

创金合信上证超大盘量化精选股票型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2020年08月28日

送出日期：2020年09月01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	创金合信上证超大盘量化	基金代码	008768
基金简称A	创金合信上证超大盘量化A	基金代码A	008768
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2019年12月27日	上市交易所及上市日期	暂未上市
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	
董梁	2019年12月27日		2003年12月01日
其他	《基金合同》生效后之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，本基金将根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。《基金合同》生效满三年后继续存续的，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60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并6个月内召集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

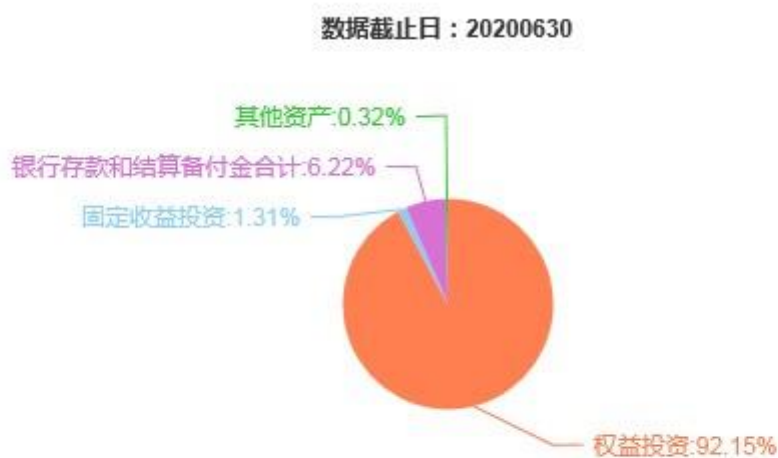
(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金采取定量方法进行组合管理，力争在严格控制风险的前提下，实现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、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行

	<p>的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具(含同业存单)、金融衍生品(包括股指期货、股票期权等)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。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金在履行适当程序后可将其纳入投资范围。</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不低于80%。其中,投资于上证超大盘股票占非现金基金资产的比例不低于80%,本基金所称上证超大盘股票,包括上证50指数成分股及其备选成分股等股票。每个交易日日终,在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如果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>本基金采取定量方法进行组合管理,力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上,追求获得超越业绩比较基准的回报。(1)本基金对上证超大盘股票的界定本基金所称上证超大盘股票,包括上证50指数成分股及其备选成分股等股票。本基金对于上证超大盘股票的界定方式将随中国证券市场未来的发展与变革情况作出相应的调整,并在履行适当程序后及时公告。(2)股票组合的构建本基金股票投资组合的构建以国际通行的多因子模型为基础框架,并根据预先设定的风险预算、交易成本、投资限制等时机情况的需要进行组合优化。</p>
业绩比较基准	<p>上证50指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率(税后)×5%</p>
风险收益特征A	<p>本基金为股票型基金,理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p>

注:了解详细情况请阅读基金合同及招募说明书“基金的投资”部分。

(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
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	备注
认购费	$0 \leq M < 100$ 万	1.20%	
	$100 \text{万} \leq M < 200$ 万	0.60%	
	$200 \text{万} \leq M < 500$ 万	0.20%	
	$500 \text{万} \leq M$	1000.00元/笔	
申购费 (前收费)	$0 \leq M < 100$ 万	1.50%	
	$100 \text{万} \leq M < 200$ 万	0.80%	
	$200 \text{万} \leq M < 500$ 万	0.30%	
	$500 \text{万} \leq M$	1000.00元/笔	
赎回费	$0 \text{天} \leq N < 7$ 天	1.50%	
	$7 \text{天} \leq N < 30$ 天	0.75%	
	$30 \text{天} \leq N < 180$ 天	0.50%	
	$180 \text{天} \leq N$	0.00%	

注：特定投资群体适用的费率详见基金招募说明书等相关文件。

(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	1.50%
托管费	0.20%
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。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等。特别的，出于保护基金份额持有人的目的，

本基金为保障基金资产组合的流动性与基金份额持有人的净赎回需求相适配,还将在特定环境下启动相应的流动性风险管理工具。

本基金为债券型基金,本基金的主要投资对象为债券类资产,因此,本基金将面临较高的债券市场系统性风险。其次,信用债券为本基金债券类资产中的重要投资对象,因此,本基金无法完全规避发债主体特别是公司债、企业债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险。再次,权证是一种金融衍生品,具有高杠杆、高风险、高收益的特征。除了一般意义上的市场风险外,权证还具有以下投资风险:标的证券价格风险、流动性风险、时效性风险、履约风险等。

(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。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.cjhxfund.com][400-868-0666]

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。