

# 永赢量化混合型发起式证券投资基金对冲策略执行情况公告

## 1 公告基本信息

基金名称 永赢量化混合型发起式证券投资基金

基金简称 永赢量化混合发起式

基金主代码 001565

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2015年8月6日

基金管理人名称 永赢基金管理有限公司

基金托管人名称 中信证券股份有限公司

基金注册登记机构名称 永赢基金管理有限公司

公告依据 《中华人民共和国证券投资基金法》及配套法规、《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》、《永赢量化混合型发起式证券投资基金招募说明书》以及《永赢量化混合型发起式证券投资基金更新招募说明书》

## 2 对冲策略执行情况说明

投资策略 采用多因子选股策略为主，辅以事件驱动以及宏观择时等其他绝对收益策略，对冲系统性风险，力争实现稳定的绝对回报。

对冲策略的限制 权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。

对冲策略的执行情况 自中金所针对股指期货的交易限制放宽以来，市场流动性增加，同时随着市场情绪的转暖各合约的贴水幅度也明显收窄，部分合约已出现升水现象，对冲策略的执行环境进一步改善。本基金管理人严格遵照合同约定，运用量化多因子模型构建现货组合，并在此基础上采用套期保值手段卖出相应股指期货合约来对冲系统风险，对冲比例在基金运作期间均符合相关要求，未发生基金投资策略与对冲策略发生偏离的情形。

股票资产的规模（单位：元） 19,148,390.39

股票资产占基金资产净值的比例 49.79%

运用股指期货进行对冲的空头合约市值（单位：元） 15,745,860.00

股指期货占基金资产净值的比例 40.94%

权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例 82.23%

## 3 其他需要提示的事项

本公告仅对本基金对冲策略执行情况予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况，请登录本公司网站

（[www.maxwealthfund.com](http://www.maxwealthfund.com)）或拨打本公司客服电话 021-51690111。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。公司在此提醒广大投资者，购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益；投资者应了解基金投资的买者自负原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，投资者需自行承担。

永赢基金管理有限公司

2018年1月5日