

兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金(A 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2021 年 5 月 24 日

送出日期：2021 年 5 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	兴全中证 800 六个月持有指数	基金代码	010673
下属基金简称	兴全中证 800 六个月持有指数 A	下属基金交易代码	010673
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2021 年 2 月 9 日	上市交易所及上市日期	-
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	每个交易日开放
基金经理	申庆	开始担任本基金基金经理的日期	2021 年 2 月 9 日
		证券从业日期	1997 年 1 月 1 日
基金经理	张晓峰	开始担任本基金基金经理的日期	2021 年 5 月 24 日
		证券从业日期	2011 年 4 月 27 日
其他	每份基金份额的最短持有期限 6 个月		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

敬请阅读《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金招募说明书》第九部分了解与本基金投资有关的详细情况。

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 800 指数进行有效跟踪的基础上，对基金投资组合进行相对增强，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 800 指数的成份股及其备选成份股、其他非指数成分股(包含主板、中小板、创业板及其他国内依法发行上市的股票、港股通标的股票)、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)、货币市场工具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的相关规定)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。

	<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:本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%,投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产比例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%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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、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>本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过指数复制的方法拟合、跟踪中证 800 指数,并在严格控制与业绩比较基准偏离风险的前提下进行相对增强的组合管理,力争实现超越业绩比较基准的投资收益。本基金力争日均跟踪误差的绝对值不超过 0.5%,年化跟踪误差不超过 7.75%。</p>
业绩比较基准	<p>本基金业绩比较基准:中证 800 指数收益率×90%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×5%+银行活期存款利率(税后)×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金,预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金除了投资 A 股外,还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p> <p>基金管理人对本基金的风险评级为 R3。</p>

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

截至 2021 年 3 月 31 日,本基金合同生效不满 2 个月,不编制定期报告,故暂无投资组合资产配置图。

(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

截至 2021 年 3 月 31 日,本基金合同生效不满 2 个月,不编制定期报告,故暂无比较图。

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) /持有期限(N)	收费方式/费率
申购费 (前收费)	M<500,000	1.20%
	500,000≤M<2,000,000	0.80%
	2,000,000≤M<5,000,000	0.40%
	5,000,000≤M	1,000 元/笔
赎回费	180 天≤N<1 年	0.25%
	N≥1 年	0.00%

(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	1.10%	
托管费	0.15%	
指数许可使用费	指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计，按季支付。指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 50,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。	0.016%

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，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资者作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。

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、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，投资者将可能无法及时赎回申请的全部基金份额，或赎回的款项可能延迟支付。

1、本基金为股票型基金，预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。此外，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港股或选择不将基金资产投资于港股，本基金并非必然投资港股。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，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。

2、科创板上市的股票是国内依法上市的股票，属于《基金法》第七十二条第一项规定的“上市交易的股票”。本基金基金合同中的投资范围中包括国内依法发行上市的股票，且投资科创板股票符合本基金基金合同所约定的投资目标、投资策略、投资范围、资产配置比例、风险收益特征和相关风险控制指标。本基金可根据投资目标、投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，并非必然投资于科创板股票。

3、本基金每份基金份额的最短持有期为 6 个月。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满 6 个月（6 个月指 30 天乘以 6 的自然天数，下同）后的下一工作日（即最短持有期到期日）。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（不含该日）前，基金份额持有人不能提出赎回申请；自其最短持有期到期日（含该日）起，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后 6 个月内无法赎回的风险。

4、本基金的特定风险

(1) 目标指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

目标指数并不能完全代表整个股票市场。目标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) 目标指数波动的风险

目标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、投资者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目标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目标指数的收益率发生偏离：

①由于目标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误差。

②由于目标指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在目标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误差。

③成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过目标指数收益率，产生跟踪误差。

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误差。

⑤由于基金应对日常赎回保留的少量现金、投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与目标指数产生跟踪误差。

⑥由于本基金为指数增强型基金，采用复制目标指数基础上的有限度个股调整策略，因此对指数跟踪进行修正与适度增强可能会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对目标指数的跟踪程度。

⑦其他因素产生的跟踪误差。如未来法律法规允许的情况下的卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪误差；因基金申购与赎回带来的现金变动等。

(4) 目标指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更目标指数的情形，本基金将变更目标指数。基于原目标指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的目标指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

(5) 指数编制机构停止服务的风险及指数成分券停牌或者违约的风险等。

5、当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金的注册和核准，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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。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。

基金管理人保证本概要所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本概要中的净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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，其他信息发送变更的，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

与本基金有关的以下资料登载于基金管理人网站等规定网站：

- (1) 基金合同及其修订、托管协议及其修订、基金招募说明书及其更新；
- (2) 基金定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告；
- (3) 基金份额净值和基金份额累计净值；
- (4) 基金销售机构及其联系方式；
- (5) 与本基金有关的其他重要资料。

基金管理人联系方式如下：

基金管理人网站：www.xqfunds.com

基金管理人客服电话：400-678-0099（免长话）、021-38824536

六、其他情况说明

本基金产品资料概要是招募说明书及其更新的摘要文件，仅用于向投资者提供简明的基金概要信息。投资者投资本基金前应仔细阅读基金的招募说明书（及其更新）和基金合同等法律文件。