

汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2024年10月08日

送出日期：2024年10月09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 | 汇丰晋信大盘波动股票 | 基金代码 | 002334 |
| 基金简称C | 汇丰晋信大盘波动股票C | 基金代码C | 002335 |
| 基金管理人 | 汇丰晋信基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2016年03月11日 | 上市交易所及上市日期 | 暂未上市 |
| 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 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 证券从业日期 | |
| 刘禹良 | 2023年11月18日 | 2020年10月12日 | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

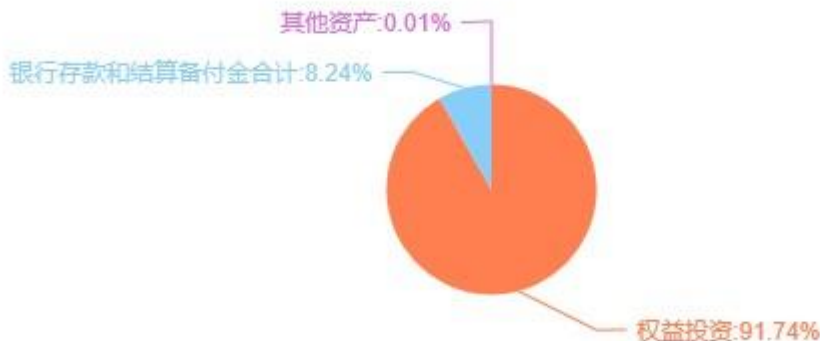
请投资者阅读《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金招募说明书》第十一部分“基金的投资”了解详细情况。

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金基于汇丰集团低波动率策略构建投资组合，力求为投资者提供相对业绩比较基准更高的相对收益。 |
| 投资范围 | 本基金为股票型基金，投资范围包括国内依法发行上市的股票(含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构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。本基金可以参与融资业务。基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 80%-95%，除股票以外的其他资产投资比例为 5%-20%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金主要使用个股优选策略及波动率优化策略构建投资组合，本基金投资于前述“个股优选策略及波动率优化策略”精选的股票不低于非现金基金资产的 80%。 |

| | |
|---------------|--|
| <p>主要投资策略</p> | <p>1、大类资产配置策略 本基金将根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度调整基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>2、股票投资策略 本基金充分借鉴汇丰集团的投资理念和技术，依据中国资本市场的具体特征，引入集团在海外市场成功运作的低波动率策略。该策略包括了“估值-盈利”个股优选策略和“波动率优化策略”。</p> <p>3、债券投资策略 本基金在固定收益类资产的投资上，将采用自上而下的投资策略，通过对未来利率趋势预期、收益率曲线变动、收益率利差和公司基本面的分析，积极投资，获取超额收益。</p> <p>4、权证投资策略 本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行主动投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略 本基金将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得基金资产的长期稳健回报。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>沪深300指数*90%+同业存款利率（税后）*10%</p> |
| <p>风险收益特征</p> | <p>本基金是一只股票型基金，属于证券投资基金中预期风险、预期收益较高的基金产品，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> |

(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2024年06月30日



注：由于四舍五入原因，上述投资组合资产配置比例的分项之和与合计（100%）可能存在尾差。

(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

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日



注：本基金的基金合同于2016年3月11日生效，本基金基金合同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% | |
| | 7天≤N<30天 | 0.50% | |
| | 30天≤N<180天 | 0.20% | |
| | N≥180天 | 0.00% | |

申购费C： 本基金C类基金份额不收取申购费用。

(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/年费率或金额 | 收取方 |
|------|-------------|------------|
| 管理费 | 1.20% | 基金管理人和销售机构 |

| | | |
|--------|---|--------|
| 托管费 | 0.20% | 基金托管人 |
| 销售服务费C | 0.50% | 销售机构 |
| 审计费用 | 15,000.00 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 0.00 | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 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按实际发生额从基金资产扣除。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。 | 相关服务机构 |

注：1、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。

2、本基金审计费用、信息披露费为年金额，由基金整体承担，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

| |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 2.11% |

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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。

本基金是一只借助特殊策略模型对股票进行筛选的基金，由于中国股票市场的特殊性，运用该策略可能在一段时间内使基金实际业绩波动大于业绩比较基准，偏离投资目标的设定。

本基金面临的风险主要有市场风险、管理风险、职业道德风险、流动性风险、合规性风险、本基金的特定风险、投资科创板股票的风险及其他风险等，详见《汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金招募说明书》第十九部分“风险揭示”。

（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。

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，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.hsbcjt.cn]、客服电话[021-20376888]

基金合同、托管协议、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。