

# 华商大盘量化精选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：2024年5月27日

送出日期：2024年6月7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	华商大盘量化精选混合	基金代码	630015
基金管理人	华商基金管理有限公司	基金托管人	华夏银行股份有限公司
基金合同生效日	2013-04-09	上市交易所及上市日期	暂未上市
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	艾定飞	开始担任本基金基金经理的日期	2022-01-10
		证券从业日期	2014-07-07

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金主要以数量化投资技术为基础，并与基本面研究紧密结合，充分发挥各自在投资决策过程中的优势，努力把握市场长中短各期投资机会，在严格控制风险的前提下，实现基金资产的持续稳健增长。
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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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>本基金的投资组合比例为：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）投资比例为基金资产的0-95%。大盘股投资比例不低于股票资产的80%，其中大盘股是指总市值不低于20亿元或者流通市值不低于15亿元。</p> <p>债券、权证、现金、货币市场工具、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5-100%，其中权证占基金资产净值的0%-3%，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，保持现金或者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，股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，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>基金因所持有股票价格的变化而导致大盘股投资比例低于上述规定的不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内进行调整，最长不超过6个月。未来，随股票市场发展</p>

和个股市值差异的变化，基金管理人可在保持大盘风格的前提下适当调整大盘股定义标准，并及时公告。

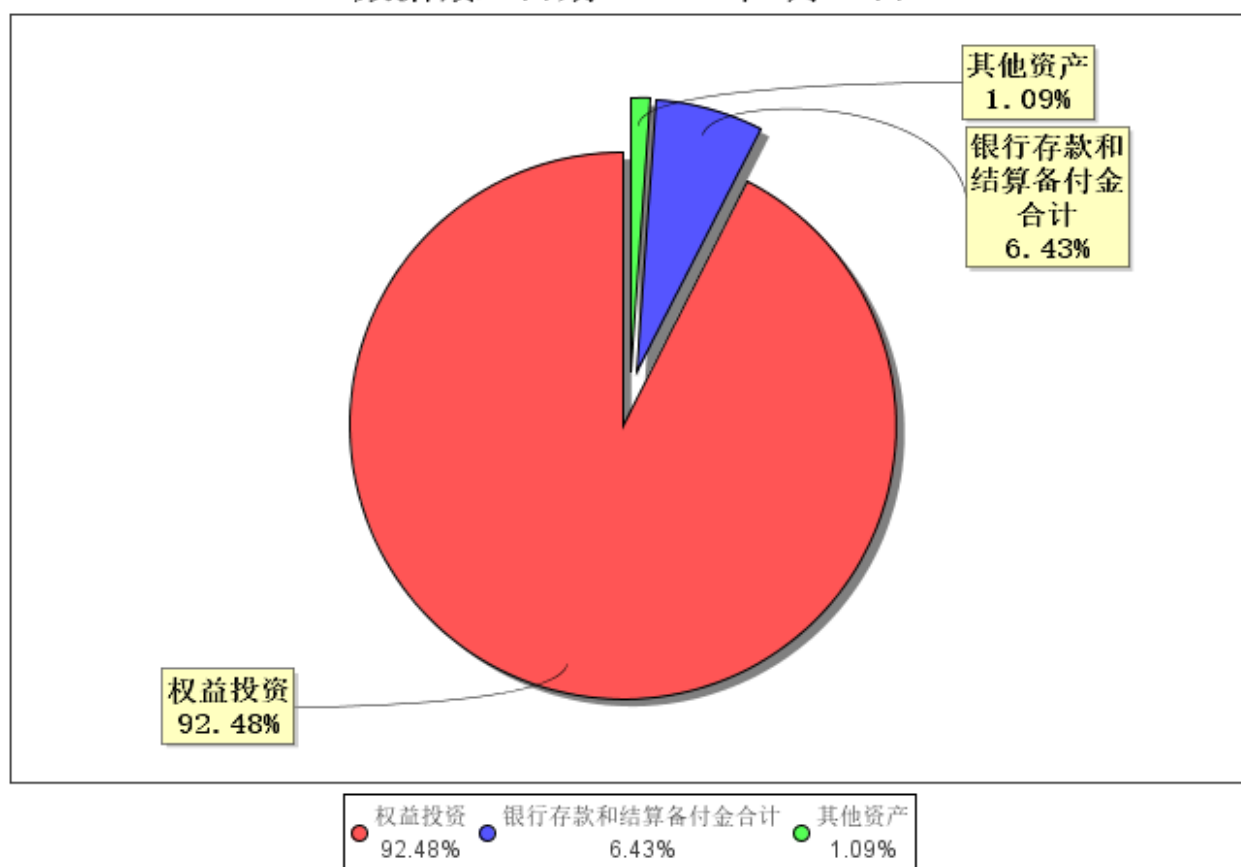
**主要投资策略** 本基金坚持“自上而下”的系统风险模型判定策略和“自下而上”的股票投资策略相结合的原则，并辅以定性分析。首先基于系统风险模型来判定中短期市场风险，以此来控制投资组合仓位和采用股指期货择时对冲策略；结合量化股票分析系统来选择股票，并辅以基本面研究分析个股做二次确认；对于模型所选出的并得到基本面研究支持的股票，再对其进行技术形态和统计指标分析来做个股择时；最后对满足条件的股票进行投资。  
具体投资策略详见基金合同。

