富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合型证券投资基金（富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E）基金产品资料概要更新

2026 年 11 月 11 日（信息截至：2026 年 11 月 10 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	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合	基金代码	008835
份额简称	富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E	份额代码	020353
基金管理人	富国基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2020 年 02 月 25 日	基金类型	混合型
运作方式	其他开放式	开放频率	对每份基金份额设置三个月的最短持有期限
交易币种	人民币		
基金经理	方旻	任职日期	2020 年 02 月 25 日
		证券从业日期	2010 年 02 月 10 日

二、 基金投资与净值表现

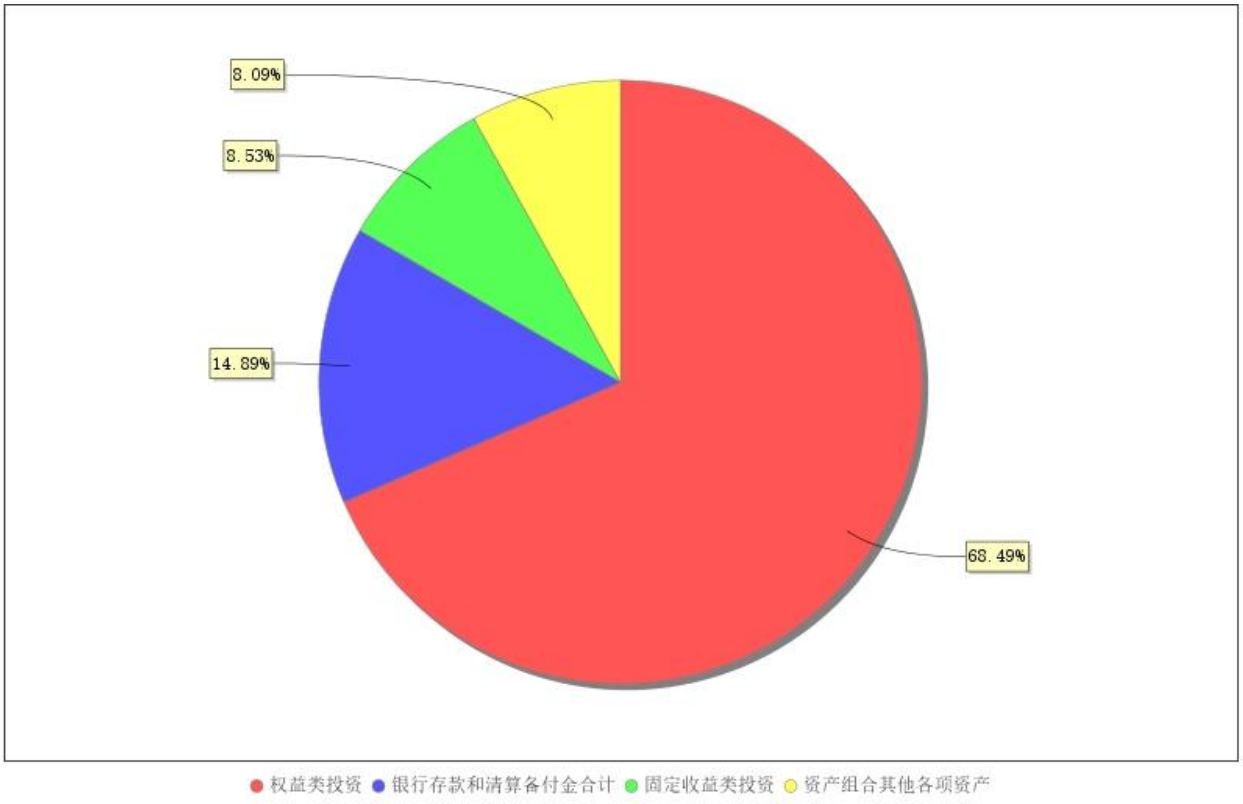
（一） 投资目标与投资策略

投资目标	在严格控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货）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)。 基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值与权益类多头头寸的价值的净风险敞口不超过基金资产净值的 10%。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、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值；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、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。本基金股票及存托凭证资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。本基金投资于同业存单和银行存款的比例不超过基金资产的 20%。
主要投资策略	本基金根据对市场的判断，采用“多空对冲”等投资策略，在控制基金资产的股票系统性风险暴露的前提下，实现基金资产的保值增值。本基金采用“自下而上”的数量化选股策略，根据市场状况及变化，不定期对模型进行调整，改进模型有效性，从而取得更高的收益。同时遵循数量化选股策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。本基

