

# 博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票C）基金产品资料概要更新

编制日期：2023年3月8日

送出日期：2023年3月9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	博时量化多策略股票	基金代码	005635
下属基金简称	博时量化多策略股票 C	下属基金代码	005636
基金管理人	博时基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2018-04-03		
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日开放申购、赎回
基金经理	黄瑞庆	开始担任本基金基金经理的日期	2018-04-03
		证券从业日期	2002-07-01

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

敬请投资者阅读更新的《招募说明书》第八章了解详细情况

投资目标	本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求获取长期相对市场的超额收益。
投资范围	本基金主要投资于境内依法发行或上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、权证、股指期货、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、国债期货和现金，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的相关规定）。 基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的80%-95%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例为0-50%）；权证投资比例为基金资产净值的0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 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。

### 主要投资策略

#### 1、量化选股策略

(1) A股投资策略：本基金的选股策略以量化多策略体系为基础，涵盖因子打分、事件驱动、量价特征等多种投资逻辑。其中因子打分策略主要包括价值、成长、质量、市场情绪和分析师预期等因子，事件策略包括高管增持、股权激励、定向增发等，各个策略自成体系，具有各自的投资逻辑和风险特

#### (2) 港股投资策略：

本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下港股市场的投资机会。

#### 2、其他投资策略：

存托凭证投资策略、债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券的投资策略、金融衍生品投资策略。

### 业绩比较基准

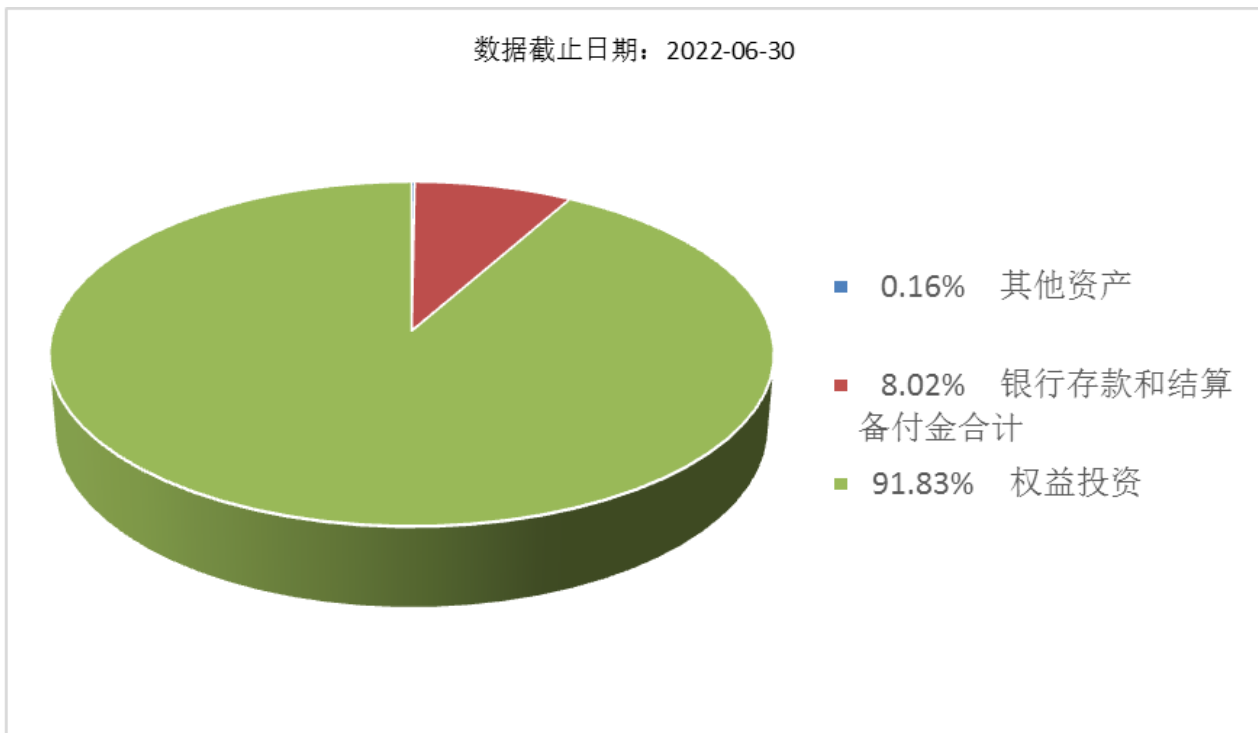
中证全指指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%

