

华商科创板量化选股混合型证券投资基金（华商科创板量化选股混合 A 份额）

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024 年 9 月 24 日

送出日期：2024 年 10 月 25 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	华商科创板量化选股混合	基金代码	018973
下属基金简称	华商科创板量化选股混合 A	下属基金代码	018973
基金管理人	华商基金管理有限公司	基金托管人	中信建投证券股份有限公司
基金合同生效日	2023-11-27	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	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	艾定飞	开始担任本基金基金经理的日期	2023-11-27
		证券从业日期	2014-07-07
其他	《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金管理人应及时通知基金托管人，本基金基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

注：本基金为偏股混合型基金

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读《华商科创板量化选股混合型证券投资基金招募说明书》“第九部分 基金的投资”了解详细情况。

投资目标	本基金主要投资科创板上市企业，以数量化投资方法为基础，在严格控制风险的前提下，力求实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
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，包括内地依法发行或上市的股票（包括主板、创业板、科创板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、货币市场工具、

债券回购、同业存单、银行存款、资产支持证券、股指期货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）。

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。

本基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例为基金资产的60%-95%，其中，投资于科创板股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%-20%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约所需缴纳的交易保证金后，保持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。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

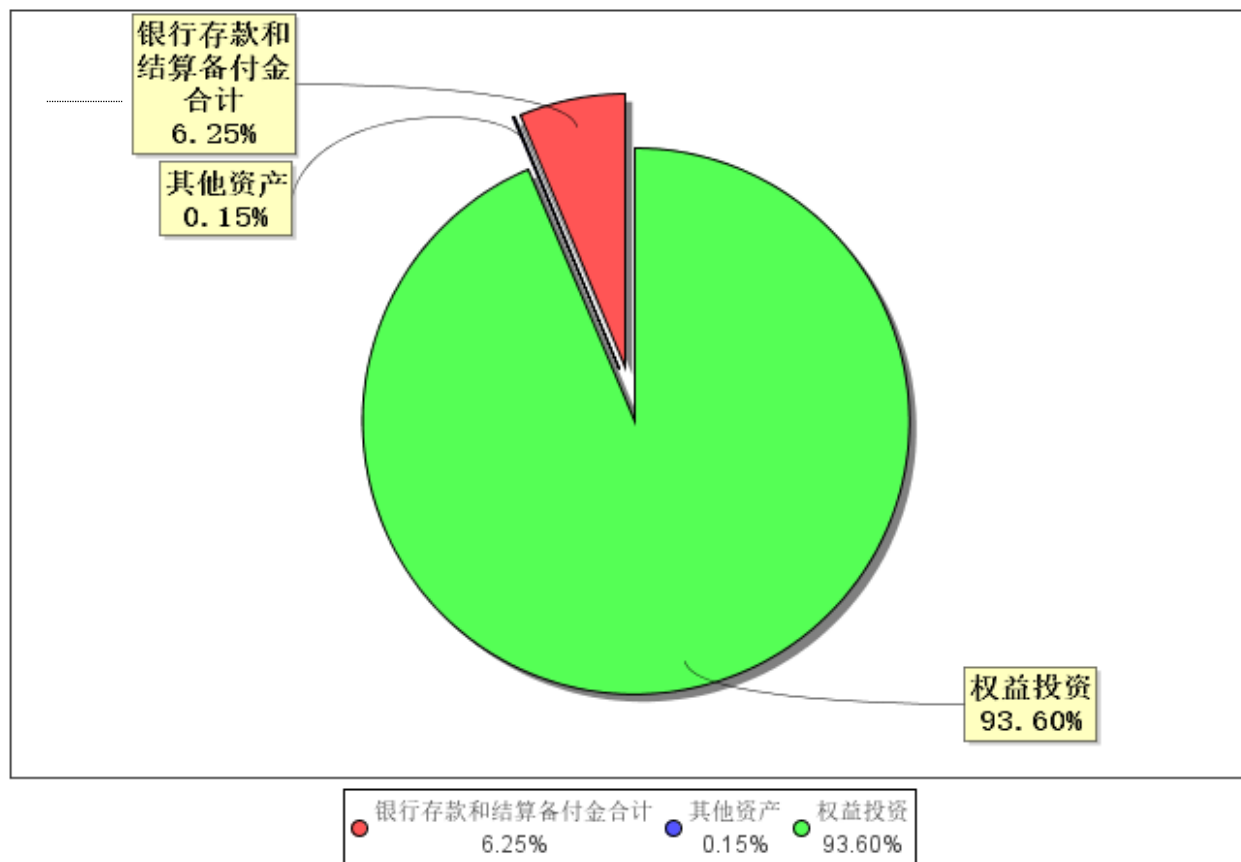
如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