	金还将根据对证券市场走势的判断，适时利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险，并采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。债券投资策略方面，本基金基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对固定收益资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。本基金的存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略详见法律文件。
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）+3%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，利用股指期货等金融工具对冲系统性风险，与股票市场的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金的实际收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

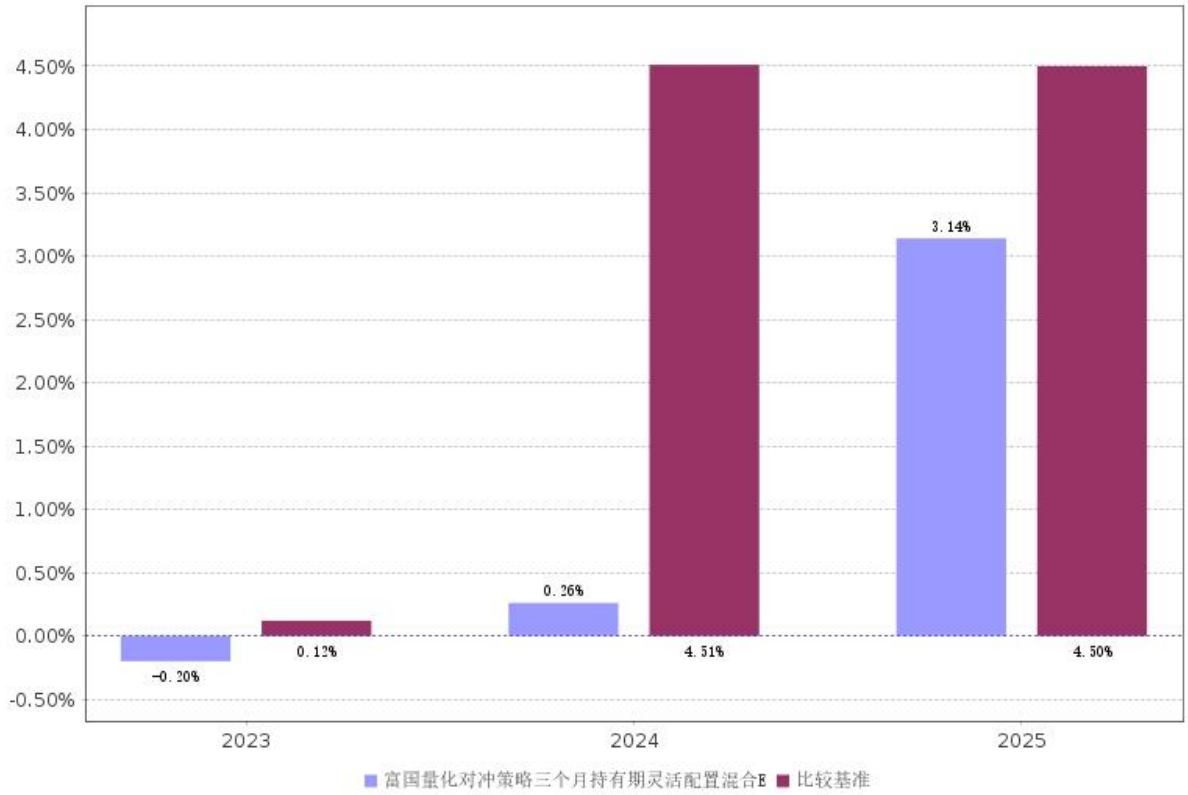
注：详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

（二） 投资组合资产配置图表



注：截止日期 2026 年 09 月 30 日。

（三） 自基金合同生效以来基金（富国量化对冲策略三个月持有期灵活配置混合 E）每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：本基金合同生效日 2020 年 02 月 25 日。E 类份额自 2023 年 12 月 22 日起有基金份额。业绩表现截止日期 2025 年 12 月 31 日。基金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

