

# 平安量化精选混合型发起式证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要(更新)

编制日期: 2020年8月24日

送出日期: 2020年8月25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	平安量化精选混合	基金主代码	005486
下属基金份额类别	平安量化精选混合C	下属基金份额类别代码	005487
基金管理人	平安基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2018年2月1日		
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	刘俊廷	开始担任本基金基金经理的日期	2020年4月24日
		证券从业日期	2011年7月18日
基金经理	毛时超	开始担任本基金基金经理的日期	2020年7月15日
		证券从业日期	2016年7月5日
其他	《基金合同》生效满三年之日,若基金规模低于2亿元人民币的,《基金合同》自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续。		

## 二、基金投资与净值表现

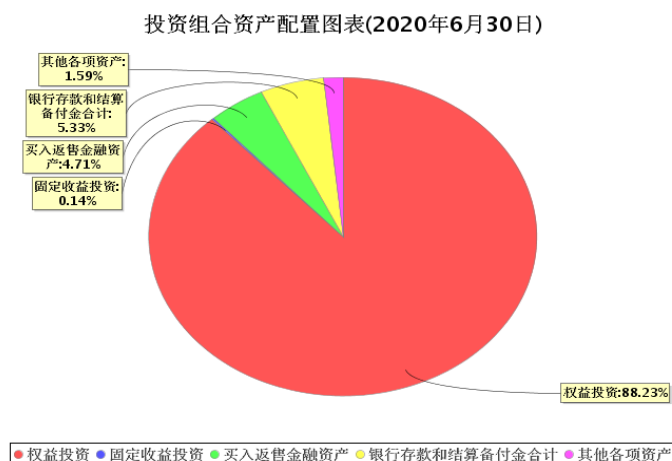
### (一) 投资目标与投资策略

投资目标	在严格控制风险的基础上,本基金通过量化模型进行资产配置、精选股票,力求在有效分散风险的同时实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	<p>本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票),权证,股指期货,国债期货,债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许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:股票占基金资产的比例范围为45-90%,其中每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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%,前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证及其他金融工具的投资比例依照法律</p>

	<p>法规或监管机构的规定执行。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的,基金管理人将在履行适当程序后,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>本基金在投资过程中主要运用量化投资策略进行投资管理,减少人为主观情绪及个人判断的失误概率,使投资过程富有纪律性和规范性,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。本基金的投资策略主要包括两部分:一是,采取数量化方法,运用行业轮动投资时钟的资产配置策略,确定资产配置的具体比例;二是,在股票投资过程中,本基金将保持通过模型选股构建股票投资组合的投资策略,强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险,力争实现基金资产的长期稳定增值。</p>
<b>业绩比较基准</b>	<p>沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%</p>
<b>风险收益特征</b>	<p>本基金是混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金</p>

注:详见本基金招募说明书第九部分“基金的投资”。

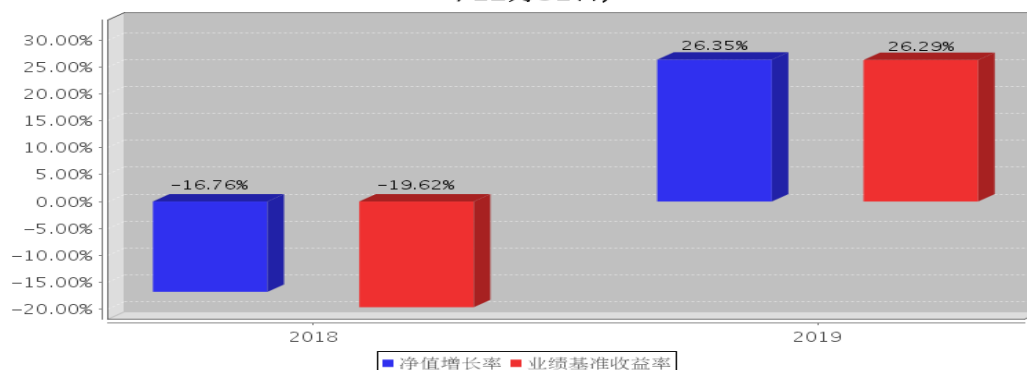
### (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



注:由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

### (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对比图

平安量化精选混合C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(2019年12月31日)



注:1、数据截止日期为2019年12月31日。

- 2、本基金基金合同于2018年02月01日正式生效
- 3、基金的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

以下费用在赎回基金过程中收取：

费用类型	金额(M) / 持有期限(N)	收费方式 / 费率	备注
赎回费	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.50%	
	30 天 ≤ N	0.00%	

注：本基金C类份额无申购费

#### (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	0.80%
其他费用	会计师费、律师费、审计费等

注：本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。

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。

### 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。

本基金的主要风险：

- 1、市场风险
- 2、管理风险
- 3、流动性风险评估及流动性风险管理
- 4、股指期货、国债期货等金融衍生品投资风险
- 5、中小企业私募债券的投资风险
- 6、资产支持证券的投资风险
- 7、流通受限证券的投资风险
- 8、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
- 9、科创板的投资风险
- 10、本基金的特定风险：

(1) 本基金属于混合型基金，股票、债券和货币等大类资产之间的配置策略受宏观经济、微观经济、市场环境、技术周期等各类因素的影响，配置策略的错误将导致本基金的特定风险。

(2) 特定投资对象风险本基金的股票投资在行业研究的基础上，通过自上而下和自下而上相

结合的方法,精选具有成长型的公司股票和价值被低估的股票构建投资组合。但是,在特定的市场时期,由于市场偏好和热点不同,可能存在股票价格显著偏离其价值的情况,从而导致基金业绩表现在短期内落后于市场。

此外,在上市公司股票估值分析中,基金管理人将重点关注财务指标中的价值类指标。若上市公司公开财务数据存在一定程度的信息失真,这也可能导致研究结果与公司实际投资价值发生偏离,从而导致投资风险。

(3)《基金合同》生效三年后基金无法继续存续的风险本基金的《基金合同》生效之日起三年后的对应日,若基金资产规模低于2亿元,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限,存在着基金无法继续存续的风险。

## (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。

对于因本基金合同的订立、内容、履行和解释或与本基金合同有关的争议,合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会进行仲裁,仲裁地点为北京市。

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

以下资料详见平安基金官方网站

网址: [www.fund.pingan.com](http://www.fund.pingan.com) 客服电话: 400-800-4800(免长途话费)

- 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