

## 蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）

编制日期：2023年08月25日

送出日期：2023年08月26日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决策前，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	蜂巢卓睿混合	基金代码	006857
基金简称 C	蜂巢卓睿混合 C	基金代码 C	006858
基金管理人	蜂巢基金管理有限公司	基金托管人	广发证券股份有限公司
基金合同生效日	2019年01月30日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	廖新昌	开始担任本基金基金经理的日期	2019年01月30日
		证券从业日期	1997年08月01日

## 二、基金投资与净值表现

## （一）投资目标与投资策略

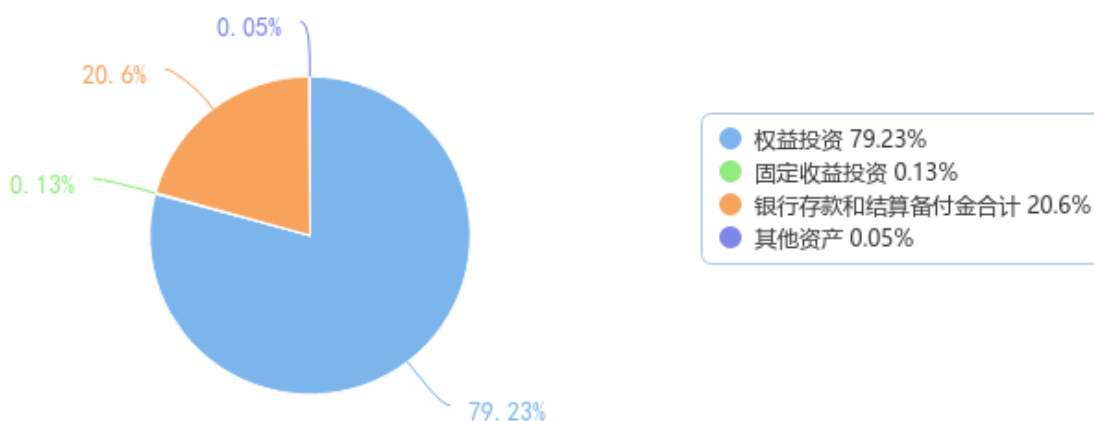
投资者可通过阅读《蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》第九部分了解详细情况。

投资目标	本基金通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资范围	本基金投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：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），债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、股指期货、国债期货、权证、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等，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：股票资产占基金资产的比例为0%-95%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约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的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。股指期货、国债期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。
主要投资策略	1. 资产配置策略；2. 股票投资策略；3. 债券投资策略；4. 衍生品投资策略；5. 资产支持证券投资策略。

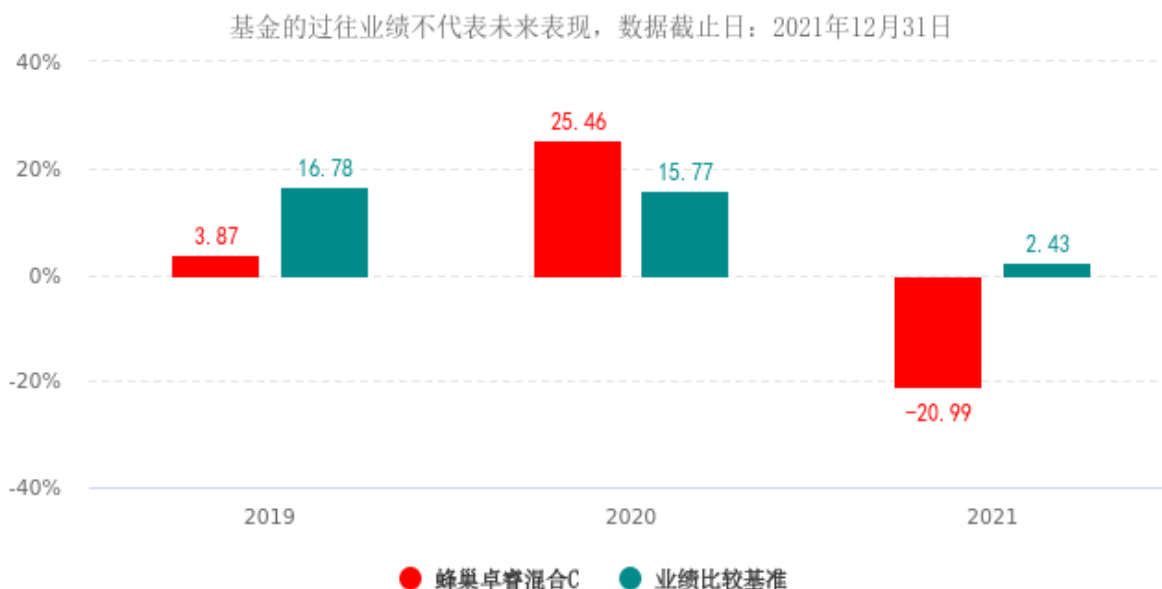
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*55%+中证全债指数收益率*45%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

