

东兴医药生物量化选股混合型证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2026年09月14日

送出日期：2026年09月21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	东兴医药生物量化选股混合	基金代码	020830
基金简称A	东兴医药生物量化选股混合A	基金代码A	020830
基金简称C	东兴医药生物量化选股混合C	基金代码C	020831
基金管理人	东兴基金管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2024年09月03日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	混合型	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	2024年09月03日		2010年07月01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60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

注：本基金为偏股混合型基金。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

详见《东兴医药生物量化选股混合型证券投资基金招募说明书》第八部分“基金的投资”。

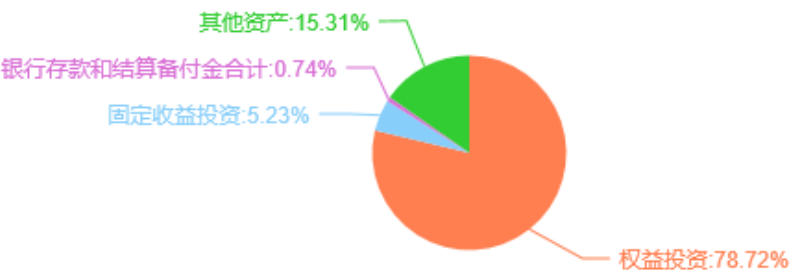
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，把握医药生物相关的投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。
投资范围	本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债

	券、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)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)。 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。 基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例为基金资产的60%-95%;投资于医药生物相关上市公司发行的股票的比例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、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后,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;股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 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。
主要投资策略	本基金为混合型基金,投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略等。 1、资产配置策略 2、股票投资策略 (1) 医药生物的界定 本基金所涉及的医药生物主题是指由从事医药生物相关产品或服务研发、生产或销售的公司组成,包括化学制药行业、中药行业、生物制品行业、医药商业行业、医疗器械行业和医疗服务行业等传统医药领域,以及医疗信息化、移动医疗、医药电商等新兴医疗领域。同时,本基金将对医药生物的发展进行密切跟踪,除上述领域外,本基金将根据实际情况,在审慎研究的基础上,保护基金份额持有人利益,在履行适当程序的前提下,适时调整医药生物主题的概念和所覆盖的投资范围的认定。 (2) 多因子投资策略。通过构建多因子模型体系,在底层大数据的基础上,对股票进行量化因子打分,根据得分结果筛选股票,构建股票组合。量化模型的因子包括估值、盈利、成长、财务质量、趋势、量价关系等因子。 (3) 机器学习辅助投资体系。通过机器学习技术发现因子和收益之间潜在的隐含关系(如逻辑回归、聚类、支持向量机等非线性关系),实现对因子进行动态预测,获取投资信号以辅助进行投资决策。 3、债券投资策略 本基金管理人将采取自上而下的研究方法,通过深入研究国内外宏观经济形势、国内财政政策、货币市场政策、市场结构变化和资金流动情况等因素对未来利率的变化和收益率曲线变动的方向及幅度的影响,审慎拟定组合久期,构建债券组合。 4、存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的研究判断,进行存托凭证的投资。 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
业绩比较基准	中证全指医药卫生指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平理论上高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

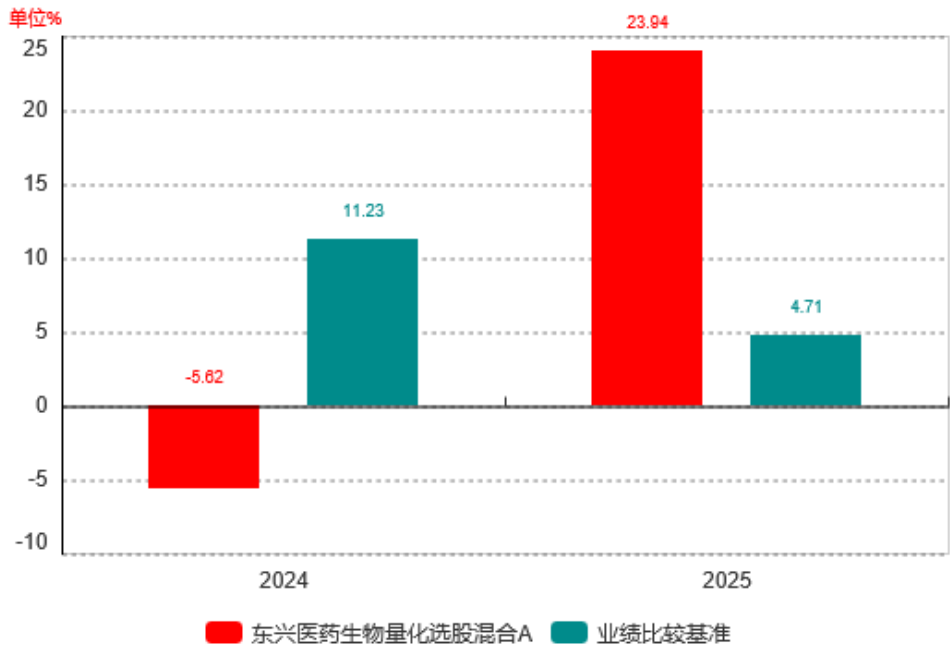
（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2026年06月30日

