

国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021年7月23日

送出日期：2021年7月26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	国金量化添利	基金代码	006189
基金管理人	国金基金管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2018-11-02	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	开放式	开放频率	本基金每六个月开放一次，每次开放期最长不超过10个工作日，最短不少于2个工作日
基金经理	尹海峰	开始担任本基金基金经理的日期	2019-02-12
		证券从业日期	2011-07-01
	马芳	开始担任本基金基金经理的日期	2020-09-03
		证券从业日期	2016-11-12

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

请阅读《招募说明书》基金的投资部分了解详细情况。

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。
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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券）、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、债券回购、国债期货以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相关规定）。</p> <p>本基金投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每次开放期前十五个工作日、开放期及开放期结束后十五个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限。基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。</p> <p>开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。在封闭期内本基金不受上述5%限</p>

制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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

1、封闭期投资策略

债券类资产投资主要用于提高非股票资产的收益率，基金管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。

在债券投资方面，基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。本基金股票部分以“量化投资”为主要投资策略，“阿尔法多因子选股模型”进行股票选择并据此构建股票投资组合。在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。

2、开放期投资策略

本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。

业绩比较基准

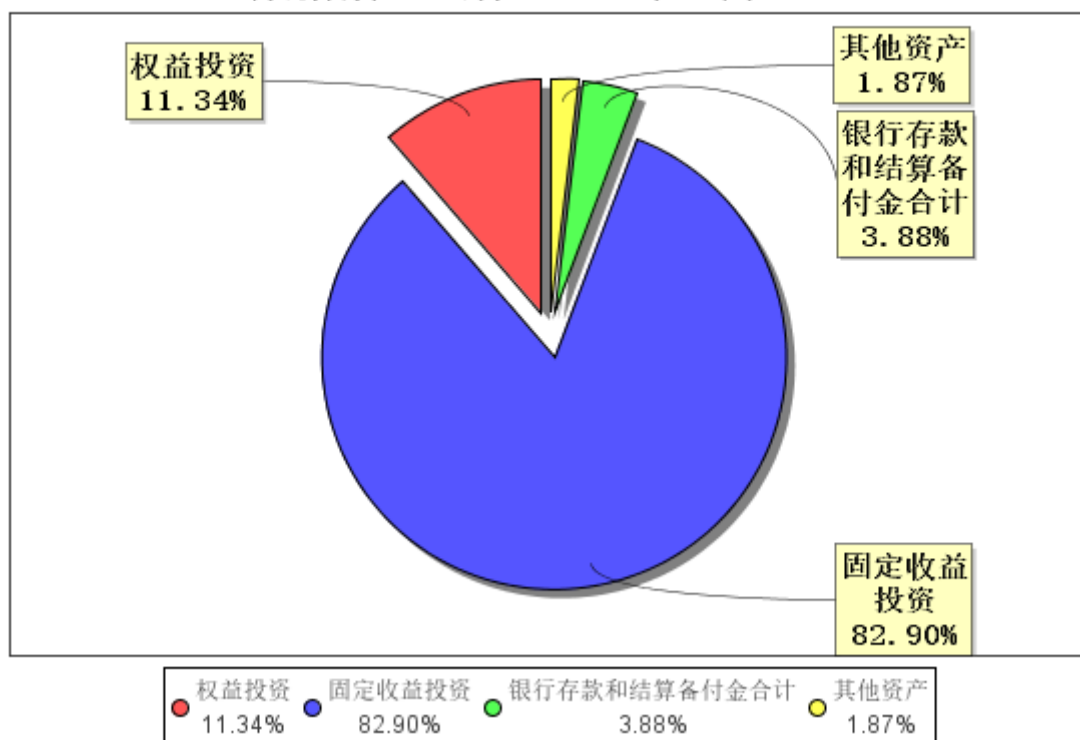
