中金中证 500ESG 基准指数增强型证券投资基金（C 类份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2026 年 11 月 2 日

送出日期：2026 年 11 月 6 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	中金中证 500ESG 指数增强	**基金代码**	016680
下属基金简称	中金中证 500ESG 指数增强 C	**下属基金交易代码**	016681
基金管理人	中金基金管理有限公司	**基金托管人**	宁波银行股份有限公司
基金合同生效日	2022 年 10 月 25 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	王家列	**开始担任本基金基金经理的日期**	2024 年 12 月 27 日
		证券从业日期	2016 年 07 月 08 日

二、基金投资与净值表现

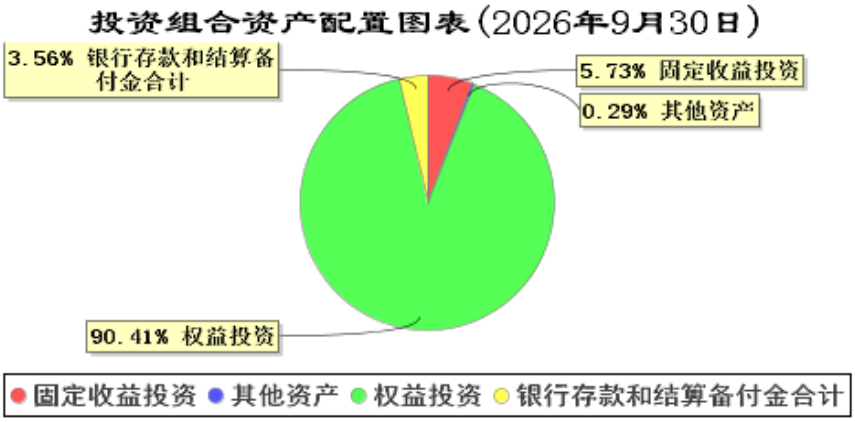
(一) 投资目标与投资策略

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	标的指数：中证 500ESG 基准指数 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、创业板及其他经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、地方政府债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、股票期权、国债期货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）。 本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。 基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例不低于 80%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 20%）；投资于标的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，现金或到期日在一年以内的政府债券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。

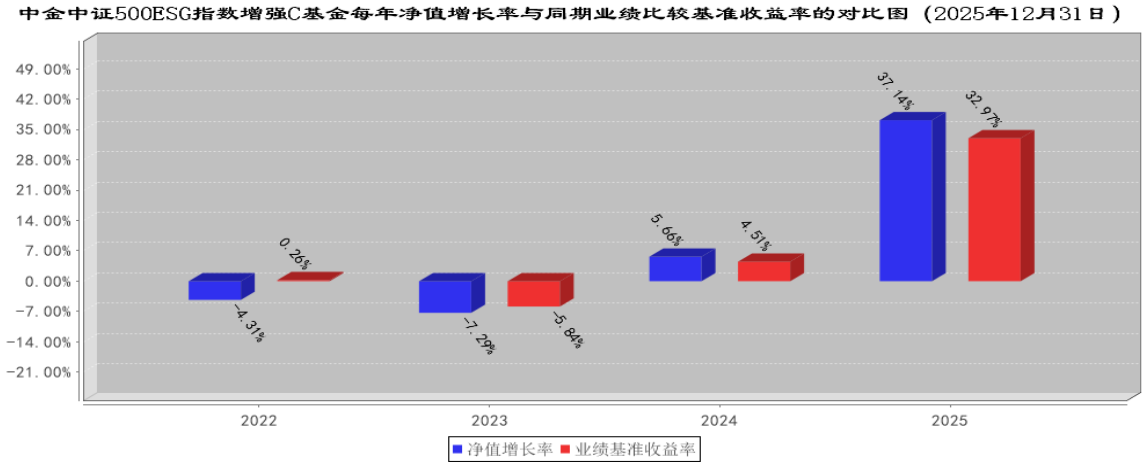
主要投资策略	本基金主要的股票投资策略为标的指数投资策略，通过复制目标股票指数作为基本投资组合，然后通过量化增强策略考虑基本面与技术面等多种因素，找出具有相对于标的指数超额收益的相关量化因子，并根据因子对应的股票权重调整基本投资组合，最后对投资组合进行跟踪误差以及交易成本等相关优化，力争在控制风险的基础上实现超越目标指数的相对收益。具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、可转债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货、国债期货及股票期权的投资策略；7、转融通投资策略；8、融资投资策略；9、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 500ESG 基准指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，其预期的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，力争实现超越业绩比较基准的业绩表现。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 本基金可投资港股通标的股票，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。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

注：详见《中金中证 500ESG 基准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



(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：业绩表现截止日期 2025 年 12 月 31 日。基金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
申购费（前收费）	本基金 C 类份额无申购费	
赎回费	N＜7 日	1.50%
	N≥7 日	0.00%

(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	0.80%	基金管理人和销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
销售服务费	0.40%	销售机构
审计费用	0.00 元	会计师事务所
信息披露费	0.00 元	规定披露报刊
其他费用	费用的计算方式及支付方式详见招募说明书及相关公告	

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生金额从基金资产扣除。审计费用、信息披露费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:

中金中证 500ESG 指数增强 C

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	1.35%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务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。

投资于本基金的主要风险有:

1、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）债券收益率曲线风险；（5）上市公司经营风险；（6）购买力风险；（7）再投资风险；（8）债券回购风险；2、信用风险；3、流动性风险；4、管理风险；5、估值风险；6、操作及技术风险；7、合规性风险；8、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；9、其他风险；

10、本基金特有风险：（1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险；（2）标的指数波动的风险；（3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险；（4）标的指数变更的风险；（5）主动增强投资的风险；（6）跟踪误差控制未达约定目标的风险；（7）成份股停牌的风险；（8）成份股退市的风险；（9）

指数编制机构停止服务的风险；（10）港股通机制下，港股投资的风险；（11）期货投资风险；（12）资产支持证券投资风险；（13）期权投资风险；（14）流动性受限证券投资风险；（15）转融通证券出借业务风险；（16）参与融资业务的风险；（17）存托凭证投资风险；（18）证券公司短期公司债券投资风险；（19）投资北京证券交易所股票的风险；（20）启用侧袋机制的风险。

(二) 重要提示

本基金的募集申请于2022年8月23日经中国证监会证监许可[2022]1924号《关于准予中金中证500ESG基准指数增强型证券投资基金注册的批复》注册。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。

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临时相关公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：www.ciccfund.com，客服电话：400-868-1166

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

六、其他情况说明

无。