

光大保德信量化核心证券投资基金基金产品资料概要

更新

编制日期：2021年11月19日

送出日期：2021年11月24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	光大保德信量化股票	基金代码	360001
基金管理人	光大保德信基金管理有 限公司	基金托管人	中国光大银行股份有限 公司
基金合同生效日	2004-08-27		
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	翟云飞	开始担任本基金 基金经理的日期	2016-12-09
		证券从业日期	2010-06-10
	赵大年	开始担任本基金 基金经理的日期	2021-11-20
		证券从业日期	2007-07-20

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。
投资范围	<p>本基金的投资方向为具有良好流动性的金融工具，包括在国内依法公开发行的股票、存托凭证、法律法规及证监会允许基金投资的其它金融工具。其中股票投资对象重点为基本面良好且具有持续增长潜力，股价处于合理区间的优质股票。</p> <p>本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，股票资产的基准比例为基金资产净值的90%，浮动范围为85—95%；现金的基准比例为基金资产净值的10%，浮动范围为5—15%。</p> <p>本基金建仓时间为6个月，基金在合同生效后6个月内达到上述比例限制。</p> <p>针对开放式基金申购/赎回的异常流动性需求，资产配置可不受上述比例限制，但基金管理人将在合理期限内调整投资组合，使基金资产配置比例恢复至正常市场情况下的水平，上述合理期限指10个交易日，法律法规另有规定时，从其规定。</p>
主要投资策略	本基金通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多重优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。在构建投资组合时综合考虑收益因素及风险因素，并通过投资组合优化器构建并动态优化投

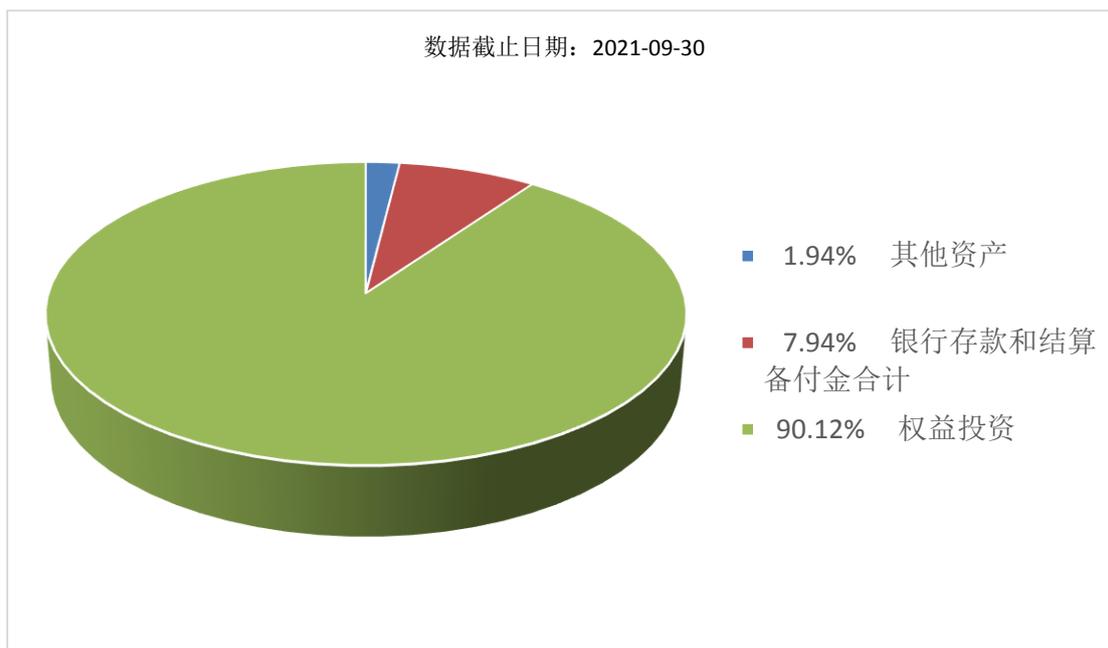
投资组合，确保投资组合风险收益特征符合既定目标。
 本基金投资策略包括：多因素数量模型的运用、行业评级、个股评级、投资组合优化器的运用、权证的投资策略。

