

# 长城量化选股鑫选六个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2024年4月2日

送出日期：2024年4月3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	长城量化选股鑫选六个月持有混合	基金代码	016364
下属基金简称	长城量化选股鑫选六个月持有混合 A	下属基金代码	016364
下属基金简称	长城量化选股鑫选六个月持有混合 C	下属基金代码	016365
基金管理人	长城基金管理有限公司	基金托管人	华鑫证券有限责任公司
基金合同生效日			
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	最短持有期限 6 个月，在最短持有期限内不可赎回，自最短持有期限届满后的下一工作日起可赎回。
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。		

注：本基金基金类型为混合型（偏股混合型）。

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

详情请见本基金《招募说明书》“基金的投资”章节内容。

投资目标	本基金通过量化投资模型精选标的，在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
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、创业板及其他依法发行、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、政府支持债券、

	<p>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、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相关规定）。</p> <p>本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中，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，扣除股指期货、国债期货、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不低于基金资产净值的 5%，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。</p>
主要投资策略	<p>本基金基于基金管理人量化投资研究平台的研究成果，灵活运用多种量化投资策略，借助量化的手段和方法分析选取股价具有影响性的因子，采用量化多因子模型进行投资。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。</p> <p>2、股票（含存托凭证）投资策略</p> <p>本基金将通过基础股票池的分层筛选，基于高成长的股票进行多因子建模，综合多因子模型打分筛选股票，构建分散化的投资组合。多因子模型的因子来源主要包括基本面因子、市场交易型因子、预期性因子等。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>4、金融衍生品投资策略</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>6、融资业务策略</p>
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×75%+中证港股通综合指数收益率（人民币）×5%+中债综合指数收益率×20%</p>
风险收益特征	<p>本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>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。</p>

(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：

长城量化鑫选六个月持有混合 A

费用类型	份额（S）或金额（M）/持	收费方式/费率	备注
------	---------------	---------	----

	有期限 (N)		
认购费	M < 100 万元	1%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.6%	非养老金客户
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.3%	非养老金客户
	500 万元 ≤ M	1000 元/笔	非养老金客户
	M < 100 万元	0.2%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.12%	养老金客户
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.06%	养老金客户
	500 万元 ≤ M	1000 元/笔	养老金客户
申购费 (前收费)	M < 100 万元	1.2%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.8%	非养老金客户
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.4%	非养老金客户
	500 万元 ≤ M	1000 元/笔	非养老金客户
	M < 100 万元	0.24%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 300 万元	0.16%	养老金客户
	300 万元 ≤ M < 500 万元	0.08%	养老金客户
	500 万元 ≤ M	1000 元/笔	养老金客户
赎回费	本基金不收取赎回费用		-

长城量化鑫选六个月持有混合 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
认购费	本基金 C 类份额不收取认购费用		-
申购费 (前收费)	本基金 C 类份额不收取申购费用		-
赎回费	本基金不收取赎回费用		-

注：投资者多次认/申购，认/申购费率按每笔认/申购申请单独计算。

(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	1.20%	
托管费	0.10%	
销售服务费	长城量化鑫选六个月持有混合 A	0.00%
	长城量化鑫选六个月持有混合 C	0.50%
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、股票期权等交易费用，基金的银行汇划费用，证券、期货等账户开户费用、账户维护费用，因投	

	<p>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。</p>
--	---

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。

##### 1、 市场风险

本基金主要投资于证券市场，市场价格可能会因为国际国内政治环境、宏观和微观经济因素、国家政策、投资者风险收益偏好和市场流动性程度等各种因素的变化而波动，从而产生市场风险，主要包括：（1）政策风险；（2）经济周期风险；（3）利率风险；（4）信用风险；（5）购买力风险；（6）证券发行人经营风险。

##### 2、 管理风险

##### 3、 流动性风险

##### 4、 特有风险

##### （1） 资产配置风险

本基金为混合型基金，股票、债券和货币等大类资产之间的配置策略受宏观经济、微观经济、市场环境、技术周期等各类因素的影响，配置策略的错误将导致本基金的特定风险。

##### （2） 投资港股通标的股票的风险

##### 1) 港股交易失败风险

##### 2) 汇率风险

##### 3) 境外市场的风险

##### 4) 交收制度带来的流动性风险

##### 5) 港股通下对公司行为的处理规则带来的风险

##### 6) 香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

##### 7) 港股通规则变动带来的风险

8) 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。

（3） 本基金设置基金份额持有人最短持有期限。基金份额持有人持有的每份基金份额最短持有期限为 6 个月，在最短持有期限内该份基金份额不可赎回，在最短持有期限届满后的下一工作日起（含该日）可赎回。基金份额持有人面临在最短持有期限内不能赎回基金份额的风险

##### （4） 股指期货投资风险

股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能使投资者权益遭受较大损失。同时，股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，从而增加本基金总体风险水平。

##### （5） 国债期货投资风险

国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。

(6) 股票期权投资风险

股票期权价格主要受到标的资产价格水平、标的资产价格波动率、期权到期时间、市场利率水平等因素的影响。因此，投资股票期权主要存在 Delta 风险、Gamma 风险、Vega 风险、Theta 风险以及 Rho 风险。同时，进行股票期权投资还面临流动性风险、信用风险、操作风险等。

(7) 参与融资交易风险

融资交易的风险主要包括流动性风险、信用风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

(8) 资产支持证券投资风险

本基金拟投资资产支持证券，除了面临债券所需要面临的信用风险、市场风险和流动性风险外，还面临资产支持证券的特有风险：提前赎回或延期支付风险，可能造成基金财产损失。

(9) 基金投资存托凭证的风险

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。

(10) 本基金采用证券公司交易模式和结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经营机构进行场内交易，并由选定的证券经营机构作为结算参与人代理本基金进行结算，该种交易结算模式可能存在信息系统风险、操作风险、效率降低风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险等风险。

(11) 基金合同自动终止风险

《基金合同》生效后，连续 50 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，基金管理人应当终止基金合同，不需召开基金份额持有人大会进行表决。因此投资者可能面临《基金合同》自动终止的风险。

5、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

6、其他风险

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

## 六、其他情况说明

暂无。