

中信建投量化选股股票型证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2024年04月12日

送出日期：2024年04月15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 | 中信建投量化选股股票 | 基金代码 | 020772 |
| 基金简称A | 中信建投量化选股股票A | 基金代码A | 020772 |
| 基金简称C | 中信建投量化选股股票C | 基金代码C | 020773 |
| 基金管理人 | 中信建投基金管理有限公司 | 基金托管人 | 国金证券股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | | 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 | |
| 王鹏 | | 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，基金管理人应当终止《基金合同》，并按照《基金合同》的约定程序进行清算，无需召开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。 | | |

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。 |
| 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，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创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 |

| | |
|---------|---|
| | <p>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>本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。</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80%-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> |
| 主要投资策略 | <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> |
| 业绩比较基准 | <p>中证800指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%</p> |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</p> |
| 风险收益特征A | <p>本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</p> |
| 风险收益特征C | <p>本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</p> |

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：

中信建投量化选股股票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 |
|----------|---------------------|------------|-----------|
| 认购费 | M<100万 | 1.20% | 金额认购，单位：元 |
| | 100万≤M<200万 | 1.00% | 金额认购，单位：元 |
| | 200万≤M<500万 | 0.60% | 金额认购，单位：元 |
| | 500万≤M | 1000.00元/笔 | 金额认购，单位：元 |
| 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 |
| | 500万≤M | 1000.00元/笔 | 金额申购，单位：元 |
| 赎回费 | N<7日 | 1.50% | |
| | 7日≤N<30日 | 0.75% | |
| | 30日≤N<180日 | 0.50% | |
| | 180日≤N | 0.00% | |

中信建投量化选股股票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 | 0<M | 0.00% | 金额认购，单位：元 |
| 申购费（前收费） | 0<M | 0.00% | 金额申购，单位：元 |
| 赎回费 | N<7日 | 1.50% | |
| | 7日≤N<30日 | 0.50% | |
| | 30日≤N | 0.00% | |

注：本基金A类基金份额对持续持有期少于30日的基金份额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于或等于30日但少于90日的基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于或等于90日但少于180日的基金份额持有人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产。赎回费中未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金C类基金份额对持续持有期少于30日的基金份额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产。

（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 | 0.20% |
| 销售服务费C | 0.40% |

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。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。其他费用详见本基金招募说明书“基金费用与税收”章节。

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、股指期货交易风险；2、国债期货交易风险；3、资产支持证券投资风险；4、流通受限证券投资风险；5、存托凭证投资风险；6、参与融资业务的风险；7、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，应提交北京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，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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][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。