

# 中融量化精选混合型基金中基金(FOF)更新招募说明书摘要(2018年1号)

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

中融量化精选混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）募集的准予注册文件名称为：《关于准予中融量化精选混合型基金中基金（FOF）注册的批复》（证监许可〔2018〕380号），注册日期为：2018年3月5日。

本招募说明书是对原《中融量化精选混合型基金中基金（FOF）招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律、法规规定募集，并经中国证监会注册。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、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，投资者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。投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。本基金为混合型基金中基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金为风险收益特征相对稳健的基金中基金。投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同等信息披露文件，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。

基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

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，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年11月3日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2018年9月30日（未经审计）。

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称 中融基金管理有限公司

注册地址 深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界中心29层

办公地址 北京市朝阳区东风南路3号院中融信托北京园区C座4层、5层

法定代表人 王瑶

总裁 杨凯

成立日期 2013年5月31日

注册资本 11.5亿元

经营范围 基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

股权结构 中融国际信托有限公司占注册资本的51%，上海融晟投资有限公司占注册资本的49%

存续期间 持续经营

电话 (010) 56517000

传真 (010) 56517001

联系人 肖佳琦

## 二、主要人员情况

### 1、基金管理人董事、监事、总裁、高级管理人员基本情况

#### (1) 基金管理人董事

王瑶女士，董事长，法学硕士。1998年7月至2013年1月在中国证监会工作期间，先后在培训中心、机构监管部、人事教育部等部门工作。2013年5月加入中融基金管理有限公司，先后担任公司督察长、总经理，自2015年2月起至今任公司董事长。

杨凯先生，总裁，工商管理硕士。曾任湖南工程学院教师、振远科技股份有限公司产品工程师、宝盈基金管理有限公司市场开发部总监、特定客户资产管理部总监、研究部总监、基金经理、公司副总经理。2016年9月加入中融基金管理有限公司，自2016年10月起至今任公司总裁。

刘洋先生，董事，毕业于英国曼彻斯特大学，工商管理博士。曾任职于中国工商银行黑龙江省分行国际业务部、中植高科技投资有限公司、上海中植金智科技投资有限公司、中植企业集团有限公司。现任中融国际信托有限公司董事长。

李骥先生，独立董事，1989年毕业于北京大学法律系，获学士学位。曾任职西安飞机工业公司法律顾问、中国管理科学研究院投资与市场研究所办公室主任、银川经济技术开发区投资控股有限公司总裁。现任中农科创投资股份有限公司董事长、中农科创资产管理有限公司董事长。

姜国华先生，独立董事，2002年毕业于美国加利福尼亚大学，获博士学位，并拥有香港科技大学硕士学位以及北京大学学士学位。任职于北京大学光华管理学院，同时担任北京大学研究生院副院长。

董志勇先生，独立董事，2004年毕业于新加坡南洋理工大学，获经济学博士学位，并拥有英国剑桥大学经济学硕士学位以及中国人民大学学士学位。现任北京大学经济学院党委书记兼院长，经济学院教授。

#### (2) 基金管理人监事

卓越女士，监事，毕业于对外经济贸易大学金融学专业，取得经济学硕士学位。曾任职于普华永道中天会计师事务所，2017年5月加入中融基金管理有限公司，现任职于法律合规部。

#### (3) 基金管理人高级管理人员

杨凯先生，总裁，工商管理硕士。曾任湖南工程学院教师、振远科技股份有限公司产品工程师、宝盈基金管理有限公司市场开发部总监、特定客户资产管理部总监、研究部总监、基金经理、公司副总经理。2016年9月加入中融基金管理有限公司，自2016年10月起至今任公司总裁。

向祖荣先生，督察长，法学博士。曾任职于北京建工集团总公司、中国证券监督管理委员会、中国上市公司协会。2014年8月加入中融基金管理有限公司，自2014年10月起至今任公司督察长。

曹健先生，副总裁，工商管理硕士，注册税务师。曾任黑龙江省国际信托投资公司证券部财务负责人、天元证券公司财务负责人、江海证券有限公司财务负责人。2013年5月加入中融基金管理有限公司，曾任公司首席财务官，自2014年12月起至今任公司副总裁。

