安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金(C 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2026 年 10 月 16 日

送出日期：2026 年 10 月 19 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	安信阿尔法定开混合	**基金代码**	005280
下属基金简称	安信阿尔法定开混合 C	**下属基金交易代码**	009624
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	**基金托管人**	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2017 年 12 月 6 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**	每 3 个月开放一次
基金经理	施荣盛	**开始担任本基金基金经理的日期**	2025 年 3 月 11 日
		证券从业日期	2013 年 07 月 02 日
其他	基金合同生效满 3 年后，若基金资产净值低于 2 亿元的，基金合同自动终止，同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。		

二、基金投资与净值表现

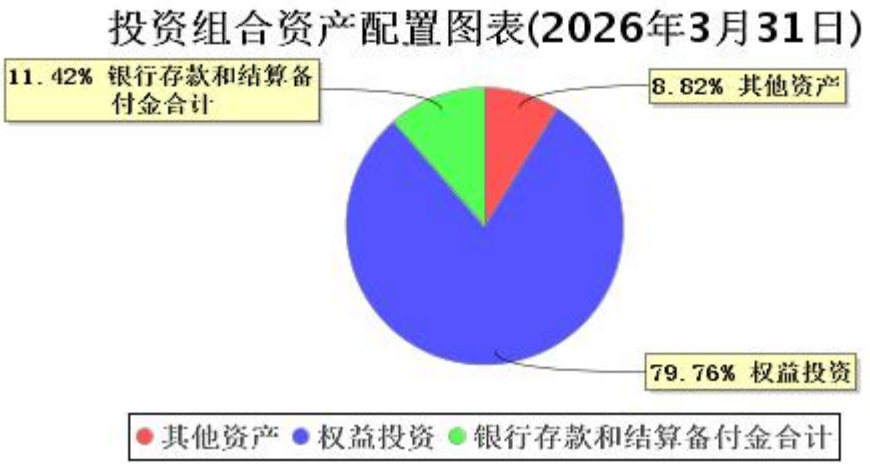
(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金以追求绝对收益为目标，在完全对冲市场风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
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)、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、银行存款等固定收益类资产，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)。 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。 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%。 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

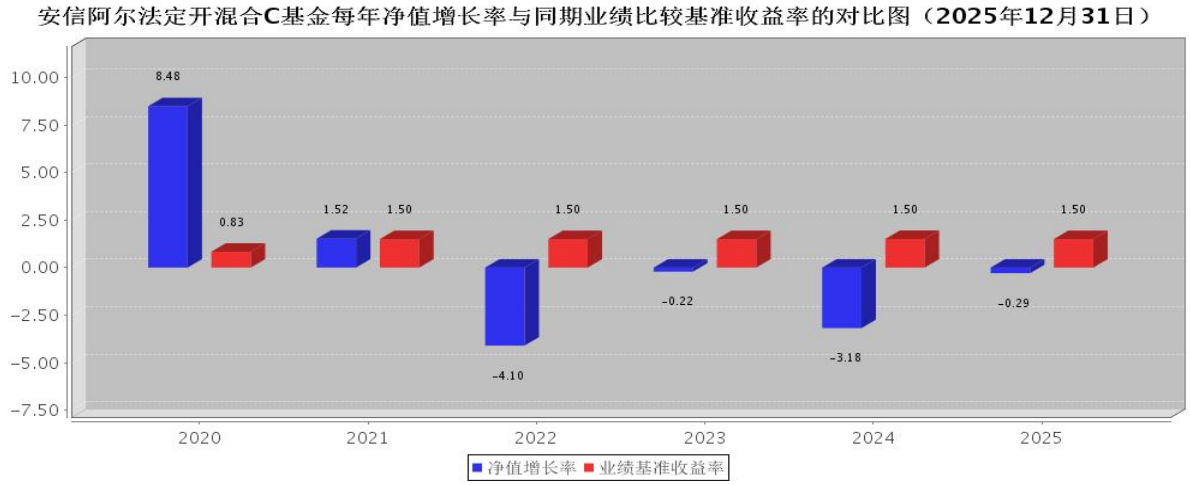
	年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。 本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第(一)项、第(三)项、第(五)项及第(七)项的限制。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
主要投资策略	本基金主要采用市场中性策略，通过量化模型优选出股票多头组合，并通过股指期货等对冲工具剥离市场系统性风险，获取稳健的阿尔法收益。资产配置方面，通过对宏观经济周期、货币供应量、市场估值水平、宏观政策导向以及市场氛围等因素的分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。股票投资方面，主要采用Alpha多因子模型，并结合风险模型和优化模型，构建Alpha股票组合，并使用股指期货对冲市场系统性风险。同时，本基金将运用期现套利、股指期货跨期套利、高频交易等绝对收益策略，进一步平抑本基金的收益波动。此外，本基金还将采用债券投资策略、资产证券投资策略、衍生工具投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金、货币市场基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。

