中金金序量化蓝筹混合型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
二〇一八年九月

重要提示

中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金(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]936号《关于准予中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金注册的批复》注册,并于2018年2月6日经中国证监会证券基金机构监管部机构部函[2018]314号《关于中金金序量化蓝筹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2018年2月6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。

中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金(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、其他风险等。

本基金主要投资于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、债券、货币市场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(但须符合中国证监会的相关规定),在政策市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下,如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能遇见的特殊情形下,可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击,发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

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。

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。

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8月5日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6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:3亿元人民币
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投资管理委员会主席、董事总经理。

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。

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、副教务长。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,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

魏李宇先生,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研究员、高级量化研究员。现任中金基金管理有限公司量化公募投资部副总经理。

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。现任中金基金管理有限公司董事总经理、权益投研负责人、专户投资部投资经理。

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部执行总经理。

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;华夏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。

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执行总经理,量化投资总监;现任中金基金管理有限公司量化投资部执行总经理。

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。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(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)。

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
2、其他销售机构
(1)包商银行股份有限公司
客服电话: 95352
网站: www.bsb.com.cn
(2)上海挖财金融信息服务有限公司
客服电话: 021-50810673
网站: http://www.wacai.com/
(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:王诗屿
电话:021-20613999
传真:021-68596919
客服电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com
(5)北京汇成基金销售有限公司
客服电话:010-56282140
网址:www.fundzone.cn
(6)北京虹点基金销售有限公司
客服电话:400-068-1176
网站:www.jimufund.com
(7)上海陆金所资产管理有限公司
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14楼
法定代表人:郭坚
客户服务电话:021-20665952
网址:https://www.lu.com/
联系人:宁博宇
(8)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
(9)北京蛋卷基金销售有限公司
客服电话: 400-061-8518
网站: https://danjuanapp.com/
(10)中国银河证券股份有限公司
客服电话:95551
网站:http://www.chinastock.com.cn
(11)平安证券有限责任公司
客服电话:95511-8
网站:http://stock.pingan.com
(12)中国国际金融股份有限公司
住所:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:丁学东
客户服务电话:010-65051166
网址:www.cicc.com.cn
联系人:杨涵宇
(13)中国中投证券有限责任公司
客服电话:95532
网址:http://www.china-invs.cn
(14)太平洋证券股份有限公司
客服电话: 400-665-0999
网站: www.tpyzq.com
(15)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
(16)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栋202室
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人:陈柏青
联系人:韩爱彬
客服电话:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn
(17)北京植信基金销售有限公司
客服电话:010-56075718
网址:www.zhixin-inv.com
(18)南京苏宁基金销售有限公司
客服电话:95177
网址:www.snjijin.com
(19)浙江同花顺基金销售有限公司
客服电话:4008-773-772
网址:www.5ifund.com
(20)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

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的销售机构销售本基金,并及时公告。

(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

中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金。

五、基金的类型及运作方式

(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;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

本基金采用数量化技术对投资策略进行优化,将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数体现在数量模型中,通过数量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制,充分发挥数量化投资的优势。一方面,在偏好大盘蓝筹的基础上,构建最小化市场波动性的投资组合;另一方面,通过量化选股等策略追求超越业绩比较基准的投资收益。

第一,本基金通过控制组合波动率和组合仓位等手段进行风险控制,在承担一定市场风险的情况下,根据股票之间的相关性和和股票的历史表现,运用量化手段对股票组合的波动性进行一个合理估计,根据设定的风险程度来决定股票组合的风险预算,并在此基础上追求股票的收益。第二,本基金通过数量化技术,综合考虑股票的总市值、流通市值、公司治理、过往分红以及平均每日市场交易量等因素,选择有代表性的蓝筹股票标的作为本基金的股票池。具体来说,首先计算每一只标的股票的价值特征(市净率、市盈率、市销率、市现率以及分红率)和成长特征(长期一致预期净利润增长率、短期一致预期净利润增长率以及营业收入一致预期增长率),按照价值和成长特性讲市场分成4个象限,蓝筹股票的股票池确定在第I象限和第II象限,每半年调整一次。第三,本基金利用数量化技术精细划分蓝筹股票的行业,在宽窄幅度不同的行业上,通过采用精选量化因子等方式进行组合配置,力争超额收益。

