

中金量化多策略灵活配置混合型证券投资

基金招募说明书（更新）摘要

2020 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

二零二零年一月

重要提示

中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请于2016年6月27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[2016]1415号《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，并于2016年11月10日经中国证监会证券投资基金机构监管部部函[2016] 2759号《中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》备案。本基金的基金合同于2016年11月10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价值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。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等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、操作风险、技术风险、合规性风险、本基金特有风险、税负增加风险和其他风险等。本基金可投资科创板股票，科创板股票的主要风险包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、监管规则及政策变化风险等。本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型证券投资基金，高于债券型证券投资基金和货币市场基金。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，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。

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、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，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。

投资有风险，投资人认/申购基金时应认真阅读本招募说明书、基金产品

资料概要。

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。

本基金关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行。

本基金本次更新招募说明书对基金合同修订、基金托管协议修订进行更新，相关信息更新截止日为2020年1月18日。除非另有说明，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2019年11月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年09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：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层

法定代表人：楚钢

成立时间：2014年2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：3.5亿元人民币

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、主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

楚钢先生，董事长，理论物理学博士，特许金融分析师。历任花旗集团副总裁、新兴市场风控经理、地方政府债券自营交易员、基金经理、拉丁美洲股票期权交易负责人及另类投资董事总经理等职务。现任中国国际金融股份有限公司首席运营官、管理委员会成员。

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、管理委员会成员。

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。陈刚先生是美国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。

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。

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。现任上海交通大学上海高级金融学院教授、执行院长，并兼任上海人寿股份有限公司及上海证券有限责任公司独立董事。

冒大卫先生，独立董事，哲学博士。历任北京大学光华管理学院团委书记、党委副书记、党委书记，北京大学医学部副主任、财务部部长，北京大学副总会计师等职务。现任神州泰岳软件股份有限公司总裁。

王元先生，法学硕士。历任北京君合律师事务所上海分所、上海市耀良律师事务所、北京市嘉源律师事务所上海分所律师。现任北京市嘉源律师事务所高级合伙人、管委会成员，兼任上海思华科技股份有限公司独立董事。

2、基金管理人监事

白娜女士，执行监事，管理学硕士。历任航天信息股份有限公司内审部审计主管；长盛基金管理有限公司基金会计；中国国际金融股份有限公司资产管理部高级经理。现任中金基金管理有限公司基金运营部负责人。

3、基金管理人高级管理人员

楚钢先生，董事长。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。

汤琰女士，管理学硕士。历任中国工商银行深圳分行高级理财经理；华安基金管理有限公司零售业务部副总经理。现任中金基金管理有限公司副总经理。

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。

夏静女士，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首席信息官、风险管理部负责人。

4、本基金基金经理

刘重晋先生，理学博士。历任松河投资咨询（深圳）有限公司副总经理、量化研究员。2017年4月加入中金基金管理有限公司，现任量化公募投资部基金经理。

5、投资决策委员会成员

李永先生，副总经理，工商管理硕士。简历同上。

王雁杰先生，经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部行业研究员，定向资产管理业务投资经理，集合资产管理计划投资经理；中金基金管理有限公司专户投资部投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部

基金经理、董事总经理。

石玉女士，管理学硕士。历任中国科技证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司职员；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资产管理部高级研究员、投资经理助理、投资经理。2016年7月加入中金基金管理有限公司，现任投资管理部基金经理。

朱宝臣先生，理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部投资经理、量化投资总监。2017年10月加入中金基金管理有限公司，现任量化投资团队负责人。

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投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人情况

(一) 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)。

2018年末，集团资产规模23.22万亿元，较上年增长4.96%。2018年度，集团实现净利润2,556.26亿元，较上年增长4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为1.13%和14.04%；不良贷款率1.46%，保持稳中有降；资本充足率17.19%，保持领先同业。

2018年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018年中国最佳大型零售银行奖”、“2018年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会2018年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等11个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工300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

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

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。

原玘，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、相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

