

中金金泽量化精选  
混合型发起式证券投资基金  
更新招募说明书摘要  
(2018 年第 1 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

二〇一八年三月

## 重要提示

中金金泽量化精选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2017年6月16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[2017] 929号《关于准予中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册，并于2017年9月1日经中国证监会证券投资基金机构监管部机构部函[2017]2118号《关于中金金泽量化精选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2017年9月1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，并不表明其对本基金的投资价值、收益及市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）投资于证券及期货市场，基金净值会因为证券及期货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。本基金投资中的风险包括但不限于：市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、估值风险、操作及技术风险、合规性风险、本基金特有风险、税负增加风险、其他风险等。本基金投资品种包含中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。本基金属于混合型基金，其预期的风险和预期收益高于货币市场基金、债券证券投资基金，低于股票型证券投资基金。

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合同等信息披露文件，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，自主做出投资决策，自行承担投资风险，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。

本基金基金份额分为 A、C 两类，其中 A 类基金份额收取认/申购费，不计提销售服务费；C 类基金份额不收取认/申购费，但计提销售服务费；A、C 两类基金份额适用不同的赎回费率。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。

投资有风险，投资人认/申购本基金时应认真阅读本招募说明书及其更新。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本更新招募说明书已经本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为2018年2月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31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：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层

法定代表人：林寿康

成立时间：2014年2月10日

批准设立机关：中国证监会

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：2.5亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：张显

联系电话：010-63211122

公司的股权结构如下：

股东名称	持股比例
中国国际金融股份有限公司	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，货币经济学博士。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；德意志银行（香港）新兴市场部经济学家；中国信达资产管理公司国际部副主任。现任中国国际金融股份有限公司管理委员会成员、投资管理业务负责人、董事总经理。

孙菁女士，董事，管理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资本市场部副总经理、公司管理部副总经理、运营支持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。

黄劲峰先生，董事，机械工程专业学士。历任英国毕马威会计师事务所（英国及香港）审计、核算见习生、副经理、经理等职务；香港汇丰银行资本市场财务经理、货币及外汇市场财务经理职务；高盛（亚洲），高盛集团（日本东京）固定收益外汇及大宗商品产品财务控制负责人、权益类产品财务控制负责人、日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责人、执行董事等职务；北京高华证券有限责任公司中后台协调、风险管理岗位；高盛（亚洲）有限责任公司资产管理部亚太区首席营运官、亚太（除日本）首席营运官、产品研发主管和董事总经理职务。现任中国国际金融股份有限公司首席财务官、董事总经理。

陈刚先生，董事，法学博士。历任国务院发展研究中心技术经济研究所研究人员；北京世泽律师事务所律师；中国国际金融股份有限公司合规律师、中国国际金融（香港）有限公司合规律师、中金美国证券有限公司法律部负责人；厚朴香港投资咨询有限公司法律合规事务负责人。陈刚先生是纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。现任中国国际金融股份有限公司合规总监、董事总经理。

赵璧先生，董事，经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司投资银行部经理；中信产业基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司总经理助理。

李永先生，董事，工商管理硕士。历任中国人保资产管理有限公司交易员、风险监控员、投资经理；中国人寿资产管理有限公司养老金及机构业务部投资经理、固定收益团队负责人、固定收益部投资经理、高级投资经理、一级团队负责人；中国人寿资产管理有限公司固定收益投资委员会委员、自有资金投资委员会委员。现任中金基金管理有限公司副总经理。

张龙先生，独立董事，博士。历任内蒙康隆能源有限公司总经理，现任中宝睿信投资有限公司董事长。

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森管理学院金融系终身教授；中欧国际工商学院金融和会计系讲席教授、系

主任、副教授长。现任上海交通大学上海高级金融学院教授、执行院长。

颜羽女士，独立董事，经济法硕士、EMBA 硕士。历任云南政法干部管理学院教师；四通集团条法部法律咨询副主任；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。