## （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（数据截至日期：2022年06月30日）



## （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



## 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	1.5%	
	7 天≤N<30 天	0.5%	
	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	按日计提，按月收费/1.20%
托管费	按日计提，按月收费/0.20%
销售服务费 C 类	按日计提，按月收费/0.40%
其他费用	基金合同生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费、基金份额持有人大会费用、基金的证券和期货交易费用、基金的银行汇划费用、基金相关账户的开户费用和账户维护费用，以及按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

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。

#### 1. 本基金的特定风险：

本基金是混合型基金，基金资产主要投资于股票市场与债券市场，因此股市、债市的变化将影响到基金业绩表现。本基金虽然按照风险收益配比原则，实行动态的资产配置，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专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

#### （1）资产支持证券风险

本基金投资资产支持证券，可能面临利率风险、流动性风险、现金流预测风险。利率风险是指市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动可能会影响资产支持证券收益。

流动性风险是指在交易对手有限的情况下，资产支持证券持有人将面临无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而遭受损失的风险。资产支持证券的还款来源为基础资产未来现金流，现金流预测风险是指由于对基础资产的现金流预测发生偏差导致的资产支持证券本息无法按期或足额偿还的风险。

#### （2）投资于流通受限证券的风险

本基金投资范围包括流通受限证券，由于流通受限证券具有锁定期，存在潜在的流动性风险。

因此可能在本基金需要变现资产时，因流动性受限，本基金无法卖出所持有的流通受限证券，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

### （3）其他投资风险

本基金还投资于股指期货、国债期货等金融工具，而股指期货、国债期货属于高风险投资工具，相应市场的波动也可能给基金财产带来较高风险。

### （4）量化模型的投资风险

本基金使用量化模型构建股票组合，其中构建量化模型的数据包括交易数据、基本面数据、另类数据等因子，这些数据通常来源于不同的数据提供商，并且根据不同的需求在数据挖掘过程中可能采取不同的处理方法。投资人员采用处理后的数据构建量化选股模型，数据质量和数据挖掘过程中出现的错误可能直接影响量化模型的精度，形成数据风险。本基金采用量化模型构建股票投资组合，并不是基于量化模型进行程序化交易。本基金在投资过程中用到量化模型选股，量化模型的缺陷在一定程度上会影响基金的业绩表现，在实际运作过程中，市场环境的变化可能会导致量化模型失效，基金业绩表现不佳，无法达到预期的投资效果的风险。

## 2. 市场风险

证券市场价格受到各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：（1）政策风险。（2）经济周期风险。（3）利率风险。（4）购买力风险。（5）上市公司经营风险。

## 3. 信用风险

## 4. 流动性风险

## （二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册或核准，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。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。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，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[[www.hexaamc.com](http://www.hexaamc.com)][400-100-3783]

- 1、《蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 3、《蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

- 4、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 5、基金份额净值
- 6、基金销售机构及联系方式
- 7、其他重要资料

## 六、其他情况说明