

联博中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）

基金产品资料概要

编制日期：2025 年 11 月 12 日

送出日期：2025 年 11 月 13 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	联博中证 500 指数增强	基金代码	026059
下属基金简称	联博中证 500 指数增强 A	下属基金代码	026059
基金管理人	联博基金管理有限公司	基金托管人	交通银行股份有限公司
基金合同生效日	-	基金类型	股票型
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
交易币种	人民币		
基金经理	朱良	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2003 年 11 月 15 日
	杨光	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2017 年 06 月 07 日
其他	《基金合同》生效后，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，基金管理人应当终止基金合同，本基金按照《基金合同》的约定进入清算程序并终止，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》第九章了解详细情况。

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，实现超越业绩比较基准的投资收益，力求基金资产的长期增值。
投资范围	本基金的标的指数为中证 500 指数。
	本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金还可投资于部分非成份股（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括

协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、信用衍生品、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。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金为指数增强型基金，以中证 500 指数为标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获取高于标的指数的投资收益。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.50%，年化跟踪误差不超过 8%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度、年化跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

主要投资策略

- 1、股票投资策略：（1）指数投资策略。（2）指数增强策略。（3）本基金可通过港股通机制投资于香港股票市场，本基金将通过自下而上的方法，精选出具有投资价值的优质标的。（4）本基金可根据法律法规和监管机构的要求投资存托凭证，将通过深度的基本面研究与量化分析，挑选长期盈利能力遭低估、并具备正向催化剂的公司所发行的存托凭证进行投资。
- 2、债券投资策略
- 3、衍生产品投资策略
- 4、资产支持证券投资策略
- 5、参与融资和转融通证券出借业务的投资策略

业绩比较基准

中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征

本基金为股票型指数增强基金，其预期风险与收益理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
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。

(二) 投资组合资产配置图表

无

(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

无

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：

联博中证 500 指数增强 A：

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<100 万元	1.00%	非养老金客户

申购费（前收费）	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.60%	非养老金客户
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔	非养老金客户
	M < 100 万元	0.10%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.06%	养老金客户
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔	养老金客户
	M < 100 万元	1.20%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%	非养老金客户
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔	非养老金客户
	M < 100 万元	0.12%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.08%	养老金客户
M ≥ 500 万元	1000 元/笔	养老金客户	
赎回费	N < 7 天	1.50%	100% 归入基金财产
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%	100% 归入基金财产
	30 天 ≤ N < 180 天	0.50%	100% 归入基金财产
	N ≥ 180 天	0.00%	-

注：上述适用差别化费率的养老金客户是指通过基金管理人直销中心认购或申购 A 类基金份额的养老金客户。

（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
审计费用	-	会计师事务所
信息披露费	-	规定披露报刊
其他费用	按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。	相关服务机构

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。

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风险包括：市场风险、流动性风险、特有风险、管理风险、合规性风险、操作或技术风险、交易对手风险、基金财产投资运营过程中的增值税、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、其他风险等。

本基金特有风险如下：

（1）本基金为指数增强基金，主要策略为跟踪标的指数并选择性进行增强投资，可能存在策略失效，无法战胜指数收益的风险。根据本基金的投资策略，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。这种使用数量化模型进行个股的选择以及权重的优化的投资策略，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。

（2）标的指数的风险：1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险。2）标的指数波动的风险。3）标的指数变更的风险。

（3）跟踪误差控制未达约定目标的风险：1）本基金作为指数增强型基金，以跟踪标的指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。基金投资组合与标的指数构成可能存在差异，从而可能导致基金实际收益率与标的指数收益率产生偏离。2）由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。3）由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。4）成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。5）由于成份股停牌或流动性差等原因使基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。6）由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。7）在基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金的收益产生影响，从而影响基金对标的指数的跟踪程度。8）其他因素产生的偏离。

（4）指数编制机构停止服务的风险：本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，如指数编制机构停止服务，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

（5）成份股停牌的风险：本基金的标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，从而使基金的部分资产无法变现或出现大幅折价，存在对基金净值产生冲击的风险，且基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

（6）股指期货投资风险：本基金可投资股指期货，股指期货的投资可能面临市场风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

（7）国债期货投资风险：本基金可投资国债期货，国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险、交易对手风险等。

（8）股票期权投资风险：本基金可投资股票期权，股票期权的风险主要包括市场风险、行权风险、流动性风险、时间价值风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

（9）信用衍生品投资风险：本基金可能投资于信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险。

（10）存托凭证投资风险：本基金可投资存托凭证，除普通股票投资可能面临的宏观经济风险、政

策风险、市场风险、流动性风险外，投资存托凭证可能还会面临以下风险：1）存托凭证持有人与持有基础股票的股东在法律地位享有权利等方面存在差异可能引发的风险。2）发行人采用协议控制架构的风险。3）增发基础证券可能导致的存托凭证持有人权益被摊薄的风险。4）交易机制相关风险。5）存托凭证退市风险。6）汇率风险。7）其它风险。

