

中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2024年07月30日

送出日期：2024年08月06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	中信建投量化精选6个月持有期混合	基金代码	012878
基金简称A	中信建投量化精选6个月持有期混合A	基金代码A	012878
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	基金托管人	中信银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年07月27日	上市交易所及上市日期	
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式	开放频率	每个开放日，但本基金对每份基金份额设置6个月的最短持有期。每份基金份额的最短持有期结束日的下一个工作日（含）起，基金份额持有人可就该基金份额提出赎回申请及转换转出申请。
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
王鹏	2021年07月27日	2015年01月22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，基金管理人将终止《基金合同》，并按照《基金合同》约定程序进行清算，此事项不需要召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

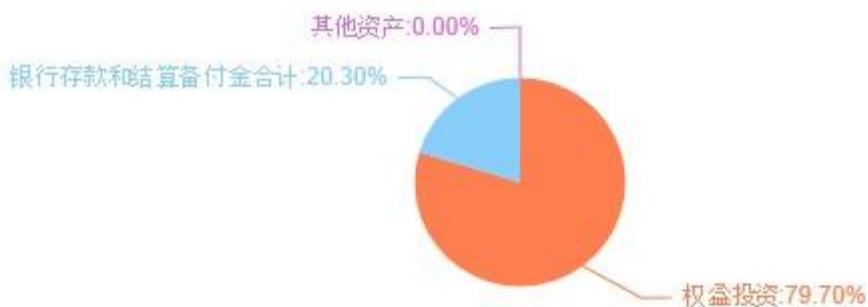
投资者可阅读本基金招募说明书的“基金的投资”章节了解详细情况。

投资目标	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。
------	--

<p>投资范围</p>	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、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>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：股票（含存托凭证）资产占基金资产的60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；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>
<p>主要投资策略</p>	<p>本基金通过对各类宏观经济指标及资产市场行为数据进行量化分析，判断当前市场行为热点、运动趋势以及投资者风险偏好，并构建多种估值、发展预期等因子指标。基于各因子与股票、债券等大类资产价格的内在相关性及其影响机制，分别进行定量判断、筛选及归类。在上述归类结果的基础上，灵活运用各类数量模型，分别构建股票、债券、货币等大类资产配置价值的趋势判断的量化因子，形成对股票、债券、货币等大类资产的配置观点。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。</p>

(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024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



注：基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日。基金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<100万	1.50%	金额申购，单位：元
	100万≤M<200万	1.20%	金额申购，单位：元
	200万≤M<500万	0.80%	金额申购，单位：元
	M≥500万	1000.00元/笔	金额申购，单位：元
赎回费		0.00%	本基金对每份基金份额设置6个月的最短持有期

## （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	1.20%	基金管理人和销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
审计费用	50,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他费用	详见本基金招募说明书“基金费用与税收”章节	

注：1、年费金额单位：元。

2、审计费、信息披露费为基金整体承担费用，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。

3、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。

## （三）基金运作综合费用测算

若投资者申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

基金运作综合费率（年化）
1.44%

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化）。基金管理费率、托管费率为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

## 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。

投资者须了解并承受市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、本基金特有的风险及其他风险。

本基金特有的风险包括：

1、本基金对每份基金份额设置6个月的最短持有期。在基金份额的最短持有期内，投资者不能就该基金份额提出赎回申请及转换转出申请，因此面临在最短持有期限内无法赎回的风险；

2、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。基金可能因为模型计算的误差或模型中变量因子不完善而导致判断结论的失误，从而导致投资损失；

3、股指期货投资风险；

4、国债期货投资风险；

5、资产支持证券投资风险；

6、流通受限证券投资风险；

7、存托凭证投资风险；

8、基金合同自动终止的风险。

## （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。

因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费和律师费用由败诉方承担。

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、定期报告等。

## 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.cfund108.com](http://www.cfund108.com)][客服电话：4009-108-108]

- 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

## 六、其他情况说明

无。