BlackRock
贝莱德

AI赋能智选成长

贝莱德中证500指数增强型证券投资基金

基金代码：021043（A类）021044（C类）

9月3日起重磅首发

均衡布局新兴赛道 攻守兼备潜力突出

该指数行业分布均衡分散，聚焦新产业成长赛道，能被规模投资者长期看与新兴产业快速发展带来的机遇，与大盘指数形成一定互补，配置价值凸显。同时，该指数前10大权重成分股集中度相对较低，仅占总比例6.64%。能有效分散单一股票风险。

成分行业权重占比

成长弹性与稳健兼备，具备投资性价比

中证500指数展现出强劲的弹性并展示一定的稳定性。近3年的波动回报显著低于同期沪深300指数。创业板指数近3年波动率高达17.34%，中证500年均任于创业板指数，中证1000指数等偏成长风格的指数，相较于这三大宽基指数，中证500指数同期的风险调整后收益更高。

	波动率	年化波动率	年化夏普比率
沪深300	9.62%	33.33%	0.0013
创业板指	-34.7%	29.12%	-0.092
中证1000	1.02%	24.94%	-0.047
沪深300	6.70%	17.34%	0.002

数据来源：Wind，贝莱德整理，2015.1.5-2025.9.3，年化波动率和年化夏普比率为日频数据计算，年化夏普比率计算时，无风险利率为1.5%

A股开启“慢牛”行情，估值具备相对优势

当前中证500指数的估值优势突出。Wind 数据显示，截至9月8日22日，中证500指数市盈率为28.52倍，相较于沪深300指数的中证1000（45.50倍），创业板指（38.86倍），其估值更具吸引力。

超额引擎加强版 主动管理+指数化

贝莱德中证500指数增强基金（基金）紧密跟踪中证500指数，并通过量化主动管理策略，力求获得超越指数表现的收益。以贝莱德基金量化及多元产品团队管理的贝莱德指增产品贝莱德沪深300指增基金为例，成立以来净值增长率16.33%，显著超越同期沪深300指数表现。

同期产品历来表现沪深300指增的安全性表现

	成立以来	今年以来
贝莱德沪深300指增A净值增长率	16.33%	12.67%
沪深300	13.77%	11.26%
超额收益	+2.56%	+1.31%

数据来源：Wind，贝莱德整理，2015.1.5-2025.9.3，投资于股票不少于80%的基金资产，不含股票型ETF，不含股票型LOF，不含股票型FOF，不含QDII基金，以贝莱德基金旗下产品贝莱德沪深300指增基金（A类）的业绩表现为例，贝莱德沪深300指增基金（A类）成立日期为2015年1月5日，成立以来业绩表现为该基金成立以来业绩表现，业绩表现以人民币计算，业绩表现以扣除管理费及其他费用后的净值增长率计算，业绩表现不代表未来业绩，投资有风险，投资前请参阅基金合同等法律文件。

硬分实力 10+年深度量化投资专家团队

- 贝莱德基金量化及多资产投资总监，CFA持证人
- 目前在职产品：贝莱德沪深300指数增强基金，贝莱德中证500指数增强基金，贝莱德富元沪深结构型证券投资基金
- 清华大学电子信息工程学士、美国伯明翰大学电子工程硕士、美国哈佛大学电子工程博士
- 15年全球投研经验，10年投资管理经验

投任基金经理王臻京具有先进的海外量化投资经验，曾负责管理沪深300指数和标普500等多项产品全球量化策略，多项沪深股票对冲策略、新兴市场股票策略、除了丰富的海外投资经验，王臻京也深耕A股市场，拥有A股行业经验优势，量化定制策略等。

注：王臻京先生管理基金不代表贝莱德（Blackrock Investment Management (UK) Limited）、贝莱德资产管理（上海）有限公司、贝莱德基金管理（上海）有限公司、贝莱德资产管理（深圳）有限公司、贝莱德基金管理（北京）有限公司、贝莱德证券投资顾问（北京）有限公司、贝莱德证券投资顾问（上海）有限公司、贝莱德证券投资顾问（深圳）有限公司、贝莱德证券投资顾问（北京）有限公司的观点。

基金资料

基金名称	贝莱德中证500指数增强型证券投资基金
基金类型	股票型证券投资基金
运作方式	普通开放式
投资目标	本基金为指数增强型基金，通过量化选择股票的投资方法及严格的投资纪律执行，在保证指数化、风险控制、流动性、成本管理前提下，力争获取超越指数标准差的超额收益，追求基金资产的长期增值。
投资范围	本基金投资（含存托凭证）的股票不少于基金资产的80%；其中投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产的90%。投资于股票通过的投资比例应满足指数基金产的90%。每个交易日日终应保持现金或其他政府债券、股指期货合约需要缴纳交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或其国行合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。
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%

费率结构

基金管理费	0.80%/年
基金托管费	0.15%/年

A类份额费率

	认购金额（M）	认购费率
认购费	M<100万	1.00%
	100万≤M<300万	0.60%
	300万≤M<500万	0.30%
	M≥500万	1000元/笔
申购费	申购金额	申购费率
	M<100万	1.20%
	100万≤M<300万	0.80%
	300万≤M<500万	0.40%
	M≥500万	1000元/笔
赎回费	持有期限	赎回费率
	1年内	1.50%
	1年以上	0%

C类份额费率

（不收取认购费用，计提销售服务费）

销售服务费	0.60%/年	
赎回费	持有期限	赎回费率
	1年内	1.50%
	1年以上	0%

注：以上C类份额费率，赎回费率和基金管理费、托管费分别年度应计提及支付。1年以内，年份不足一年的，按实际天数计算。

中证500指数增强型证券投资基金（以下简称“基金”）属股票型、高风险证券投资基金，其风险水平高于混合型、债券型、货币市场型证券投资基金。

基金管理人对本基金的投资风险特别提示：

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场的波动而发生变动的风险，本基金可能会出现本金亏损的风险。

**本基金投资于股票的比例不低于基金资产净值的80%，股票市场的系统性风险、个别证券的非系统性风险、股票市场的流动性风险、股票市场的政策风险、股票市场的信用风险、股票市场的市场风险、股票市场的通货膨胀风险、股票市场的利率风险、股票市场的汇率风险、股票市场的其他风险、股票市场的管理风险、股票市场的操作风险、股票市场的合规风险、股票市场的不可抗力风险、股票市场的其他风险、股票市场的流动性