

浦银安盛港股通量化优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：2021年9月1日

送出日期：2021年09月03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 | 浦银安盛港股通量化混合 | 基金代码 | 005255 |
| 下属基金简称 | 浦银安盛港股通量化混合 A | 下属基金交易代码 | 005255 |
| 下属基金简称 | 浦银安盛港股通量化混合 C | 下属基金交易代码 | 013224 |
| 基金管理人 | 浦银安盛基金管理有限公司 | 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2018年1月24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 | 罗雯 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2018年1月24日 |
| | | 证券从业日期 | 2008年7月8日 |

注：自2021年8月5日起，本基金增加C类份额。

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

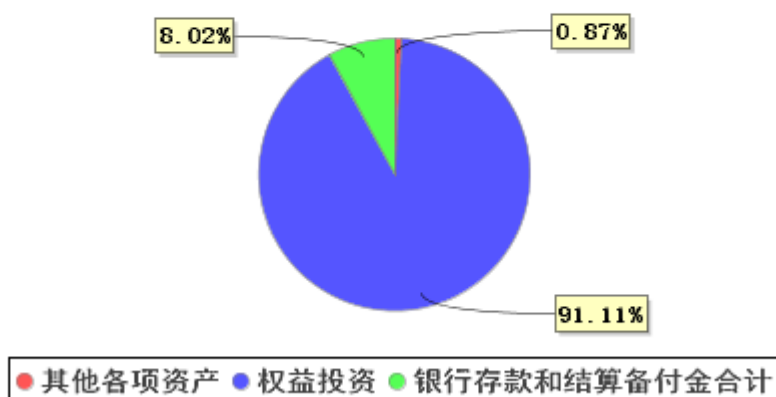
请投资者阅读《招募说明书》第九章了解详细情况

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金通过积极主动的资产配置，在合理控制风险并保证充分流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资范围 | 本基金投资于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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（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、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款、衍生工具（股指期货、权证等）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）。 基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不低于非现金资产的80%，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，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%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 |
| 主要投资策略 | 资产配置策略采用浦银安盛资产配置模型，通过宏观经济、估值水平、流动性和市场政策等四个因素的分析框架，动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，进行股票、债券和现金等大类资产的合理配置，在严格控制投资风 |

| | |
|---------------|---|
| | 险的基础上追求基金资产的长期持续稳定增长。 本基金在个股选择策略上，注重有现金分红、成长性好、基本面优良、相对 A 股市场估值合理的股票进行长期投资。此外，将从香港股票市场与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响和人民币与港币间的汇兑比率变化等方面对投资策略进行调整。 |
| 业绩比较基准 | 恒生综合指数收益率*55%+中证综合债指数收益率*45% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于中高风险、中高收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担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。 |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

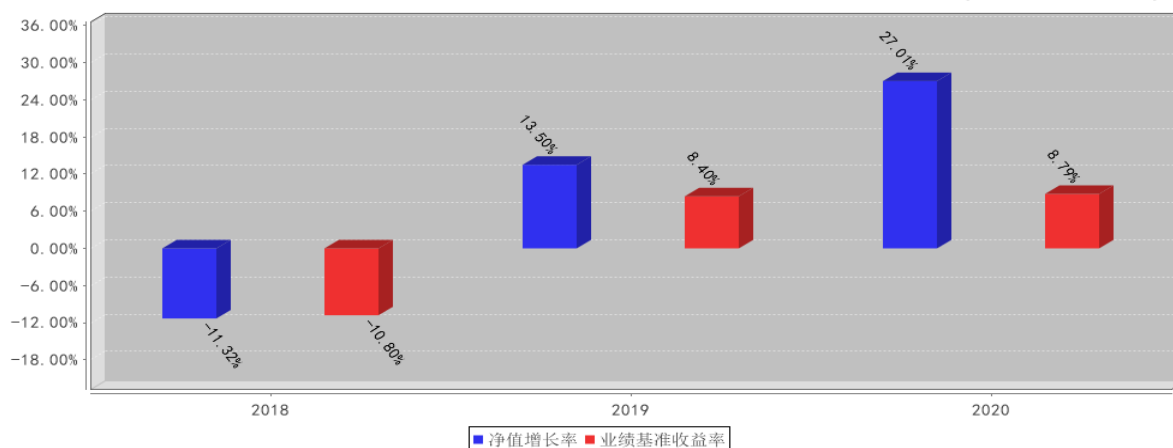
投资组合资产配置图表(2021年6月30日)