注：详见《安信稳健阿尔法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



(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



注：根据基金管理人 2020 年 5 月 28 日《关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》，自 2020 年 6 月 12 日起，本基金增加 C 类份额。基金合同生效当年期间的相关数据按实际存续期计算。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

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	备注
申购费（前收费）	M≥0	0.00%	本基金 C 类份额无申购费
赎回费	N＜7 天	1.50%	100%归入基金资产
	7 天≤N＜30 天	0.50%	100%归入基金资产
	N≥30 天	0.00%	-

注：本基金 C 类份额不收取申购费。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

(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/年费率或金额	收取方
管理费	1.00%	基金管理人和销售机构
附加管理费	附加管理费是在每一个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 的孰高者，基金管理人才能收取附加管理费。	基金管理人和销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
销售服务费	0.60%	销售机构
审计费用	10,000.00 元	会计师事务所

信息披露费	80,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	律师费、银行间账户维护费、银行划款费等，详见招募说明书的基金费用与税收章节。	

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。相应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

若投资者认购/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：

安信阿尔法定开混合 C

基金运作综合费率（年化）
2.01%

注：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。本基金管理费包括基本管理费和附加管理费，其中附加管理费不纳入测算范围内。

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。

一）本基金投资运作过程中面临的主要风险有：

1、市场风险；2、管理风险；3、职业道德风险；4、流动性风险；5、合规性风险；6、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险；7、其他风险

二）本基金的特有风险

（1）非开放日不能赎回的风险

本基金每三个月开放一次，每次开放期不超过 5 个工作日，封闭期为每相邻两个开放日之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，因此基金份额持有人面临在非开放日内不能赎回基金份额的风险。

（2）巨额赎回风险

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期支付或暂停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赎回份额的风险。

（3）绝对收益策略失败风险

本基金主要采用市场中性策略来实现绝对收益，但是不能确保策略能完全剥离基金的系统性风险，因而有可能绝对收益策略失败导致基金损失。

（4）卖空风险

本基金目前主要采用股指期货来剥离基金的系统性风险，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跑不赢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。

（5）股票选择风险

（6）量化模型及金融数据的风险

（7）股指期货特有的风险

1、杠杆风险；2、基差风险；3、股指期货展期时的流动性风险；4、期货盯视结算制度带来的现金管理风险；5、到期日风险；6、对手方风险；7、连带风险；8 未平仓合约不能继续持有风险。

（8）发起式基金自动终止的风险

（9）投资于存托凭证的风险

(二)重要提示

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金的募集申请于2015年11月20日经中国证监会证监许可[2015]2684号文注册，并根据2017年5月12日机构部函[2017]1166号文进行募集。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金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作出准予注册的决定，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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。

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，除监管规定信息发生重大变更外，基金管理人每年更新一次资料概要。因此，本文件内容可能存在一定的滞后性，敬请投资者同时关注基金管理人发布的临时公告。

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。

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，则任何一方有权将争议提交位于北京市的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力，仲裁费及律师费由败诉方承担。

五、其他资料查询方式

以下资料详见安信基金官方网站［www.essencefund.com］［客服电话：4008-088-088］

1、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》、
《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》、
《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》

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