(一)资产配置策略

本基金将通过量化建模的方式综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素,对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行深入分析,确定当前市场环境下的主要投资方向和资产配置比例。同时,量化模型通过持续跟踪宏观经济变量、风险预警指标等,判断不同资产类别在当前市场环境下的风险收益状态,根据市场环境变化时,动态调整投资组合结构、各类资产配置比例。

(二)量化选股策略

本基金选股策略以量化多因子模型选股为主,充分借助基金管理人大数据量化平台的研究成果,有效整合了传统多因子研究的模型和大数据分析,根据融合模型对有代表性的大盘蓝筹股票进行投资。本基金采用的选股策略包括多因子选股策略、风格轮动策略、行业轮动策略、动量反转量化选股策略、趋势追踪量化选股策略等。

1、多因子选股策略

本基金管理人以基本面选股策略和技术投资相结合为理念,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,考虑包括规模、盈利能力、价值等蓝筹股票相对有效的因子,辅以成长性等基本面因子,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,利用数量化技术,筛选出有效的成分因子,结合大数据分析构建多因子选股模型。具体来说,在蓝筹股的因子中,结合市场特点,周期股的权重比较大,估值因子是比较有效的选股因子。

2、风格轮动策略

风格轮动模型是利用市场的风格特征进行投资,若是风格转换的初期介入,则可以获得一定的超额收益。本基金通过数量化技术综合分析市场的风格特征,持续跟踪市场的风格转换,构建有效的风格转换信号,建立了风格轮动模型,以此动态调整组合配置。

3、行业轮动策略

由于经济周期的原因,总有一些行业先启动,一些行业跟随。在经济周期过程中,依次对这些轮动的行业进行配置,相对买入持有策略会有更好的效果。本基金通过量化模型对行业表现进行综合分析和持续跟踪,构建了行业轮动信号,在经济周期过程中,根据市场环境变化,动态调整组合行业配置。

4、动量反转量化选股策略

动量反转模型是指股票的强弱变化情况,过去一段时间强的股票在未来一段时间继续保持强势,过去一段时间弱的股票在未来一段时间继续弱势,称为动量效应。过去一段时间强的股票在未来一段时间会走弱,过去一段时间弱势的股票在未来一段时间会走强,称为反转效应。若本基金判定动量效应会持续,则应该买入强势股;若判断会出现反转效应,则应该买入弱势股。

5、趋势追踪量化选股策略

趋势追踪属于图形交易的一种,当股价出现上涨趋势的时候,则买入;当出现下跌趋势的时候,则卖出。本基金判断趋势的指标有很多种,包括均线策略、MACD、BIAS等,其中以均线策略最简单、最有效。

6、投资组合优化

本基金会根据量化风险模型对投资组合进行优化,通过特有的以量化投资为核心的多重优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。在构建投资组合时综合考虑收益因素及风险因素,并通过投资组合优化器构建并动态优化投资组合,在控制风险的前提下追求收益的优最大化。

(三)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定量化研究,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、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。

4、可转换债券投资策略

在分析宏观经济运行特征并对各类市场大势做出判断的前提下,本基金对可转债所对应的基础股票进行分析和研究,从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估,对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注,对可转债投资价值进行有效的评估,选择投资价值较高的个券进行投资。

5、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。

6、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。

7、中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债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。

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*75%+中债综合指数收益率*25%。

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沪深300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、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2018年6月30日,报告期间为2018年4月1日至2018年6月30日。本报告财务数据未经审计。

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	82,200,044.48	73.31
	其中:股票	82,200,044.48	73.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,444,050.00	15.56
	其中:债券	17,444,050.00	15.56
	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	9,000,000.00	8.03
	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	3,008,300.30	2.68
8	其他资产	480,866.85	0.43
9	合计	112,133,261.63	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

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	168,489.00	0.15
B	采矿业	2,194,403.25	1.98
C	制造业	37,257,278.83	33.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,989,767.94	2.69
E	建筑业	4,614,197.11	4.15
F	批发和零售业	3,720,166.75	3.35
G	交通运输、仓储和邮政业	2,726,050.00	2.45
H	住宿和餐饮业	4,570.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,750,767.05	2.48
J	金融业	15,831,502.37	14.26
K	房地产业	6,119,972.50	5.51
L	租赁和商务服务业	995,581.18	0.90
M	科学研究和技术服务业	34,555.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	617,148.60	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	51,188.20	0.05
R	文化、体育和娱乐业	2,024,050.70	1.82
S	综合	100,356.00	0.09
	合计	82,200,044.48	74.02

