

中信建投中证500指数增强型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2024年05月15日

送出日期：2024年05月22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	中信建投中证500增强	基金代码	006440
基金简称A	中信建投中证500增强A	基金代码A	006440
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	基金托管人	中信证券股份有限公司
基金合同生效日	2020年05月09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	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
王鹏	2020年05月09日		2015年01月22日

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

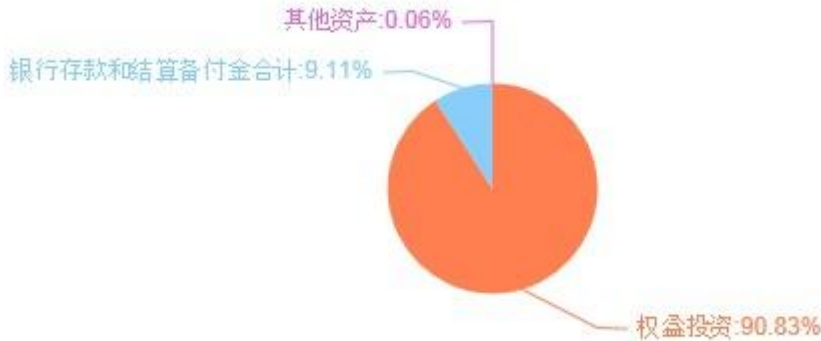
投资者可阅读本基金招募说明书的“基金的投资”章节了解详细情况。

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。
投资范围	<p>本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票（含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券）、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、通知存款等）、货币市场工具、股指期货、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）。</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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。</p> <p>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不低于90%，</p>

	<p>投资于标的指数成份股及备选成份股的比例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合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保持的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或投资于到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。</p> <p>如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
主要投资策略	<p>本基金为指数增强型基金，以中证500指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。</p> <p>指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，实现超额收益。</p>
业绩比较基准	<p>中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>

(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024年03月31日



(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：基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日。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	1.00%	金额申购，单位：元
	100万≤M<500万	0.60%	金额申购，单位：元
	M≥500万	1000.00元/笔	金额申购，单位：元
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	0.75%	
	30天≤N<180天	0.50%	
	N≥180天	0.00%	

注：本基金A类基金份额对持续持有期少于30天的基金份额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于或等于30天但少于3个月（1个月按30天计算）的基金份额持有人收取的赎回费，不低于赎回费总额的75%将计入基金财产；对持续持有期长于或等于3个月但少于6个月的基金份

额持有人收取的赎回费，不低于赎回费总额的50%将计入基金财产。赎回费中未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

## （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	0.75%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	50,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
指数许可使用费	0.016%，年下限金额：200,000.00	指数编制公司
其他费用	详见本基金招募说明书“基金费用与税收”章节	

注：1、年费金额单位：元。

2、标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元（基金合同生效之日所在季度的标的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，标的指数使用许可费收取下限为每季度5万元，即不足5万元时按照5万元收取，指数许可使用协议终止日所在季度的标的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限）。

3、审计费、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。

4、本基金交易证券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）
0.93%

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。

投资者须了解并承受市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、本基金特有风险及其他风险。

本基金特有风险包括：

- 1、基金投资组合收益率与标的指数收益率偏离的风险；
- 2、基金投资组合收益率与股票市场平均收益率偏离的风险；

- 3、跟踪误差控制未达约定目标的风险；
- 4、指数编制机构停止服务的风险；
- 5、成份股停牌的风险；
- 6、量化选股模型失效的风险；
- 7、股指期货投资风险；
- 8、国债期货投资风险；
- 9、资产支持证券投资风险；
- 10、证券公司短期公司债券投资风险；
- 11、存托凭证投资风险。

## （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。

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，应提交北京仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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、定期报告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：[www.cfund108.com](http://www.cfund108.com)][客服电话：4009-108-108]

- 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。