## 2、基金管理人监事

夏静女士，执行监事，数学系理学硕士。历任普华永道（深圳）咨询有限公司北京分公司风险管理及内部控制服务部经理；中国国际金融股份有限公司稽核部高级经理。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。简历同上。

李永先生，副总经理。简历同上。

李虹女士，督察长，法学硕士。历任美国众达律师事务所北京代表处律师；中国国际金融股份有限公司合规管理部副总经理。李虹女士是美国纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。

## 4、本基金基金经理

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；中国国际金融股份有限公司高级研究员、投资经理助理、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。

杨立先生，经济学硕士。历任民生证券股份有限公司证券投资助理、证券投资经理；华融证券股份有限公司中级投资经理、高级投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部副总经理。

## 5、投资决策委员会成员

李永先生，副总经理。简历同上。

郭党钰先生，工商管理硕士。历任宁波镇海炼化投资经理；华泰证券项目经理；德恒证券高级经理；华策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，简历同上。

魏亭先生，香港大学统计专业博士。历任北京尊嘉资产管理有限公司量化策略研究员、高级量化研究员。现任中金基金管理有限公司量化投资部副总经理。

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

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 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

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

中国建设银行成立于 1954 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 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2017 年 6 月末，本集团资产总额 216,920.67 亿元，较上年末增加 7,283.62 亿元，增幅 3.47%。上半年，本集团实现利润总额 1,720.93 亿元，较上年同期增长 1.30%；净利润较上年同期增长 3.81%至 1,390.09 亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016 年，本集团先后获得国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。荣获

《欧洲货币》“2016 中国最佳银行”，《环球金融》“2016 中国最佳消费者银行”、“2016 亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016 年“世界银行 1000 强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第 2；在美国《财富》2016 年世界 500 强排名第 22 位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。



### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2017 年二季度末，中国建设银行已托管 759 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销中心

##### （1）直销柜台

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：北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际大厦 17 层

法定代表人：林寿康

电话：010-63211122

传真：010-66159121

联系人：张显

客户服务电话：400-868-1166

网站：www.ciccfund.com

(2) 网上直销

交易系统：中金基金网上交易系统

交易系统网址：[trade.ciccfund.com](http://trade.ciccfund.com)

2、其他销售机构

(1) 中国光大银行股份有限公司

客服电话：95595

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

(2) 包商银行股份有限公司

客服电话: 95352

网站: [www.bsb.com.cn](http://www.bsb.com.cn)

(3) 上海天天基金销售有限公司

客服电话：400-991-8918

网址：<http://fund.eastmoney.com>

(4) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

传真：021-68596919

客服电话：400-700-9665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(5) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

客服电话: 4000-766-123

网站: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(6) 通华财富（上海）基金销售有限公司

客服电话: 95156 转 5

网站: <https://www.tonghuafund.com>

（7）北京恒天明泽基金销售有限公司

客服电话：400-898-0618

网址：<http://www.chtfund.com>

（8）北京汇成基金销售有限公司

客服电话:400-619-9059

□□网址:[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

（9）北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

客服电话：4008199868

网址：[www.tdyhfund.com](http://www.tdyhfund.com)

（10）上海基煜基金销售有限公司

客服电话: 400-820-5369

网站: [www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

（11）北京虹点基金销售有限公司

客服电话：400-068-1176

网站：[www.jimufund.com](http://www.jimufund.com)

（12）上海陆金所资产管理有限公司

客服电话：4008219031

网站：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

（13）北京肯特瑞财富投资管理有限公司

客服电话: 400-098-8511

网站: <http://jdd.jr.jd.com/index.html>

（14）北京蛋卷基金销售有限公司

客服电话: 400-061-8518

网站: <https://danjuanapp.com/>

（15）洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司

客服电话：4006706863

网址：[www.hongtaiwealth.com](http://www.hongtaiwealth.com)