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。

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	601318	中国平安	43,300	2,536,514.00	2.28
2	600519	贵州茅台	3,110	2,274,840.60	2.05
3	600016	民生银行	211,910	1,483,370.00	1.34
4	600015	华夏银行	137,250	1,022,512.50	0.92
5	002304	洋河股份	7,650	1,006,740.00	0.91
6	601006	大秦铁路	120,250	987,252.50	0.89
7	000425	徐工机械	232,700	986,648.00	0.89
8	600887	伊利股份	34,860	972,594.00	0.88
9	000157	中联重科	235,100	966,261.00	0.87
10	600369	西南证券	230,700	888,195.00	0.80

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	6,000,600.00	5.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	11,443,450.00	10.30
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	17,444,050.00	15.71

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	019571	17国债17	60,000	6,000,600.00	5.40
2	112328	16曲文01	50,000	4,965,500.00	4.47
3	112041	11冀东01	35,000	3,505,950.00	3.16
4	136247	16华综01	20,000	1,974,400.00	1.78
5	122486	15旭辉01	10,000	997,600.00	0.90

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

本报告期末,本基金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

本报告期末,本基金未持有贵金属。

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

本报告期末,本基金未持有权证。

9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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。

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。

10.投资组合报告附注

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。

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。

10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	34,821.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	444,445.90
5	应收申购款	1,599.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	480,866.85

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。

10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末,本基金未持有股票。

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:

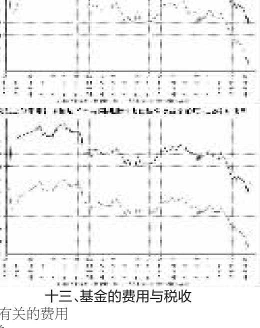
中金蓝筹A

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
2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日	-7.06%	0.78%	-12.86%	0.92%	5.80%	-0.14%

中金蓝筹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
2018年2月6日(基金合同生效日)至2018年6月30日	-2.84%	0.93%	-12.86%	0.92%	10.02%	0.01%

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



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×1.00%÷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×0.25%÷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×0.40%÷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11月30日刊登的《中金金序量化蓝筹混合型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概况及主要人员情况进行了更新;
3、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;
4、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;
5、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;
6、在“第八部分 基金份额的申购与赎回”中,对申购、赎回开始日及业务办理时间部分进行了更新;
7、在“第九部分 基金的投资”中,增加了“基金投资组合报告”内容,数据内容截止时间为2018年6月30日,财务数据未经审计;
8、增加了“第十部分 基金的业绩”,相关数据内容截止时间为2018年6月30日;
9、在“第十七部分 风险揭示”中,更新了相关内容;
10、在“第二十部分 托管协议的内容摘要”中,更新了相关内容;
11、在“第二十二部分 其他应披露事项”中,披露了报告期内基金管理人在指定媒介上披露的与本基金相关的所有公告。

中金基金管理有限公司
2018年9月19日

中金基金管理有限公司
关于以通讯方式召开中金金序量化成长混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、召开会议基本情况

中金基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依据中国证监会证监许可【2017】1007号文注册募集的中金金序量化成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2018年2月8日成立。

根据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规以及《中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,基金管理人经与本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会。会议的具体安排如下:

1、会议召开方式:通讯方式。

2、会议投票表决起止时间:自2018年9月24日起,至2018年10月25日17:00止(投票表决时间以公证机构收到表决票时间为准)。

3、会议表决票的寄达地点:
公证机构:北京市方正公证处
办公地址:北京市西城区西环广场塔3办公楼12层1217室
邮政编码:100044
联系人:彭祎
联系电话:010-58073517

请在信封表面注明“中金金序量化成长混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

二、会议审议事项

《关于终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》(见附件一)。

上述议案的内容说明请参见《关于终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》(见附件四)。

三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2018年9月21日,即在2018年9月21日交易时间结束后,在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登陆本基金管理人网站(http://www.ciccfund.com)下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容,其中:

(1)个人投资者自行投票的,需在表决票上签字,并提供本人身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件;