易海波先生，副总裁，企业管理硕士。曾任招商证券股份有限公司研究发展中心金融工程研究员、理财投资部量化投资经理、量化投资部总经理。2016年11月加入中融基金管理有限公司，自2017年11月起至今任公司副总裁。

王启道先生，副总裁，管理学学士。曾任中国民族证券有限责任公司人力资源部培训师、中国人民人

寿保险股份有限公司投资部、投资三处经理助理。2016年4月加入中融基金管理有限公司，自2018年3月起至今任公司副总裁。

## 2. 本基金基金经理

哈图先生，中国国籍，毕业于北京大学，硕士，具有基金从业资格，证券从业年限11年。2007年8月至2010年3月，任职于天相投资顾问有限公司金融创新部，担任基金分析师。2010年4月至2012年1月，任职于华夏人寿保险股份有限公司，担任投资经理。2012年2月至2015年4月，任职于英大人寿保险股份有限公司，担任投资经理。2015年5月至2016年7月，任职英大保险资产管理有限公司，担任高级投资经理。2016年7月加入中融基金管理有限公司，任策略投资部基金经理。现任本基金的基金经理。

## 3. 投资决策委员会成员

投资决策委员会的成员包括：主席总裁杨凯先生；常设委员董事总经理黄震先生和产品开发部李晓伟先生；一般委员副总裁易海波先生、董事总经理孔学兵先生、量化投资部赵菲先生、董事总经理田刚先生、国际业务部付世伟先生、固收投资部罗杰先生。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

邮政编码：100032

法定代表人：易会满

成立时间：1984年1月1日

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发【1983】146号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币35,640,625.71万元

存续期间：持续经营

### 二、主要人员情况

截至2018年6月，中国工商银行资产托管部共有员工212人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### 三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月，中国工商银行共托管证券投资基金874只。自2003年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### 四、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非

常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017 共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

#### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

#### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

#### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地

对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### 五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

#### 第三部分 相关服务机构

##### 一、基金份额发售机构

###### 1. 直销机构

1) 名称：中融基金管理有限公司直销中心

住所：深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：北京市朝阳区东风南路 3 号院中融信托北京园区 C 座 4 层

法定代表人：王瑶

邮政编码：100016

电话：010-56517002、010-56517003

传真：010-64345889、010-84568832

邮箱：zhixiao@zrfunds.com.cn

联系人：赵琦、巩京博

网址：www.zrfunds.com.cn

## 2) 中融基金电子交易平台

基金管理人直销电子交易方式包括网上交易、移动客户端交易等。投资者可以通过基金管理人网上交易系统或移动客户端办理业务，具体业务办理情况及业务规则请登录基金管理人网站查询。

网址：<https://trade.zrfunds.com.cn/etrading/>

## 2. 其他销售机构

### 1)中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客服电话：95588

### 2)中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

客服电话：95566

### 3)交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

客服电话：95559

### 4)江苏江南农村商业银行股份有限公司

住所：常州市和平中路 413 号

办公地址：常州市和平中路 413 号

法定代表人：陆向阳

客服电话：96005

### 5)国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 楼

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

联系人：周杨

客服电话：95536

### 6)五矿证券有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元

法定代表人：赵立功

电话：0755-23902400

联系人：赖君伟

客服电话：40018-40028

### 7)中泰证券股份有限公司

住所：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李玮

电话：021-20315290

联系人：许曼华

客服电话：95538

8)东北证券股份有限公司

住所：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

电话：0431-85096517

联系人：安岩岩

客服电话：95360

9)中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

电话：010-60838888

联系人：顾凌

客服电话：95548

10)中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：姜晓林

电话：0532-85022326

联系人：吴忠超

客服电话：95548

11)中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：010-85156398

联系人：许梦园

客服电话：95587/4008-888-108

12)中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

电话：010-83574507

联系人：辛国政

客服电话：4008-888-888 或 95551

13)国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

联系人：芮敏祺

客服电话：95521/400-8888-666

14)国金证券股份有限公司

住所：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：028-86690057、028-86690058

