

汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金更新基金产品资料概要(2020年11月17日更新)

编制日期：2020年11月16日

送出日期：2020年11月17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	汇添富成长多因子量化策略股票	基金代码	001050
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2015年02月16日	上市交易所	-
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	吴振翔	开始担任本基金基金经理的日期	2015年02月16日
		证券从业日期	2006年01月01日
	许一尊	开始担任本基金基金经理的日期	2015年11月24日
		证券从业日期	2010年07月01日
其他	-		

二、基金投资与净值表现

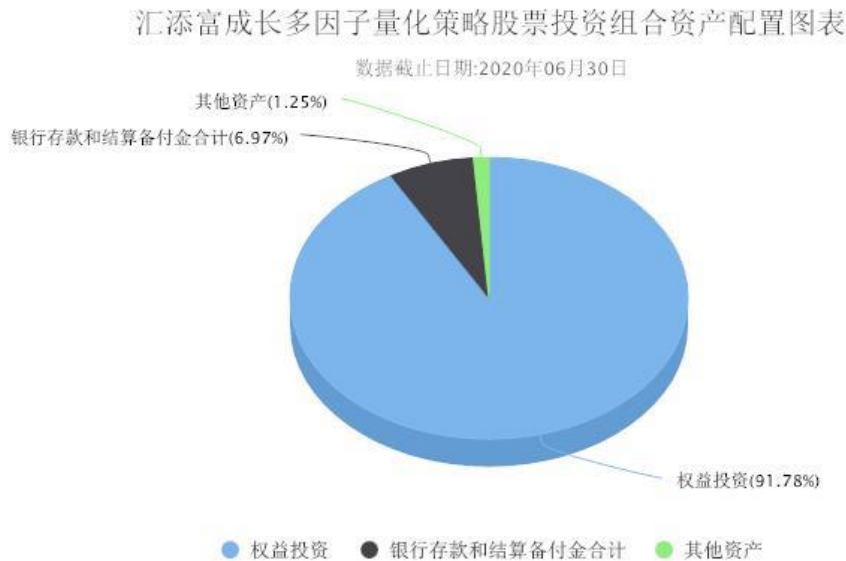
(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资范围	<p>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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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相关规定）。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证不低于基金资产的80%，其中投资于成长型行业的上市公司股票及存托凭证不低于非现金基金资产的80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>

	本基金对于成长型行业的定义：本基金对行业成长性的划分主要基于行业的估值水平，由于市场对成长型行业的未来发展有较好的预期，因而这些行业的估值相对较高，而价值型行业的估值相对较低。本基金具体通过市净率指标对申万一级行业进行成长性和价值性划分。将市净率排名位于前 1/4 的行业定义为“典型成长”行业；将市净率排名位于后 1/4 的行业定义为“典型价值”行业；而市净率排名位于中间 1/2 的行业，由于兼具成长性与价值性，定义为“兼具成长和价值”的行业。本基金将“典型成长”行业和“兼具成长和价值”的行业统一定义为成长型行业。
主要投资策略	本基金主要投资于成长型行业的股票，采用基金管理人的金融工程团队开发的多因子量化策略进行选股。在本基金的投资过程中，将控制股票投资组合与业绩比较基准指数的结构性偏离，以期在长期实现持续超越业绩比较基准收益率的投资目标。本基金在股票投资过程中将坚持量化模型驱动的投资决策流程，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，力争基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*90%+活期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

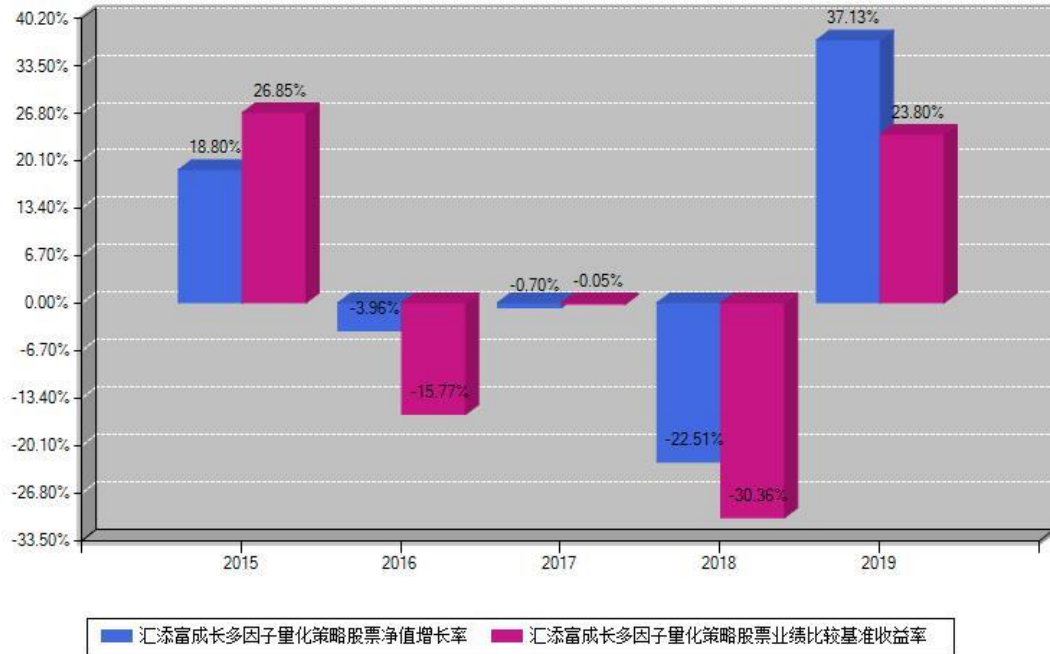
注：投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读本基金的《招募说明书》。本基金产品有风险，投资需谨慎。

（二）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

汇添富成长多因子量化策略股票每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：基金的过往业绩不代表未来表现。本《基金合同》生效之日为2015年02月16日，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)	费率/收费方式	备注
申购费 (前收费)	0 万元 ≤ M < 100 万元	1.50%	
	100 万元 ≤ M < 200 万元	1.00%	
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%	
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔	
赎回费	0 天 ≤ N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%	
	30 天 ≤ N < 180 天	0.50%	
	N ≥ 180 天	0.00%	

注：本基金已成立，投资本基金不涉及认购费。

（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	年费率	收费方式
------	-----	------

管理费	1.50%	-
托管费	0.25%	-
销售服务费	-	-
其他费用	-	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用/会计师事务所/律师费/诉讼费、基金份额持有人大会费用、证券/期货交易费用、银行汇划费用、开户费用、账户维护费用等费用

注：本基金费用的计算方法和支付方式详见本基金的《招募说明书》。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。

本基金的风险包括市场风险、管理风险、流动性风险、特有风险、操作或技术风险、合规性风险等风险，其中特有风险包括：

1、量化投资特有风险；2、其他特有风险；3、投资科创板股票的风险；4、存托凭证投资风险。

（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。

本基金的争议解决处理方式为仲裁。具体仲裁机构和仲裁地点详见本基金合同的具体约定。

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：www.99fund.com、电话：400-888-9918

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

无