

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021年8月11日

送出日期：2021年8月31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	中金绝对收益	基金代码	001059
基金管理人	中金基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2015-04-21	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	定期开放式	开放频率	每三个月开放一次
基金经理	魏宇	开始担任本基金基金经	2020-10-22
		理的日期	
		证券从业日期	2010-08-08

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金灵活应用多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值，以期实现超越业绩比较基准的绝对收益。
投资范围	<p>本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具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。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、股指期货、权证、债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具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的相关规定）。</p> <p>本基金的投资组合比例为：本基金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。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。</p> <p>开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。</p> <p>开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应</p>

收申购款等。

主要投资策略 本基金采用市场中性策略为主的多种绝对收益策略剥离系统风险，力争实现基金资产长期稳定的绝对回报。其中，市场中性策略包括量化选股策略和期货对冲策略两大策略。具体包括：1、量化选股策略；2、存托凭证投资策略；3、期货对冲策略；4、其他策略。

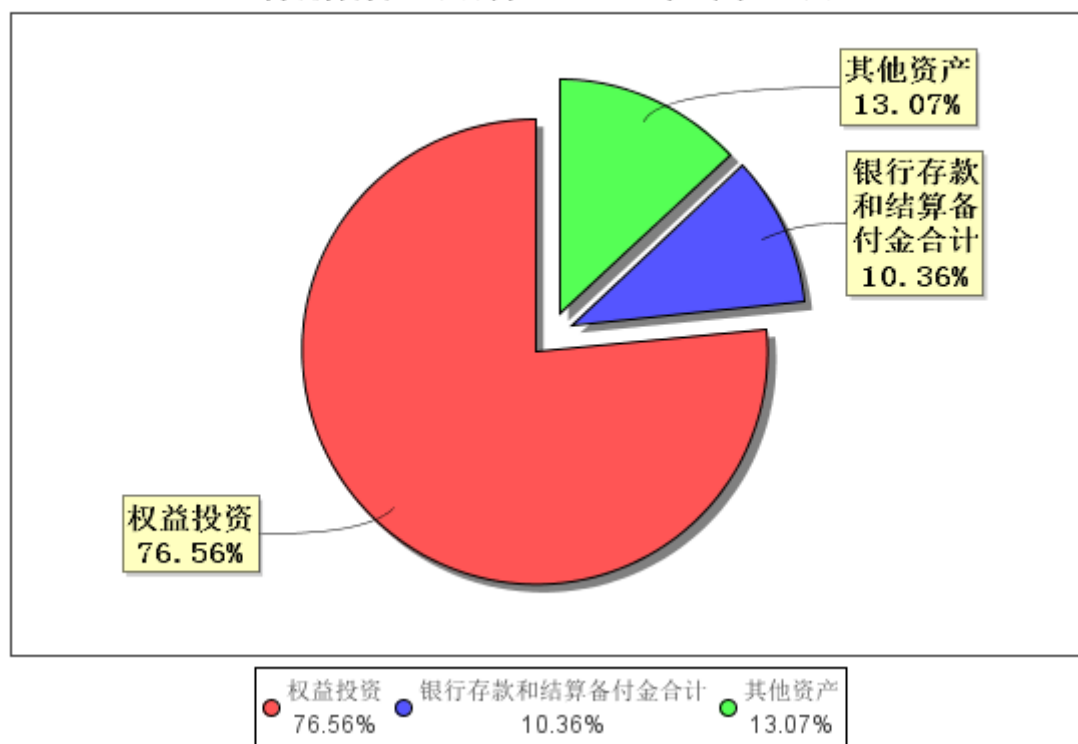
业绩比较基准 一年期银行定期存款收益率。

风险收益特征 本基金为特殊的混合型基金，通过多种绝对收益策略剥离本基金的系统性风险，实现基金资产的价值增值。因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。