费用类型	金额（M）/持有期限（N）	费率
赎回费	N＜7 天	1.5%
	7≤N＜30 天	0.5%
	N≥30 天	0

注：本基金 E 类基金份额不收取申购费用，赎回费用在投资者赎回基金过程中收取。

（二） 基金运作相关费用

费用类别	年费率/收费方式	收取方
管理费	0.80%	基金管理人、销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
销售服务费	0.01%	销售机构
审计费用	18,000.00 元/年	会计师事务所
信息披露费	60,000.00 元/年	规定披露报刊

注：以上费用将从基金资产中扣除；本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。审计费用、信息披露费为基金整体承担的年费用金额，非单个份额类别费用。年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。除上述费用外的其他运作费用，详见《招募说明书》中的“基金费用与税收”章节。若本基金触发基金合同中关于“基金份额持有人数量和资产规模”的预警情形，基金管理人可决定是否承担本基金项下相关固定费用，最终实际情况以基金定期报告披露为准。

（三） 基金运作综合费用测算

基金运作综合费率（年化）
1.17%

注：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上表所示。基金管理费率、托管费率、销售服务费率为基金现行费率，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。

本基金投资中的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，大量赎回或暴跌导致的流动性风险，基金投资过程中产生的操作风险，因交收违约和投资债券引发的信用风险，基金投资对象与投资策略引致的特有风险等。

本基金的特有风险包括：1、市场中性策略风险

市场中性策略产品与普通的股票型、混合型基金不同。普通股票型指数基金通过复制指数来获取指数所代表的股票市场表现，普通主动股票型基金和混合型基金通过资产配置、选时、精选行业、个股等策略来争取超越市场表现的收益，这些类别的基金与股票市场表现都保持着较高的相关性。而市场中性策略产品，通过卖空股指期货对冲系统性风险，其预期收益和预期风险与股票市场表现的相关性较低，主要取决于其投资策略的有效性。

2、投资策略失败风险

本基金将根据资本市场情况灵活选择权益类、固定收益类资产投资比例及策略，并将利用股指期货等金融衍生工具对冲市场波动风险，因此本基金将受到来自权益市场、固定收益市场和股指期货等金融衍生品市场多方面风险：

（1）如果固定收益市场系统性风险爆发或对各类固定收益金融工具的选择不准确都将对本基金的净值表现造成不利影响。

（2）对股票市场的筛选与判断是否科学、准确，基本面研究以及定量分析的准确性，也将影响到本基金所选券种能否符合预期投资目标。

（3）对股指期货等金融衍生品市场走势的判断与分析，以及对股指期货等金融衍生品市场与现货市场联动关系的判断与分析是否科学、准确，也将影响到本基金的对冲策略等衍生品投资策略能否为基金财产贡献合理的投资收益。

（4）本基金的市场中性投资策略包括指数增强策略和对冲策略两部分，具体通过构建指数增强现货组合，同时卖空股指期货合约以对冲市场系统性风险，力求获得指数增强现货组合超越股指期货合约表现的超额收益。本基金采取多种投资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，因而有可能策略失败导致基金损失。

（5）除此之外，投资策略还可能存在卖空风险、本金损失风险。

3、本基金对于每份基金份额设置三个月最短持有期限，基金份额在最短持有期内不办理赎回及转换转出业务。自最短持有期结束后，方可办理赎回及转换转出业务。故投资者面临在最短持有期内无法赎回及转换转出基金份额的风险。

除此之外，本基金还可能存在股指期货投资风险、国债期货投资风险、资产支持证券投资风险、港股通股票投资风险、存托凭证投资风险、北京证券交易所股票投资风险等基金运作的特有风险。

（二） 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册/核准，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。

与本基金或基金合同相关的一切争议将提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁，仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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、定期公告等披露文件。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站（www.fullgoal.com.cn），客户服务热线：95105686，4008880688（全国统一，免长途话费）

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