

浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2021年3月23日

送出日期：2021年4月16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 | 浦银安盛量化多策略混合 | 基金代码 | 005865 |
| 下属基金简称 | 浦银安盛量化多策略混合 A | 下属基金交易代码 | 005865 |
| 下属基金简称 | 浦银安盛量化多策略混合 C | 下属基金交易代码 | 005866 |
| 基金管理人 | 浦银安盛基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2018年9月5日 | 上市交易所及上市日期 | - |
| 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 | 陈士俊 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2018年9月5日 |
| | | 证券从业日期 | 2008年10月9日 |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

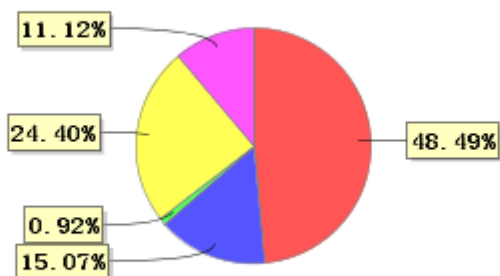
请投资者阅读《招募说明书》第九章了解详细情况

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资范围 | 本基金的投资对象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）、权证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债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）。 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 0-95%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中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 | 资产配置策略采用浦银安盛资产配置模型，通过宏观经济、估值水平、流动性和市场政策等四个因素的分析框架，动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，进行股票、债券和现金等大类资产的合理配置，在严格控制投资风 |

| | |
|--------|--|
| | 险的基础上追求基金资产的长期持续稳定增长。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，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(2020年12月31日)

