等。

### （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官方网站 [www.ccbfund.cn] [客服电话：400-81-95533]

- 基金合同、托管协议、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