

交银施罗德中证 A500 指数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：2026-03-21

送出日期：2026-03-25

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	交银中证 A500 指数增强发起 A	基金代码	026736
基金管理人	交银施罗德基 金管理有限公 司	基金托管人	中国工商银行股份 有限公司
基金合同生效日	2026-02-10		
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	邵文婷	开始担任本基金基金经理的日期	2026-02-10
		证券从业日期	2016-01-25
基金经理	杨彦煜	开始担任本基金基金经理的日期	2026-03-21
		证券从业日期	2016-07-11
其他	<p>《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 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的方式延续《基金合同》期限。若届时有效的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>《基金合同》生效三年后继续存续的，基金存续期内，连续 20 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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。</p>		

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力争对中证 A500 指数进行有效跟踪的基础上，对基金投资组合进行相对增强，追求超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
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，包括中证 A500 指数的成份股（含存托凭证）及备选成份股（含存托凭证）、其他股票（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、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超

短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指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)。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下,本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。

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。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票(含存托凭证)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占股票资产的0%-50%;投资于中证A500指数成份股(含存托凭证)及备选成份股(含存托凭证)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需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。

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。

本基金标的指数为中证A500指数。

主要投资策略

本基金为股票指数增强型基金,在力争对中证A500指数进行有效跟踪的基础上,对基金投资组合进行相对增强,追求超越业绩比较基准的投资回报,谋求基金资产的长期增值。在正常市场情况下,力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过8%。

1、股票投资策略;2、债券投资策略;3、股指期货投资策略;4、资产支持证券投资策略;5、融资、转融通证券出借业务投资策略。

业绩比较基准

中证A500指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征

本基金是一只股票型基金,其预期风险和预期收益理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

本基金为股票指数增强型基金,主要投资于标的指数成份股及备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金可投资港股通标的股票,会面临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。

注:详见《交银施罗德中证A500指数增强型发起式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

无。

(三)自基金合同生效以来/最近十年(孰短)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:

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 < 1000 万元	0.3%	
	1000 万元 ≤ M	1000 元/每笔	
申购费(前收费)	M < 1000 万元	0.3%	
	1000 万元 ≤ M	1000 元/每笔	
赎回费	N < 7 天	1.5%	个人投资者
	7 天 ≤ N	0%	个人投资者

N < 7 天	1.5%	机构投资者
7 天 ≤ N < 30 天	1.0%	机构投资者
30 天 ≤ N < 180 天	0.5%	机构投资者
180 天 ≤ N	0%	机构投资者

注：1、通过直销机构认购/申购的 A 类基金份额，不收取认购/申购费用。2、本基金对持续持有期少于 7 日的投资人收取 1.5% 的赎回费，请投资人予以关注。3、销售机构若有其他费率优惠请见基金管理人或其他销售机构的有关公告或通知。

（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	-	销售机构
审计费用	-	会计师事务所
信息披露费	-	规定披露报刊
指数许可使用费	-	指数编制公司
其他费用	详见本基金招募说明书“基金的费用与税收”部分	

注：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。

（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：

基金运作综合费率（年化）

-

注：本基金尚未披露基金年报，暂不披露该内容。

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。

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

1、市场风险

（1）政策风险、（2）经济周期风险、（3）利率风险、（4）上市公司经营风险、（5）购买力风险

2、管理风险

3、流动性风险

4、信用风险

5、本基金的特有风险

（1）本基金为股票指数增强型基金，投资于股票（含存托凭证）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占股票资产的 0%-50%；投资于中证 A500 指数成份股（含存托凭证）及备选成份股（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%，因投资权益类资产而面临权益类资产市场的系统性风险和个股风险

（2）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、（3）标的指数波动的风险、（4）基金投资组合回报与标的指数回报偏离及跟踪误差控制未达约定目标的风险、（5）指数编制机构停止服务的风险、（6）成份股停牌或退市的风险

（7）本基金可投资创业板股票，创业板个股上市后的前五个交易日不设价格涨跌幅限制，第六个交易日开始涨跌幅限制比例为 20%

（8）投资港股通标的股票的特定风险

本基金可投资港股通标的的股票，会面临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

的联接基金。该联接基金将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的的指数的 ETF。该联接基金具体投资范围及比例等将依据届时有效的法律法规或监管机构要求确定。以上变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，但不需召开基金份额持有人大会审议。因此，本基金存在自动转型的风险。

6、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

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概括性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资者在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

7、其他风险

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的核准或注册，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，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。基金合同可在基金管理人网站（www.fund001.com）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund/index.html>）获取，请阅读本基金法律文件后再进行认/申购等交易。

销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

▲ ▲ 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，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按其届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。

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

以下资料详见交银施罗德基金官方网站[www.fund001.com] [客服电话：400-700-5000]

- 《交银施罗德中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》、
- 《交银施罗德中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》、
- 《交银施罗德中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》
- 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。