(2)机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务章或基金管理人认可的其他印章(以下合称“公章”),并提供加盖公章的营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);合格境外机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章),并提供该授权代表的身份证件(包括使用的身份证或者护照或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(3)个人投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供个人投资者身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明文件)正反面复印件,以及填妥的授权委托书原件(参照附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(4)机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供持有人的加盖公章的营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等),以及填妥的授权委托书原件(参照附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。合格境外机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件,以及填妥的授权委托书原件(参照附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

(5)以上(1)、(2)、(3)、(4)项及本公告全文中的有效身份证明文件、公章、业务章、批文、开户证明及登记证书等文件,以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件在自2018年9月24日起,至2018年10月25日17:00止的期间内通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达至本次大会公证机构,并请在信封表面注明:“中金金序量化成长混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

送达时间以公证机构收到表决票时间为准,即:专人送达的以实际递交时间为准;快递送达的,以公证机构签收时间为准;以邮寄挂号信方式送达的,以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

本次大会公证机构的办公地址及联系方式如下:
办公地址:北京市西城区西环广场塔3办公楼12层1217室
邮政编码:100044
联系人:彭祎
联系电话:010-58073517

五、会议召开的条件和表决票数要求

1、本次会议召开的条件为:本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。

2、本次会议表决的票数要求为:基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权,不足一份的基金份额不具有表决权。本次议案按特别决议处理,《关于终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》须经前述参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效。

3、本次基金份额持有人大会决议,本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案,基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

法律法规另有规定的,从其规定。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为:由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(中国建设银行股份有限公司)授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日期(即2018年10月25日)后两个工作日内进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下:

(1)表决票填写完整清晰,所提供文件符合本公告规定,且在规定时间之内送达公证机构的,为有效表决票;有效表决票按表决意见计入相应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2)如表决票上的表决意见未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认、意愿无法判断或相互矛盾,但其他各项符合本公告规定的,视为弃权表决,计入有效表决票;并按“弃权”计入对应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3)如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在规定时间之内送达公证机构的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4)基金份额持有人重复提交表决票的,如各表决票表决意见相同,则视为同一表决票;如各表决票表决意见不相同,则按如下原则处理:

①送达时间不是同一天的,以最后送达日所填写的有效的表决票为准,先送达的表决票视为被撤回;

②送达时间为同一天的,视为在同一表决票上做出了不同表决意见,计入弃权表决票;

③送达时间确定原则见“四、表决票的填写和寄交方式”中相关说明。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规以及《中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同》的规定,本次持有人大会需要有效表决票所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开,根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定及《中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同》的约定,本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时,除非授权文件另有载明,本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效,但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见届时发布的召集基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构
1、召集人:中金基金管理有限公司
客服电话:400-868-1166
官方网址:www.ciccfund.com
2、基金托管人:中国建设银行股份有限公司
3、公证机构:北京市方正公证处
4、见证律师事务所:上海市通力律师事务所

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站查阅,投资者如有任何疑问,可致电基金管理人客服电话400-868-1166(免长途话费)咨询。

3、基金管理人将在发布本公告后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告,就持有人大会相关情况做必要说明,请予以留意。

4、本公告的有关内容由中金基金管理有限公司负责解释。

附件一:《关于终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》

附件二:《中金金序量化成长混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三:《授权委托书》

附件四:《关于终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》

中金基金管理有限公司
2018年9月19日

附件一: 关于终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案

中金金序量化成长混合型证券投资基金基金份额持有人:

根据市场环境变化,为更好地维护基金份额持有人利益,根据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规以及《中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同》的规定,中金金序量化成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人中金基金管理有限公司经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,提议终止《中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同》,具体内容详见附件四《关于终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》。

为实施终止本基金基金合同的方案,提议授权基金管理人办理本次终止基金合同的有关具体事宜,包括但不限于根据市场情况确定清算程序及基金合同终止的具体时间,并根据《关于终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》的相关内容对本基金实施清算并终止基金合同。

以上议案,请予审议。

中金基金管理有限公司
2018年9月19日

附件二: 中金金序量化成长混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称:			
证件号码(身份证件号/营业执照号)		基金账户号	
审议事项	同意	反对	弃权
关于终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案			
基金份额持有人/代理人签字或盖章 日期:2018年 月 日			

