

建信中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2026 年 6 月 24 日

送出日期：2026 年 6 月 25 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	建信中证 A 股 ETF	基金代码	159066
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	基金托管人	国信证券股份有限公司
基金合同生效日	2026 年 6 月 24 日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所
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	张溢麟	开始担任本基金基金经理的日期	2026 年 6 月 24 日
		证券从业日期	2016 年 9 月 8 日
其他	场内简称：A 股 ETF 建信 当本基金发生深圳证券交易所相关规则所规定的因不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的情形时，本基金将由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金，变更后基金名称为“建信中证 A 股指数证券投资基金”，基金管理人可变更本基金的登记机构、申购与赎回的安排等条款并根据变更为非上市指数基金的情况相应调整基金合同，而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》第十一部分了解详细情况

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金的标的指数为中证 A 股指数。 本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款，定期存款以及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权、信用衍生品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。 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

	<p>以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且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、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</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>在正常市场情况下，本基金追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人可根据基金运作及指数情况决定本基金采用抽样复制投资策略或完全复制投资策略。本基金优先采用抽样复制投资策略。本基金采用抽样复制投资策略时，基金管理人将运用指数化的投资方法，基于数量化投资分析等方法构建投资组合，追求投资组合与标的指数的风险收益特征尽可能相近，以达到紧密跟踪标的指数的目的。</p> <p>本基金采用完全复制策略时，按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的，尽量降低跟踪误差。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市等风险，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。</p> <p>2、存托凭证的投资策略</p> <p>本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。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存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然参与存托凭证投资。其他投资策略包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、股指期货交易策略、股票期权投资策略、国债期货交易策略、信用衍生品投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略</p>
业绩比较基准	中证 A 股指数收益率
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征相似。</p>

(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
认购费	S < 100 万	0.3%
	S ≥ 100 万	每笔 1000 元

注：1、基金管理人办理网下现金认购及网下股票认购时不收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。募集期投资人可以多次认购本基金，按每笔认购份额确定认购费率，以每笔认购申请单独计算费用。

2、投资人在申购或赎回本基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过 0.3% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

3、场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(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	0.15%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	16,000.00 元	会计师事务所
其他费用	本基金其他费用详见基金合同或招募说明书费用章节。	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。

本基金特有的风险：

1、标的指数回报与证券市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个证券市场。标的指数成份股的平均回报率与整个证券市场的平均回报率可能存在偏离。

2、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

3、标的指数值计算出错的风险

尽管指数公司将采取一切必要措施以确保指数的准确性，但不对此作任何保证，亦不因指数的任何错误对任何人负责。因此，如果标的指数值出现错误，投资人参考指数值进行投资决策，则可能导致损失。

4、标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如发生导致标的指数变更的情形，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。若标的指数发生变更，本基金的投资组合将相应进行调整。届时本基金的风

险收益特征可能发生变化，且投资组合调整可能产生交易成本和机会成本。投资者须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

5、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离，也可能使基金的跟踪误差控制未达约定目标：

(1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(2) 由于标的指数成份股发生送配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(3) 成份股派发现金红利、成份股增发、送配等所获收益可能导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。

(4) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本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。

(5) 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等费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(6) 在本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，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

(7) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别证券的持有比例与标的指数中该证券的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

6、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

7、IOPV 计算错误的风险

深圳证券交易所发布基金份额参考净值（IOPV），供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算也可能出现错误。投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资人自行承担后果。

8、投资人申购失败的风险

如果投资者申购时未能提供符合要求的申购对价，或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的申购申请，则投资者的申购申请失败。

基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置并调整申购份额上限，如果一笔新的申购申请被确认成功会使本基金当日申购份额超过申购赎回清单中规定的申购份额上限时，该笔申购申请将被拒绝。

本基金的申购赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资人在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停，临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

9、投资人赎回失败的风险

如果投资人提出赎回申请时持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或者基金投资组合中不具备足额的符合要求的赎回对价，或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者赎回申请，则投资者的赎回申请失败。基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资人按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回。

基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置并调整赎回份额上限，如果一笔新的赎回申请被确认成功会使本基金当日赎回份额超过申购赎回清单中规定的赎回份额上限时，该笔赎回申请将被拒绝。基

金管理人可能在申购赎回清单中设置极低的赎回份额上限，投资人将面临无法赎回全部或部分份额的风险。

10、非深圳证券交易所上市的成份股可以现金替代方式的风险

在通过深圳证券交易所申购赎回的模式中，非深圳证券交易所上市的成份股可以现金替代方式不同于现有其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资者带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格的折溢价水平。极端情况下，如果使用非深圳证券交易所可以现金替代证券的权重增加，该方式带来的不确定性可能导致本基金的二级市场价格折溢价处于相对较高水平。

基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格及基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对非深圳证券交易所可以现金替代的证券进行处理，投资者的利益可能受到影响。

11、基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额等。在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

12、申购赎回清单差错风险

如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错，包括组合证券名单、数量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错，投资人利益将受损，申购赎回的正常进行将受影响。