（16）银河证券股份有限公司

客服电话: 95551

网站: <http://www.chinastock.com.cn/>

(17) 华泰证券股份有限公司

客服电话:95597

网站: <http://www.htsc.com.cn>

(18) 长城证券股份有限公司

客服电话: 400-6666-888

网站: <http://www.cgws.com/>

(19) 平安证券有限责任公司

客服电话：95511

网址：<http://stock.pingan.com>

(20) 中国中投证券有限责任公司

客服电话:95532

网站: <http://www.china-invs.cn/>

(21) 太平洋证券股份有限公司

客服电话: 400-665-0999

网站: [www.tpyzq.com](http://www.tpyzq.com)

其他销售机构详见本基金基金份额发售公告或基金管理人届时发布的变更或增减销售机构的公告。

## (二) 登记机构

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：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层

法定代表人：林寿康

电话：010-63211122

传真：010-66155573

联系人：白娜

### （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：安冬、陆奇

联系人：安冬

### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层

办公地址：中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层

执行事务合伙人：邹俊

电话：010-85085000

传真：010-85185111

签章注册会计师：程海良、李砾

联系人：程海良

## 四、基金的名称

中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金。

## 五、基金的类型与运作方式

### （一）基金的类型

混合型证券投资基金。

## （二）基金的运作方式

契约开放式。

## 六、基金的投资目标

本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的稳定增值。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、同业存单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相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 50%-95%；在每个交易日日终，在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

## 八、基金的投资策略

本基金的量化模型从策略配置出发，投资框架涵盖理论驱动型策略、数据驱动型策略和混合策略三大类别，其中、理论驱动型策略包括注重基本面分析的因子策略以及密集使用量价关系的动量、反转策略，数据驱动型策略有模式识别类策略、机器学习类策略。本基金在资产投资过程中将使用模型动态调配各策略类别的比重，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，力争基金资

产长期稳定增值。

### （一）量化配置策略

本基金以量化配置策略管理各子策略的相应头寸，采用科学的优化方法与完整的资产配置框架，估算各个子策略收益/风险指标以及相关性和相关性，以最大程度分散风险，提高收益风险比为目标，在流动性许可的前提下，动态分配各个子策略的实际权重，提高基金组合整体表现。

### （二）量化选股策略

#### （1）股票多因子选股策略

本策略采用多因子选股方法，秉承基本面和技术面分析相结合的理念，模型中纳入考察的因子不仅包括影响整个股票市场走势的宏观因子，如 GDP、PPI、CPI、利率等；也涵盖短中期内可能显著作用个股并且具有经济意义的基本面指标，包括价值、成长性、质量、规模等因子；更囊括在 A 股市场中尤其有效的量价类指标，包括动量、反转、波动、换手四大类技术因子以及资金面因子。通过对因子的量化分析和综合评价，把握隐藏在个股收益不稳定性背后的因子收益稳定性，精选最能代表短期强势因子的个股构建多头组合，力争创造长期稳定的超额收益。本策略具备设计完善的风控模型，可针对不可预测的个股风险进行充分分散。同时，为进行盘后分析构建的归因模型可定期监测、总结策略收益或损失来源。

#### （2）股票中低频趋势策略

本策略通过对证券市场的运动趋势进行系统性回溯研究，通过分析市场资金、情绪、风险偏好等关键信息把握大势，试图在一定的置信程度内预测行业的中短期方向和趋势持续程度。以此为依据构建行业超额收益组合，并在模型提示趋势结束或是侦测到市场有转折迹象退出。

#### （3）事件驱动策略

本基金观察分析可能造成股价异常波动的事件，把握其影响股价的原因和持续期，通过对过往事件发生时个股投资回报的量化分析，分离出事件冲击下的异常收益并寻求统计规律，获取事件影响所带来的超额投资回报率分布情况，并以此判断一类事件的投资价值。策略中包括定向增发、业绩预告、业绩超预期

期、次新股投资、股权激励等传统事件类别，还包含分级基金套利等广义事件。同时，模型也将持续跟踪关注可能显著影响个股短期走势的新事件。

#### （4）中高频配对交易统计套利策略

本基金通过对股票大量数据的回溯研究，用量化统计分析找出市场内部单一个股或个股之间的稳定性关系，估计其概率分布并确定该分布的极端区域。若短期股价出现异常波动发生极端情形，可以借由计算机快速捕捉机会，等待股票价格表现恢复正常后退出。

