

海富通量化前鋒股票型證券投資基金（海富通量化前鋒股票A）基金產品資料概要更新

編制日期：2024年12月12日

送出日期：2024年12月23日

本概要提供本基金的重要信息，是招募說明書的一部分。作出投資決定前，請閱讀完整的招募說明書等銷售文件。

一、產品概況

基金簡稱	海富通量化前鋒股票	基金代碼	005188
下屬基金簡稱	海富通量化前鋒股票 A	下屬基金代碼	005189
基金管理人	海富通基金管理有限公 司	基金託管人	中國銀行股份有限公司
基金合同生效日	2018-02-08		
基金類型	股票型	交易币种	人民币
運作方式	普通開放式	開放頻率	每個開放日
基金經理	李自悟	開始擔任本基金 基金經理的日期	2023-02-15
		證券從業日期	2008-04-30

二、基金投資與淨值表現

（一）投資目標與投資策略

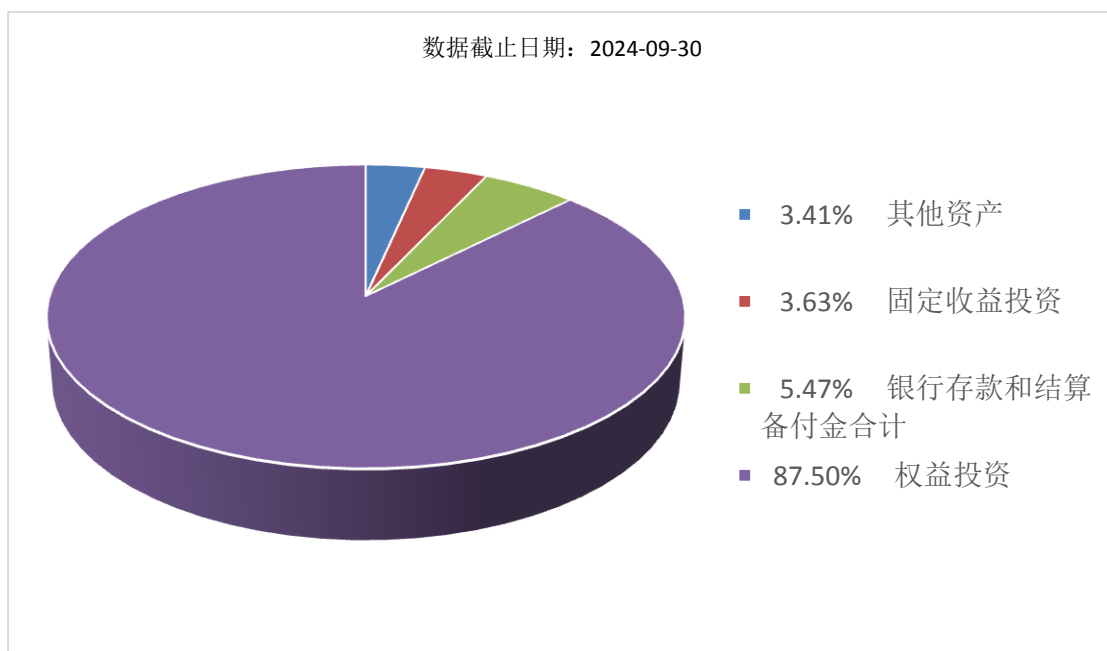
投資者可閱讀本基金《招募說明書》“九、基金的投資”了解詳細情況。

投資目標	本基金通過多因子量化模型方法，精選股票進行投資，在嚴格控制風險的前提下，力爭獲取超越比較基準的投資回報。
投資範圍	本基金的投資範圍為具有良好流動性的金融工具，包括國內依法發行上市的股票（包含中小板、創業板及其他經中國證監會核准上市的股票）、存託憑證、債券（包括國債、金融債、央行票據、企業債、公司債、次級債、可轉換債券（含分離交易可轉債）、可交換債券、短期融資券、超級短期融資券、中期票據、地方政府債、中小企業私募債及其他經中國證監會允許投資的債券）、資產支持證券、債券回購、銀行存款（包括協議存款、定期存款及其他銀行存款）、同業存單、貨幣市場工具、權證、股指期貨以及法律法規或中國證監會允許基金投資的其他金融工具，但須符合中國證監會的相關規定。基金的投資組合比例為：股票資產及存託憑證占基金資產的80%-95%；每個交易日終在扣除股指期貨合約需繳納的交易保證金後，基金保留的現金或者到期日在一年以內的政府債券不低於基金資產淨值的5%，其中現金不包括結算備付金、存出保證金和應收申購款等；股指期貨及其他金融工具的投資比例符合法律法規和監管機構的規定。如法律法規或監管機構以後允許基金投資其他品種，基金管理人在履行適當程序後，