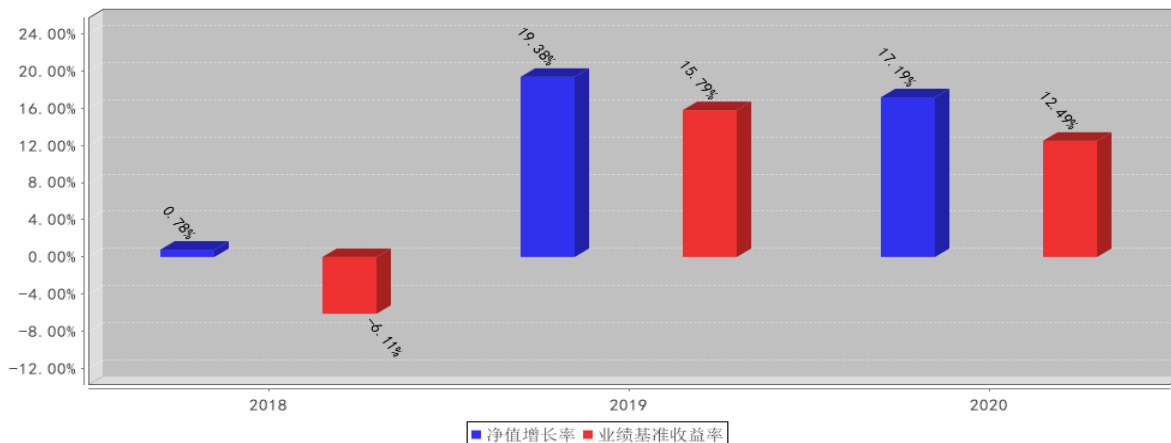


● 固定收益投资 ● 买入返售金融资产 ● 其他各项资产 ● 权益投资
● 银行存款和结算备付金合计

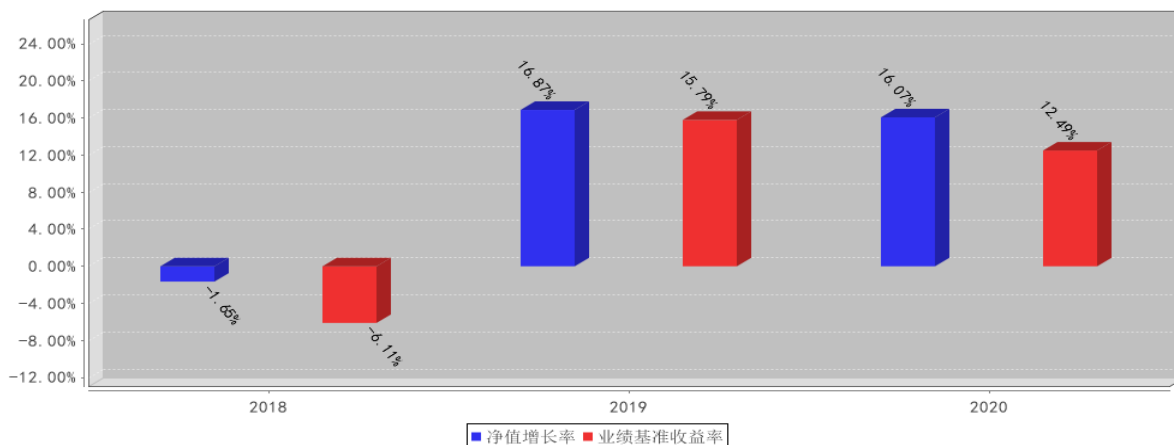
注:由于四舍五入原因,上述各类资产市值占资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

(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

浦银安盛量化多策略混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2020年12月31日)



浦银安盛量化多策略混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2020年12月31日)



注:本基金合同生效日为2018年9月5日,生效当年非完整自然年度,按实际存续期计算。业绩表现截止日期2020年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。

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:

浦银安盛量化多策略混合 A

| 费用类型 | 份额(S)或金额(M) /持有期限(N) | 收费方式/费率 |
|--------------|--------------------------------|----------|
| 申购费 (前收费) | $M < 1,000,000$ | 1.50% |
| | $1,000,000 \leq M < 3,000,000$ | 1% |
| | $3,000,000 \leq M < 5,000,000$ | 0.30% |
| | $5,000,000 \leq M$ | 1,000元/笔 |
| 赎回费 | $N < 7$ 天 | 1.50% |
| | $7 \text{天} \leq N < 30$ 天 | 0.75% |
| | $30 \text{天} \leq N < 1$ 年 | 0.50% |
| | $1 \text{年} \leq N < 2$ 年 | 0.25% |
| | $N \geq 2$ 年 | 0.00% |

浦银安盛量化多策略混合 C

| 费用类型 | 份额(S)或金额(M) /持有期限(N) | 收费方式/费率 |
|------|----------------------------|---------|
| 赎回费 | $N < 7$ 天 | 1.50% |
| | $7 \text{天} \leq N < 30$ 天 | 0.50% |
| | $N \geq 30$ 天 | 0.00% |

(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 | 0.60% |

| | | |
|-------|---------------|-------|
| 托管费 | 0.15% | |
| 销售服务费 | 浦银安盛量化多策略混合 C | 0.80% |
| 其他费用 | 会计师费、律师费等 | |

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。

投资本基金可能遇到的风险包括:因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金投资策略所特有的风险等。

1、本基金特有风险如下:

1.1、本基金在类别资产配置中会由于受到市场环境、公司治理、制度建设等因素的不同影响,导致资产配置偏离最优化,这可能为基金投资绩效带来风险。本基金在股票投资过程中运用公司内部的量化选股策略对上市公司进行基本面的分析和估值。然而,宏观经济、行业生命周期和模型参数的估计等将给基金在个股投资决策中带来一定的不确定性,因而存在个股选择的风险。本基金在固定收益品种投资过程中,由于利率变动受到众多因素的影响,基于预期的利率变动而采取的债券投资策略也面临一定的个券选择风险。

1.2、本基金可投资于股指期货和国债期货,股指期货和国债期货作为金融衍生品,具备一些特有的风险点。投资股指期货和国债期货所面临的主要风险是市场风险、流动性风险和基差风险。

1.3、本基金投资科创板股票风险,主要存在以下几个方面:

(1) 市场风险 (2) 流动性风险 (3) 信用风险 (4) 集中度风险 (5) 系统性风险 (6) 政策风险

2、开放式基金共有的风险如管理风险、流动性风险和其他风险。

3、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。

(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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见本基金管理人网站

网址[www.py-axa.com]

客服电话:400-8828-999(免长途话费)或(021)33079999

《浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、

《浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》、

《浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

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