

# 海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划（C类份额）产品资料概要

编制日期：2021年2月10日

送出日期：2021年2月18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	海通量化价值精选	基金代码	850004
下属基金简称	海通量化价值精选C	下属基金交易代码	850099
基金管理人	上海海通证券资产管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年2月24日		
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式	开放频率	C类份额每个开放日办理申购赎回业务；C类份额持有人持有的每份份额最短持有期限为一年，在最短持有期限内该类集合计划份额不可赎回或转换转出。
基金经理	胡倩	开始担任本基金基金经理的日期	2019年5月8日
		证券从业日期	2003年8月25日
基金经理	朱蓓	开始担任本基金基金经理的日期	2019年5月8日
		证券从业日期	2009年12月15日
其他	本集合计划为证券公司大集合资产管理产品，根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》，参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，由海通稳健成长集合资产管理计划转型而来。		

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

投资目标	本集合计划通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现集合计划资产的增值。
投资范围	本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法

	<p>发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许集合计划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>本集合计划根据法律法规的规定参与融资业务。在法律法规允许的情况下并履行适当程序后，本集合计划可以参与融券业务和转融通证券出借业务。在法律法规允许的情况下，本集合计划可以投资各类期权品种。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于股票的比例占集合计划资产的 60%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。</p>
<p><b>主要投资策略</b></p>	<p>本集合计划基于长期量化研究构建投资模型，坚持数据驱动，挖掘市场中的潜在逻辑，通过优化量化投资模型来规避情绪带来的负面影响，力图获得超越业绩基准的投资回报。</p> <p>本集合计划基于实证检验，选取出符合 A 股投资逻辑的因子，并根据对经济周期和资本市场发展的不同阶段的分析和判断动态调整因子权重，从而构建多因子选股体系。策略组合构建方法包括：（1）筛选有效因子；（2）动态优化因子权重；（3）生成股票组合并优化股票权重；（4）港股投资策略。</p> <p>主要投资策略有：资产配置策略、以超越业绩基准为目的的股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、融资业务投资策略、其他金融衍生产品的投资策略。</p>
<p><b>业绩比较基准</b></p>	<p>80%×沪深 300 指数收益率+20%×商业银行活期存款利率（税后）</p>
<p><b>风险收益特征</b></p>	<p>本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。</p> <p>本集合计划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>
<p>注：详见《海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》第九部分“集合计划的投资”。</p>	

**(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表**

注：无。

**(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：无。

### 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	金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式 / 费率	备注
认购费	-	-	
	-	-	
	-	-	
申购费 (前端收费)	-	-	
	-	-	
	-	-	
赎回费	N < 7 天	1.5%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%	
	N ≥ 30 天	0%	

#### (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	0.8%
业绩报酬	在本集合计划投资者赎回日和集合计划终止日，管理人将根据投资者的期间年化收益率 (R)，对 C 类计划份额期间年化收益率超过 8% 以上部分按照 20% 的比例收取管理人业绩报酬。
托管费	0.15%
销售服务费	0.5%
其他费用	-

注：本集合计划交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从集合计划资产扣除；按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

### 四、风险揭示与重要提示

#### (一) 风险揭示

本集合计划不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买本集合计划时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

本集合计划的主要风险包括系统性风险、非系统性风险、集合计划管理风险、流动性风险、本集合计划的特定风险及其他风险。其中本集合计划的特定风险包括：参与港股通标的股票的投资风险、股指期货投资风险、股票期权投资风险、资产支持证券的投资风险及融资业务的风险。

#### (二) 重要提示

中国证监会对海通稳健成长集合资产管理计划变更为本集合计划的批准，并不表明其对本集合计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。

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本集合计划财产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

投资者自依《资产管理合同》取得本集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《资产管理合同》的当事人。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见上海海通证券资产管理有限公司官方网站[[www.htsamc.com](http://www.htsamc.com)][客服电话:95553]

- 《海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》、《海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》
- 定期报告，包括本集合计划季度报告、中期报告和年度报告
- 本集合计划份额净值
- 销售机构及联系方式
- 其他重要资料