注:由于四舍五入原因,上述各类资产市值占资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

(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比较图

浦银安盛港股通量化混合A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(2020年12月31日)



注:本基金合同生效日为2018年1月24日,生效当年非完整自然年度,按实际存续期计算。业绩表现截止日期2020年12月31日。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:

浦银安盛港股通量化混合 A

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|--------------|-----------------------------|-----------|
| 申购费 (前收费) | M < 100 万元 | 1.50% |
| | 100 万元 ≤ M < 300 万元 | 1.00% |
| | 300 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.30% |
| | M ≥ 500 万元 | 1,000 元/笔 |
| 赎回费 | N < 7 日 | 1.50% |
| | 7 日 ≤ N < 30 日 | 0.75% |
| | 30 日 ≤ N < 1 年 | 0.50% |
| | 1 年 ≤ N < 2 年 | 0.25% |
| | N ≥ 2 年 | 0.00% |

浦银安盛港股通量化混合 C

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|------|-----------------------------|---------|
| 赎回费 | N < 7 日 | 1.50% |
| | 7 日 ≤ N < 30 日 | 0.50% |
| | N ≥ 30 日 | 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 | |
|-------|---------------|-------|
| 管理费 | 1.50% | |
| 托管费 | 0.25% | |
| 销售服务费 | 浦银安盛港股通量化混合 C | 0.40% |
| 其他费用 | 会计师费、律师费等 | |

注:本基金交易证券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。投资本基金可能遇到的风险包括:因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金投资策略所特有的风险等。

1、本基金特有风险如下:

1.1、本基金在类别资产配置中会由于受到市场环境、公司治理、制度建设等因素的不同影响,导致资产配置偏离最优化,这可能为基金投资绩效带来风险。

1.2、与量化投资方法相关的特定风险

量化策略投资以广泛覆盖各类信息源的数据库为基础,包括宏观经济数据、行业经济数据、证券与期货交易行情数据、上市公司财务数据等。这些数据通常来源于不同的数据提供商,并且因为不同的需要,在数据加工过程中可能遵循不同的规范。基金管理人以加工后的数据作为建立模型的数据来源,因此,源

数据错误或预处理过程中出现的错误可能直接影响量化模型的输出结果，形成数据风险。

此外，由于本基金借鉴外方股东安盛投资管理亚洲（新加坡）Rosenberg 团队在港股市场上的量化投资管理经验采用量化模型指导投资决策，因此定量方法的缺陷在一定程度上也会影响本基金的表现。一方面，面对不断变换的市场环境，量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中；另一方面，在定量模型的具体设定中，核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性；最后，定量模型存在对历史数据的依赖。因此，在实际运作过程中，市场环境的变化可能导致遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

1.3、投资于股指期货可能引致的特定风险

1.4、汇率风险

本基金将投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险。

1.5、境外市场的风险

(1) 本基金将通过港股通投资于香港市场，在市场进入、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

(2) 香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，本基金将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定风险。

1.6、投资科创板股票风险

1.7、存托凭证投资风险

2、开放式基金共有的风险如管理风险、流动性风险和其他风险。

3、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。

(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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见本基金管理人网站 网址[www.py-axa.com]

客服电话：400-8828-999（免长途话费）或（021）33079999

《浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、《浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料

六、其他情况说明

无