联系人：刘婧漪、贾鹏

客服电话：95310

15)华西证券股份有限公司

住所：成都市高新区天府二街 198 号

办公地址：成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

电话：028-86135991

联系人：周志茹

客服电话：95584/4008-888-818

16)中国民族证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

办公地址：北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层-43 层

法定代表人：姜志军

客服电话：95571/40088-95618

17)西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：廖庆轩

电话：023-63786633

联系人：张煜

客服电话：95355

18)申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

联系人：钱达琛

客服电话：021-33389888

19)华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦

法定代表人：祝献忠

电话：010-85556048

联系人：孙燕波

客服电话：95390

20)平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：何之江

电话：021-38637436

联系人：周一涵

客服电话：95511

21)兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

电话：021-38565547

联系人：乔琳雪

客服电话：95562

22)信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层

法定代表人：张志刚

电话：010-83252182

联系人：唐静

客服电话：95321

23)东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 12、15 层

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

电话：010-66559742

联系人：夏锐

客服电话：95309

24)华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

联系人：庞晓芸

客服电话：95597

25)广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 5、7、8、17、18、19、38-44 楼

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

26)长江证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市新华路特 8 号

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

电话：027-65799999

联系人：奚博宇

客服电话：95579

27)东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

联系人：王一彦

客服电话：95531、400-8888-588

28)中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

电话：010-65051166-1753

联系人：任敏

客服电话：010-65051166

29)宏信证券有限责任公司

住所：四川省成都市锦江区人民南路二段十八号川信大厦 10 楼

办公地址：四川省成都市锦江区人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

法定代表人：吴玉明

电话：028-86199041

联系人：杨磊

客服电话：4008-366-366

30)安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

电话：0755-82558305

联系人：陈剑虹

客服电话：95517

31)方正证券股份有限公司

住所：长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：高利

客服电话：95571

32)渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：王春峰

电话：022-28451991

联系人：蔡霆

客服电话：400-651-5988

33)联讯证券股份有限公司

住所：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 楼

法定代表人：徐刚

电话：0755-83331195

联系人：彭莲

客服电话：95564

34)光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：周健男

电话：021-22169999

联系人：李芳芳

客服电话：95525

35)上海华信证券有限责任公司

住所：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 20 楼

法定代表人：陈灿辉

电话：021-63898427

联系人：徐璐

客服电话：400-820-5999

36)招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

电话：0755-82943666

联系人：黄婵君

客服电话：95565

37)国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

电话：010-84183389

联系人：黄静

客服电话：400-818-8118

38)民生证券股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：冯鹤年

电话：010-85127999

联系人：韩秀萍

客服电话：95376

39)东莞证券股份有限公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 22 楼

法定代表人：陈照星

联系人：李荣

电话：0769-22115712

客服电话：95328

40)世纪证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40/42 层

法定代表人：姜昧军

电话：0755-83199599

联系人：王雯

客服电话：4008323000

41)大同证券有限责任公司

住所：山西省大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市小店区长治路世贸中心 12 层

法定代表人：董祥

电话：0351-4130322

联系人：薛津

客服电话：4007-121212

42)万联证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层

法定代表人：张建军

电话：020-38286026

联系人：甘蕾

客服电话：95322

43)申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

客服电话：4008-000-562

44)天风证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

客服电话：95391 / 400-800-5000

45)国开证券股份有限公司

住所：北京市西城区阜成门外大街 29 号 1-9 层

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 29 号 1-9 层

电话：010-88300715

联系人：刘欣灿

客服电话：4008895593

46)第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

客服电话：95358

47)长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层

法定代表人：丁益

客服电话：400-6666-888

48)北京唐鼎耀华基金销售有限公司

住所：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-819-9868

49)北京晟视天下基金销售有限公司

住所：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 28 层