### （三）其他投资策略

#### （1）债券投资策略

本基金使用量化利率模型、信用模型分析债券的合理价值，构建风控模型限制债券组合的久期、信用风险和流动性风险。一方面发挥固定收益证券长期配置价值，另一方面发掘债券由于短期价值失衡带来的投资机会，构造能够提供稳定收益、与其它市场相关性低的债券投资组合。

#### （2）中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债券的投资策略主要基于信用品种投资，在此基础上重点分析信用风险及流动性风险。首先，确定经济周期所处阶段，研究中小企业私募债发行人所处行业在经济周期中所受的影响，以确定行业总体信用风险的变动情况，并投资具有积极因素的行业；其次，对中小企业私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析；最后，结合中小企业私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素，综合评价中小企业私募债的信用风险和流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。

#### （3）股指期货投资策略

本基金通过对期货市场及其标的指数运行趋势的系统性定量化研究，估算其短期内价格的变化方向以及变动幅度，寻求其在情绪面带动下所能达到的短期估值水平，构建趋势投资策略；另一方面，研究期限价差变动的统计规律，计算股指期货的理论价值，采用恰当的套期保值方法管理现货净头寸。

基金管理人将建立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流程和风险控制等制度并报董事会批准。

#### （4）国债期货投资策略

本基金投资国债期货以套期保值、回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

#### （5）权证投资策略

在进行权证投资时，基金管理人将通过对权证标的证券基本面的研究，辅助运用权证定价模型寻求其合理估值水平，根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性，通过限量投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

#### （6）资产支持证券投资策略

本基金将持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展，将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，制定周密的投资策略。在具体投资过程中，重点关注标的证券发行条款、基础资产的类型，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，加强对未来现金流稳定性的分析。本基金将严格控制资产支持证券的总量规模，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，实现资产支持证券对基金资产的最优贡献。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*95%+中债综合指数收益率\*5%。

中证 800 指数成份股由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，中证 800 指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况；中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市

场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。基于本基金资产配置比例以及中证 800 指数和中债综合指数的特征，选用该业绩比较基准能够反应本基金的风险收益特征。

今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

## 十、基金的风险收益特征

本基金属于混合型基金，其预期的风险和预期收益高于货币市场基金、债券证券投资基金，低于股票型证券投资基金。

## 十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 12 月 31 日，报告期间为 2017 年 10 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日。本报告财务数据未经审计。

### 11.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例 （%）
1	权益投资	13,985,684.00	88.16
	其中：股票	13,985,684.00	88.16

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	798,880.00	5.04
	其中：债券	798,880.00	5.04
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	700,000.00	4.41
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	274,841.74	1.73
8	其他资产	104,574.15	0.66
9	合计	15,863,979.89	100.00

#### 11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,367,932.00	53.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	847,400.00	5.43
J	金融业	2,172,660.00	13.92

K	房地产业	2,597,692.00	16.64
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施 管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,985,684.00	89.61

### 11.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	86,000	1,461,140.00	9.36
2	600507	方大特钢	108,000	1,370,520.00	8.78
3	600383	金地集团	108,000	1,364,040.00	8.74
4	000625	长安汽车	80,000	1,008,000.00	6.46
5	600340	华夏幸福	30,800	966,812.00	6.19
6	600309	万华化学	25,200	956,088.00	6.13
7	000887	中鼎股份	52,000	944,840.00	6.05
8	002174	游族网络	38,000	847,400.00	5.43
9	000049	德赛电池	18,000	712,620.00	4.57
10	600987	航民股份	60,000	676,800.00	4.34

### 11.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

1	国家债券	798,880.00	5.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	798,880.00	5.12

#### 11.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019557	17 国债 03	8,000	798,880.00	5.12

#### 11.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 11.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末，本基金未持有贵金属。

#### 11.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末，本基金未持有权证。

#### 11.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 11.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期末，本基金未持有国债期货。

