

东兴中证全指指数量化增强型证券投资基金

基金产品资料概要

编制日期：2026年05月29日

送出日期：2026年06月01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	东兴中证全指指数量化增强	基金代码	027594
基金简称A	东兴中证全指指数量化增强A	基金代码A	027594
基金简称C	东兴中证全指指数量化增强C	基金代码C	027595
基金管理人	东兴基金管理有限公司	基金托管人	青岛银行股份有限公司
基金合同生效日		上市交易所及上市日期	暂未上市
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	
李兵伟先生		2010年07月01日	

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

详见《东兴中证全指指数量化增强型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对中证全指指数进行有效跟踪的基础上，本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资范围	本基金的标的指数为中证全指指数。 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（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的其他股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、公

	<p>开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股票期权、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>本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。</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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例不低于80%，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%；其中港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资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、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如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>1、资产配置策略</p> <p>本基金属于指数增强型基金，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。同时在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金为指数增强型基金，以中证全指指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强投资策略，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>本基金在参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合的同时，结合多因子量化选股和投资组合优化等方法对投资组合进行优化，力求实现超越业绩比较基准的投资收益。</p> <p>3、港股通标的股票投资策略、4、债券投资策略、5、资产支持证券投资策略、6、股指期货投资策略、7、股票期权投资策略、8、可转换债券投资策略、9、可交换债券投资策略、10、国债期货投资策略、11、证券公司短期公司债券投资策略、12、存托凭证的投资策略、13、融资、转融通证券出借业务投资策略</p>
业绩比较基准	<p>中证全指指数收益率×95%+银行活期存款基准利率（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理论上高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。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> <p>投资港股通标的股票时，需承担因港股市场投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。具体风险请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。</p>
--------	--

(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

暂无。

(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

暂无。

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：

东兴中证全指指数量化增强A

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 < 50 万元	0.30%	
	50 万元 ≤ M < 200 万元	0.20%	
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.10%	
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔	
申购费 (前收费)	M < 50 万元	0.30%	
	50 万元 ≤ M < 200 万元	0.20%	
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.10%	
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔	
赎回费	N < 7 天	1.50%	个人投资者
	N ≥ 7 天	0.00%	个人投资者
	N < 7 天	1.50%	其他投资者
	7 天 ≤ N < 30 天	1.00%	其他投资者
	30 天 ≤ N < 180 天	0.50%	其他投资者
	N ≥ 180 天	0.00%	其他投资者

东兴中证全指指数量化增强 C

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
------	---------------------------	---------	----

赎回费	N<7天	1.50%	个人投资者
	N≥7天	0.00%	个人投资者
	N<7天	1.50%	其他投资者
	7天≤N<30天	1.00%	其他投资者
	30天≤N<180天	0.50%	其他投资者
	N≥180天	0.00%	其他投资者

认购/申购费C：本基金C类基金份额不收取认购/申购费。

注：通过直销机构认购/申购本基金A类基金份额的不收取认购/申购费。投资人重复认购、申购，须按每次认购、申购所对应的费率档次分别计费。本基金A类基金份额的认购、申购费用由通过其他销售机构认购、申购A类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

（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	0.10%	基金托管人
销售服务费C	0.20%	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
其他费用	按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用按实际发生额从基金财产中扣除。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。	相关服务机构

注：1、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。

2、本基金审计费用、信息披露费为年金额，由基金整体承担，非单个基金份额类别费用，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。

3、对于投资者通过直销机构认购/申购的C类基金份额计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购/申购的C类基金份额，持续持有期限超过一年继续计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。

（三）基金运作综合费用测算

暂无。

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。

一、本基金的特定风险

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票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、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停牌或摘牌、流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4、主动增强投资的风险

5、跟踪误差控制未达约定目标的风险

6、成份股停牌的风险

7、成份股退市的风险

8、指数编制机构停止服务的风险

9、投资港股通标的股票的风险

10、投资于国债期货的风险

11、投资于股指期货的风险

12、投资于资产支持证券的风险

13、投资于股票期权的风险

14、参与融资业务相关风险

15、参与转融通证券出借业务的风险

16、投资于存托凭证的风险

(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。

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网站[网址：www.dxamc.cn][客服电话：400-670-1800]

- 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