法定代表人：蒋煜

电话：010-58170949

联系人：殷雯

客服电话：010-58170761

50)北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：周斌

客服电话：400-8980-618

51)众升财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招弟

电话：010-59497361

联系人：李艳

客服电话：400-876-9988

52)深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

电话：0755-33227950

联系人：童彩平

客服电话：4006-788-887

53)上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

电话：021-20613999

联系人：张茹

客服电话：400-700-9665

54)蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6 层

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

55)上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

客服电话：400-1818-188

56)浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

联系人：吴强

客服电话：4008773772

57)北京坤元基金销售有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 8 号 B 座 501

办公地址：北京市东城区建国门内大街 8 号 B 座 501

法定代表人：李雪松

电话：010-85264506

联系人：刘洋

客服电话：400-818-5585

58)中期资产管理有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 16 号中期大厦 A 座 8 层

法定代表人：姜新

客服电话：95162、400-8888-160

59)诺亚正行基金销售有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

60)上海汇付基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼

法定代表人：金佶

电话：021-33323999

联系人：陈云卉

客服电话：400-820-2819

61)上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号

法定代表人：王之光

电话：021-20665952

联系人：宁博宇

客服电话：4008219031

62)北京虹点基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室

法定代表人：郑毓栋

客服电话：400-618-0707

63)大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人：姚杨

客服电话：400-928-2266

64)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层

法定代表人：马勇

电话：010-83363101

联系人：文雯

客服电话：400-166-1188

65)上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691923

联系人：苗明

客服电话：400-820-2899

66)奕丰基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

电话：0755-89460500

联系人：陈广浩

客服电话：400-684-0500

67)北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

法定代表人：李昭琛

电话：010-60619607

联系人：吴翠

客服电话：010-62675369

68)北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

电话：010-59601366-7024

联系人：李露平

客服电话：400-818-8000

69)珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

电话：020-896290994

联系人：黄敏嫦

客服电话：020-89629066

70)一路财富（北京）基金销售股份有限公司

住所：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室

法定代表人：吴雪秀

电话：010-88312877-8028

联系人：段京璐

客服电话：400-001-1566

71)上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7733

72)北京广源达信基金销售有限公司

住所：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区浦项中心 B 座 19 层

法定代表人：齐剑辉

客服电话：400-623-6060

73)上海云湾基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

法定代表人：桂水发

电话：021-20530224

联系人：江辉

客服电话：400-820-1515

74)上海联泰基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

电话：021-52822063

联系人：兰敏

客服电话：400-118-1188

75)北京电盈基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1号楼36层3603室

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12层B室

法定代表人：曲馨月

电话：010-56176118

联系人：张旭

客服电话：400-100-3391

76)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区福华路355号岗厦皇庭中心8楼DE

法定代表人：高锋

电话：0755-82880158

联系人：廖嘉琦

客服电话：400-804-8688

77)泰诚财富基金销售（大连）有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

法定代表人：林卓

电话：0411-88891212

联系人：徐江

客服电话：400-0411-001

78)上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼

法定代表人：王廷富

电话：021-51327185

联系人：徐亚丹

客服电话：400-799-1888

79)北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

80)深圳市金斧子基金销售有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层

办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元7层

法定代表人：赖任军

电话：0755-29330513

联系人：刘昕霞

客服电话：400-9302-888

81)北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部

法定代表人：江卉

客服电话：95118

82)天津万家财富资产管理有限公司

住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

电话：010-5901384

联系人：王芳芳

客服电话：010-59013842

83)上海大智慧基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元

法定代表人：申健

电话：021-20219188

联系人：印强明

客服电话：021-20292031

84)和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服电话：400-920-0022

85)上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号的太平金融大厦 1503-1504 室

