国金成长量化选股股票型证券投资基金（国金成长量化选股股票 A 份额）

基金产品资料概要

编制日期：2026 年 11 月 11 日

送出日期：2026 年 11 月 12 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	国金成长量化选股股票	**基金代码**	028994
下属基金简称	国金成长量化选股股票 A	**下属基金交易代码**	028994
基金管理人	国金基金管理有限公司	**基金托管人**	中信银行股份有限公司
基金合同生效日	-	**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	姚加红	**开始担任本基金基金经理的日期**	-
		证券从业日期	2004 年 10 月 24 日
基金经理	李洪超	**开始担任本基金基金经理的日期**	-
		证券从业日期	2016 年 01 月 11 日

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

请阅读《招募说明书》基金的投资部分了解详细情况。

投资目标	本基金主要通过数量化的投资方法精选成长型股票，在合理控制投资组合风险的前提下，力争实现组合资产的长期稳健增值。
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（包含主板、科创板、创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款以及其他银行存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品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）。 本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务。 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。
主要投资策略	1、资产配置策略； 2、股票投资策略：（1）量化选股策略（2）存托凭证投资策略

	3、固定收益品种投资策略：（1）债券投资策略（2）可转换债券、可交换公司债券投资策略（3）资产支持证券投资策略； 4、衍生品投资策略：（1）股指期货交易策略（2）国债期货交易策略（3）股票期权投资策略（4）信用衍生品投资策略； 5、融资业务策略。
业绩比较基准	中信成长风格指数收益率*90%+活期存款基准利率*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

注：无。

(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：无。

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
认购费（前收费）	M＜500 万元	0.80%
	M≥500 万元	1000 元/笔
申购费（前收费）	M＜500 万元	0.80%
	M≥500 万元	1000 元/笔
赎回费	N＜7 日	1.50%
	7 日≤N＜30 日	1.00%
	30 日≤N＜180 日	0.50%
	N≥180 日	0.00%

注：1、上表中的认购/申购费用仅适用于通过基金管理人以外的其他销售机构认购/申购本基金 A 类基金份额的情形。投资者通过基金管理人认购/申购本基金 A 类基金份额的，不收取认购/申购费用。

2、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用按照法律法规的规定收取并全额计入基金财产。

3、投资者通过全部销售机构（含基金管理人、其他销售机构）赎回 A 类基金份额时均收取赎回费。

(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	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	-	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。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其	相关服务机构

	更新。	

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、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年度收费金额为预估值，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

注：无。

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。

本基金存在的主要风险有：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、未知价风险、合规性风险、本基金的特有风险、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及其他风险等。

本基金的特有风险：

1、本基金为股票型证券投资基金，基金资产主要投资于股票市场，因此股市的波动将影响到基金业绩及基金份额持有人回报。本基金投资于股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例范围为 80%-95%，受到股市系统性风险的影响较大，无法完全规避市场整体下跌风险和个股下跌风险，基金净值可能受到影响。本基金重视股票投资风险的防范，但是基于投资范围的规定，本基金的波动性可能较高，面临的市场风险较大。

2、量化投资风险

（1）采用量化模型的风险

本基金采用量化模型选择股票并构建投资组合，存在模型失效并导致基金亏损的风险；同时，宏观经济环境、股票市场环境、交易规则等重大变化也可能会影响模型的有效性，无法达到预期投资效果。

（2）数据错误的风险

本基金采用的量化模型以广泛覆盖各类型信息的数据库为基础，包括宏观经济数据、行业经济数据、证券与期货交易行情数据、上市公司财务数据等，这些数据规模庞大，在搜集、采集、预处理等过程中均可能出现错误，从而影响量化模型的输出结果。

3、投资存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于境内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等，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

4、投资衍生品的风险

（1）参与国债期货交易的风险

本基金可参与国债期货交易，国债期货的交易可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。

流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证

金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

（2）参与股指期货交易的风险

本基金可参与于股指期货交易，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会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。

（3）投资股票期权风险

股票期权的风险主要包括市场风险、流动性风险、保证金风险、信用风险和操作风险等。市场风险指由于标的价格变动而产生的衍生品的价格波动。流动性风险指当期权交易量大于市场可报价的交易量而产生的风险。保证金风险指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险。信用风险指交易对手不愿或无法履行契约的风险。操作风险则指因交易过程、交易系统、人员疏失或者其他不可预期事件所导致的损失。