(1) 直销柜台

名称：中金基金管理有限公司

客服电话：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

2、其他销售机构

(1) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

客服电话：95118

网址：<http://fund.jd.com>

(2) 中国国际金融股份有限公司

网址：www.cicc.com

电话：010- 65051166

(3) 上海基煜基金销售有限公司

网址：www.jiyufund.com.cn

电话：400-820-5369

(4) 北京蛋卷基金销售有限公司

网址: danjuanapp.com

电话: 400-061-8518

(5) 上海天天基金销售有限公司

网址: www.1234567.com.cn

电话: 95021

(6) 通华财富(上海)基金销售有限公司

客服电话: 95156

网址: <https://www.tonghuafund.com>

(7) 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

(8) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

客服热线: 400-819-9868

网站: www.tdyhfund.com

(9) 中国中投证券有限责任公司

客服电话: 400-600-8008、95532

网址: <http://www.china-invs.cn>

(10) 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>

(11) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

客服电话: 4000-766-123

网站: www.fund123.cn

(12) 北京植信基金销售有限公司

客服电话: 010-56075718

网址: www.zhixin-inv.com

(13) 南京苏宁基金销售有限公司

网址: www.snjijin.com

电话: 95177

(14) 济安财富(北京)基金销售有限公司

客服电话: 400-673-7010

网址: <http://www.jianfortune.com>

(15) 浙江同花顺基金销售有限公司

网址: www.5ifund.com

电话: 4008-773-772

(16) 中信证券股份有限公司

客服电话: 95548

网址: www.citics.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: 北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层

法定代表人: 楚钢

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：张君一，丁时杰
联系人：程海良

四、基金的名称

中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

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，在严格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、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、次级债、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、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0-95%；在每个交易日日终，在扣除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；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资策略

本基金的量化选股模型在注重基本面研究的同时，结合多种统计量化策略，主要包括多因子模型和统计套利模型等多种量化策略。本基金在股票投资过程中将保持模型选股并构建股票投资组合的投资策略，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。

（1）量化选股策略

1) 多因子选股策略

本基金的多因子选股策略秉承价值投资和技术投资相结合的理念，不但将可能影响股价并且具有经济意义的基本面指标纳入因子汇总，包括盈利能力、价值、成长性、规模等基本面因子；同时也关注市场短期的波动指标，包括交易活动、持仓量、成交量、期现价差、不同期限的动量趋势，强弱指标、超买超卖、反转概率等技术因子。通过对因子的量化分析和综合评价，精选最能代表这些因子的个股构建多头组合。

2) 统计套利模型

本基金通过对股票大量数据的回溯研究，用量化统计分析工具找出市场内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。由于市场进入这些极端区域后价格关系不能长久维持，可以借由计算机快速捕捉市场进入这些极端区域的机会，挑选历史上大概率跑赢市场的股票进行组合，试图以较高的成功概率进场套利。统计套利是将套利建立在对历史数据进行统计分析的基础之上，估计相关变量的概率分布，并结合基本面数据进行分析用以指导套利交易。相比于无风险套利，统计套利增加风险，但可获得的套利机会将多于无风险套利。

3) 事件驱动套利

本基金通过挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的事件以及对过往事件的数据检测，获取事件影响所带来的超额投资回报。事件驱动模型的“事件”是指具有较为明确的时间和内容，能够对部分投资者的投资行为产生一定的影响，从而决定股价短期波动的因素。

4) 投资组合优化

本基金将根据量化风险模型对投资组合进行优化，调整个股权重，在控制风险的前提下追求收益最大化。

(2) 其他策略

1) 债券投资策略

在债券投资方面，本基金将深入研究国民经济运行状况、货币市场及资本市场资金供求关系，采取利率策略、信用策略、相对价值策略以及正逆回购进行杠杆操作等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

2) 股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的量化研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，并与现货资产进行匹配，在法律法规允许的范围内，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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。

3) 权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。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，结合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。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*80% + 中证全债指数收益率*20%。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映A股市场总体价格走势；中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。基于本基金资产配置比例以及沪深300指数和中证全债指数的特征，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

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型证券投资基金，高于债券型证券投资基金和货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