法定代表人：王翔

电话：021-65370077-209

联系人：俞申莉

客服电话：400-820-5369

86)凤凰金信（银川）基金销售有限公司

住所：宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402 办公用房

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人：张旭

客服电话：400-810-5919

87)南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

客服电话：95177

88)乾道盈泰基金销售（北京）有限公司

住所：北京市西城区德胜门外大街 13 号院 1 号楼 1302

办公地址：北京市西城区德胜门外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：王兴吉

电话：18500501595

联系人：宋子琪

客服电话：400-088-8080

89)北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

联系人：戚晓强

客服电话：400-159-9288

90)武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号

法定代表人：陶捷

客服电话：4000-027-9899

91)天津国美基金销售有限公司

住所：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层

法定代表人：丁东华

电话：010-59287105

联系人：许艳

客服电话：400-111-0889

92)北京格上富信基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

电话：010-85594745

联系人：张林

客服电话：400-066-8586

93)上海挖财基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

客服电话：021-50810673

94)上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 16 层

法定代表人：毛淮平

客服电话：400-817-5666

95)中民财富基金销售（上海）有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层

法定代表人：弭洪军

客服电话：400-876-5716

96)喜鹊财富基金销售有限公司

住所：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

法定代表人：陈皓

客服电话：4006997719

97)通华财富（上海）基金销售有限公司

住所：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼

法定代表人：马刚

客服电话：95156

98)厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

法定代表人：陈洪生

客服电话：400-918-0808

99)中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

电话：010-59336593

联系人：徐英

客服电话：4008-909-998

100)贵州省贵文文化基金销售有限公司

住所：贵州省贵阳市南明区龙洞堡电子商务港太升国际 A 栋 2 单元 5 层 17 号

办公地址：贵州省贵阳市南明区兴业西路 CCDI 大楼一楼

法定代表人：陈成

电话：0851-85407888

联系人：黄笛

客服电话：0851-85407888

101)济安财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人：杨健

电话：010-65309516

联系人：李海燕

客服电话：400-673-7010

102)嘉实财富管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

电话：010-85097570

联系人：余永键

客服电话：400-021-8850

103)和耕传承基金销售有限公司

住所：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风东路东、康宁街北 6 号楼 6 楼 602、603 房间

办公地址：北京市朝阳区酒仙桥路 6 号国际电子城 360 大厦 A 座

法定代表人：王旋

联系人：董亚芳

客服电话：4000-555-671

104) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人：戎兵

电话：010-52858244

联系人：魏晨

客服电话：400-6099-200

105) 民商基金销售（上海）有限公司

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

联系人：童筱爽

客服电话：021-50206003

106) 大连网金基金销售有限公司

住所：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

客服电话：4000899100

107) 中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

电话：13718246886/010-60834022

联系人：刘宏莹

客服电话：400-990-8826

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的其他机构销售本基金，并及时公告。

## 二、登记机构

名称：中融基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：北京市朝阳区东风南路 3 号院中融信托北京园区 C 座 4 层、5 层

法定代表人：王瑶

电话：010-56517000

传真：010-56517001

联系人：黎峰

网址：[www.zrfunds.com.cn](http://www.zrfunds.com.cn)

## 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

联系人：安冬

经办律师：安冬、陆奇

## 四、审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：张勇、李旭芳

联系人：李旭芳

#### 第四部分 基金名称

中融量化精选混合型基金中基金（FOF）

#### 第五部分 基金类型、运作方式与存续期间

1. 基金类型：混合型基金中基金。

2. 基金的运作方式：契约型开放式。

3. 基金存续期间：不定期。

#### 第六部分 基金的投资目标

本基金以量化投资技术为基础，并与基本面研究紧密结合，努力把握市场投资机会，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的持续稳健增长。

#### 第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金份额（含 QDII 基金）、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）、债券（包括国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券、中小企业私募债券、次级债等）、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、资产支持证券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）。

本基金不投资于分级基金份额、香港互认基金份额、股指期货、国债期货和股票期权。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于中国证监会依法核准或注册的证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，本基金投资于权益类资产（包括股票、股票型基金、混合型基金）占基金资产的比例为 0-30%；其中，权益类资产（包括股票、股票型基金、混合型基金）的战略配置比例为 20%，固定收益类资产（包括债券、债券型基金、货币市场基金等）的战略配置比例 80%。权益类资产的战术调整幅度不超过战略配置比例的正负 10%。在极端市场情况下，可以将权益类资产占比最低调整到 0%。基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等。