（4）投资信用衍生品风险

信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。流动性风险指信用衍生品在交易转让过程中，因无法找到交易对手或交易对手较少，导致难以将其以合理价格变现的风险。偿付风险是在信用衍生品的存续期内，由于不可控制的市场及环境变化，创设机构可能出现经营情况不佳，或创设机构的现金流与预期出现一定的偏差，从而影响信用衍生品结算的风险。价格波动风险是由于创设机构或所受保护债券主体，经营情况或利率环境出现变化，引起信用衍生品交易价格波动的风险。

5、投资资产支持证券风险

本基金可投资资产支持证券，可能面临利率风险、流动性风险、现金流预测风险。利率风险是指市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动可能会影响资产支持证券收益。流动性风险是指在交易对手有限的情况下，资产支持证券持有人将面临无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而遭受损失的风险。资产支持证券的还款来源为基础资产未来现金流，现金流预测风险是指由于对基础资产的现金流预测发生偏差导致的资产支持证券本息无法按期或足额偿还的风险。

6、科创板股票投资风险

本基金可投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于：

（1）科创板上市公司股价波动较大的风险。科创板对个股每日涨跌幅限制为 20%，且新股上市后的前 5 个交易日不设置涨跌幅限制，股价可能表现出比 A 股其他板块更为剧烈的波动；

（2）科创板上市公司退市的风险。科创板执行比 A 股其他板块更为严格的退市标准，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，因此上市公司退市风险更大，可能会对基金净值产生不利影响；

（3）科创板股票流动性较差的风险。由于科创板投资门槛高于 A 股其他板块，整体板块活跃度可能弱于 A 股其他板块；科创板机构投资者占比较大，板块股票存在一致性预期的可能性高于 A 股其他板块，在特殊时期存在基金交易成交等待时间较长或无法成交的可能；

（4）本基金投资集中度相对较高的风险。因科创板均为科技创新成长型公司，其商业模式、盈利模式等可能存在一定的相似性，因此，持仓股票股价存在同向波动的可能，从而产生对基金净值不利的影响。

7、创业板股票投资风险

本基金投资于创业板股票，会面临创业板市场特有的投资风险，包括但不限于以下方面：

（1）股价波动风险

创业板企业多为成长型公司，具有商业模式新、盈利稳定性较弱、估值波动较大等特点，市场可比公司可能较少，传统估值方法可能不完全适用。此外，创业板股票单日涨跌幅限制为 20%，且新股上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，股价波动可能显著高于主板市场，存在短期剧烈波动的风险。

（2）退市风险

创业板执行比 A 股其他板块更为严格的退市标准，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，可能对基金净值产生不利影响。

（3）流动性风险

创业板市场以中小市值公司为主，部分股票交易活跃度可能低于主板市场，在市场情绪低迷或个股基本面恶化时，可能出现流动性不足的情况，导致基金买卖股票时成交价格偏离预期，甚至面临无法及时成交的风险。

（4）投资集中风险

创业板上市公司以成长型的创新创业企业与新技术、新产品、新业态、新模式深度融合的传统产业中的优秀企业为主，行业分布相对集中，且部分公司商业模式相似，可能导致持仓股票股价呈现同向波动，放大基金净值的波动性。

8、投资北交所股票的风险

本基金若投资北交所股票，可能面临投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险、流动性风险、上市公司经营风险、上市公司退市风险等。

9、参与融资交易风险

本基金可参与融资业务。融资业务除具有普通证券交易所具有的政策风险、市场风险、违约风险、业务资格合法性风险、系统风险等各种风险外，因融资业务的杠杆效应，本基金的净值可能表现出更大的波动性，投资者有机会获得较大的收益，也有可能蒙受巨大损失。

10、投资流通受限证券的风险

本基金可投资流通受限证券，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值，本基金的基金净值可能由于估值方法的原因偏离所持有证券的收盘价所对应的净值，因此，投资者在申购赎回时，需考虑估值方法对基金净值的影响。另外，本基金可能面临在流通受限期间证券价格大幅下跌的风险，以及在基金大规模赎回的情况下可能因为无法变现造成流动性风险和合规性风险。

(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。

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。

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释而产生的或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。未能以协商或调解方式解决的，任何一方应将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：www.gfund.com，客服电话：4000-2000-18

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

六、其他情况说明

无。