主要投资策略	本基金将采用大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略等。各投资策略的具体内容详见基金法律文件。
业绩比较基准	上证科创板50成份指数收益率×75%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%+中证港股通综合指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金除了投资A股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，将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

数据截止日期：2024年6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

注：本基金基金合同于2023年11月27日生效，未有截至最近一次披露的年度报告。

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
申购费（前收费）	M < 500,000	1.5%	-
	500,000 ≤ M < 2,000,000	1.2%	-
	2,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.8%	-
	M ≥ 5,000,000	1000元/笔	-
赎回费	N < 7日	1.5%	-
	7日 ≤ N < 30日	0.75%	-
	30日 ≤ N < 365日	0.5%	-
	1年 ≤ N < 2年	0.25%	1年指365日
	N ≥ 2年	0%	-

注：通过本公司直销中心申购本基金的养老金客户适用特定的申购费率，详见本基金《招募说明书》及相关公告。

（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	-	销售机构
审计费用	年费用金额66,000.00元	会计师事务所
信息披露费	年费用金额120,000.00元	规定披露报刊

注：本基金A类份额管理费及托管费每日计提，按月支付。

其他费用详见本基金基金合同、招募说明书及相关公告。

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。

本基金审计费用以及信息披露费为基金整体承担费用，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

注：本基金尚未披露基金年度报告。

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。

本基金投资运作过程中面临的主要风险有：市场风险，流动性风险，管理风险，启用侧袋机制的风险，股指期货投资风险，资产支持证券投资风险，投资存托凭证的风险，本基金特有风险以及其他风险。

本基金特有风险包括：

1、本基金是混合型基金，既能投资股票等权益类资产，亦能投资债券等固定收益类金融工具，因此股票市场和债券市场的变化均会影响到本基金的业绩表现。

2、投资于科创板的风险（主要包括流动性风险、退市风险、投资集中风险、市场风险、系统性风险、股价波动风险和政策风险）

3、本基金自动终止的风险

4、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于港股通标的股票的风险

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的港股通标的股票，除与其他投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临以下特有风险，包括但不限于：

（1）投资于香港证券市场的特有风险（其中包括香港证券市场与内地证券市场规则差异的风险、股价较大波动的风险、中小市值公司投资风险、股份数量、股票面值大幅变化的风险、停牌风险、直接退市风险、交收制度带来的风险）

（2）通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的特有风险（其中包括港股通规则变动带来的风险、港股通标的股票范围受限及动态调整的风险、基金净值波动风险、交易失败及交易中断的风险、无法进行交易的风险、汇率风险、交易价格受限的风险、港股通制度下对公司行为的处理规则带来的风险、结算风险）

（3）其他可能的风险。

（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本基金基金份额，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。仲裁委员会是中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点是北京市。

五、其他资料查询方式

以下资料详见华商基金管理有限公司网站（www.hsfund.com）。客服电话：400-700-8880、010-58573300。

- 1、《华商科创板量化选股混合型证券投资基金基金合同》、《华商科创板量化选股混合型证券投资基金托管协议》、《华商科创板量化选股混合型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。

六、其他情况说明

无。