

# 银河量化价值混合型证券投资基金（银河量化价值混合 C 份额）

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2022 年 11 月 25 日

送出日期：2022 年 11 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	银河量化价值混合	基金代码	005053
下属基金简称	银河量化价值混合 C	下属基金交易代码	013026
基金管理人	银河基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2017 年 10 月 13 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	罗博	开始担任本基金基金经理的日期	2021 年 06 月 07 日
		证券从业日期	2001 年 04 月 02 日

注：本基金自 2021 年 7 月 26 日起增设 C 类份额。

### 二、基金投资与净值表现

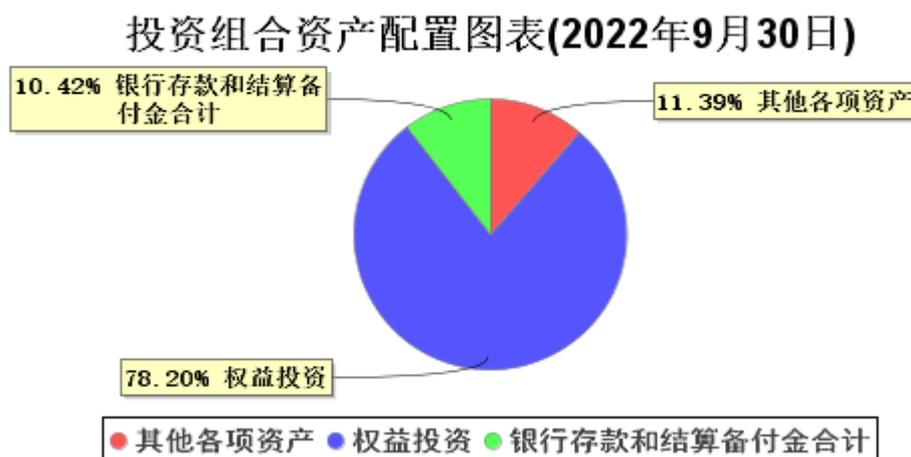
#### （一）投资目标与投资策略

投资者阅读《银河量化价值混合型证券投资基金招募说明书》第十章了解详细情况

投资目标	本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资，在有效控制风险的前提下，力求基金资产长期增值。
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和存托凭证（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票和存托凭证）、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、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单）、权证、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：本基金股票资产投资占基金资产的比例为 60%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、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</p>

	执行。 如法律法规或中国证监会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	1、资产配置策略；2、股票投资策略：本基金将运用量化选股模型，以量化多因子选股、事件驱动选股策略为主，辅以量化行业配置、套利策略等多个策略，力求寻找基本面良好，价值相对低估，波动偏低，能带来长期稳定超额收益的股票投资组合。同时，本基金也将对基金整体的波动和风险进行控制，力求基金资产长期增值；3、固定收益类资产投资策略；4、金融衍生品投资策略：（1）股指期货投资策略；（2）权证投资策略；5、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平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



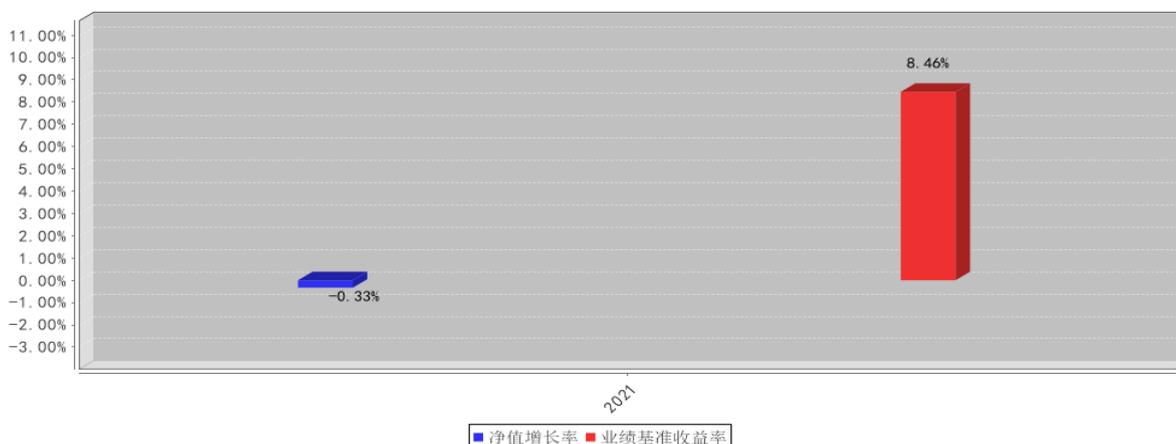
注:1、因四舍五入原因，图中市值占资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

2、本基金自 2021 年 7 月 26 日起新增 C 级且份额为零，本基金自 2021 年 12 月 16 日起 C 级新增份额。

3、本基金自 2022 年 6 月 22 日起 C 级份额为零，本基金自 2022 年 6 月 24 日起 C 级新增份额。

(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

银河量化价值混合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2021年12月31日



注：1、本基金自 2021 年 7 月 26 日起新增 C 级且份额为零，本基金自 2021 年 12 月 16 日起 C 级新增份额。

2、本基金自 2022 年 6 月 22 日起 C 级份额为零，本基金自 2022 年 6 月 24 日起 C 级新增份额。

### 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
赎回费	N < 7 天	1.5%
	7 天 ≤ N < 30 天	0.5%
	N ≥ 30 天	0%

注：本基金仅 A 类份额收取申购费；C 类份额收取销售服务费，不收取申购费。

#### （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	收费方式/年费率
管理费	1.50%
托管费	0.25%
销售服务费	0.30%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货交易费用；基金的银行汇划费用；基金的相关账户的开户及维护费用等

注：1、本基金仅 C 类份额收取销售服务费。

2、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。

##### 1、本基金的特定风险

本基金建立量化模型的数据来源以广泛覆盖各类信息源的数据库为基础，包括宏观经济数据、行业经济数据、证券与期货交易行情数据、上市公司财务数据等。这些数据通常来源于不同的数据提供商，并且因为不同的需要，在数据加工过程中可能遵循不同的规范。基金管理人以加工后的数据作为建立模型的数据来源，因此，源数据错误或预处理过程中出现的错误可能直接影响量化模型的输出结果，形成数据风险。

此外，由于本基金采用量化模型指导投资决策，因此该方法的有效性在一定程度上也会影响本基金的表现。一方面，面对不断变换的市场环境，量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中；另一方面，在定量模型的具体设定中，核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性；最后，定量模型存在对历史数据的依赖。因此，在实际运作过程中，市场环境的变化可能导致遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

2、混合型证券投资基金共有的风险，如市场风险、管理风险、流动性风险、投资股指期货的风险、投资存托凭证的风险、操作或技术风险、政策变更风险、其他风险等。

3、当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称

进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

## （二）重要提示

本基金根据中国证券监督管理委员会 2017 年 6 月 8 日《关于准予银河量化价值混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2017】872 号）的注册，进行募集。

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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资人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、定期报告等。

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，任何一方均应将争议提交中国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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见银河基金管理有限公司网站[网址：[www.cgf.cn](http://www.cgf.cn)][客服电话：400-820-0860]

1. 《银河量化价值混合型证券投资基金基金合同》、《银河量化价值混合型证券投资基金托管协议》、《银河量化价值混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
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。