中债总全价指数收益率×80%+中证500指数收益率×20%

风险收益特征

本基金属于债券型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

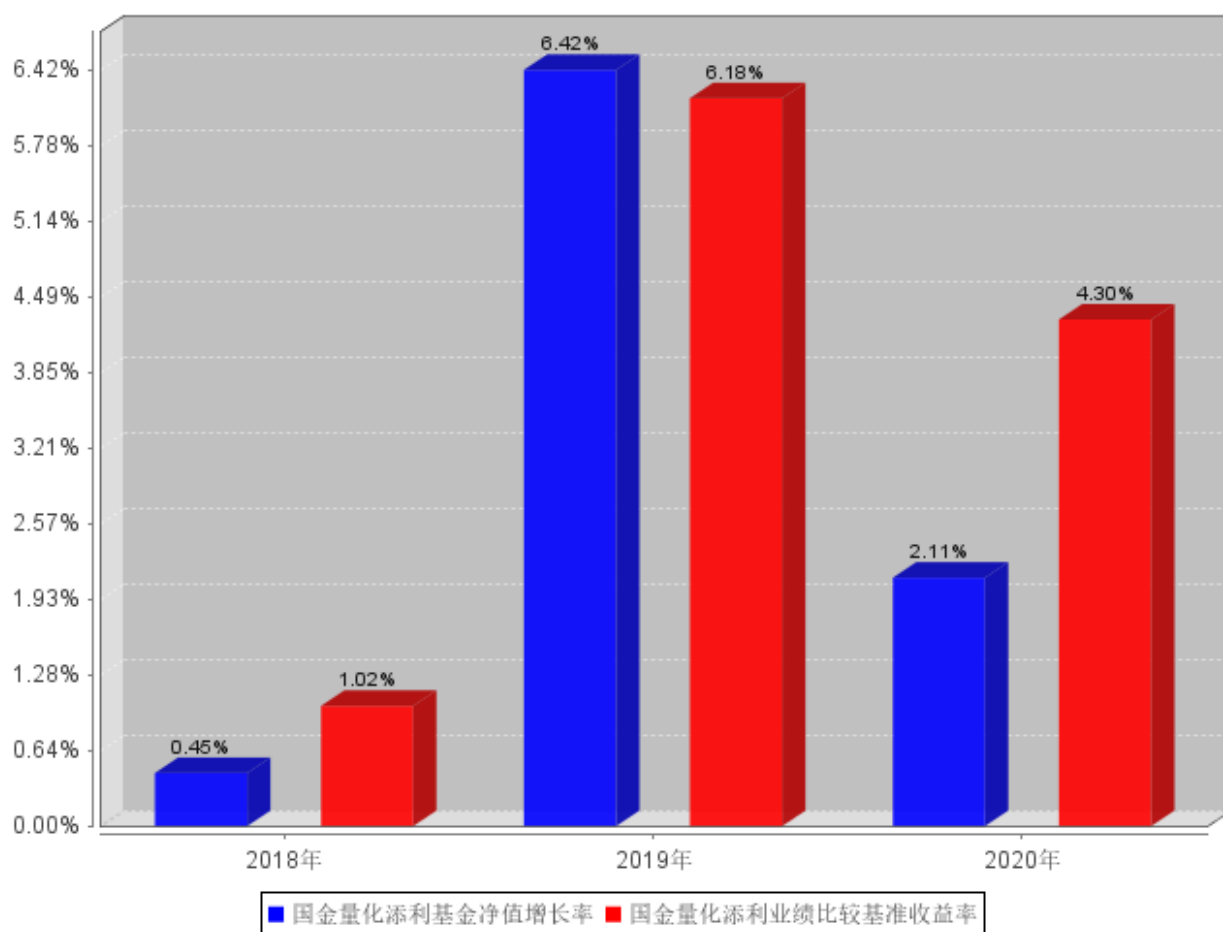
投资组合资产配置图表
数据截止日期：2020年12月31日



（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

国金量化添利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2020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：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
认购费	$0 < M < 500,000$	0.60%	-
	$500,000 \leq M < 1,000,000$	0.50%	-
	$1,000,000 \leq M < 2,000,000$	0.40%	-
	$2,000,000 \leq M < 5,000,000$	0.20%	-
	$M \geq 5,000,000$	1000元/笔	-
申购费（前收费）	$0 < M < 500,000$	0.80%	-
	$500,000 \leq M < 1,000,000$	0.60%	-
	$1,000,000 \leq M < 2,000,000$	0.50%	-
	$2,000,000 \leq M < 5,000,000$	0.30%	-
	$M \geq 5,000,000$	1000元/笔	-
赎回费	$1 \text{天} \leq N < 7 \text{天}$	1.50%	-

7天≤N<30天	0.75%	-
30天≤N<180天	0.50%	-
N≥180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	本基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付 0.50%
托管费	本基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付 0.10%
销售服务费	无

注：基金运作期间产生的审计费、律师费等其他费用，以及相关费用计算方法和支付方式请详见招募说明书等法律文件。

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、特有风险及其他风险。

本基金的特定风险：1、定期开放运作的风险；2、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同的风险；3、国债期货的风险；4、本基金的投资范围包括中小企业私募债，由于该类债券采取非公开方式发行和交易，并不公开各类材料（包括招募说明书、审计报告等），外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能会降低市场对这类债券的认可度，从而影响这类债券的市场流动性。另一方面，由于中小企业私募债的债券发行主体资产规模较小、经营的波动性较大，且各类材料不公开发布，也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。由此可能给基金净值带来不利影响或损失；5、资产支持证券风险；6、量化投资方法相关的特定风险。

（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