#### 第八部分 基金的投资策略

本基金以资产配置为核心，通过战略与战术资产配置，将基金资产风险水平控制在可承受的程度内并获得承担风险的回报，将基金资产持续稳健增长的长期目标分解到管理标的基金的各个专业的投资团队中，力争实现基金资产的稳健增值。

本基金主要通过量化模型精选投资标的。在投资方法上，本基金使用量化择时模型在战术资产配置层面对权益类资产进行配置调整，并运用量化指标模型体系从多角度对全市场基金进行优选，从而构建基金组合。

##### 1、大类资产配置策略

###### （1）战略资产配置

为了保持基金资产持续稳健增长的风险收益特征，根据权益类资产与固定收益类资产长期的收益水平与风险水平，本基金的战略资产配置方案为：权益类资产（包括股票、股票型基金、混合型基金）的投资占比为 20%，固定收益类资产（包括债券、债券型基金、货币市场基金等）的投资占比为 80%。

## (2) 战术资产配置

为进一步增强基金资产收益并尽量控制最大回撤在可承受的程度，本基金可根据基金管理人对未来大类资产风险收益特征的判断，在战略资产配置比例正负 10% 的范围内通过量化模型进行调整，在极端市场情况下，为了控制基金净值的最大回撤幅度，可以将权益类资产占比最低调整到 0%。

在战术资产配置层面，基金管理人将参考中长期、中短期、短期三个时间尺度的量化择时模型的结果，进行战术资产配置决策。

1) 中长期模型提示 3 个月至 12 个月权益类资产风险与机会水平，核心关注经济周期、资产间相对价值、政策与流动性等因素，决定权益类资产比例偏离的范围。

当经济周期量化模型处于衰退后期或复苏期阶段、股债相对价值量化模型中股票处于较具价值阶段、政策与流动性环境边际变化对股票市场利好阶段时，权益资产配置比例上限范围为 25%-30%；

当经济周期量化模型处于过热后期或者滞涨期、股债相对价值量化模型中债券处于较具价值阶段、政策与流动性环境边际变化对股票市场利空阶段时，权益资产配置比例上限范围为 15%-20%。

其余市场环境下，权益资产配置比例上限范围为 20%-25%。

2) 中短期模型提示 1 个月至 3 个月权益类资产风险与机会，核心关注市场情绪周期等因素，决定权益类资产比例偏离的时点。

在 1 个月至 3 个月的时间尺度上，市场情绪量化模型通过全体股票量价的位置、速度、加速度分布的变化可以描述当前市场的活跃程度。在活跃程度从低迷至活跃向上拐点时间窗口，提升权益资产比例，在活跃程度从活跃至低迷向下拐点时间窗口，降低权益资产比例。

3) 短期模型提示 1 个月内市场状况，核心关注市场对信息的反馈模式、技术指标等因素，决定投资计划实施的节奏。

市场趋势量化模型通过市场主要指数时间序列趋势的强弱，描述当前市场的趋势强度。市场短期趋势较强，或者当前趋势持续时间已经较长，市场中短期拐点形成时间窗口一般较长，投资计划实施可以分多次进行；反之市场短期趋势较弱，或者当前趋势持续时间较短，市场中短期拐点形成时间窗口一般较短，投资计划实施可以分较少次数进行。

本基金以量化模型体系的结果为跟踪研究市场状态变化的基础，并根据市场发展变化不断对其完善，力争对基金资产有效的实施大类资产配置。

## 2、基金投资策略

本基金通过基金量化指标模型体系进行备选基金池的筛选，在多角度考虑基金公司、基金经理的综合实力的基础上，考察基金的风险调整后收益、波动率、最大回撤、超越业绩基准的程度与稳定性等量化指标，精选各类型基金，形成备选基金池，结合资产配置方案、基金风险收益特征及之间的相关性，选择基金规模、交易方式、流动性情况符合要求的基金构建基金组合。

本基金基金筛选主要过程如下：

(1) 首先，在满足本基金投资范围的基础上，全市场范围内定期更新基金样本，包括剔除不满足基金存续时间、基金规模、基金类型等要求的基金样本。然后对不同型基金通过不同维度指标筛选得到基金的投资价值定量得分。