业绩比较基准 90%×沪深300指数+10%×同业存款利率。

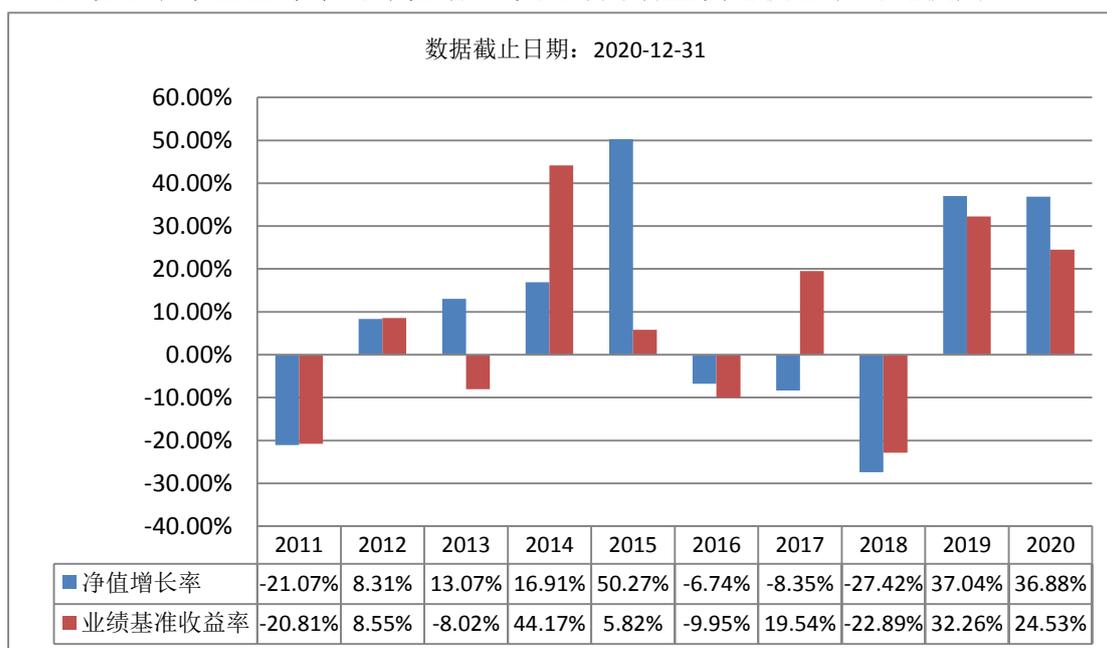
风险收益特征 本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险限制范围内追求收益最大化。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表



(三) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：1、为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自2014年4月1日起，将本基金

的业绩比较基准由原“90%×富时中国A200指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深300指数+10%×同业存款利率”。

2、本基金的过往业绩不代表未来表现。合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

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	备注
申购费(前收费)	M < 1,000 万元	1.50%	
	M ≥ 1,000 万元	1000 元/笔	
赎回费	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 365 天	0.50%	
	365 天 ≤ N < 730 天	0.20%	
	N ≥ 730 天	-	

(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	按日计提 1.50%
托管费	按日计提 0.25%

注：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

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金的风险主要包括：市场风险（可具体分为政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险）、信用风险、管理风险和其他风险（包括技术风险、资金前端控制风险、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险、因战争，自然灾害等不可抗力产生的风险）。

此外，本基金的风险还包括：

1、本基金的特定风险

(1) 本基金是一只积极投资的股票基金，主要通过数量模型选择股票并构建投资组合，由于上市公司财务数据的可靠性及透明度存在一定的不确定性，可能导致数量模型对股票收益率的预期产生偏差，从而给本基金的股票选择带来风险。

(2) 由于本基金资产配置比例相对固定，且股票资产比例较高，在股票市场发生较大波动时，本基金系统性风险较大，可能对基金的净值产生较大影响。

2、流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

3、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。

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。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册或核准，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

以下资料详见光大保德信基金管理有限公司官方网站：www.epf.com.cn，客服热线：4008-202-888。

1. 基金合同、托管协议、招募说明书
2. 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
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料