

中融智选对冲策略3个月定期开放灵活配置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：2020年08月04日

送出日期：2020年08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	中融智选对冲3个月定开混合	基金代码	008848
基金管理人	中融基金管理有限公司	基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金合同生效日	2020年04月03日	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	定期开放式	开放频率	每3个月开放一次
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
赵菲	2020年04月08日		2008年08月01日

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资目标	基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期稳健增值。
投资范围	<p>本基金的投资对象是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）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权）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）。本基金可以在履行适当程序后，参与融资融券业务。</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> <p>本基金的投资组合比例为：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%。本基金权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值占基金资产净值的0-10%。其中：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买入其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其它权益类工具多头价值的合计值；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卖出其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其它权益类工具空头价值的合计值。本基金持有的银行存款及同</p>

	业存单比例不超过基金资产的20%。 开放期内,在扣除股指期货、国债期货和股票期权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。本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第(一)项、第(三)项、第(五)项及第(七)项的限制。
主要投资策略	1、资产配置策略;2、多头股票投资策略;3、对冲工具投资策略;4、其他绝对收益策略;5、股票期权投资策略;6、债券投资策略;7、国债期货投资策略;8、可转换债券投资策略;9、现金管理策略;10、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金,主要采用追求绝对收益的市场中性策略,使用股指期货对冲市场风险,使得收益波动与股票市场相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金,其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性。

(二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表



数据截止日：20200630

(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

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
申购费(前收费)	0 ≤ M < 100万	1.50%	
	100万 ≤ M < 200万	1.00%	
	200万 ≤ M < 500万	0.80%	
	500万 ≤ M	1000.00元/笔	
赎回费	0天 ≤ N < 7天	1.50%	
	7天 ≤ N < 30天	0.75%	
	30天 ≤ N < 180天	0.50%	

	180天≤N	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	1.20%
托管费	0.25%
其他费用	基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；基金合同生效后与基金相关的会计师事务所费、律师费、诉讼费、仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券/期货交易费用；基金的银行汇划费用；基金的开户费用、账户维护费用；因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

注：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。

1、本基金的特定风险

本基金为特殊的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，使用股指期货对冲市场风险，使得收益波动与股票市场相关性较低。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性。（1）非开放日不能赎回的风险。（2）投资策略失败风险。（3）卖空风险。（4）股票选择风险。（5）金融数据的风险。（6）投资股指期货特有的风险。1）股指期货政策变化风险。2）杠杆风险。3）基差风险。4）股指期货展期时的流动性风险。5）期货盯视结算制度带来的现金管理风险。6）到期日风险。7）对手方风险。8）连带风险。9）强制平仓风险。10）未平仓合约不能继续持有风险。（7）发起式基金自动终止的风险。（8）投资国债期货特有的风险。（9）参与港股投资的风险。（10）投资股票期权的风险。

2、市场风险。证券市场价格受到各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：（1）政策风险、（2）经济周期风险、（3）利率风险、（4）通货膨胀风险、（5）、上市公司经营风险、（6）再投资风险。

3、信用风险。

4、操作风险。

5、管理风险。

6、合规风险。

（二）重要提示

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。

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。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见中融基金官方网站[www.zrfunds.com.cn][客服电话：400-160-6000；010-56517299]

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

争议解决方式：各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。