

中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划(A 类 份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2021 年 9 月 29 日

送出日期：2021 年 9 月 30 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决策前，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	集合-中金汇越定开	基金代码	920012
下属基金简称	集合-中金汇越定开 A	下属基金交易代码	920012
基金管理人	中国国际金融股份有限公司	基金托管人	中信银行股份有限公司
基金合同生效日	2020 年 9 月 17 日	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	本集合计划第一个开放期为集合计划合同生效日起后续 5 个工作日，第二个开放期为第一个开放期所在月份的后续第 3 个日历月的前 5 个工作日，第三个开放期为第二个开放期所在月份的后续第 3 个日历月的前 5 个工作日，以此类推。每个开放期内的 5 个工作日内均可办理集合计划的申购、赎回业务。
基金经理	方圆	开始担任本基金基金经理的日期	2020 年 9 月 17 日
		证券从业日期	2010 年 5 月 13 日

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

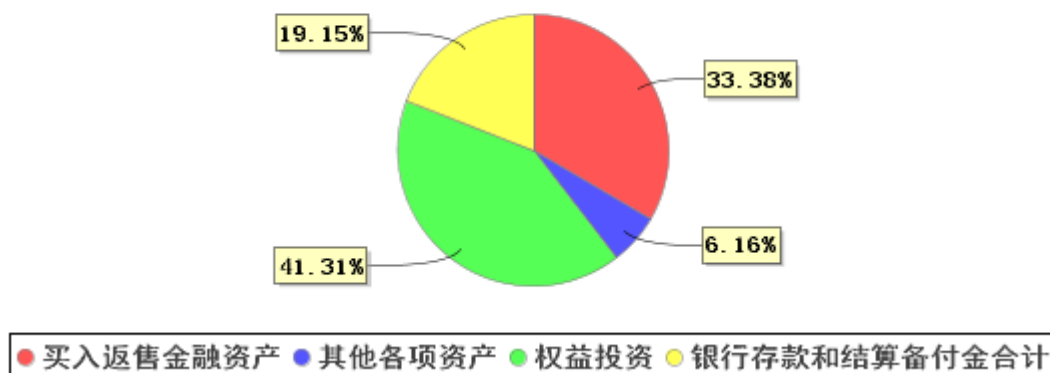
投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略对冲投资组合的市场风险，谋求投资组合资产的长期增值，以期实现超越业绩比较基准的收益。
投资范围	本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、地方政府债、金融债、公司债、企业债、公开发行次级债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券以及中国证监会允许投资的其他债券）、股指期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协

	议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、现金等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。 本集合计划可根据法律法规的规定参与融资融券业务。
主要投资策略	本集合计划在力求有效控制投资风险的前提下，通过全市场选股构建预期收益高于市场回报的投资组合，同时利用股指期货等对冲工具对冲投资组合的市场风险，以求获得不依赖市场整体走向的比较稳定的长期资产增值。 开放期内，本集合计划将保持适当的流动性，方便投资人安排投资，在遵守本集合计划有关投资限制与投资比例的前提下，将适当增加高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为一年期金融机构人民币存款基准利率。
风险收益特征	本集合计划为特殊的灵活配置混合型集合资产管理计划，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。

注: 敬请投资者阅读《中金汇越量化对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》第九部分了解详细情况

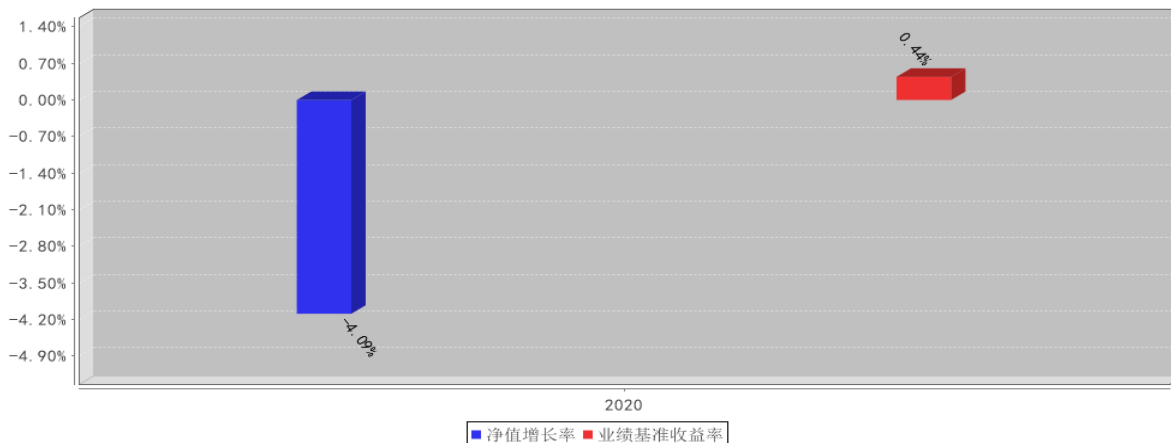
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(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

集合-中金汇越定开A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2020年12月31日)



注: 基金的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<100 万	1.5%
	100 万≤M<200 万	1%
	200 万≤M<500 万	0.6%
	M≥500 万	1,000 元/笔
赎回费	N<7 天	1.5%
	7 天≤N<30 天	0.75%
	30 天≤N<365 天	0.50%
	365 天≤N<730 天	0.25%
	N≥730 天	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	1.5%
托管费	0.15%

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。

本集合计划主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致集合计划收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括市场风险、管理风险、流动性风险、集合计划特定投资风险、操作或技术风险、合规性风险等。

(二) 重要提示

中国证监会准予本集合计划合同变更的回函，并不表明其对本集合计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。

集合计划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集合计划财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

集合计划投资者自依集合计划合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人。

本资料概要所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

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

以下资料详见集合计划管理人网站[www.cicc.com][咨询电话：800-810-8802（固话用户免费） | (010)6505-0105（直线）]

1. 集合计划合同、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. 集合计划份额净值
4. 集合计划销售机构及联系方式
5. 其他重要资料

六、其他情况说明

无