

安信量化优选股票型发起式证券投资基金(A类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2023年8月21日

送出日期：2023年8月22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 | 安信量化优选股票 | 基金代码 | 006346 |
| 下属基金简称 | 安信量化优选股票 A | 下属基金交易代码 | 006346 |
| 基金管理人 | 安信基金管理有限责任公司 | 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9月3日 | 上市交易所及上市日期 | - |
| 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 |
| 基金经理 | 施荣盛 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020年01月13日 |
| | | 证券从业日期 | 2013年07月02日 |
| 其他 | 《基金合同》生效满3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元的，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基金合同期限。《基金合同》生效后，若连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的，基金管理人将根据基金合同第十九部分的约定进行清算并终止《基金合同》，而无需召开基金份额持有人大会。 | | |

二、基金投资与净值表现

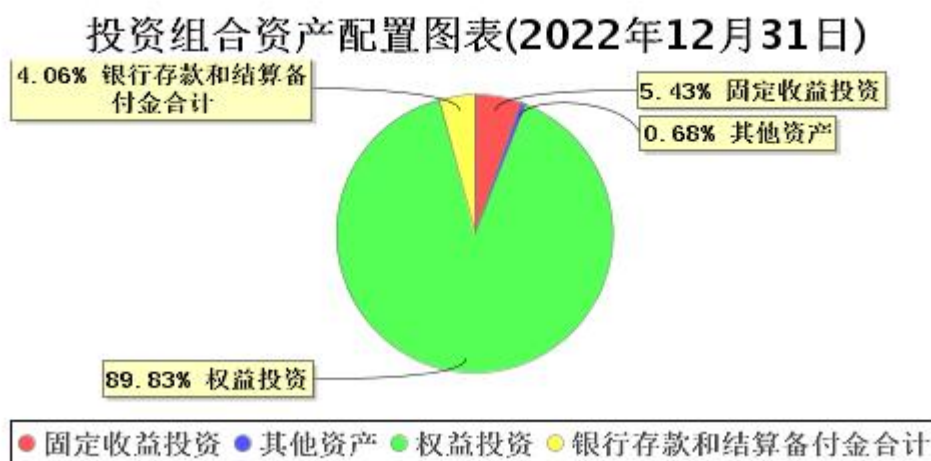
(一) 投资目标与投资策略

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金以数量化分析为基础，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。 |
| 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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离型可转换债券）、次级债、可交换债券、资产支持证券、银行存款、债券回购、权证、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。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。 基金的投资组合比例为： 本基金股票投资占基金资产的比例为80%-95%；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，本基金保留的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 | 资产配置方面，通过对宏观经济周期、宏观政策导向、货币供应量、市场估值水平以及市场情绪等因素的分析，形成对大类资产收益率在不同市场周期的预测和判断，从而确 |

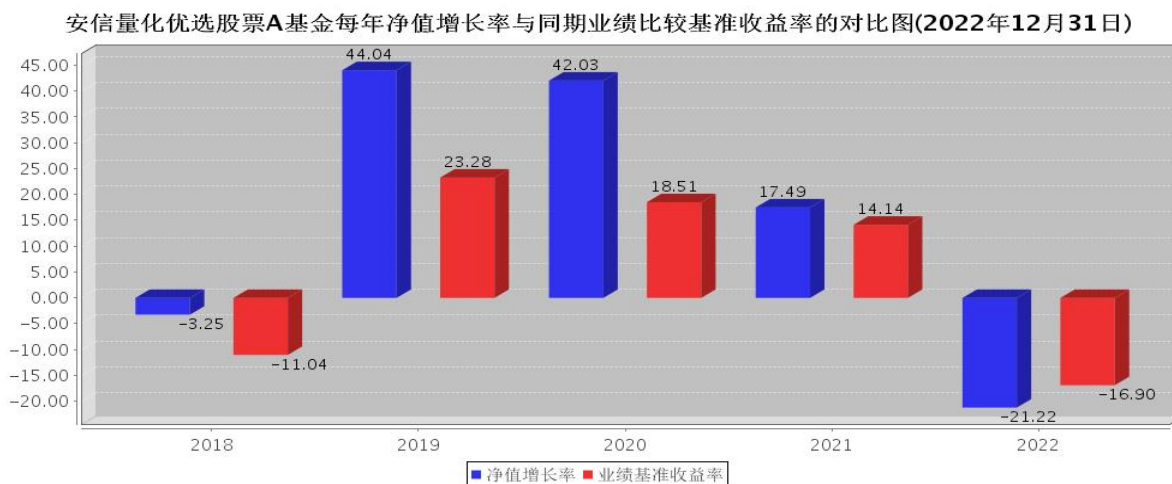
| | |
|---------------|--|
| | 定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，适度降低组合系统性风险。本基金使用量化模型构建股票组合，主要基于对股票市场及上市公司相关数据的深度挖掘，在综合数据可获得性、建模复杂程度的基础上，对数据进行个性化的分析处理，形成了一套完善的选股体系，并据此构建股票组合。债券投资方面，采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。同时，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将采用国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。 |