注：详见《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》第九部分“基金的投资”。

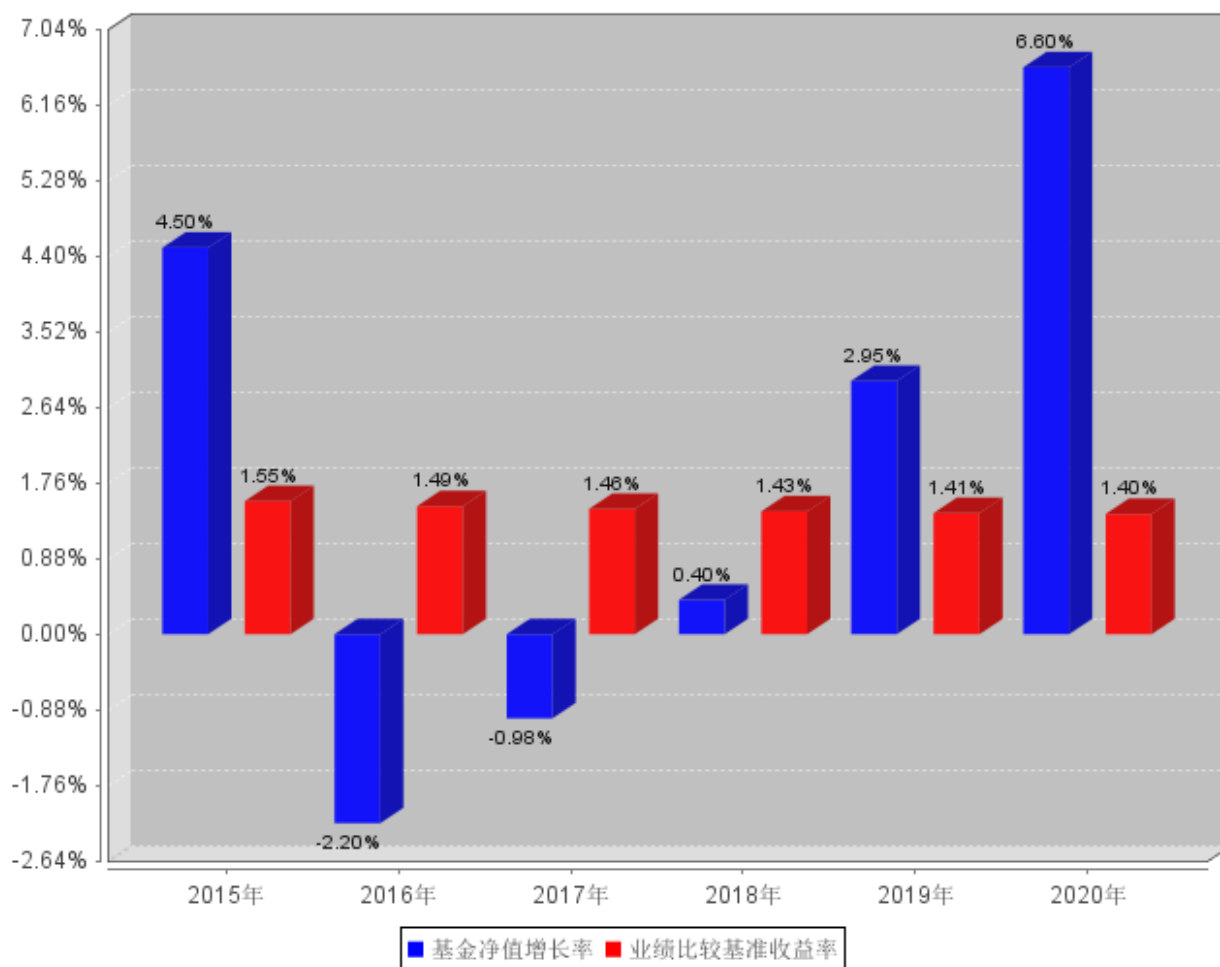
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表
数据截止日期：2021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

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



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
申购费 (前收费)	M < 1,000,000	1.50%
	1,000,000 ≤ M < 2,000,000	1.00%
	2,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.60%
	M ≥ 5,000,000	1000元/笔
赎回费	N < 7日	1.50%
	7日 ≤ N < 30日	0.75%
	30日 ≤ N < 365日	0.50%
	365日 ≤ N < 730日	0.25%
	N ≥ 730日	0

（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	-
基本管理费	1.00%
附加管理费	附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照“新高法原则”提取超额收益的10%作为附加管理费；即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期间最高基金份额累计净值和1孰高者，基金管理人才能收取附加管理费
托管费	0.25%
销售服务费	-
其他费用	费用的计算方法及支付方式详见招募说明书及相关公告

注：本基金交易证券、基金等发生的费用和税负，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。

投资于本基金的主要风险有：

- 1、市场风险，主要包括：（1）政策风险；（2）经济周期风险；（3）利率风险；（4）购买力风险；（5）上市公司经营风险；（6）债券收益率曲线风险；（7）再投资风险；（8）债券回购风险；
- 2、信用风险；
- 3、流动性风险；
- 4、管理风险；
- 5、估值风险；
- 6、操作及技术风险；
- 7、合规性风险；
- 8、税负增加风险；
- 9、启用侧袋机制的风险；
- 10、本基金特有风险：（1）非开放日不能赎回的风险；（2）规模风险；（3）模型有效性及策略失败风险；（4）股票选择风险；（5）本金损失风险；（6）卖空风险；（7）金融数据的风险；（8）股指期货投资风险；（9）科创板股票投资风险；（10）存托凭证投资风险。

（二）重要提示

本基金的募集申请于2015年1月28日经中国证监会证监许可[2015]144号《关于准予中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册。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临时相关公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：www.ciccfund.com，客服电话：400-868-1166

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

六、其他情况说明

无。