

中海量化策略混合型证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月6日

送出日期：2024年6月27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	中海量化策略混合	基金代码	398041
基金管理人	中海基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2009年6月24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	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	梅寓寒	开始担任本基金基金经理的日期	2021年9月4日
		证券从业日期	2013年3月1日

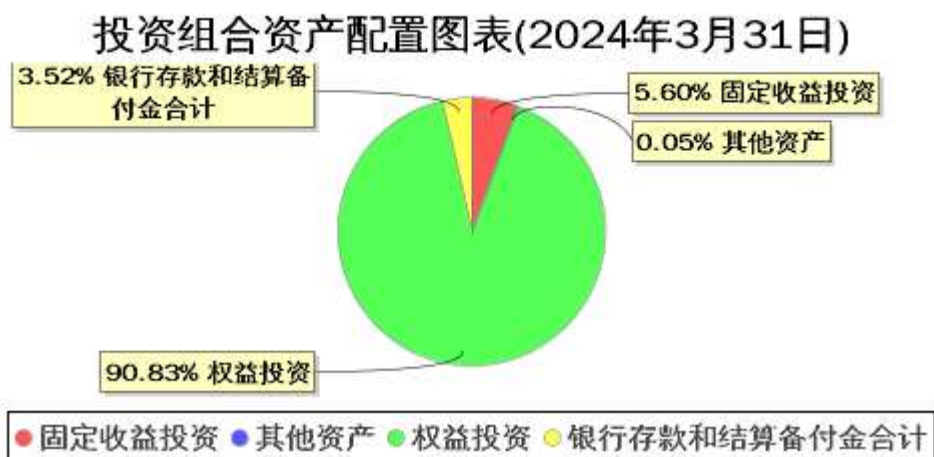
二、基金投资与净值表现

(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	根据量化模型，精选个股，积极配置权重，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资范围	本基金投资范围限于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、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金投资组合的资产配置：股票资产的比例为基金资产的60%—95%，债券资产（含短期融资券和资产证券化产品）为基金资产的0%—40%，权证投资的比例为基金资产净值的0%—3%，本基金持有的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%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他产品（如股指期货、期权等衍生品），基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。
主要投资策略	1、股票投资；2、债券投资：1）债券资产配置方法；2）个券选择方法；3）债券投资流程；3、资产支持证券投资；4、权证投资：1）套利投资策略；2）风险锁定策略；3）股票替代策略；4）杠杆投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数涨跌幅×80%+中国债券总指数涨跌幅×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 最近十年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：数据截止日期为 2023 年 12 月 31 日，基金过往业绩不代表未来表现。基金合同生效当年不满完整自然年度，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
申购费 (前收费)	M < 1,000,000	1.50%	非养老金客户
	M < 1,000,000	0.60%	养老金客户
	1,000,000 ≤ M < 5,000,000	1.00%	非养老金客户
	1,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.30%	养老金客户
	M ≥ 5,000,000	1,000 元/笔	非养老金客户
	M ≥ 5,000,000	1,000 元/笔	养老金客户
赎回费	N < 7 日	1.50%	-
	7 日 ≤ N < 1 年	0.50%	-
	1 年 ≤ N < 2 年	0.25%	-

	N≥2年	0.00%	-
--	------	-------	---

(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	1.200%	基金管理人和销售机构
托管费	0.200%	基金托管人
审计费用	50,000.00元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00元	规定披露报刊
其他费用	基金合同生效后与基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用等费用	相关服务机构

注：上表中年费用金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

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。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/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）
持有期间	1.48%

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+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、销售服务费率（若有）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。

本基金主要风险如下：

1、本基金特有风险

本基金是一只积极投资的混合型基金，主要通过数量模型选择股票并构建投资组合，由于上市公司财务数据的可靠性及透明度存在一定的不确定性，可能导致数量模型对股票收益率的预期产生偏差，从而给本基金的股票选择带来风险。

由于本基金资产配置比例相对固定，且股票资产比例较高，在股票市场发生较大波动时，本基金系统性风险较大，可能对基金的净值产生较大影响。

本基金作为量化策略基金，非常依赖相关数据的准确性和可靠性。个别研究报告数据是否准确与可靠是本基金的特有风险，将对本基金的业绩表现有所影响。因此，采用反映市场综合研究数据的一致预期指标能一定程度上规避个别研究报告数据带来的准确性与可靠性风险。

2、系统性风险

系统性风险是指因整体政治、经济、社会等环境因素对股票、债券价格产生影响而形成的风险，主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、汇率风险和其他风险等。

3、非系统性风险

非系统性风险是指单个证券特有的风险，包括企业的信用风险、经营风险、财务风险等。

4、开放式基金共有的基金管理风险，主要包括基金产品风险、管理风险、流动性风险、交易风险、运营风险和道德风险。

5、投资科创板股票的特有风险

本基金资产投资于科创板股票，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，包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

(二) 重要提示

中海量化策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2009 年 4 月 29 日证监许可【2009】347 号文核准募集。中国证监会对本基金募集的核准，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。

基金风险收益特征的表述是代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构及其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法不同，因此销售机构的风险等级评价与本文件中风险收益特征的表述可能存在不同。投资者在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

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

以下资料详见中海基金官方网站【www.zhfund.com】【客服电话：400-888-9788】

《中海量化策略混合型证券投资基金基金合同》、《中海量化策略混合型证券投资基金托管协议》、《中海量化策略混合型证券投资基金招募说明书》

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