（11）新股投资风险：本基金可参与股票申购，由于股票发行政策、发行机制等影响新股发行的因素变动，将影响本基金的资产配置，从而影响本基金的风险收益水平。另外，发行股票的配售比例、中签率的不确定性，或其他发售方式的不确定性，也可能使本基金面临更多的不确定因素。

（12）流动受限证券投资风险：本基金可投资流通受限证券。由于流通受限证券具有一定的锁定期限，在此期间无法转让变现，因此可能对基金的流动性造成一定的负面影响；受证券市场不可控因素的影响，流通受限证券在可流通后可能发生亏损的风险。

（13）资产支持证券投资风险：本基金可投资资产支持证券，资产支持证券在国内市场尚处发展初期，具有低流动性、高收益的特征，并存在一定的投资风险。

（14）参与融资业务相关风险：本基金可根据法律法规的规定和基金合同的约定参与融资业务，参与融资交易的风险主要包括流动性风险、信用风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

（15）参与转融通证券出借业务相关风险：本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与转融通证券出借业务，可能存在转融通证券出借业务特有风险，包括但不限于以下风险：1）流动性风险。2）信用风险。3）市场风险。

（16）科创板股票投资风险：本基金的投资范围包括科创板股票，如投资，将面临科创板股票相关的特有风险，包括但不限于：1）市场风险。2）股价大幅波动风险。3）流动性风险。4）退市风险。5）系统性风险。6）集中度风险。7）政策及监管规则变化的风险。

（17）北京证券交易所上市股票投资风险：北京证券交易所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异，本基金如投资，则须承受与之相关的特有风险。包括：1）中小企业经营风险。2）股价波动风险。3）流动性风险。4）集中度风险。5）转板风险。6）退市风险。7）由于存在表决权差异安排可能引发的风险。8）监管规则变化的风险。

（18）港股通标的股票投资风险：本基金可通过“港股通”投资于香港市场，在市场环境、市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策、市场制度等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。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。香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，此外，在港股通下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：1）股价较大波动的风险。2）只有内地和香港两地均为交易日的日期才为港股通交易日，在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险。3）无法进行交易的风险。4）港股通制度下对公司行为的处理规则带来的风险。5）代理投票。6）汇率风险。7）资产分配。8）港股通额度限制。

（19）《基金合同》自动终止的风险：《基金合同》生效后，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，基金管理人应当终止《基金合同》，本基金按照《基金合同》的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会。因此投资者可能面临《基金合同》自动终止的风险。

（20）证券经纪商交易结算模式的风险：本基金采用证券经纪商交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经营机构进行场内交易和结算，该种交易结算模式可能存在操作风险、资金使用效率降低的风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险、无法完成当日估值等风险。

（21）受到强制赎回等相应措施的风险：出于反洗钱、非居民金融账户涉税信息尽职调查与信息报送等相关的合规要求，本基金基金管理人有权对可购买本基金的投资者资质予以规定并不时调整，

如已持有本基金基金份额，但不再满足本基金的投资者资质要求或基金合同约定的其他条件或出现基金合同约定情形的，基金管理人有权依据基金合同的约定对相应基金份额予以强制赎回或采取其他相应控制措施。因而，基金投资人或基金份额持有人面临基金份额可能按照基金合同的约定被强制赎回、追加认购/申购被拒绝、因违反法律法规承担相应法律责任等风险。

（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。

各方当事人同意，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，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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。

基金管理人深知个人信息对投资者的重要性，致力于投资者个人信息的保护。基金管理人承诺按照法律法规和相关监管要求的规定处理投资者的个人信息，包括通过基金管理人直销、销售机构或场内经纪机构购买联博基金管理有限公司旗下基金产品的所有个人投资者。基金管理人需处理的机构投资者信息中可能涉及其法定代表人、高级管理人员、受益所有人、经办人等个人信息，也将遵守上述承诺进行处理。

详情请关注基金合同第七部分“基金合同当事人及权利义务”的相关内容及基金管理人官方网站（www.alliancebernstein.com.cn）不时披露的个人信息处理相关政策。

基金管理人有权对可购买本基金的投资者资质予以规定并不时调整，详情请关注《联博基金管理有限公司开放式基金(登记)业务规则》及基金管理人于公司网站披露的相关规则，以及基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资者知悉并接受基金管理人为订立、履行基金合同所必需、为提供产品或服务所必需或为履行国家法律法规及行业主管部门有关规定的义务或职责(包括但不限于反洗钱客户尽职调查、非居民金融账户涉税信息尽职调查)，在遵守法律法规的前提下及在必要的情况下，可向相关接收方(包括但不限于会计师事务所、律师事务所、份额登记机构等第三方服务机构)提供个人信息。如您对前述安排有异议或需要更多信息方可作出购买本基金的决定，请先联系基金管理人或基金销售机构。基金投资者依据《基金合同》、《招募说明书》的规定提交本基金的认购/申购申请，即表示基金投资者自愿接受上述安排。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见本基金管理人网站 网址：www.alliancebernstein.com.cn

客服电话：400-001-1300

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

六、 其他情况说明
无