

汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 C 类份额更新基金产品资料概要(2024 年 05 月 24 日更新)

编制日期：2024 年 05 月 23 日

送出日期：2024 年 05 月 24 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 | 汇添富绝对收益定开混合 | 基金代码 | 000762 |
| 下属基金简称 | 汇添富绝对收益定开混合 C | 下属基金代码 | 008140 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 | 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 03 月 15 日 | 上市交易所 | - |
| 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 | 每半年开放一次 | | |
| 基金经理 | 顾耀强 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2017 年 03 月 15 日 |
| | | 证券从业日期 | 2004 年 07 月 01 日 |
| | 吴江宏 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2017 年 03 月 15 日 |
| | | 证券从业日期 | 2011 年 07 月 01 日 |
| 其他 | 自 2019 年 11 月 11 日起，本基金增设 C 类基金份额。 《基金合同》生效后，在每个开放期的最后一日日终时，有下列情形之一的，基金管理人与基金托管人协商一致后，可不经基金份额持有人大会决议，本基金与基金管理人管理的、基金托管人托管的其他同一类基金合并或终止基金合同：1、基金份额持有人数量不满 200 人；2、基金资产净值低于 5000 万元 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

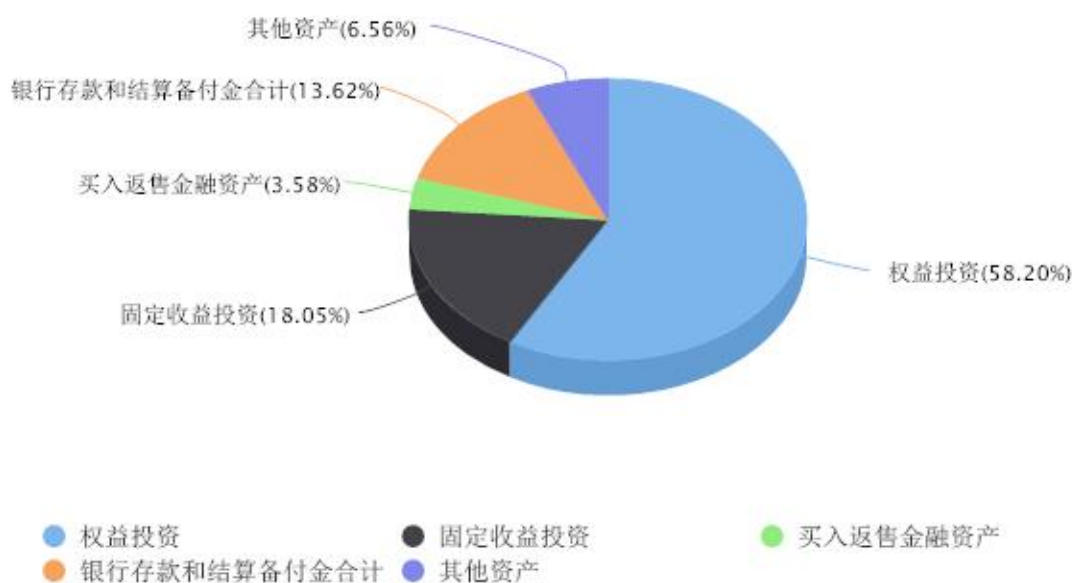
| | |
|------|---|
| 投资目标 | 基于基金管理人对市场机会的判断，灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略，在严格的风险管理下，追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。 |
| 投资范围 | 本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、 |

| | |
|--------|---|
| | <p>中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等,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及存托凭证市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票及存托凭证市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。</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%。</p> <p>开放期内,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。本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>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。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金采用包括市场中性投资策略在内的多种绝对收益策略,力争实现基金资产长期持续稳定的绝对回报。绝对收益策略包括:市场中性投资策略、其他绝对收益策略。其他投资策略包括:债券投资策略、中小企业私募债投资策略、衍生品投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>一年期定期存款税后利率</p> |
| 风险收益特征 | <p>本基金为特殊的混合型基金,采用多种绝对收益策略,其中市场中性策略采用股指期货对冲市场风险,使得多空组合的收益波动与市场相关性较低。本基金属于中低风险水平追求绝对收益的投资品种,其预期风险低于股票型基金和一般的混合型基金。</p> |

