

## 汇泉智享量化选股混合型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要

编制日期：2024年06月24日

送出日期：2024年06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	汇泉智享量化选股混合	基金代码	020922
基金简称 C	汇泉智享量化选股混合 C	基金代码 C	020923
基金管理人	汇泉基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	-	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	杨宇	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	1998年07月08日

注：本产品处于募集期，基金经理任职日期以产品合同生效日为准。

## 二、基金投资与净值表现

## (一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金通过量化模型对不同资产类别和投资策略进行动态配置和个股精选，在严格控制风险和保证良好流动性的前提下，力争获取相对业绩比较基准的超额收益。
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（含主板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、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、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经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、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权）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相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。在条件许可的情况下，本基金可根据相关法律法规，在履行适当程序后，参与融券业务和转融通证券出借业务。 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

	<p>当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例：本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的 0%-50%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于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%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
<b>主要投资策略</b>	<p>资产配置方面，本基金以量化多因子策略为基础，依托汇泉自主研发的数量分析模型，动态调整大类资产的投资比例，并结合宏观环境动态调整行业配置和投资策略，精选优质个股构建具备超额收益的股票投资组合。股票投资方面，本基金通过定性分析对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司；利用定量分析方法对基本面投资理念系统化。债券投资方面，本基金主要通过类属配置、期限结构配置两个层次进行投资管理。</p>
<b>业绩比较基准</b>	<p>中证 800 指数收益率×65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×30%</p>
<b>风险收益特征</b>	<p>本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

注：投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读本基金的《汇泉智享量化选股混合型证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。本基金产品有风险，投资需谨慎。

## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

注：本基金暂不适用。

## （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

注：本基金暂不适用。

## 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
认购费			本类份额不收取认购费
申购费(前收费)			本类份额不收取申购费
赎回费	N<7 天	1.50%	
	7 天≤N<30 天	0.50%	

N≥30 天

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
销售服务费 C 类	0.60%	销售机构
审计费用	—	会计师事务所
信息披露费	—	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、仲裁费和诉讼费，基金份额持有人大会费用，基金的证券、期货、股票期权交易费用，基金的银行汇划费用，基金的开户费用、账户维护费用，因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用，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。	相关服务机构

注：本基金费用的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。相应费用年金额的，金额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。本产品处于募集期，审计费用和信息披露费暂无预估的年度收费金额。

## 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。

本基金投资过程中面临的主要风险有：投资组合的风险、管理风险、合规性风险、操作风险、本基金特有风险、启用侧袋机制的风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险及其他风险。其中特有风险包括：

1、市场下跌风险，本基金是混合型基金，基金资产主要投资于股票市场与债券市场，因此股市、债市的变化将影响到基金业绩表现。本基金虽然按照风险收益配比原则，实行动态的资产配置，但并不能完全抵御市场整体下跌风险，基金净值表现因此会可能受到影响。

2、本基金的投资范围包括港股通标的股票，本基金面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险。

3、本基金的投资范围包括股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品和存托凭证、资产支持证券等特殊品种而面临的其他额外风险。

4、本基金的投资范围包括融资业务，存在市场风险、流动性风险、信用风险。

5、基金管理人职责终止的风险，在基金管理人职责终止情况下，投资者面临基金管理人变更

或基金合同终止的风险。

## （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。

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，仲裁地点是北京市。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见汇泉基金管理有限公司官方网站：[www.springsfund.com](http://www.springsfund.com)；客服电话：400-001-5252、010-81925252。

- 1、《汇泉智享量化选股混合型证券投资基金基金合同》  
《汇泉智享量化选股混合型证券投资基金托管协议》  
《汇泉智享量化选股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。