

万家量化同顺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：2020年8月31日

送出日期：2020年9月2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 | 万家量化同顺多策略混合 | 基金代码 | 005650 |
| 下属分级基金的基金简称 | 万家量化同顺A | | 万家量化同顺C |
| 下属分级基金的基金代码 | 005650 | | 005651 |
| 基金管理人 | 万家基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2018-05-04 | 上市交易所及上市日期 | 暂未上市 - |
| 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 | 每日 |
| 基金经理 | 尹航 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020-07-21 |
| | | 证券从业日期 | 2013-07-01 |

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资者请阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况。

| | |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在坚持风险收益合理定价的理念基础上，利用量化方法使投资适应市场变化，并引入多维度数据，建立有效因子组合，在合理控制风险的基础上，寻求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资范围 | <p>本基金主要投资于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（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、国债期货、股票期权、权证以及债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等金融工具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的相关规定）。</p> <p>本基金可参与融资业务。</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> |

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0%-95%；每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的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；权证投资占基金资产净值的0-3%。股指期货、国债期货、股票期权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执行。

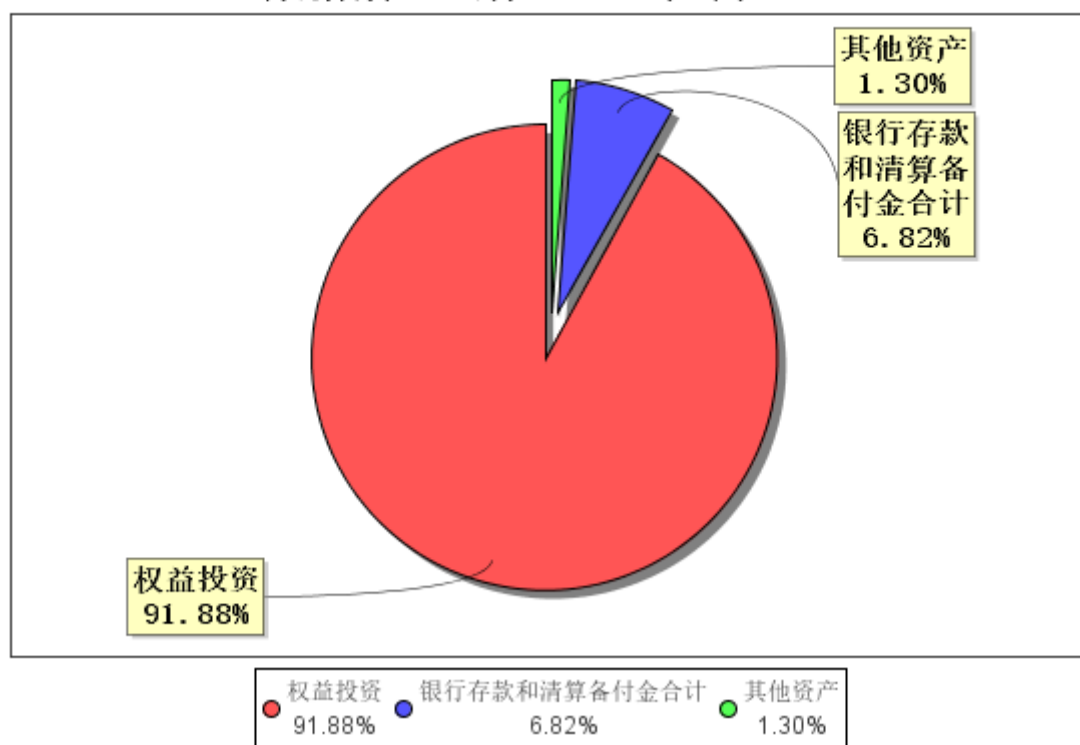
主要投资策略 1、股票资产的量化投资策略：（1）量化多因子策略、（2）量化择时策略；2、债券资产投资策略；3、股指期货投资策略；4、国债期货投资策略；5、股票期权投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、权证投资策略；8、融资交易策略。