注: 详见《安信量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》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



(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:基金合同生效当年期间的相关数据按实际存续期计算。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

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:

| 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 | M<1,000,000 | 1.20% | - |
| | 1,000,000≤M<3,000,000 | 0.80% | - |
| | 3,000,000≤M<5,000,000 | 0.40% | - |
| | M≥5,000,000 | 1,000.00元/笔 | - |
| 申购费 (前收费) | M<1,000,000 | 1.50% | - |
| | 1,000,000≤M<3,000,000 | 1.00% | - |
| | 3,000,000≤M<5,000,000 | 0.60% | - |
| | M≥5,000,000 | 1,000.00元/笔 | - |
| 赎回费 | N<7天 | 1.50% | 100%归入基金资产 |
| | 7天≤N<30天 | 0.75% | 100%归入基金资产 |
| | 30天≤N<180天 | 0.50% | 30天≤N<90天,75%归入基金资产;90天≤N<180天,50%归入基金资产; |
| | N≥180天 | 0.00% | - |

注:投资人重复认/申购,须按每次认/申购所对应的费率档次分别计费。

认/申购费用由认/申购人承担,不列入基金资产,认/申购费用用于本基金的市场推广、注册登记和销售。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

本基金针对养老金客户的相关费率政策及在销售机构开展的费率优惠活动,详见本基金招募说明书或销售机构的公告。

(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 | 1.20% |
| 托管费 | 0.20% |
| 其他费用 | 会计师费、律师费、信息披露费等 |

注: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。

一) 本基金投资运作过程中面临的主要风险有:

1、市场风险；2、管理风险；3、职业道德风险；4、流动性风险；5、合规性风险；6、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；7、其他风险。

二) 本基金的特有风险

(1) 市场下跌风险

本基金是股票型基金，基金资产主要投资于股票市场，因此股市的变化将影响到基金业绩表现。本基金虽然使用量化模型构建风险调整后的最优股票投资组合，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。本基金管理人将发挥自身投研优势，加强市场、上市公司基本面的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

(2) 股指期货投资风险

1、杠杆风险；2、基差风险；3、股指期货展期时的流动性风险；4、期货盯视结算制度带来的现金管理风险；5、到期日风险；6、对手方风险；7、连带风险；8、未平仓合约不能继续持有风险。

(3) 资产支持证券投资风险

资产支持证券的风险主要包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险等。

(4) 国债期货的投资风险

国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。

(5) 量化模型的投资风险

(6) 本基金是发起式基金，在《基金合同》生效满3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元的，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基金合同期限。同时，《基金合同》生效满3年后本基金继续存续的，若连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的，基金管理人将根据基金合同第十九部分的约定进行清算并终止《基金合同》。因此，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

(二) 重要提示

安信量化优选股票型发起式证券投资基金的募集申请于2018年7月13日经中国证监会(2018)1119号文注册。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但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。

除监管规定信息发生重大变更外，基金管理人每年更新一次资料概要。因此，本文件内容可能存在一定的滞后性，敬请投资者同时关注基金管理人发布的临时公告。

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。

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，则任何一方有权将争议提交深圳仲裁委员会，仲裁地点为深圳市，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。

五、其他资料查询方式

以下资料详见安信基金官方网站 [www.essencefund.com] [客服电话：4008-088-088]

- 1、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》、
《安信量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议》、
《安信量化优选股票型发起式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