说明:

1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。基金份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所填基金账户号的全部基金份额(以权益登记日所登记的基金份额为准)的表决意见。

2、如表决票上的表决意见未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认、意愿无法判断或相互矛盾,但其他各项符合本公告规定的,视为弃权表决,计入有效表决票;并按“弃权”计入对应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

3、如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在规定时间之内送达公证机构的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

4、本表决票中“基金账户号”,指持有中金金序量化成长混合型证券投资基金的基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的,应当填写基金账户号,其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。

(本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站(www.ciccfund.com)下载并打印,在填写完整并签字盖章后均为有效。)

附件三:

授权委托书

兹委托 ______________________ 代表本人(或本机构)参加投票截止日期为2018年10月25日的以通讯方式召开的中金金序量化成长混合型证券投资基金基金份额持有人大会,并代为全权行使对议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若中金金序量化成长混合型证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的,本授权继续有效。

委托人(签字/盖章):______________________
委托人身份证号或营业执照号:______________________
委托人基金账户号:______________________
代理人(签字/盖章):______________________
代理人身份证号或营业执照号:______________________

委托日期:2018年 月 日

说明:

1、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

2、本授权委托书中“基金账户号”,指基金份额持有人持有本基金的基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的,应当填写基金账户号,其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。

3、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四: 《关于终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》

一、声明

1、中金金序量化成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同于2018年2月8日生效。为更好地满足投资者需求,维护基金份额持有人利益,根据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规以及《中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金管理人(中金基金管理有限公司)经与基金托管人(中国建设银行股份有限公司)协商一致,决定召开基金份额持有人大会,审议《关于终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

2、本次修改合同事项需经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过,存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会决议,本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案,基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

二、方案要点

1、本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。基金管理人将自决议生效之日起2个工作日内在指定媒介公告。

2、自基金份额持有人大会决议生效公告之日起,本基金即进入清算程序,基金管理人不再接受投资人的申购、赎回申请。本基金进入清算程序后,停止收取基金管理费、基金托管费。

基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项,并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

3、基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。

基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序
(1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金财产;
(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;
(3)对基金财产进行估值和变现;
(4)制作清算报告;
(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
(6)将清算报告报中国证监会备案并公告;
(7)对基金剩余财产进行分配。

5、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的规定,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

6、基金剩余财产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

7、基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告之日,《基金合同》终止。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

(一)中金金序量化成长混合型证券投资基金的历史沿革

本基金基金管理人为中金基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金于2017年11月21日当日公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同》于2018年2月8日生效。

(二)终止基金合同的可行性

1、不存在法律障碍

《基金法》第四十七条规定,“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成,行使下列职权:……(二)决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同;……”。

《基金法》第八十六条规定,“……基金份额持有人大会就审议事项作出决定,应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的二分之一以上通过;但是,转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并,应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报国务院证券监督管理机构备案,并予以公告。”

《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条规定,“……基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。……”

因此,终止基金合同不存在法律方面的障碍。

2、不存在技术障碍

本基金将根据《基金合同》中有关基金财产清算的规定,成立基金财产清算小组。基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。本基金的管理人、托管人已就财产清算的有关事项进行了充分准备,技术可行。清算报告将由会计师事务所进行外部审计,律师事务所出具法律意见书,报中国证监会备案并公告。

四、修改基金合同的主要风险及预备措施

(一)议案被基金份额持有人大会否决的风险

在提议终止基金合同并设计具体方案之前,基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访,认真听取了基金份额持有人意见,拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。如有必要,基金管理人将根据基金份额持有人意见,对终止基金合同的方案进行适当的修订,并重新公告。基金管理人可在必要情况下,推迟基金份额持有人大会的召开时间。

(二)基金合同修改前后的运作风险

自本次持有人大会决议生效公告之日起,本基金进入清算程序,基金管理人不再接受持有人提出的份额赎回申请。敬请持有人关注本基金清算期间的流动性风险。

在本次持有人大会决议生效前,如出现全部基金份额均被赎回的情形,本基金仍将在持有人大会决议生效公告之日起进入基金财产清算程序。

五、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议,请通过以下方式联系基金管理人:
中金基金管理有限公司
客服电话:400-868-1166
电子邮件:services@ciccfund.com
网址:www.ciccfund.com