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。

以下内容摘自中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金2019年第3季度报告。

5.1 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	155,222,578.62	88.28
	其中：股票	155,222,578.62	88.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,201,120.00	5.80
	其中：债券	10,201,120.00	5.80
	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	2,000,000.00	1.14
	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	6,314,894.40	3.59
8	其他资产	2,096,843.18	1.19
9	合计	175,835,436.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	3,219,491.90	1.84
B	采矿业	4,940,018.43	2.83
C	制造业	89,714,441.56	51.34
D	电力、热力、燃气及水生 产和供应业	8,625,241.57	4.94
E	建筑业	2,800,472.78	1.60
F	批发和零售业	12,334,469.25	7.06
G	交通运输、仓储和邮政业	3,926,248.61	2.25
H	住宿和餐饮业	512,626.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技 术服务业	9,177,992.21	5.25
J	金融业	777,051.75	0.44
K	房地产业	11,642,252.60	6.66
L	租赁和商务服务业	1,836,063.00	1.05

M	科学研究和技术服务业	1,975,868.00	1.13
N	水利、环境和公共设施管 理业	671,608.50	0.38
O	居民服务、修理和其他服 务业	-	-
P	教育	37,421.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,443,165.46	1.40
S	综合	588,146.00	0.34
	合计	155,222,578.62	88.82

5.2.2 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港股通股票资产。

5.3 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	600449	宁夏建材	175,200	1,533,000.00	0.88
2	600510	黑牡丹	243,900	1,514,619.00	0.87
3	600376	首开股份	179,200	1,455,104.00	0.83
4	600533	栖霞建设	442,500	1,451,400.00	0.83
5	002133	广宇集团	377,700	1,235,079.00	0.71
6	000153	丰原药业	196,800	1,202,448.00	0.69
7	600697	欧亚集团	67,332	1,176,963.36	0.67

8	601677	明泰铝业	109,100	1,164,097.00	0.67
9	000601	韶能股份	193,900	1,149,827.00	0.66
10	600668	尖峰集团	80,000	1,132,000.00	0.65

5.4 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	10,201,120.00	5.84
	其中：政策性金融债	10,201,120.00	5.84
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	10,201,120.00	5.84

5.5 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	190201	19国开01	100,000	10,001,000.00	5.72

2	108901	农发 1801	2,000	200,120.00	0.11
---	--------	---------	-------	------------	------

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1912	中证 500 期货 1912 合约	9	8,737,920.00	-356,280.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-356,280.00
股指期货投资本期收益(元)					774,360.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-314,760.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金通过做多股指期货增加部分杠杆,在保证基金权益仓位满足基金策略需求的前提下,释放出部分资金进行新股申购等操作,力争为投资者获取更多的收益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末，本基金无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末，本基金无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末，本基金无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,103,769.85
2	应收证券清算款	799,454.28
3	应收股利	-
4	应收利息	191,622.05
5	应收申购款	1,997.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,096,843.18

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

本基金基金合同生效日为2016年11月10日，基金业绩数据截至2019年9月30日。

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

阶段	净值收 益率①	净值收 益率 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
2016年11月10日（基金合同生效日）至2016年12月31日	-0.50%	0.38%	-1.46%	0.62%	0.96%	-0.24%
2017年1月1日至2017年12月31日	4.22%	0.59%	17.08%	0.51%	-12.86%	0.08%
2018年1月1日至2018年12月31日	-21.22%	1.16%	-19.17%	1.07%	-2.05%	0.09%

2019年1月1日至 2019年9月30日	31.95%	1.42%	22.05%	1.10%	9.90%	0.32%
基金合同生效日起 至2019年9月30 日	7.80%	1.06%	13.82%	0.90%	-6.02%	0.16%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

十三、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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。

上述“一、基金费用的种类中第3-9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。

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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对2019年12月4日公布的本基金更新招募说明书进行了更新，本基金本次更新招募说明书对基金合同修订、基金托管协议修订进行更新，相关信息更新截止日为2020年1月18日。除非另有说明，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2019年11月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年09月30日（财务数据未经审计）。

中金基金管理有限公司

2020年1月21日