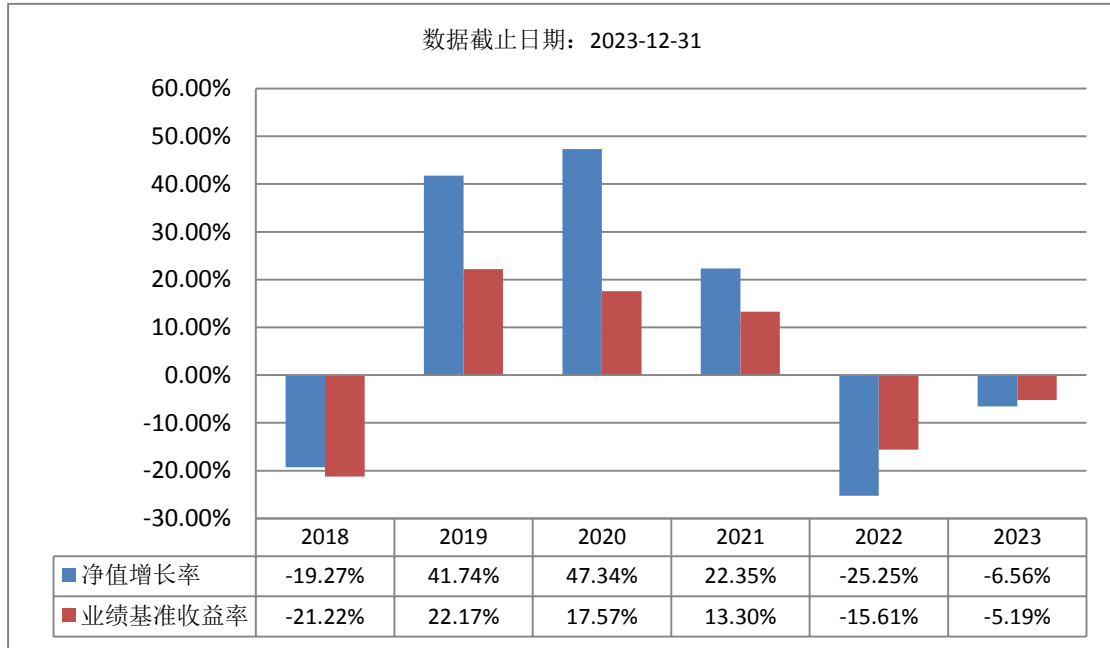
	可以将其纳入投资范围。
主要投资策略	本基金投资策略包括： 1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、权证投资策略；7、中小企业私募债券投资策略。
业绩比较基准	中证500指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

(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



(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



注：图中列示的2018年度基金净值收益率按该年度本基金实际存续期2月8日（基金合同生效日）起至12月31日止计算。

基金的过往业绩不代表未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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 < 100 万元	1.50%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 200 万元	1.20%	非养老金客户
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%	非养老金客户
	M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔	非养老金客户
	M < 100 万元	0.30%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.24%	养老金客户
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.16%	养老金客户
赎回费	M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔	养老金客户
	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%	

30 天 ≤ N < 180 天	0.50%
N ≥ 180 天	-

（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、销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
审计费用	10,000.07	会计师事务所
信息披露费	49,809.99	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，可以在基金资产中列支的其他费用。	

注：1、本基金费用的种类、计提标准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。

2、审计费用、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

若投资者申购本基金份额，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）
1.65%

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。

投资于本基金的主要风险：

（一）本基金特有的风险

1. 本基金为股票型证券投资基金，基金资产主要投资于股票市场，因此股市的波动将影响到基金业绩及持有人回报。本基金的股票资产及存托凭证占基金资产的 80%-95%，受到股市系统性风险的影响较大，无法完全规避市场整体下跌风险和个股下跌风险，基金净值可能受到影响。本基金坚持价值和长期投资理念，重视股票投资风险的防范，但是基于投资范围的规定，本基金的波动性可能较高，面临的市场风险较大。

2. 本基金基于量化模型进行股票投资决策，量化模型投资方法有别于传统的价值分析投资方法。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，在量化模型的实际运用中，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，在实际运用过程中，遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上可能无法达到预期的投资效果。

3. 科创板特有风险

本基金可投资于科创板股票，与之相关的风险主要包括：

(1) 市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司,企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性,与传统二级市场投资存在差异,整体投资难度加大,个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制,第六日开始涨跌幅限制在正负 20%以内,个股波动幅度较其他股票加大,市场风险随之上升。

(2) 流动性风险

科创板整体投资门槛较高,个人投资者必须满足交易满两年并且资金在 50 万以上才可参与,二级市场上个人投资者参与度相对较低,机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差,基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

(3) 信用风险

科创板试点注册制,对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度,科创板个股存在退市风险。

(4) 集中度风险

科创板为新设板块,初期可投标的较少,投资者容易集中投资于少量个股,市场可能存在高集中度状况,整体存在集中度风险。

(5) 系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业,在企业经营及盈利模式上存在趋同,所以科创板个股相关性较高,市场表现不佳时,系统性风险将更为显著。

(6) 政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响,国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

(7) 退市风险

科创板上市公司退市制度设计较主板市场更为严格、退市时间更短、退市速度更快,与主板市场相比,可能导致科创板市场上市公司退市的情形更多,退市速度可能更快,退市以后可能面临股票无法交易的情况,购买该公司股票的投资人将可能面临本金全部损失的风险。

4.本基金在开放日可能出现巨额赎回,导致基金资产变现困难,出现延期赎回或暂停赎回的风险。

(二) 市场风险:1.政策风险。2.经济周期风险。3.利率风险。4.上市公司经营风险。5.购买力风险。(三) 信用风险;(四) 管理风险;(五) 流动性风险;(六) 操作和技术风险;(七) 合规性风险;(八) 收益率曲线风险;(九) 杠杆放大风险;(十) 资产支持证券风险;(十一) 存托凭证特有风险;(十二) 股指期货风险;(十三) 投资中小企业私募债券的风险;

(十四) 其他风险。

(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。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因本基金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,任何一方有权根据基金合同的约定提交至仲裁机构进行仲裁。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

以下资料详见海富通基金管理有限公司网站 (<http://www.hftfund.com>) (客服电话 : 40088-40099)。

- 本基金基金合同、托管协议、招募说明书
- 本基金定期报告, 包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 本基金基金份额净值
- 本基金基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料