

# 国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（国金量化多策略 C 份额）

## 基金产品资料概要

编制日期：2023 年 02 月 22 日

送出日期：2023 年 02 月 23 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	国金量化多策略	基金代码	005443
下属基金简称	国金量化多策略 C	下属基金交易代码	017874
基金管理人	国金基金管理有限公司	基金托管人	中国光大银行股份有限公司
基金合同生效日	2018 年 2 月 1 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	马芳	开始担任本基金基金经理的日期	2020 年 9 月 3 日
		证券从业日期	2016 年 11 月 12 日
基金经理	姚加红	开始担任本基金基金经理的日期	2023 年 1 月 5 日
		证券从业日期	2004 年 10 月 24 日

注：本基金于 2023 年 2 月 22 日增设 C 类份额。

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在严格控制投资风险的前提下力求实现超越业绩比较基准的回报。
投资范围	（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权、权证）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需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。 本基金的投资比例为：股票资产投资比例为基金资产的 0-95%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终，在扣除国债期货、股指期货合约和股票期权需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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	本基金采用自主开发的量化风险模型对市场的系统性风险进行判断，作为股票、债券、

	现金等金融工具上大类配置的依据,并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化,动态地调整各金融工具的投资比例。同时,本基金将适时地采用股指期货对冲策略做套期保值,以达到控制下行风险的目标。
业绩比较基准	60%×中证500指数收益率+40%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(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:本基金于2023年2月22日增设C类份额,截至本报告送出日,本基金C类份额无可参考的年度报告。

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
赎回费	N < 7天	1.50%
	7天 ≤ N < 30天	0.50%
	N ≥ 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	基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付 1.50%
托管费	基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付 0.25%
销售服务费	基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付 0.40%

注:本基金相关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。

本基金投资运作过程中面临的主要风险有：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、基金间转换所产生的风险、特有风险及其他风险。

本基金的特有风险：

1、与量化投资方法相关的特定风险；2、投资股指期货的风险；3、投资国债期货的风险；4、投资股票期权的风险投资股票期权所面临的主要风险是股票期权价格波动带来的市场风险；5、资产支持证券风险。

### （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。

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商或调解方式解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：<http://www.gfund.com>，客服电话：4000-2000-18

- 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。