

宽基指数再添新基，东方中证 A500 指数增强型证券投资基金今日首发

近年来，中国资本市场深化改革持续发力，一系列多管齐下的“政策组合拳”为市场注入强劲信心。2024 年 9 月以来，政策端密集释放积极信号，显著提振市场情绪；2025 年 1 月，六部门联合印发《关于推动中长期资金入市工作的实施方案》，进一步引导机构资金增配权益资产，为市场提供长期稳定支撑。同期，证监会出台《促进资本市场指数化投资高质量发展行动方案》，明确鼓励指数化投资，推动被动投资工具创新发展。据 Wind 数据显示，截至 2025 年 4 月 30 日，被动指数基金规模合计 3.4 万亿。随着政府工作报告再次定调积极，宏观政策与市场环境双向协同，为中国资产价值重估奠定了坚实基础。中证 A500 指数作为覆盖广泛、行业均衡的创新指数，有望充分受益于政策红利与市场机遇。在此背景下，东方中证 A500 指数增强型证券投资基金（简称：东方中证 A500 指数增强）于 5 月 19 日正式发行。

东方中证 A500 指数增强基金所跟踪的中证 A500 指数，是一只兼顾传统经济和新质生产力的指数。该指数从不同行业中精选 500 只市值大、流动性好的股票，既涵盖传统大市值龙头企业，又纳入三级行业龙头，全方位反映各行业代表性上市公司的整体特征，显著提升“核心资产”的代表性。在行业覆盖上，该指数突出新质生产力特质，超配工业和原材料，低配金融和主要消费，充分展现经济新动能的发展方向。

东方中证 A500 指数增强基金在跟踪指数的基础上，通过量化分析、基本面研究等方法力争收益增强，主、被动相结合，既借道指数追求分享市场 Beta 收益，又通过主动管理力争挖掘超额 Alpha 机会。

东方基金拥有一只经验丰富、分工明确、协同作战的量化投资团队，通过自主开发的量化投资体系，实施严密的量化投资决策程序，以及基于 Axioma 归因系统改进的投资反馈机制。该体系拥有实盘多年稳定的 Alpha 选股模型，并结合与时俱进的风险预测和风险控制

制措施，以实现中低频多因子选股策略的优化和执行。

作为东方基金量化投资部兼资产配置部总经理，同时也是东方中证 A500 指数增强基金的拟任基金经理，盛泽是一位拥有 10 年证券从业经验、其中 7 年公募基金投资管理经验、具备多年指数增强投资研究经验的量化老将，擅长 BGI 体系多因子量化选股、量化对冲策略、指数增强策略投资。他认为，随着宏观经济数据在正面预期的带动下不断改善，叠加财报的逐步披露，市场交易或回归至基本面行情。未来的时间投资组合向行业景气度方向的板块及个股积极探索，挖掘优质个股力争提升超额收益。

当前，中国新质生产力的加速崛起，全球资本市场对中国资产价值重估。在此背景下，中证 A500 指数凭借“互联互通”与 ESG 两大特点，不仅为境外资金布局中国核心资产提供了通道，更增加了指数流动性与可投资性。如果投资者看好中国核心资产的长期价值，不妨关注东方中证 A500 指数增强型证券投资基金（A 类 023544，C 类 023545）。

【风险提示】

市场有风险，投资需谨慎。

公开募集证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄等能够提供固定收益预期的金融工具，当您购买基金产品时，既可能按持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

您在做出投资决策之前，请仔细阅读基金合同、基金招募说明书和基金产品资料概要等产品法律文件和本风险揭示书，充分认识本基金的风险收益特征和产品特性，认真考虑本基金存在的各项风险因素，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等因素充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况及销售适当性意见的基础上，理性判断并谨慎做出投资决策。

根据有关法律法规，基金管理人【东方基金管理股份有限公司】做出如下风险揭示：

一、依据投资对象的不同，基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金、基金中基金、商品基金等不同类型，您投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，您承担的风险也越大。

二、基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日基金的净赎回申请超过基金总份额的一定比例（开放式基金为百分之十，定期开放基金为百分之二十，中国证监会规定的特殊产品除外）时，您将可能无法及时赎回申请的全部基金份额，或您赎回的款项可能延缓支付。

三、您应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式，但不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

四、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。【基金管理人】提醒您基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由您自行承担。基金管理人、基金托管人、基金销售机构及相关机构不对基金投资收益做出任何承诺或保证。

五、中证 A500 指数由中证指数有限公司编制和计算，其所有权归属中证及/或其指定的第三方。“中证 A500 指数®”是中证的注册商标。中证对于标的指数的实时性、准确性、完整性和适用性不作任何明示或暗示的担保，不因标的指数的任何延迟、缺失或错误对任何人承担责任（无论是否存在过失）。中证对于跟踪标的指数的产品不作任何担保、背书、销售或推广，中证不承担与此相关的任何责任。

六、【东方中证 A500 指数增强型证券投资基金】（以下简称“本基金”），由【东方基金管理股份有限公司】（以下简称“基金管理人”）依照有关法律法规及约定申请募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）许可注册。基金的基金合同、基金招募说明书和基金产品资料概要已通过中国证监会基金电子披露网站【<http://fund.csrc.gov.cn>】和基金管理人网站【<http://www.orient-fund.com>】进行了公开披露。中国证监会对本基金的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。