**业绩比较基准** 沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%

**风险收益特征** 本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

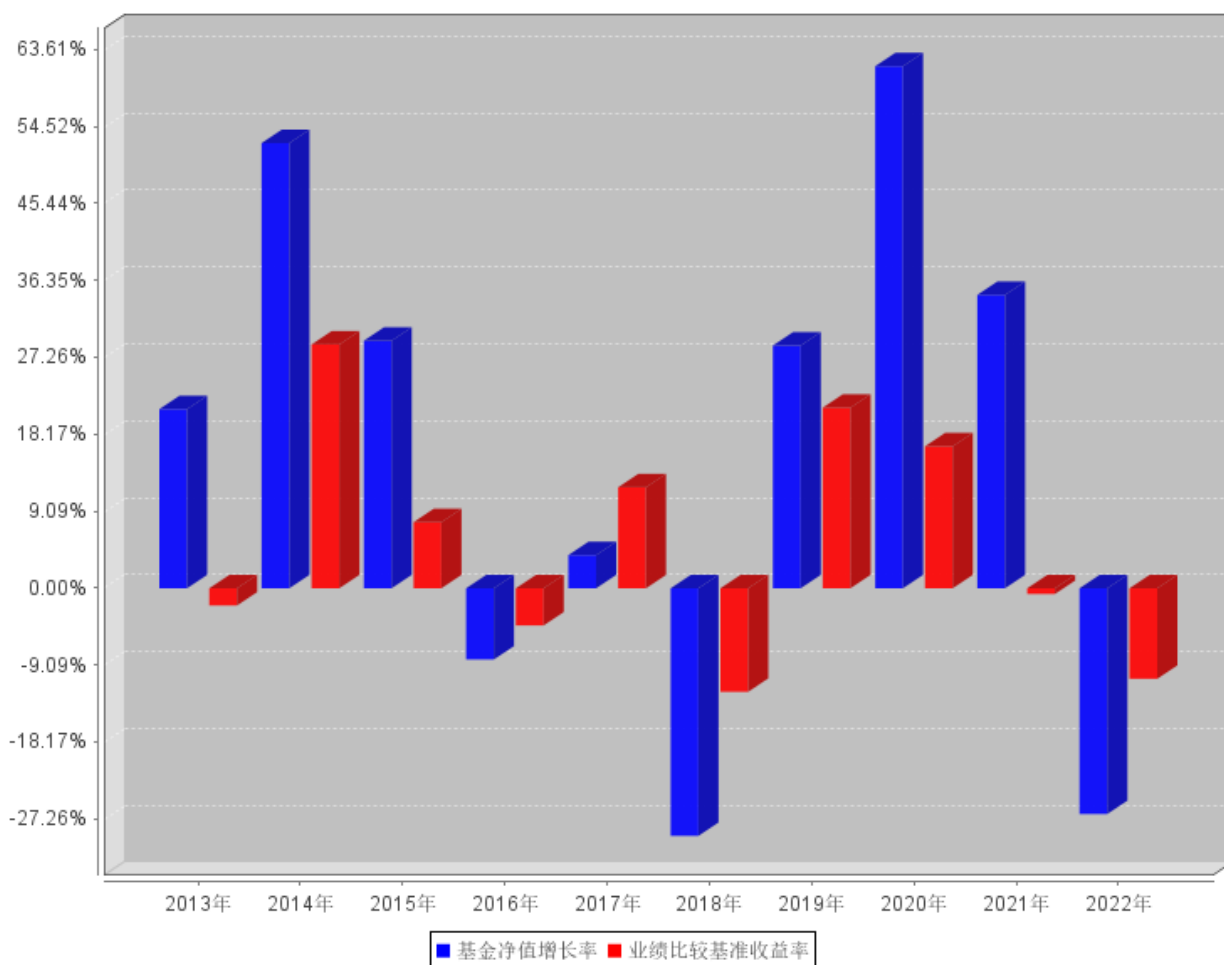
## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

**投资组合资产配置图表**  
数据截止日期：2023年3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

最近十年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2022年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 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%	-
	2,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.8%	-
	M ≥ 5,000,000	1000元/笔	-
赎回费	N < 7日	1.5%	-
	7日 ≤ N < 365日	0.5%	-
	1年 ≤ N < 2年	0.25%	-
	N ≥ 2年	0%	-

注：通过本公司直销中心申购本基金的养老金客户适用特定的申购费率，详见本基金《招募说明书》及相关公告。

## （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
销售服务费	-	销售机构
审计费用	59,000	会计师事务所
信息披露费	120,000	规定披露报刊

注：其他费用详见本基金基金合同、招募说明书及相关公告。基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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。

本基金审计费用以及信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，列示单位为人民币元，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）	
持有期间	1.48%

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。

本基金投资运作过程中面临的主要风险有：市场风险、管理风险、流动性风险、投资科创板股票的风险、投资存托凭证的风险、股指期货等金融衍生品投资风险、启用侧袋机制的风险、本基金特有的风险及其他风险。本基金特有的风险：本基金是量化基金，采用自主研发的数量化投资管理系统进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如风险判定模型判断有误、择股模型筛选股票不当、参数设立错误和系统运行所产生的风险。

### （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。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。仲裁委员会是中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点是北京。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见华商基金管理有限公司网站（[www.hsfund.com](http://www.hsfund.com)）。客服电话：400-700-8880、010-58573300。

1、《华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

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。