(上接 D79 版)

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龙园 3 号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 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
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 基金的名称

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

本基金以数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,并根据市场发展与变化不断对其完善,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。然后对不同类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 × 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(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 × 0.20% ÷ 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 × 0.60% ÷ 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