##### 11.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 11.9.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 11.10 投资组合报告附注

11.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

11.10.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 11.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	17,460.95
2	应收证券清算款	67,121.31
3	应收股利	-
4	应收利息	19,991.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	104,574.15

### 11.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 11.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600309	万华化学	956,088.00	6.13	临时停牌

### 11.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1□ 基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示：

### 中金金泽 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2017年9月1日（基金合同生效日）至2017年9月30日	0.98%	0.34%	0.83%	0.33%	0.15%	0.01%
2017年10月1日至2017年12月31日	-1.27%	0.62%	2.00%	0.72%	-3.27%	-0.10%
基金合同生效日至2017年12月31日	-0.30%	0.56%	2.85%	0.64%	-3.15%	-0.08%

### 中金金泽 C

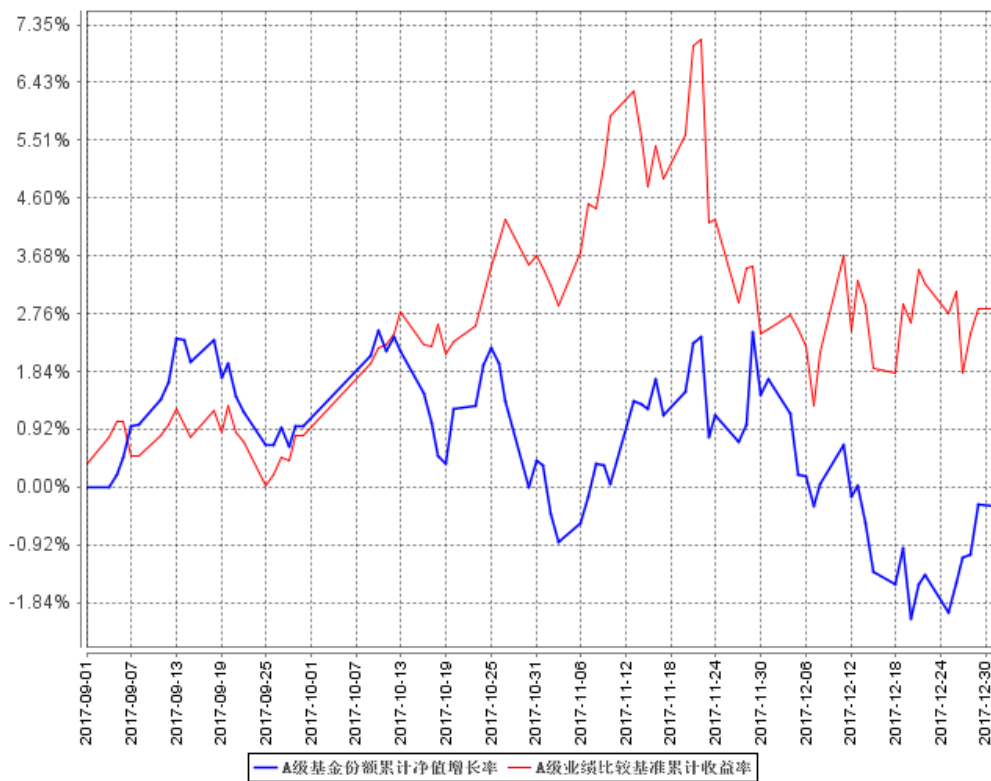
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

2017年9月 1日（基金合同 生效日）至 2017年9月 30日	0.95%	0.34%	0.83%	0.33%	0.12%	0.01%
2017年10月 1日至2017年 12月31日	-1.51%	0.62%	2.00%	0.72%	-3.51%	-0.10%
基金合同生效日 至2017年 12月31日	-0.57%	0.56%	2.85%	0.64%	-3.42%	-0.08%