业绩比较基准 中证800指数收益率*90%+一年期银行定期存款收益率（税后）*10%

风险收益特征 本基金为混合型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金但低于股票型基金。

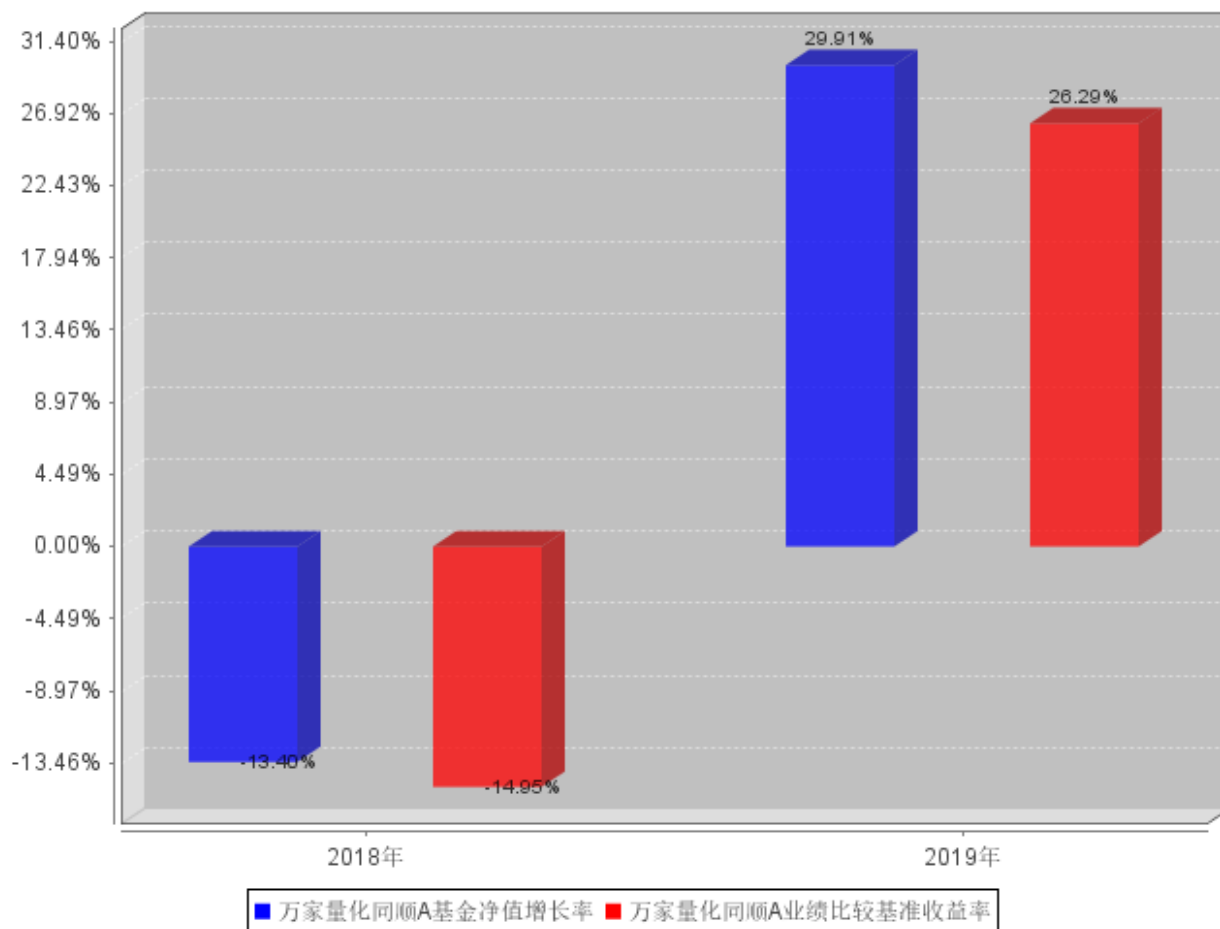
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表
数据截止日期：2020年6月30日

