

# 长盛量化红利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：2023年3月7日

送出日期：2023年3月8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    | 长盛量化红利混合    | 基金代码           | 080005       |
| 基金管理人   | 长盛基金管理有限公司  | 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11月25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    | 王宁          | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021年08月26日  |
|         |             | 证券从业日期         | 1998年05月08日  |

### 二、基金投资与净值表现

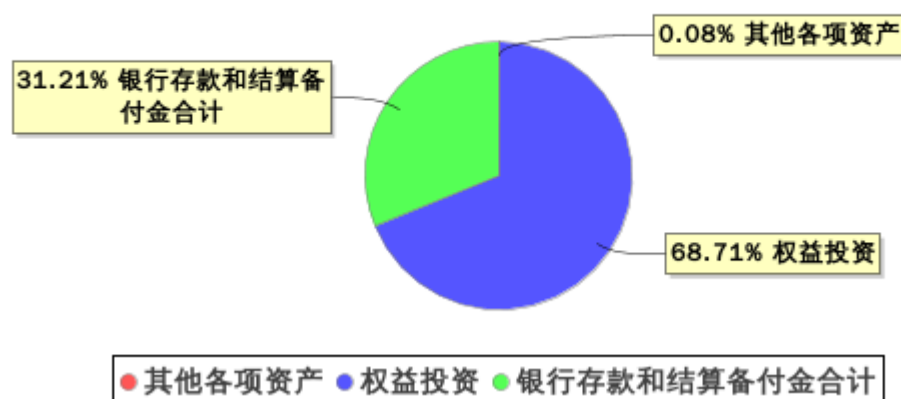
#### (一) 投资目标与投资策略

(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   | 本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标，并追求风险调整后的收益最大化，满足投资人长期稳健的投资收益需求。  |
| 投资范围   | 本基金投资于具有良好流动性的金融投资工具，包括股票、债券等。此外，本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。<br>基金资产配置比例为：股票类资产占基金资产的比例为60%—95%，其中投资于红利股票的比例不低于股票类资产的80%。债券类资产占基金资产的比例为0%—40%，权证投资占基金资产净值的比例为0%—3%，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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。<br>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的程序后，可以将其纳入投资范围。 |
| 主要投资策略 | 本基金通过严格的数量化股票选择方法生成红利风格股票池，在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合，从而形成基于核心-卫星投资策略的股票资产组合。其中，大类资产配置策略综合考虑宏观经济、政策导向和市场环境（市场估值水平、资金供求）等因素，股票投资中将以红利股票投资为主导，以价值型企业及分红能力作为选择投资对象的核心标准。  |
| 业绩比较基准 | 75%×中证红利指数+25%×中证综合债指数   |
| 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。   |

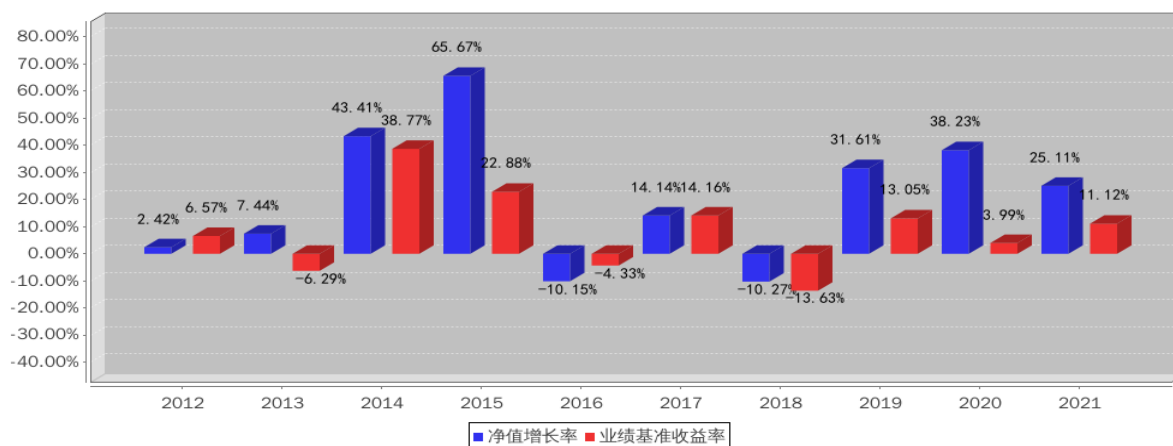
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2022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

长盛量化红利混合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(2021年12月31日)



注: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)<br>/持有期限(N) | 收费方式/费率  |
|--------------|-------------------------|----------|
| 申购费<br>(前收费) | M < 50万                 | 1.50%    |
|              | 50万 ≤ M < 200万          | 1.00%    |
|              | 200万 ≤ M < 500万         | 0.30%    |
|              | M ≥ 500万                | 1,000元/笔 |
| 赎回费          | N < 7天                  | 1.50%    |
|              | 7天 ≤ N < 1年             | 0.50%    |
|              | 1年 ≤ N < 2年             | 0.25%    |
|              | N ≥ 2年                  | 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%           |
| 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。

本基金主要面临的常规风险有市场风险、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：本基金采用量化红利投资策略，基金的投资主要根据所预测的股票未来股息率来筛选投资对象，并通过多因子指标进行相应的股票组合优化，但由于上市公司实际股息分配存在不确定的变化，可能存在股息率的预测偏差，进而导致短期的红利投资量化模型并非最优，可能使得本基金的收益低于其他混合型基金。

### (二) 重要提示

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](http://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。