不同类型基金选择主要考察维度如下：

对于主动管理类基金，重点考察其长中短各期的风险调整后收益、长中短各期信息比率、长期在同类基金中月度胜率等指标加权平均得到基金业绩绩效定量得分，业绩绩效定量得分结合基金管理人在该类产品业绩绩效平均水平的得分、机构投资者认可度得分、基金经理从业经历得分等，加权平均得到主动管理类基金投资价值的定量得分，优选得分靠前的基金品种进入备选基金池。同时根据定期报告披露数据、收益率的时间序列回归法以及 Brison 等业绩归因分析结果，对基金进行特征标注，主要特征包括股票仓位特征、行业与风格特征、交易换手特征、持仓集中度特征、债券券种偏好、杠杆久期水平与变化方式偏好等。

对于货币市场基金等类型基金产品，通过其基金规模水平得分、规模变化的稳定程度得分、场内品种流动性得分、持有者结构得分、收益水平得分等，加权平均得到投资价值定量得分，优选得分靠前的基金

品种进入备选基金池。

对于指数型基金、商品类基金等基金产品，通过对其跟踪标的风险收益特征稀缺性得分、基金规模得分、场内品种流动性得分、跟踪误差得分、持有者结构得分等，加权平均得到投资价值定量得分，优选得分靠前的基金品种进入备选基金池。

(2) 其次，通过不同考量维度的指标得分加权平均得到基金管理人综合定量得分，不同考量维度的指标得分包括公司投研实力得分、公司管理规模得分、产品线得分、公司团队稳定性得分、合规得分等。

(3) 再次，结合基金投资价值定量得分与管理人综合定量得分，进一步筛选得到备选基金池的基金样本。

在基金组合构建与调整的过程中，要充分结合定量与定性研究结果，对于基金公司治理结构、风控运营水平、激励机制、投研流程与文化，对于基金经理投资风格、核心获利逻辑与方法等不易通过定量指标刻画衡量的维度，通过直接调研或者第三方机构的相关支持进行把握，选择投资价值较明显的基金构建投资组合。在市场出现变化或者基金投资价值出现变化后，需要根据战术资产配置的调整方案，结合标的基金的基金契约或者标的基金的基金经理风格对未来市场的适应程度，对基金组合进行调整。

### 3、股票投资策略

本基金主要投资于证券投资基金基金份额，辅助投资于精选的价值型股票，通过自下而上的公司基本面全面分析，并以前瞻性的投资视角，精选优质价值型股票进行重点投资。通过适度参与股票等权益类资产的投资增强回报，在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上，力争实现基金资产的持续稳定增值。

### 4、债券投资策略

本基金债券投资采用主动性投资策略，主要包括久期管理、期限结构配置、个券信用风险管理等策略，通过持有国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含分离债）、短期融资券、回购及其他固定收益类证券，确定和构造能够提供稳定收益、流动性较高的债券组合，在获取较高的利息收入的同时兼顾资本利得。

### 5、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

### 6、权证投资策略

本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×20%+中债综合财富指数收益率×75%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

中证 800 指数是中证指数有限公司编制的，其成分股是由中证 500 和沪深 300 指数成分股构成。中证 800 指数综合反映了沪深证券市场内大中小市值公司的整体情况，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金所持有基金中与权益市场表现较相关的基金资产的比较基准。

中债综合财富指数是中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，是中债指数应用最广泛指数之一，具有较强的权威性和市场影响力。该指数样本券主要包括国债、政策性银行债券、商业银行债券、中期票据、短期融资券、企业债、公司债等，能较好地反映债券市场的整体收益。适合作为本基金所持有基金中与债券市场表现较相关的基金资产的比较基准。

本基金是混合型基金中基金，基金在运作过程中将维持 80%-95%的基金份额资产，其余资产主要投资于债券及其他具有高流动性的短期金融工具，为了控制投资风险，基金权益类资产的总体比例会根据市场