### 风险收益特征

本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于高风险/收益的基金。

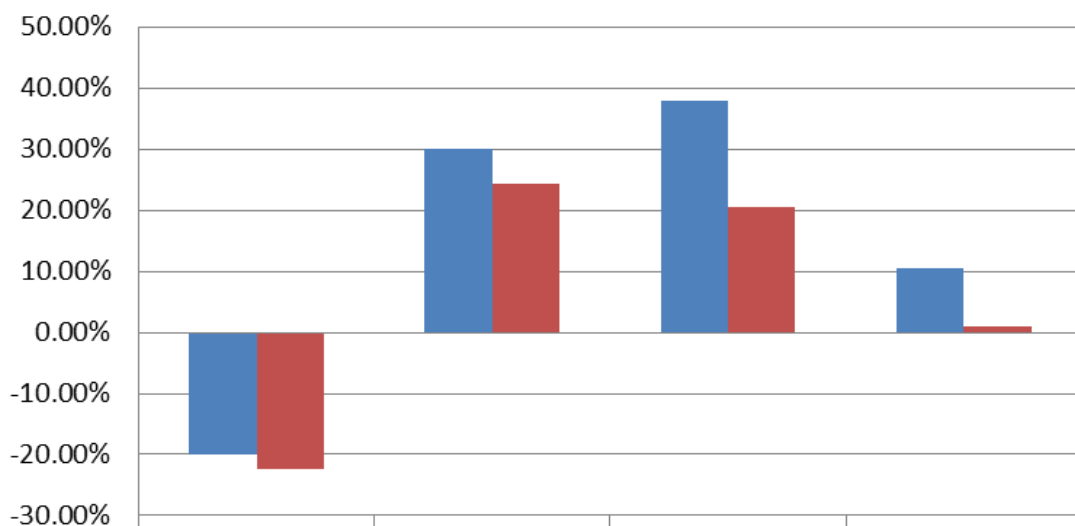
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

### 投资组合资产配置图表



## (三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

数据截止日期：2021-12-31



	2018	2019	2020	2021
净值增长率	-19.93%	30.10%	37.98%	10.55%
业绩基准收益率	-22.39%	24.43%	20.53%	1.07%

注：基金的过往业绩不代表未来表现。本基金份额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
赎回费	N < 7 天	1.50%	100%计入资产
	7 天 ≤ N < 30 天	0.50%	100%计入资产
	N ≥ 30 天	0.00%	

#### 申购费：

本基金 C 类基金份额不收取申购费

#### (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	固定比例 1.50%
托管费	固定比例 0.25%
销售服务费	固定比例 0.80%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所费、律师费、诉讼费和仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货交易费用；基金的银行汇划费用；账户开户费用、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。

投资者应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，及时关注本公司出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必然一致，本公司的适当性匹配意见并不表明对基金的风险和收益做出实质性判断或者保证。基金合同中关于基金风险收益特征与基金风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应了解基金的风险收益情况，结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险，不应采信不符合法律法规要求的销售行为及违规宣传推介材料。

#### 1、本基金的特定风险

##### (1) 港股通机制下，港股投资风险

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪/深港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还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定风险。

##### (2) 中小企业私募债券投资风险

本基金的投资范围包括中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。信用风险指发债主体违约的风险，是中小企业私募债最大的风险。流动性风险是由于中小企业私募债交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险。市场风险是未来市场价格（利率、汇率、股票价格、商品价格等）的不确定性带来的风险，它影响债券的实际收益率。这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

##### (3) 股指期货投资风险

本基金将股指期货纳入到投资范围中，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动就可能使投资人权益遭受较大损失。同时，股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金净值带来重大损失。

##### (4) 国债期货投资风险

1) 杠杆风险：衍生品投资具有高杠杆特性，因此会放大基础资产所产生的盈利或损失，加大资产管理计划投资收益的波动性。2) 基差风险：基差是指股票指数现货价格与股指期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本计划投资产生影响。3) 合约展期风险：本计划所投资的期货合约主要包括股指期货当月和近月合约。当基金所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。4) 强制平仓或止损风险：使用衍生品投资工具，有可能面临投资期内，价格反向波动过大导致的强制平仓或止损，比如结构化产品挂钩标的价格下跌超过一定程度触发止损条款，或期货保证金头寸不足导致强制平仓，在此情况下，委托资产将被迫产生损失，且日后标的资产价格回归也可能无法挽回全部已实现损失，对计划资产收益影响较大。5) 模型风险：衍生品属于虚拟投资品种，投资过程中需要通过模型进行风险定价，当投资人员使用了错误模型或者选择了不当的参数，会导致对风险或交易价格的估计错误而造成损失，损害资产管理计划的投资收益。

##### (5) 投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

2、本基金普通风险：市场风险（政策风险、经济周期风险、收益波动风险、利率风险、通货膨胀风险、再投

资风险等)、管理风险(决策风险、操作风险、技术风险、估值风险等)、信用风险、流动性风险、合规风险和其他风险。

## **(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**

以下资料详见基金管理人网站[网址:www.bosera.com][客服电话:95105568]

- (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

## **六、其他情况说明**

**争议解决方式:各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,任何一方均有权将争议提交华南国际经济贸易仲裁委员会,根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为深圳市,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,除非仲裁裁决另有决定,仲裁费由败诉方承担。**