

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

2016年第2号)

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

二〇一六年十二月

重要提示

中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请于2015年1月28日经中国证券监督管理委员会(以下简称“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件》注册,并于2015年4月21日经中国证监会证券基金机构监管部函[2015]1048号《关于中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金备案确认的函》备案。本基金的基金合同于2015年4月21日生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注

册,并不表明对本基金的价值判断或承诺,也不表明

投资于本基金没有风险。中国证监会不对本基金的投资价值及市场风

景做出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生

波动,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投

资风险。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,实现显著的资产的增值。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。本基金在市场中性策略为主要投资策

略,通过量化选股和同时构建多头与空头进行对冲的方式实现策略,因

此除面临市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作风险、技术风

险、合规风险等一般混合型基金风险外,还包括基金特有风险。首先,

本基金的市场中性策略不能确保完全剥离股票市场的系统性风险;

其次,本基金的主要投资工具指期货还可能引起基差风险、杠杆风险、

保证金不足风险、平仓风险、对手方风险等;若本基金在开放期发生了

巨额赎回,基金管理人有可能采取部分延缓支付的措施以应对巨额赎回,

因此在巨额赎回情形发生时,基金份额持有人存在不能及时获得赎回款

项的风险。

投资有风险,投资人在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募

说明书和基金定期报告披露文件,全面认识本基金的风险收益特征和产

品特性,自主判断基金的投资价值,并充分考虑自身的风险承受能力,理性

判断市场,谨慎做出投资决策。

本基金定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期

与封闭期之定期开放的运作方式。本基金根据申购/申购金额适用不同的

申购/申购费率,根据持有期限适用不同的赎回费率。

基金管理人根据投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出

投资决策后,基金管理人将根据不同的投资风险,由投资人自行负责。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

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。本基金招募说

明书已经基金托管人复核。本基金招募说明书所载内容截止日为2016年

10月20日,有关财务数据和净值数据截止日为2016年9月30日(财务数

据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:中金基金管理有限公司

住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室

办公地址:北京市朝阳区太平洋大街18号丰融国际中心17层

法定代表人:林寿康

成立时间:2014年10月10日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:中国证监会证监许可[2014]97号

组织形式:有限责任公司

注册资本:2亿元人民币

存续期间:持续经营

联系人:张昱

联系电话:010-63211122

公司的股权结构如下:

股东名称	持股比例
中国工商银行股份有限公司	100%

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

林寿康先生,董事长,工商经济学博士。历任国际货币基金组织国际

部经济学家;香港金融管理局货币管理部高级经理;德意志摩根大通

公司新兴市场部经济学家;中国信达资产管理公司国际部副董事。现任中

国国际金融股份有限公司投资管理部负责人,董事总经理。

刘健女士,董事,金融学硕士。历任大连北方会计师事务所会计师;

香港何锡麟会计师事务所;北京通成推广有限公司财务部经理;北京

通胜咨询有限公司财务咨询师;中国国际金融股份有限公司稽核部

负责人。现任中国国际金融股份有限公司资金部负责人。

孙菁女士,董事,管理学硕士。历任中国金融租赁有限公司资本

市场部副经理;公司管理部总经理;运营支撑部执行总经理及负责

人等职务。现任中金基金管理有限公司总经理。

张春先生,独立董事,经济学和决策科学博士。历任美国明尼苏达大

学卡尔斯顿商学院金融系终身教授;中欧国际工商学院金融和会计系讲

授;系主任、副教务长。现任上海交通大学高级金融学院教授、执行院长。

顾颖女士,独立董事,经济法硕士、EMBA硕士研究生。历任云南政

法干部管理学院讲师;四通集团法务法律咨询副主任;海问律师事务

所证券业务律师;嘉和律师事务所合伙人。现任嘉源律师事务所创始合

伙人。

张龙先生,独立董事,博士。历任内蒙古康隆能源有限公司总经理,现

任中金财富投资有限公司董事长,中国建设银行独立董事。

2、基金管理人监事

林寿康先生,董事长,货币经济学博士。简历同上。

孙菁女士,总经理,管理学硕士,简历同上。

杜季女士,副总经理,经济学学士。历任中国国际金融股份有限公司财务经理,摩托罗拉(中国)电子有限公司财务人员等职务。现任中金基金管理有限公司稽核部高级经理。

沈芸女士,督察长,法学硕士。历任中国建设银行(深圳分行)内部

律师,深圳证券交易所高级经理;瑞银集团(香港)董事;中国国际金融

股份有限公司合规管理部合律师、副总经理。现任中金基金管理有限公司风险管理部负责人。

3、基金管理人高级管理人员

林寿康先生,董事长,货币经济学博士。简历同上。

孙菁女士,总经理,管理学硕士,简历同上。

杜季女士,副总经理,经济学学士。历任中国国际金融股份有限公司财务经理,摩托罗拉(中国)电子有限公司财务人员等职务。现任中金基金管理有限公司稽核部高级经理。

李云先生,工学硕士。历任摩根士丹利信息技术(上海)有限公司固收部门分析师;经理;中国国国际金融股份有限公司证券投资部经理、高级经理。现任中金基金管理有限公司量化公募投资部副总经理。

5、投资决策委员会成员

郭担任先生,工商管理硕士。历任宁波海炼化投资经理;华泰证券

项目经理;德恒证券高级经理;华泰投资有限公司投资副总经理;招商

基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部执行

总经理。

石玉女士,管理学硕士。历任天弘基金管理有限公司金融工程分析

师、固定收益研究员;中国国国际金融股份有限公司高级研究员、投资经理、助理研究员。现任中金基金管理公司债券型证券投资基金、中金现金管家货币

市场基金基金经理。

李云先生,工学硕士。历任摩根士丹利信息技术(上海)有限公司固收部门分析师;经理;中国国国际金融股份有限公司证券投资部经理、高级经理。现任中金基金管理有限公司量化公募投资部副总经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

(二)基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所:北京市西城区金融大街1号1号楼

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号1号楼

法定代表人:王洪章

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

联系人:田青

联系电话:(010)6759 5096

电子邮件:田青@ccb.com

中国建设银行成立于1946年10月,是一家国内领先、国际知名的大

型股份制商业银行,总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易

所挂牌上市(股票代码601939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票

代码601939)。

2015年末,本集团资产总额18.35万亿元,较上年增长9.5%;客户贷

款和垫款总额10.49万亿元,增长10.6%;客户存款总额13.67万亿元,增

长6.09%。净利润2,289亿元,增长20.2%;营业收入6,052亿元,增长

6.09%,其中,利息净收入增长16.5%,手续费及佣金净收入增长16.2%。

平均资产回报率1.30%,加权平均净资产收益率17.27%,成本收入比

26.98%。资产充足率15.39%,主要财务指标领先同业。

基金管理人建立了股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理

人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决

策。

基金管理人建立了股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理