风险水平灵活调整。本基金将业绩比较基准中中证 800 指数、中债综合财富指数与同期银行活期存款利率（税后）的权重确定为 20%、75%和 5%，该基准是衡量本基金投资业绩的理想基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数，则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后，调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

#### 第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金中基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金为风险收益特征相对稳健的基金中基金。

#### 第十一部分 基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告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。

本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 12 月 3 日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 2018 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 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 --

其中：股票 --

?2 基金投资 106,469,225.20 79.52

3 固定收益投资 7,545,000.00 5.64

其中：债券 7,545,000.00 5.64

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 --

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 3,749,307.97 2.80

8 其他资产 16,130,269.60 12.05

9 合计 133,893,802.77 100.00

##### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

##### 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

##### 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

本基金本报告期末未持有股票。

##### 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 --

2 央行票据 --

3 金融债券 7,545,000.00 5.93

其中：政策性金融债 7,545,000.00 5.93

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 7,545,000.00 5.93

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 018005 国开 1701 75,000 7,545,000.00 5.93

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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告表编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他资产构成

?序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 77,829.98

2 应收证券清算款 15,909,977.24

3 应收股利 960.49

4 应收利息 140,891.97

5 应收申购款 609.92

6 其他应收款 -

7 其他 -

8 合计 16,130,269.60

11.4 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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

11.6 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，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十二部分 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代表其未来表现。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。基金业绩数据截至 2018 年 9 月 30 日。

本基金合同生效日为 2018 年 5 月 4 日，基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如

下表所示：

一、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中融量化精选 FOF (A) 净值表现

?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

2018 年 7 月 1 日至 2018 年 9 月 30 日 -2.30% 0.23% 0.48% 0.26% -2.78% -0.03%

自基金合同生效日至 2018 年 9 月 30 日 -2.57% 0.20% -0.68% 0.25% -1.89% -0.05%

中融量化精选 FOF (C) 净值表现

?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

2018 年 7 月 1 日至 2018 年 9 月 30 日 -2.46% 0.23% 0.48% 0.26% -2.94% -0.03%

自基金合同生效日至 2018 年 9 月 30 日 -2.86% 0.20% -0.68% 0.25% -2.18% -0.05%

二、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

注：按照基金合同和招募说明书的约定，本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至本报告期末仍在建仓期内。

第十三部分 基金的费用与税收

一、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、基金投资其他证券投资基金而产生的其他证券投资基金的销售费用，但法律法规禁止从基金财产中列支的除外；

8、基金的证券交易费用；

9、基金的银行汇划费用；

10、基金的开户费用、账户维护费用；

11、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。

二、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

基金管理人不得对本基金持有的自身管理的基金部分收取本基金的管理费。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（除去本基金持有的自身管理的其他基金所对应的基金资产净值）

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。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。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。

2、基金托管人的托管费

基金托管人不得对本基金持有的自身托管的基金部分收取本基金的托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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（除去本基金持有的自身托管的其他基金所对应的基金资产净值）

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。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。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。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期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持续销售以及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—11 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。

### 三、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。

基金管理人运用本基金财产申购自身的基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法律法规、被投资基金招募说明书约定应当收取，并记入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

### 四、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。

#### 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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，对本基金的招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- （一）更新了“重要提示”中的相关内容。
- （二）更新了“第一部分 前言”中的相关内容。
- （三）更新了“第三部分 基金管理人”中的相关内容。
- （四）更新了“第四部分 基金托管人”中的相关内容。
- （五）更新了“第五部分 相关服务机构”中的相关内容。
- （六）更新了“第六部分 基金的募集”中的相关内容。
- （七）更新了“第七部分 基金合同的生效”中的相关内容。
- （八）更新了“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的相关内容。
- （九）更新了“第九部分 基金的投资”中的相关内容。
- （十）更新了“第十部分 基金的业绩”中的相关内容。
- （十一）更新了“第二十部分 托管协议的内容摘要”中的相关内容。

(十二) 更新了“第二十二部分 其他应披露事项”中的相关内容。

中融基金管理有限公司

2018年12月18日