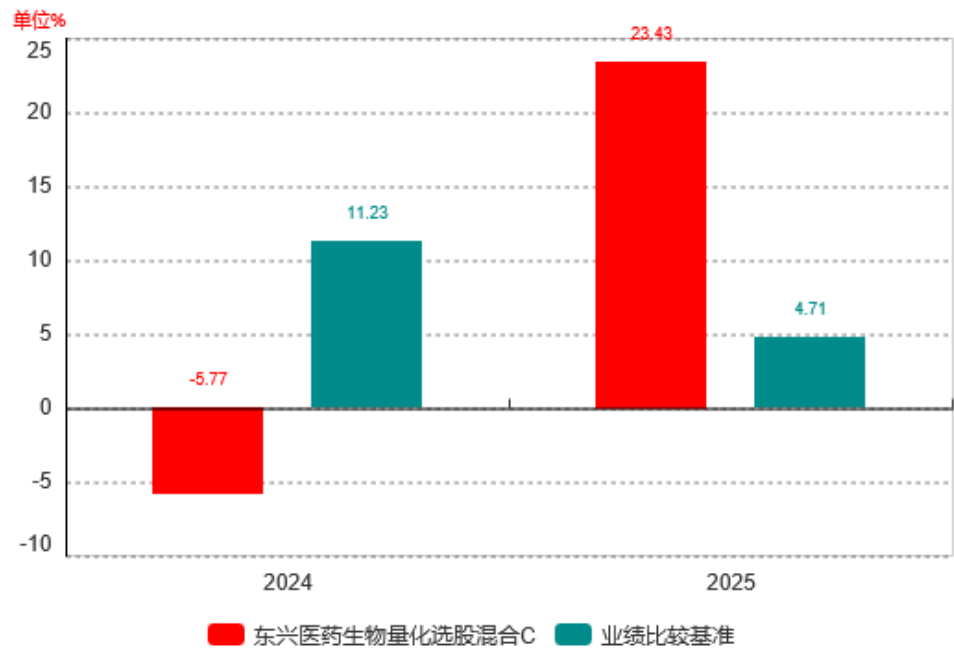


（三）自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2025年12月31日



基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2025年12月31日



注：合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

以下费用在申购 / 赎回基金过程中收取：

东兴医药生物量化选股混合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
申购费（前收费）	M<100 万	1.50%	
	100 万≤M<200 万	1.20%	
	200 万≤M<500 万	0.30%	
	M≥500 万	1000.00 元/笔	
赎回费	N<7 天	1.50%	
	7 天≤N<30 天	0.75%	
	30 天≤N<180 天	0.50%	
	N≥180 天	0.00%	

东兴医药生物量化选股混合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%	
	7 天≤N<30 天	0.50%	
	N≥30 天	0.00%	

注：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。

申购费C：本基金C类基金份额不收取申购费。

（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（元）	收取方
管理费	1.20%	基金管理人和销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
销售服务费C	0.40%	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、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、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。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

东兴医药生物量化选股混合A

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	2.03%

东兴医药生物量化选股混合C

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	2.43%

注：基金运作费率以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算，基金份额的销售服务费包含在基金运作费率中。

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）本基金特有的风险

1、本基金为混合型基金，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%-95%，因此股票市场的变化将影响到基金业绩表现，基金净值表现因此可能受到影响。基金管理人

将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

2、本基金投资于医药生物相关上市公司发行的股票的比例不低于非现金基金资产的80%。该类股票的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险，其投资收益会受到宏观经济、政府产业政策、市场需求变化、行业波动和公司自身经营状况等因素的影响，可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个股价格表现低于预期的风险。因此，本基金所投资的医药生物相关的股票可能在一定时期内表现与其他未投资的证券不同，造成本基金的收益低于其他基金，或波动率高于其他基金或市场平均水平。此外，由于本基金还可以投资其它品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。

3、本基金的投资范围包括国债期货、股指期货、股票期权。国债期货、股指期货、股票期权的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险、杠杆性风险、保证金风险、信用风险、各类操作风险等。

4、资产支持证券投资风险

5、投资存托凭证的风险

6、流动性风险评估

7、实施侧袋机制对投资者的影响

二）本基金还面临开放式基金共有的风险，如市场风险（主要包括股票投资风险和债券投资风险）、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险、信用风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险和其他风险等。

（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