13、申购赎回清单标识设置风险

基金管理人在进行申购赎回清单的现金替代标识设置时，将充分考虑由此引发的市场套利等行为对基金持有人可能造成的利益损害。但基金管理人不能保证极端情况下申购赎回清单标识设置的完全合理性。

14、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

(1) 申购赎回代理机构因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资人申购赎回服务的风险。

(2) 登记机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资人基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资人带来风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

(3) 证券交易所、登记机构、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资人利益受损的风险。

15、基金退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

16、股指期货、股票期权、国债期货、信用衍生品等金融衍生品交易风险

金融衍生品是一种金融合约，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

(1) 股指期货交易风险

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者权益遭受较大损失。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。

(2) 股票期权交易风险

股票期权交易采用保证金交易的方式，投资者的潜在损失和收益都可能成倍放大，尤其是卖出开仓期权的投资者面临的损失总额可能超过其支付的全部初始保证金以及追加的保证金，具有杠杆性风险。在参与股票期权交易时，应当关注股票现货市场的价格波动、股票期权的价格波动和其他市场风险以及可能造成的损失。

（3）国债期货交易风险

本基金参与国债期货交易，国债期货市场的风险类型较为复杂，涉及面广，主要包括：利率波动原因造成的市场价格风险、宏观因素和政策因素变化而引起的系统风险、市场和资金流动性原因引起的流动性风险、交易制度不完善而引发的制度性风险等。

（4）信用衍生品投资风险

为对冲信用风险，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等。

①流动性风险

信用衍生品在交易转让过程中因无法找到交易对手或交易对手较少，导致难以将信用衍生品以合理价格变现的风险。

②偿付风险

在信用衍生品存续期间，由于不可控制的市场及环境变化，创设机构可能出现经营状况不佳或创设机构的现金流与预期发生一定偏差，从而影响信用衍生品结算的风险。

③价格波动风险

由于创设机构或所受保护的债券主体经营状况或利率环境发生变化，引起信用衍生品价格出现波动的风险。

17、资产支持证券投资风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

18、投资存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

19、转融通证券出借风险

第一，流动性风险，本基金参与转融通证券出借业务后，当出现大额赎回时，基金将面临因为无法变现资产而无法应对赎回的风险。

第二，信用风险，本基金参与转融通证券出借业务可能会面临证券出借对手方到期不能归还所借证券，或不能补偿相应权益或费用的风险。

第三，市场风险，本基金参与转融通证券出借业务后，可能面临无法及时处置证券的市场风险。

20、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，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，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。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。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

21、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

(1) 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。

(2) 停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

(3) 若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，则该部分款项将按照约定方式进行结算（具体见招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”之“七、申购赎回清单的内容与格式”相关约定），由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(4) 在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回对价，由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分 ETF 份额的风险。

22、投资北京证券交易所股票的风险

本基金投资北京证券交易所股票，将承担因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于如下特殊风险：

(1) 流动性风险

北京证券交易所投资者门槛较高，流动性可能弱于 A 股其他板块，且机构投资者可能在特定阶段对北京证券交易所股票形成一致性预期，存在基金持有股票无法正常成交的风险。

(2) 转板风险

基金所投资北京证券交易所上市的公司满足证券法和证监会规定的基本上市条件和符合交易所规定的具体上市条件可申请转板上市。交易所需审核并做出是否同意上市的决定。无论上市公司是否转板成功，均可能引起基金净值波动。

(3) 投资集中风险

因北京证券交易所上市的公司大部分为新兴产业公司，其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似，基金难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值波动。

(4) 经营风险

因北京证券交易所上市的公司大部分为新兴产业公司，其商业模式和盈利能力存在较高的不确定性，可能面临一定的经营风险，给基金净值带来不利影响。

(5) 退市风险

北京证券交易所上市的公司后续经营期间如果触及相关法律法规、证监会及交易所等规定的退市情形，可能面临被终止上市的风险，从而可能给基金净值带来不利影响。

(6) 股价波动风险

北京证券交易所股票涨跌幅限制比例区间相对较大，股票上市交易首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%，股价大幅波动的风险可能大于 A 股其他板块，存在北京证券交易所股票价格波幅较大而导致基金亏损的风险。

(7) 投资战略配售股票风险

战略配售股票在发行时明确了一定期限的锁定期，该类证券在锁定期内的流动性较差，存在市场或个股出现大幅调整时无法及时卖出的风险。

(8) 政策风险

国家对高新技术、专精特新企业扶持力度及重视程度的变化会对北京证券交易所企业带来较大影响，国际经济形势变化对专精特新产业及北京证券交易所个股也会带来政策影响。

(9) 监管规则变化的风险

北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修订和完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致基金投资运作相应调整变化。以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

(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投资价值、市场前景和收益等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。各方当事人因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议应尽量通过协商、调解途径解决，如经友好协商、调解未能解决的最终将通过仲裁方式处理，详见《基金合同》。

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

以下资料详见基金管理人官方网站 [www.ccbfund.cn] [客服电话：400-81-95533]

- 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