

# 长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金(C类份额)

## 基金产品资料概要

编制日期：2022年04月01日

送出日期：2022年04月08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    | 长城中证医药卫生指数增强   | 基金代码           | 014205     |
| 下属基金简称  | 长城中证医药卫生指数增强C  | 下属基金交易代码       | 014206     |
| 基金管理人   | 长城基金管理有限公司   | 基金托管人          | 交通银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | -  |                |            |
| 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    | 雷俊   | 开始担任本基金基金经理的日期 | -          |
|         |  | 证券从业日期         | 2008年7月8日  |
| 其他      | 《基金合同》生效后，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50个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不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

详见本基金《招募说明书》“基金的投资”章节内容

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 以增强指数化投资方法跟踪标的指数，在严格控制与标的指数偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使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8%。  |
| 投资范围 | 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权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）。<br>本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。<br>基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%；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，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%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。<br>本基金的标的指数为中证医药卫生指数。   |
| <b>主要投资策略</b> | 本基金为增强型指数基金，以跟踪标的指数为主，在一般情况下保持相对稳定的股票投资比例，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。本基金基于基金管理人量化投资研究平台的研究成果，采用量化多因子股票模型进行投资。 |
| <b>业绩比较基准</b> | 中证医药卫生指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后) ×5%   |
| <b>风险收益特征</b> | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。<br>本基金可投资港股通标的股票，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。  |

## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

## (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

### 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)<br>/持有期限(N) | 收费方式/费率 | 备注             |
|--------------|-------------------------|---------|----------------|
| 认购费          | -                       | -       | 本基金C类份额不收取认购费用 |
| 申购费<br>(前收费) | -                       | -       | 本基金C类份额不收取申购费用 |
| 赎回费          | N<7天                    | 1.5%    | 场外份额           |
|              | 7天≤N<30天                | 0.5%    | 场外份额           |
|              | N≥30天                   | 0       | 场外份额           |

#### (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   |
|-------|--|
| 管理费   | 1%   |
| 托管费   | 0.2%   |
| 销售服务费 | 0.3%   |
| 其他费用  | 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费，基金份额持有人大会费用，基金的证券、期货交易费用，基金的银行汇划费用，证券、期货账户开户费用、账户维护费用，因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用，以及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，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基 |

|         |
|---------|
| 金财产中支付。 |
|---------|

注: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。

#### 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。

投资本基金可能遇到的特有风险包括:(1)标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险;(2)标的指数波动的风险;(3)基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险以及跟踪误差控制未达约定目标的风险;(4)指数编制机构停止服务的风险;(5)成份股停牌的风险;(6)主动增强投资的风险;(7)量化模型失效风险;(8)股指期货等金融衍生品的投资风险;(9)资产支持证券投资风险;(10)存托凭证投资风险;(11)投资港股通标的股票的风险,本基金将根据市场环境的变化以及投资策略的需要进行调整,选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票,因此本基金存在不对港股进行投资的可能;(12)参与融资和转融通证券出借业务的风险;(13)基金合同自动终止风险。

此外,本基金还将面临市场风险、管理风险、流动性风险、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险等其他一般风险。

注:详情请见本基金《招募说明书》“风险揭示”章节内容。

##### (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。

基金投资者请认真阅读基金合同中争议的处理相关章节,充分了解本基金争议处理的相关事项。

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[www.ccfund.com.cn][客服电话:400-8868-666]

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