中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2025 年 8 月 21 日

送出日期：2025 年 8 月 23 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	中航量化阿尔法六个月持有	**基金代码**	011934
下属基金简称	中航量化阿尔法六个月持有 A	**下属基金交易代码**	011934
下属基金简称	中航量化阿尔法六个月持有 C	**下属基金交易代码**	011935
基金管理人	中航基金管理有限公司	**基金托管人**	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2021 年 08 月 25 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	其他开放式	**开放频率**	最短持有期 6 个月
基金经理	龙川	**开始担任本基金基金经理的日期**	2021 年 08 月 25 日
		证券从业日期	2011 年 03 月 09 日
基金经理	杨扬	**开始担任本基金基金经理的日期**	2021 年 09 月 16 日
		证券从业日期	2010 年 12 月 06 日

二、基金投资与净值表现

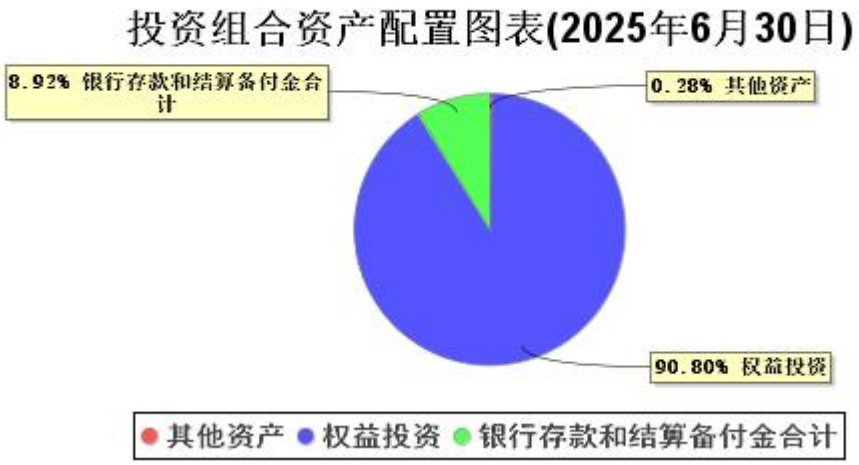
(一) 投资目标与投资策略

此部分投资者可阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况。

投资目标	本基金以数量化分析为基础，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
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、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、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、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券及其他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、定期存款等)、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的相关规定。 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

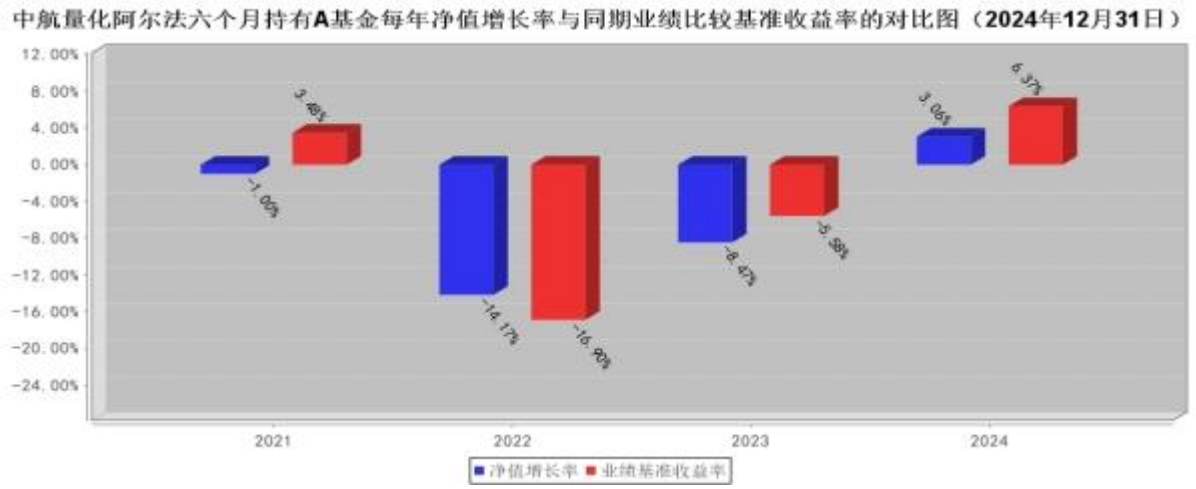
	以将其纳入投资范围。
主要投资策略	（一）资产配置策略 （二）股票投资策略：（1）多因子模型（2）事件驱动模型 （三）债券投资策略 （四）股指期货投资策略 （五）国债期货投资策略 （六）资产支持证券投资策略 （七）存托凭证投资策略 （八）可转换债券及可交换债券投资策略
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

