

# 建信多因子量化股票型证券投资基金

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月21日

送出日期：2024年6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	建信多因子量化股票	基金代码	002952
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金合同生效日	2016年8月9日	上市交易所及上市日期	-
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	叶乐天	开始担任本基金基金经理的日期	2016年8月9日
		证券从业日期	2008年5月12日
基金经理	赵荣杰	开始担任本基金基金经理的日期	2024年1月29日
		证券从业日期	2010年7月2日

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

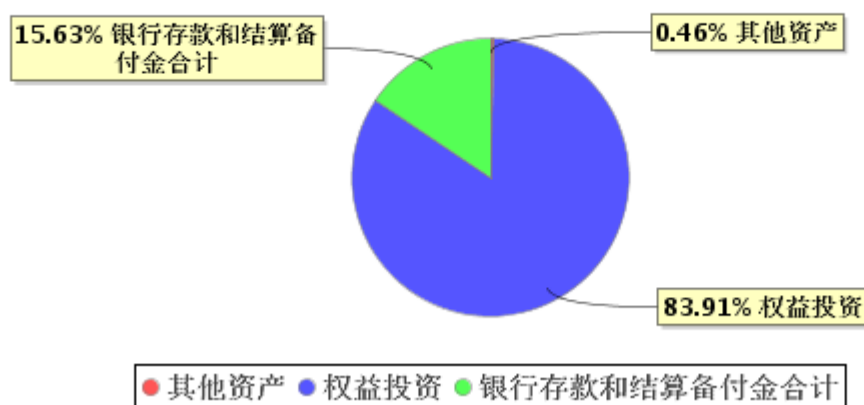
请投资者阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况

投资目标	在有效控制风险的基础上，力争获取稳定、持续超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期增值。
投资范围	<p>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（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转债（含分离交易可转债）、中期票据、短期融资券等）、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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）。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的80%；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，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货以套期保值为目的，股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p>
主要投资策略	本基金进行宏观经济研究，依托公司投研团队的研究成果，以建信多因子选股模型为基础，深入分析个股的估值水平、公司业绩增长情况、财务状况、股票市场交易情况以

	<p>及市场情绪面指标等，在考虑交易成本、流动性、投资比例限制等因素并结合基金管理人市场研判后，自下而上精选个股，力争在最佳时机选择估值合理、基本面优良且具有持续成长潜力的股票进行适度的优化配置，以获取收益。</p> <p>① 行业精选 各行业之间的预期收益、风险及其相关性是制定行业配置决策时的根本因素，本基金首先通过对宏观形势和行业景气周期进行判断，初步给出各个行业的配置范围，在配置范围内，再根据多因子模型的结果，精选得分较高的行业中的个股，以保证行业分布的相对分散，从而避免基金收益的大幅波动。</p> <p>② 个股精选 本基金在严控风险的基础上采用多因子量化模型优选个股，以争取在控制风险的基础上获得最大收益。</p> <p>A、风险控制 本基金采用量化方法从多个维度严控风险，包括行业、市值以及风格等方面。其中风格因子方面又包括长期动量、长期杠杆率以及长期 beta 等对个股的收益波动有较大解释力度的因子。本基金通过对这些因子的综合控制，使得基金整体风格与市场不至于偏离太大，以避免基金组合走极端，从而较好的控制组合在不利情况下的回撤。</p> <p>B、多因子模型 本基金主要基于多因子选股模型攫取相对业绩基准的超额收益。多因子模型可以从全方位去评估一只个股的优劣，所包含的因子涵盖综合财务因子、综合动量因子和情绪因子这三大方面。其中综合财务因子包括企业的成长、质量、财务指标等方面，综合动量因子覆盖动量、市场相关性、波动率、流动性等方面，情绪因子包含估值和分析师情绪等因素，本基金将密切关注并分析个股在各个因子上的得分情况，择优选取基本面优良、契合市场或行业轮动特点等具有稳定业绩回报和投资价值的股票。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*85%+商业银行活期存款利率(税前)*15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

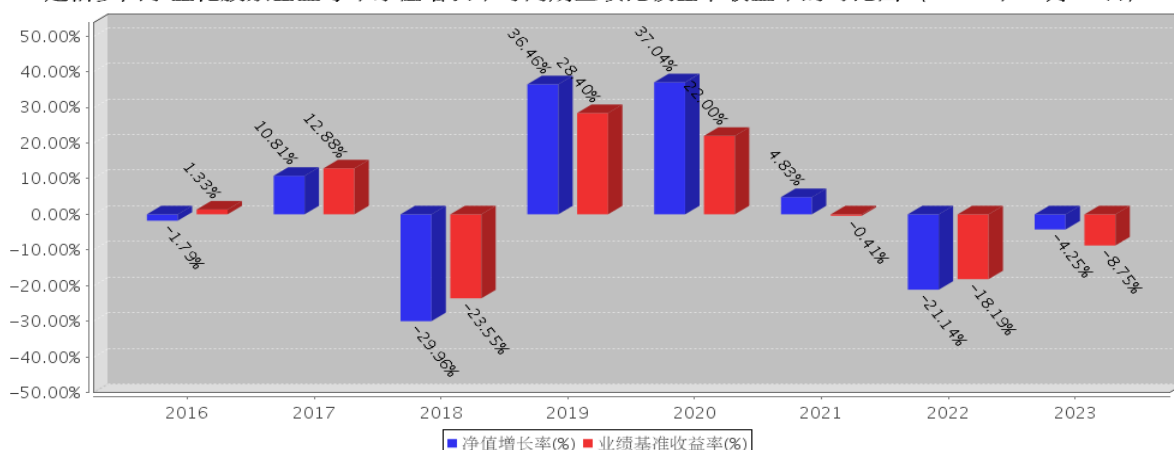
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2024年3月31日)



## (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

建信多因子量化股票基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2023年12月31日）



注：基金的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
申购费 (前收费)	0 万元 ≤ M < 100 万元	1.50%
	100 万元 ≤ M < 200 万元	1.20%
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%
	M ≥ 500 万元	1,000.00 元/笔
赎回费	0 天 ≤ N < 7 天	1.50%
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%
	30 天 ≤ 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	1.20%	基金管理人和销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
审计费用	40,000.00 元	会计师事务所
其他费用	本基金其他费用详见本基金合同或招募说明书费用章节。	相关服务机构

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、指数许可使用费（若有）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）
1.88%

注：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。

#### 1、本基金的特定风险

本基金作为积极型的股票基金，在具体投资管理中会至少维持 80% 的股票投资比例，因此具有对股票市场的系统性风险。鉴于中国股市目前仍处于发展阶段，具有波动性较大的特征，因而本基金管理人在必要时将通过资产配置，力求降低系统性风险。

此外，本基金采取的量化模型可能会因为基础性条件改变等原因而无法达到预期的投资效果；基金管理人在某些数量化策略模型的选择上和配置上可能会出现失误，从而影响基金收益而产生风险。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

#### 2、管理风险

在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，或者由于基金数量模型设计不当或实施差错导致基金收益水平偏离业绩基准从而影响基金收益水平。对主要业务人员如基金经理的依赖也可能产生管理风险。

#### 3、流动性风险

本基金的流动性风险主要体现为基金申购、赎回等因素对基金造成的流动性影响。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

### (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官方网站 [www.ccbfund.cn] [客服电话：400-81-95533]

- 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