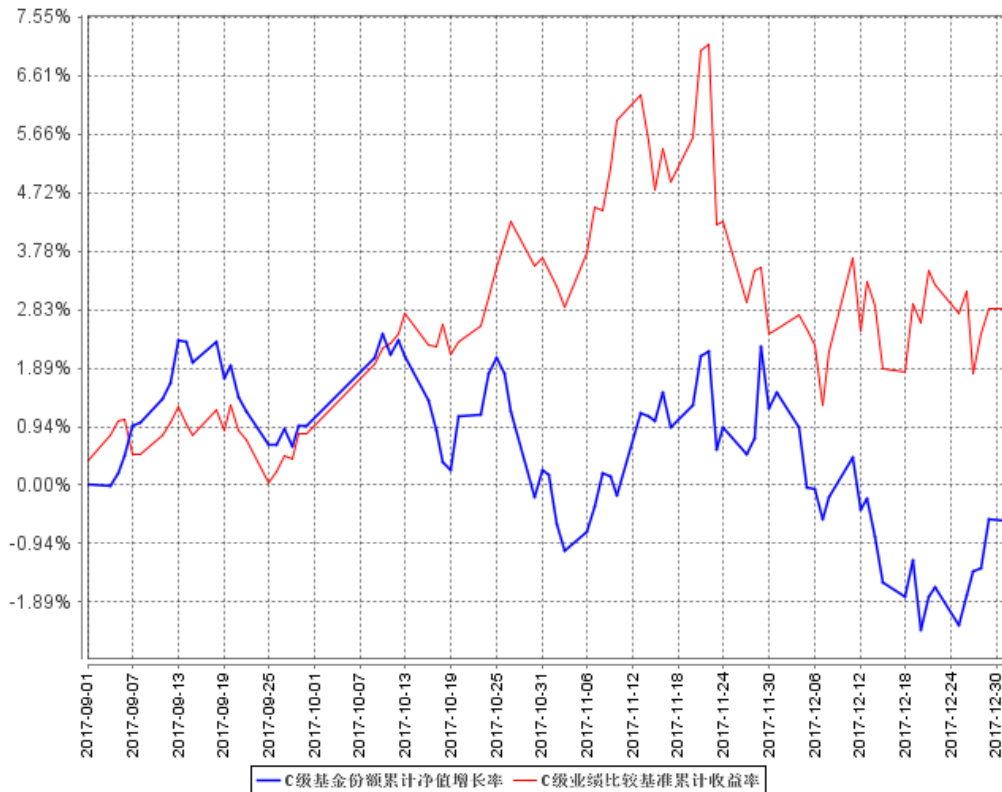
2、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## 十三、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）C类基金份额的销售服务费；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金的证券、期货交易费用；
- （8）基金的银行汇划费用；
- （9）基金的开户费用及账户维护费用；
- （10）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### （1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划

后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### （3）C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

C类基金份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺

延至最近可支付日支付。

C类基金份额销售服务费主要用于本基金C类基金份额的持续销售以及C类基金份额持有人服务等各项费用。

上述“一、基金费用的种类中第4—10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## （二）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

## （三）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金管理人于2017年8月2日刊登的《中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金招募说明书》进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”部分更新了相关内容；
- 2、在“第三部分 基金管理人”中，对基金管理人中金基金管理有限公司的主要人员情况进行了更新；
- 3、在“第四部分 基金托管人”部分更新了相关内容；
- 4、在“第五部分 相关服务机构”中，增加了部分销售机构并更新了相关服务机构的内容；
- 5、在“第六部分 基金的募集”部分中，删除了相关募集方案，增加了本基金的募集情况说明；
- 6、在“第七部分 基金合同的生效”中，删除了基金的备案条件和募集失败内容，增加了基金合同生效日期；
- 7、在“第八部分 基金份额的申购与赎回”中，更新了申购、赎回开始日及业务办理时间；
- 8、在“第九部分 基金的投资”中，增加了“基金投资组合报告”内容；
- 9、增加了“第十部分 基金的业绩”，相关数据内容截止时间为 2017 年 9 月 30 日；
- 10、在“第十七部分 风险揭示”部分更新了相关内容；
- 11、在“第二十二部分 其他应披露事项”中，增加了其他应当披露的事项。

中金基金管理有限公司

2018 年 3 月 28 日