

中信保诚国企红利量化选股股票型证券投资基金（A 类份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 06 月 27 日

送出日期：2024 年 06 月 28 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 | 中信保诚国企红利量化股票 | 基金代码 | 020768 |
| 份额类别简称 | 中信保诚国企红利量化股票 A | 份额类别子代码 | 020768 |
| 基金管理人 | 中信保诚基金管理有限公司 | 基金托管人 | 华泰证券股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2024 年 03 月 22 日 | 基金类型 | 股票型 |
| 运作方式 | 开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 交易币种 | 人民币 | | |
| 基金经理 | HAN YILING | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2024 年 03 月 22 日 |
| | | 证券从业日期 | 2013 年 12 月 01 日 |
| | 黄稚 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2024 年 03 月 22 日 |
| | | 证券从业日期 | 2011 年 07 月 15 日 |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金重点关注国企红利主题相关上市公司的投资机会，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资范围 | 本基金的投资范围包括国内依法发行或上市的股票（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（含国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许投资的债券）、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、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）。 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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证的资产不低于基金资产的80%，其中，投资于国企红利主题相关股票（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。

如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，在履行适当程序后，本基金的投资比例会做相应调整。

主要投资策略

1、资产配置策略；2、股票投资策略：（1）国企红利主题的界定，（2）股票投资策略；3、债券投资策略；4、证券公司短期公司债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、可转换债券、可交换债券投资策略；7、衍生品投资策略；8、融资业务投资策略。

业绩比较基准

中证国有企业红利指数收益率×85%+恒生指数收益率×5%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%

风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
本基金除了投资A股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，如投资，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

注：投资者可阅读招募说明书中基金的投资章节了解详细情况。

（二）投资组合资产配置图表

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

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：

中信保诚国企红利量化股票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 |
|----------|-------------------------|---------|----|
| 申购费（前收费） | M<500000.00 | 1.50% | 场外 |
| | 500000.00≤M<2000000.00 | 1.20% | 场外 |
| | 2000000.00≤M<5000000.00 | 0.80% | 场外 |
| | M≥5000000.00 | 1000元/笔 | 场外 |
| 赎回费 | N<7天 | 1.50% | 场外 |
| | 7天≤N<30天 | 0.75% | 场外 |
| | 30天≤N<180天 | 0.50% | 场外 |
| | N≥180天 | 0.00% | 场外 |

认购费：M：认购金额；单位：元

申购费：M：申购金额；单位：元

（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 | 55,000.00 元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 93,225.81 元 | 规定披露报刊 |
| 其它费用 | 律师费等 | - |

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、信息披露费用为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

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。

本基金的风险包括市场风险、估值风险、流动性风险、特有风险、其他风险。其中特有风险包括：

- 1、管理风险
- 2、新产品创新带来的风险
- 3、港股通标的股票投资风险
- 4、股指期货的投资风险
- 5、证券公司短期公司债券的投资风险
- 6、资产支持证券的投资风险
- 7、国债期货的投资风险
- 8、股票期权的投资风险
- 9、参与融资交易风险
- 10、存托凭证的投资风险
- 11、科创板的投资风险

（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。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 www.citicprufunds.com.cn，客服电话 400-666-0066

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