

长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021年7月23日

送出日期：2021年7月26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	长盛量化多策略	基金代码	003658
基金管理人	长盛基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2017-02-22	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	李琪	开始担任本基金基金经理的日期	2020-08-27
		证券从业日期	2005-08-01
	付海宁	开始担任本基金基金经理的日期	2021-06-08
		证券从业日期	2009-12-07
其他	《基金合同》生效后，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，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。		

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

（投资者阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节了解详细情况）

投资目标 通过对多种策略超额收益进行历史有效性验证和持续监控，深度挖掘具备阶段性成长机会的上市公司，满足投资人长期稳健的投资收益需求。

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指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）。

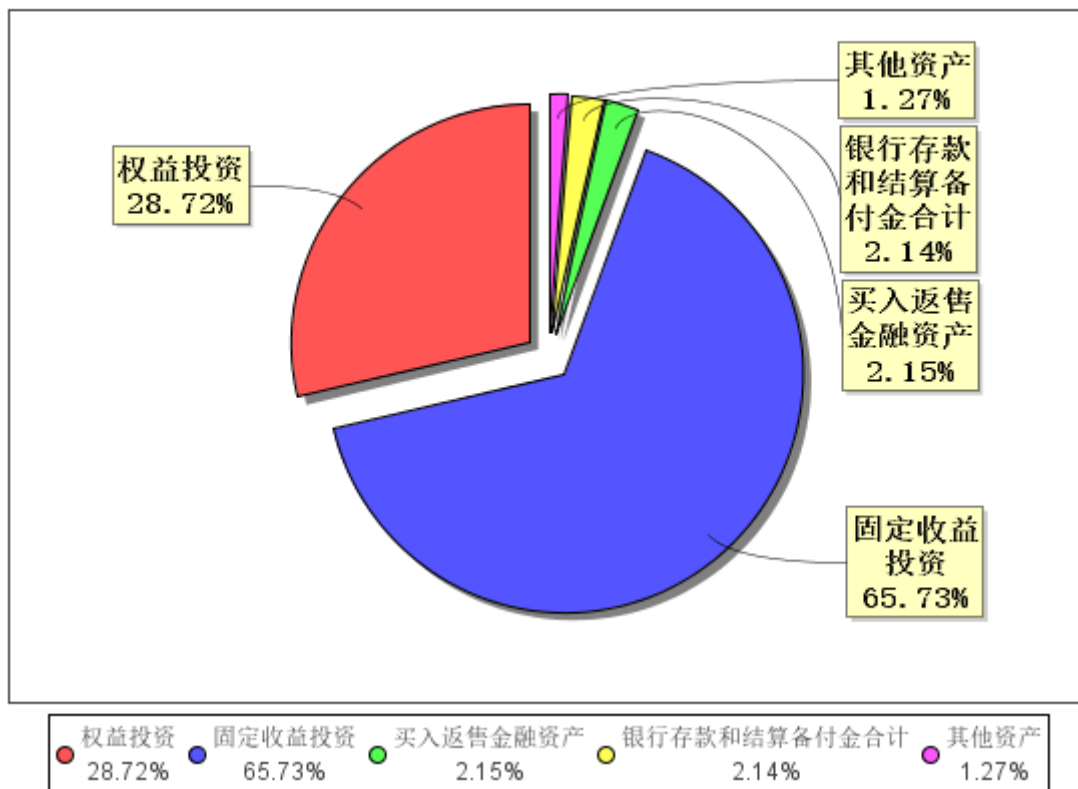
如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资比例为股票投资占基金资产的比例为0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、

	应收申购款等。
主要投资策略	<p>本基金将充分发挥基金管理人的投资研究优势，运用科学严谨、规范化的资产配置方法，对不同策略的收益和风险回撤进行动态跟踪和策略敞口调整，谋求基金资产的长期稳定增长。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金管理人将综合分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素，通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况比较分析，对各主要投资品种市场的未来发展趋势进行研判，根据判断结果进行资产配置及组合的构建，确定基金在股票、债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，动态调整各资产类别的投资比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>基金管理人主要根据上市公司基本面数据、二级市场交易价格特征、分析师预期信息和行为特征、上市公司行为等数据和信息构建多个量化选股策略，并对组合中的相关策略，定期采用等权重配置进行再平衡，并在此基础上进行优化和调整。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>本基金在实际的投资管理运作中，将运用利率配置策略、类属配置策略、信用配置策略、相对价值策略及单个债券选择策略等多种策略，以获取债券市场的长期稳定收益。</p>
业绩比较基准	沪深300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