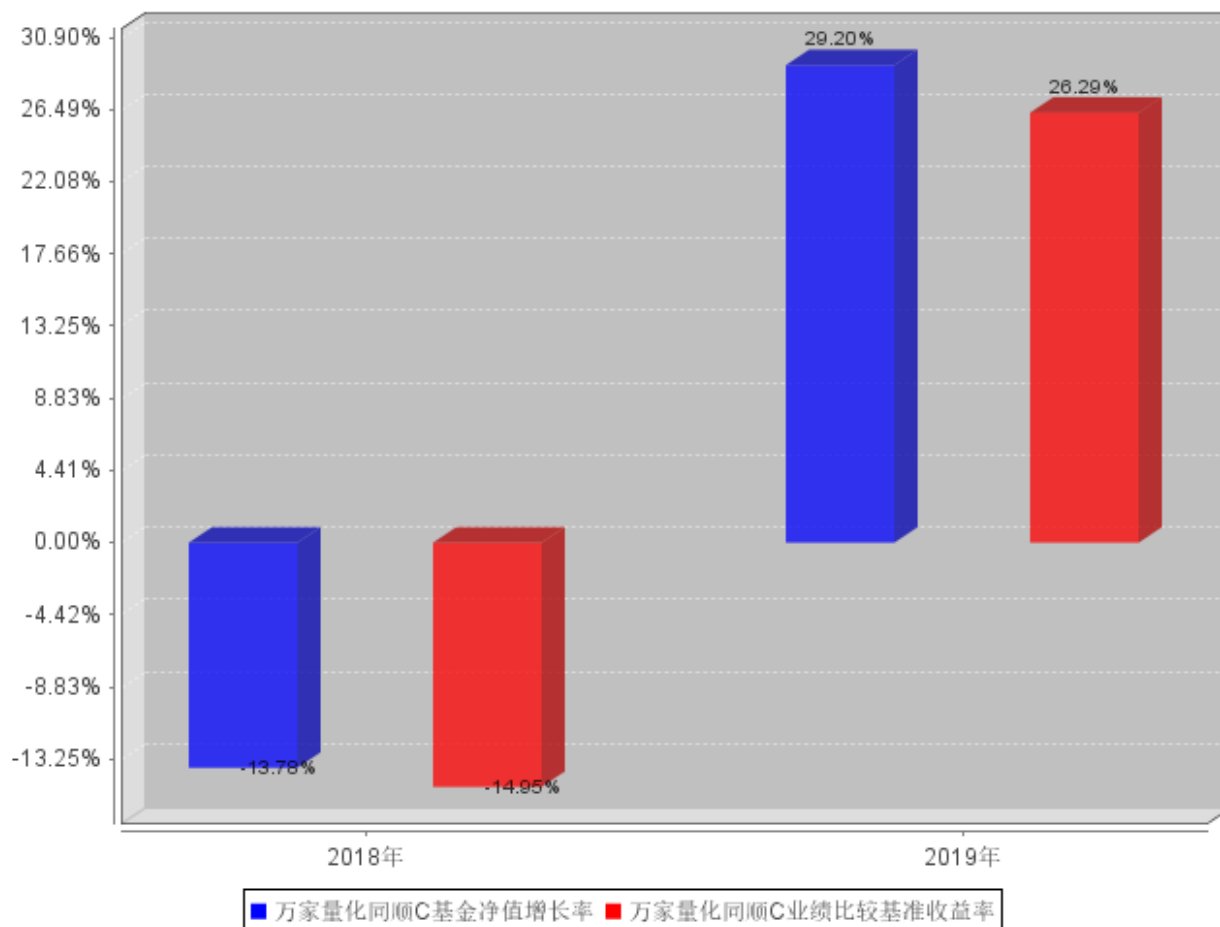


（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

万家量化同顺A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



万家量化同顺C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：业绩表现截止日期2019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：

万家量化同顺 A

| 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 < 1,000,000 | 0.15% | 特定投资者 |
| | 1,000,000 ≤ M < 2,000,000 | 0.10% | 特定投资者 |
| | 2,000,000 ≤ M < 5,000,000 | 0.06% | 特定投资者 |
| | M ≥ 5,000,000 | 1000元/笔 | 特定投资者 |
| | M < 1,000,000 | 1.5% | 其他投资者 |
| | 1,000,000 ≤ M < 2,000,000 | 1.0% | 其他投资者 |
| | 2,000,000 ≤ M < 5,000,000 | 0.6% | 其他投资者 |
| | M ≥ 5,000,000 | 1000元/笔 | 其他投资者 |
| 赎回费 | N < 7日 | 1.50% | - |
| | 7日 ≤ N < 30日 | 0.75% | - |
| | 30日 ≤ N < 180日 | 0.50% | - |

| | | |
|-------------|-------|---|
| 180日≤N<365日 | 0.25% | - |
| N≥365日 | 0 | - |

万家量化同顺 C

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|------|--------------------------|---------|----|
| 赎回费 | N<7日 | 1.50% | - |
| | 7日≤N<30日 | 0.50% | - |
| | N≥30日 | 0 | - |

申购费：本基金C类基金份额不收取申购费。

（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 | - |
| 托管费 | - |
| 销售服务费 | - |
| 万家量化同顺A | - |
| 万家量化同顺C | 0.50% |

注：本基金A类份额不收取销售服务费。

本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，以及《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费和持有人大会费用等，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。

本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于预期风险和预期收益均较高的基金。

投资本基金可能遇到的风险类型包括：证券市场整体环境引发的系统性风险；个别证券特有的非系统性风险；大量赎回或暴跌导致的流动性风险；基金投资过程中产生的操作风险；因交收违约和投资债券引发的信用风险；投资特定品种、参与特定业务或采取特定策略的特定风险等。其中特定风险包括但不限于：

1) 本基金投资范围包括国债期货、股指期货、期权等金融衍生品、资产支持证券、中小企业私募债等品种，可能给本基金带来额外风险。

2) 本基金可参与融资业务，可能存在杠杆风险等。

3) 本基金的股票资产投资主要采取量化投资策略，可能存在模型风险。

（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。

根据基金合同的解决争议条款，与《基金合同》有关的争议，当事人未能经友好协商解决的，应选择提交仲裁。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：www.wjasset.com][客服电话：400-888-0800]

基金合同、托管协议、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