注:投资者欲了解本基金的详细情况,请仔细阅读本基金的《招募说明书》。本基金产品有风险,投资需谨慎。

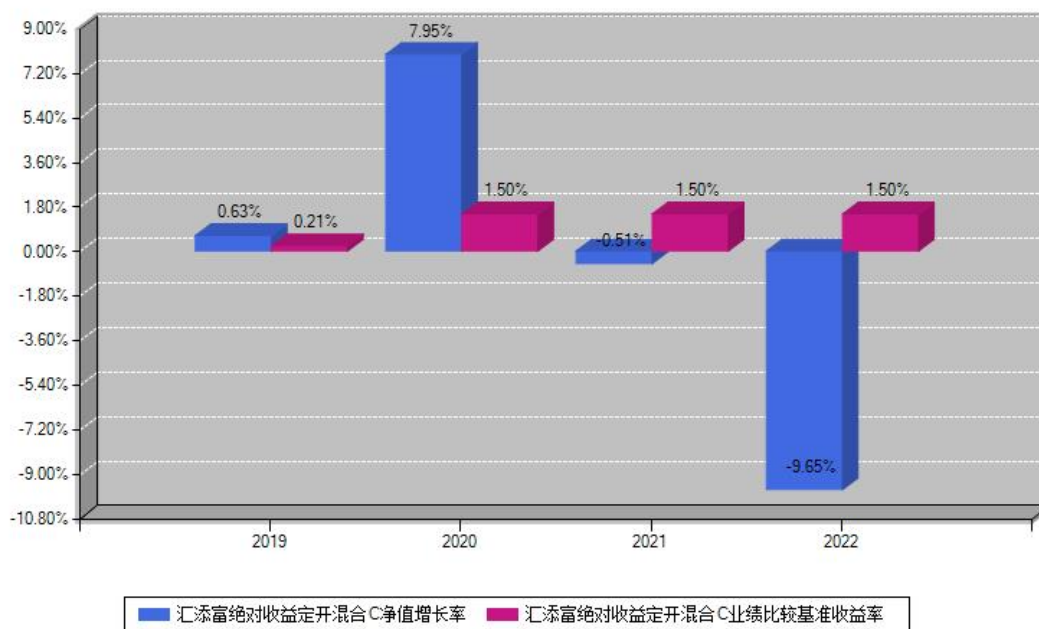
(二) 投资组合资产配置图表

投资组合资产配置图表
数据截止日期:2023年12月31日



(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

汇添富绝对收益定开混合C每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：数据截止日期为2022年12月31日，基金的过往业绩不代表未来表现。本《基金合同》生效之日为2017年03月15日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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) | 费率/收费方式 | 备注 |
|------|---------------------|---------|----|
| 赎回费 | 0天 \leq N $<$ 7天 | 1.50% | |
| | 7天 \leq N $<$ 30天 | 0.50% | |
| | N \geq 30天 | 0.00% | |
| 申购费 | 本基金C类份额不收取申购费用。 | | |

注：本基金已成立，投资本基金不涉及认购费。

(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 | 年费率或金额 | 收费方式 | 收取方 |
|---------|--------|--|------------|
| 管理费 | 1.2% | - | 基金管理人、销售机构 |
| 托管费 | 0.2% | - | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 0.8% | - | 销售机构 |
| 审计费用 | - | 90000.00元/年 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | - | 120000.00元/年 | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费 | - | - | 指数编制公司 |
| 其他费用 | - | 《基金合同》生效后与基金相关的律师费/诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用/开户费用/账户维护费用等费用。 | - |

注：本基金费用的计算方法和支付方式详见本基金的《招募说明书》。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。本基金运作相关费用年金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

| 基金运作综合费率（年化） |
|--------------|
| 2.21% |

注：基金运作综合费率（年化）测算日期为2024年05月23日。基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为

基准测算。

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。本基金面临的风险包括市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、特有风险、其他风险，其中特有风险具体包括非开放日不能赎回的风险、巨额赎回风险、本金损失风险、杠杆风险、对手方风险、投资于科创板股票的风险、投资存托凭证的风险，还包括：

1、绝对收益策略失败风险：本基金采用市场中性投资策略来实现绝对收益，但是不能确保策略能完全对冲基金的系统性风险，因而有可能因绝对收益策略失败导致基金损失。

2、卖空风险：本基金目前主要采用股指期货来对冲基金的系统性风险，将来会优选做空个股、做空其他衍生工具的方式来实现投资目标。同时持有多头和空头头寸的方式导致本基金存在在特定市场情况下收益水平不及普通偏股型基金的风险，同时有可能导致持有本基金在特殊情况下比持有普通偏股型基金蒙受更大损失。

3、股票选择风险：本基金多头股票部分主要采用基本面研究的方式进行选择，期望筛选出对比做空的股指或个股有超额收益的股票。但是通过基本面研究买入股票的区间收益率有可能低于做空的股指收益率或个股收益率，从而导致基金损失。

4、基差风险：在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。

5、到期日风险：股指期货合约到期时，基金财产如持有未平仓合约，中金所将按照交割结算价将基金财产持有的合约进行现金交割，基金财产将无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

6、盯市结算风险：股指期货采取保证金交易，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。假如市场走势对本基金财产不利，期货经纪公司会按照期货经纪合同约定的时间和方式通知基金管理人追加保证金，以使基金财产能继续持有未平仓合约。如出现极端行情，市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，又未能在规定时间内补足，按规定保证金账户将被强制平仓，甚至已缴付的所有保证金都不能弥补损失，从而导致超出预期的损失。

7、平仓风险：在某些市场情况下，基金财产可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓，例如，这种情况可能在市场达到涨跌停板时出现。出现这类情况，基金财产缴付的所有保证金有可能无法弥补全部损失，基金份额持有人还必须承担由此导致的全部损失。

8、连带风险：为基金财产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行

平仓时，基金财产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

9、基金资产投资特定投资对象的其他风险：如期货经纪公司违反法律法规或中金所交易、结算等规则，可能会导致基金财产受到损失。由于国家法律、法规、政策的变化、中金所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，基金财产持有的未平仓合约可能无法继续持有，基金财产必须承担由此导致的损失。

10、启用侧袋机制的风险

（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。

本基金的争议解决处理方式为仲裁。具体仲裁机构和仲裁地点详见本基金合同的具体约定。

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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：www.99fund.com、电话：400-888-9918

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

本次更新主要涉及“投资本基金涉及的费用”章节。