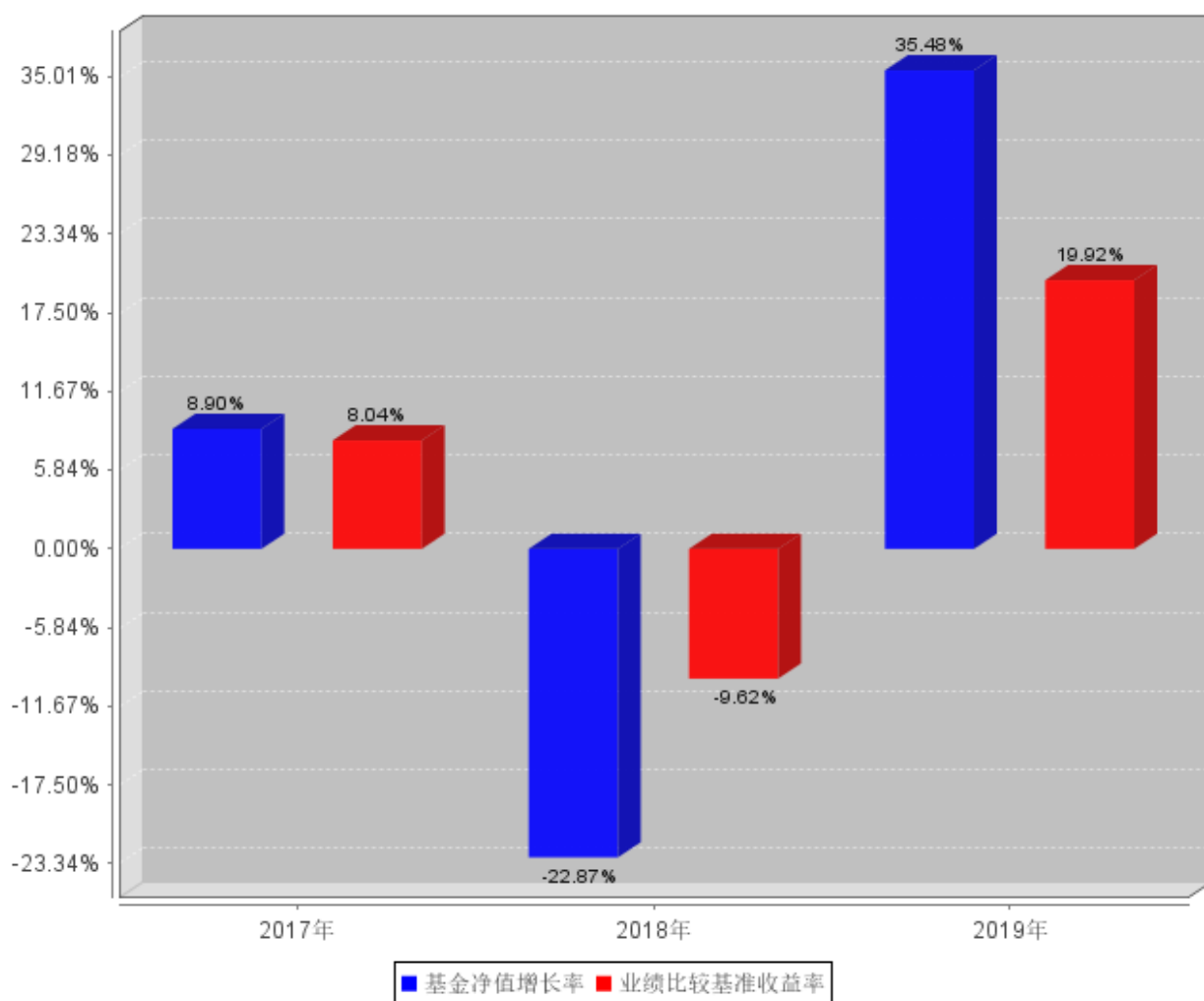
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表 数据截止日期：2020年12月31日



(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：业绩表现截止日期2019年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。

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 < 500,000	1.5%	-
	500,000 ≤ M < 2,000,000	1%	-
	2,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.5%	-
	M ≥ 5,000,000	1000元/笔	-
赎回费	N < 7天	1.5%	-
	7天 ≤ N < 30天	0.75%	-
	30天 ≤ N < 365天	0.5%	-
	365天 ≤ N < 730天	0.25%	-
	N ≥ 730天	0%	-

注：养老金费率等相关内容详见本基金招募说明书。

（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	0.25%
销售服务费	-
其他费用	会计师费、律师费、信息披露费等

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。本基金的其他费用详见招募说明书。

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。

本基金面临的常规风险：市场风险、管理风险、流动性风险（包括但不限于拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估，巨额赎回情形下的流动性风险管理措施，实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响，实施侧袋机制对投资者的影响等）、信用风险等。

本基金面临的特定风险：1、本基金为混合型证券投资基金，股票投资占基金资产的比例为0%-95%，因此本基金需承担股票市场的下跌风险；同时由于本基金持有一定比例的债券，故而也需承担债券价格变动导致的风险；2、本基金采用量化模型构建投资组合，其主要工作流程包括采集数据、分析数据、计算结果等几个部分，分别蕴含了数据风险、模型风险和编程风险；3、投资股指期货的风险等。

（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。

关于本基金争议解决方式详见本基金基金合同，请投资者务必仔细阅读相关内容。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：www.csfunds.com.cn][客服电话：400-888-2666]：

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