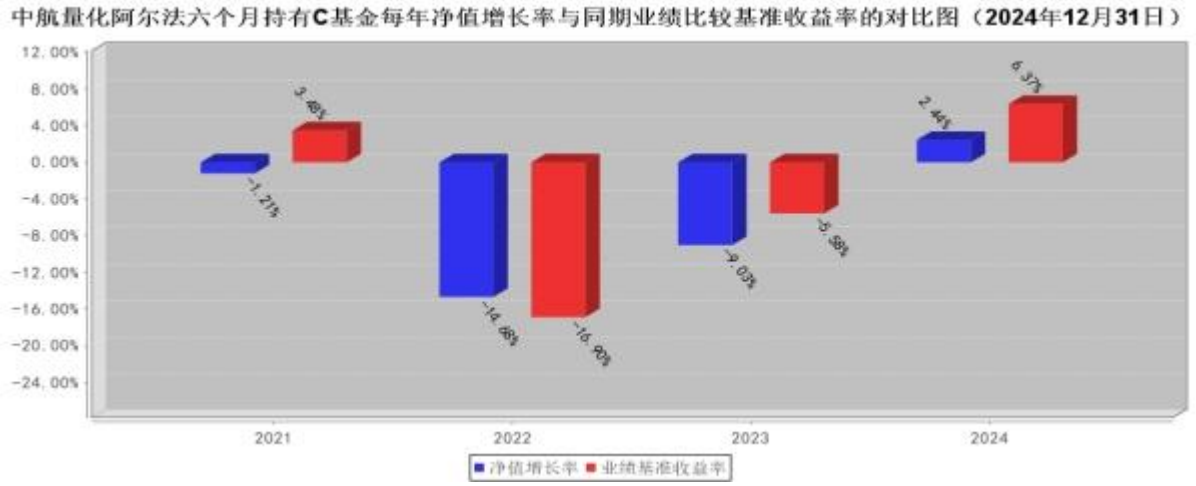
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

(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：(1)业绩表现截止日期 2024 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

(2)如合同生效当年不满完整自然年度的，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

以下费用在申购/赎回基金过程中收取：

中航量化阿尔法六个月持有 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<1,000,000	1.50%	-
	1,000,000≤M<3,000,000	0.80%	-
	3,000,000≤M<5,000,000	0.40%	-
	M≥5,000,000	1,000 元/笔	-
赎回费	对于本基金每份基金份额，本基金设置 6 个月的锁定期限，6 个月后方可赎回，赎回时不收取赎回费。		

中航量化阿尔法六个月持有 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
申购费（前收费）	C 类基金份额不收取申购费用。		
赎回费	对于本基金每份基金份额，本基金设置 6 个月的锁定期限，6 个月后方可赎回，赎回时不收取赎回费。		

申购费

本基金 A 类基金份额的申购费用由 A 类基金份额申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。C 类基金份额不收取申购费用。

投资人可以多次申购本基金，A 类基金份额的申购费率按每笔申购申请单独计算。

赎回费

对于本基金每份基金份额，本基金设置 6 个月的锁定期限，6 个月后方可赎回，赎回时不收取赎回费。

(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	1.2%		基金管理人和销售机构
托管费	0.2%		基金托管人
销售服务费	中航量化阿尔法六个月持有 A	本基金 A 类基金份额不收取销售服务费	销售机构
	中航量化阿尔法六个月持有 C	0.6%	销售机构
审计费用	5,000.00 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会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费、基金份额持有人大会费用（包括但不限于场地费、会计师费、律师费和公证费）、基金的证券/期货交易费用、基金的银行汇划费用、基金的开户费用、账户维护费用、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。根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。		第三方收取方

注：(1)本基金费用类别、费用计算方法和支付方式详见本基金的《招募说明书》。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

若投资者申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

中航量化阿尔法六个月持有 A

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	1.48%

中航量化阿尔法六个月持有 C

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	2.08%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率为基金现行费率，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。

1、本基金面临的主要风险包括：市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险。

2、本基金特有风险：

（1）股指期货投资风险：本基金可投资股指期货，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人权益遭受较大损失。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，可能给投资带来重大损失。

（2）国债期货投资风险：本基金的投资范围包括国债期货，国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。

（3）资产支持证券投资风险：本基金可投资资产支持证券，资产支持证券在国内市场尚处发展初期，具有低流动性、高收益的特征，并存在一定的投资风险。

（4）流通受限证券投资风险：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，本基金可能由于投资流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

（5）最短持有期的流动性风险：本基金对于每份基金份额设置六个月的最短持有期，在最短持有期内基金份额持有人不能提出赎回申请，最短持有期届满后方可提出赎回申请。故投资者在最短持有期届满前，还将面临无法赎回的流动性风险。

3、其他风险。

(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.avicfund.cn，客服电话：400-666-2186

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