

# 中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运 用股指期货对冲的投资策略执行情况公告

## 1. 公告基本信息

基金名称 中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

基金简称 中金绝对收益

基金主代码 001059

基金运作方式 契约型，以定期开放方式运作

基金合同生效日 2015年4月21日

基金管理人名称 中金基金管理有限公司

基金托管人名称 中国建设银行股份有限公司

基金注册登记机构名称 中金基金管理有限公司

公告依据 《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规以及《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》、《中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》

投资者范围：符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

## 2. 运用股指期货对冲的投资策略执行情况

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)自2016年10月15日进入第六个封闭期。截至2016年12月23日，本基金持有股票资产22,219,085.04元，占基金资产净值比例为19.47%。运用股指期货进行对冲的空头合约市值18,587,400.00元，占基金资产净值的比例为16.29%。

本基金最新的股指期货交易情况(包括投资政策、持仓情况等)、股指期货投资的特定风险，请投资者关注本基金的基金合同、招募说明书及相关最新公告。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资有风险，请投资人投资本基金前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书，并根据自身风险承受能力选择适合自己的基金产品。

中金基金管理有限公司

2016年12月28日