

国金量化添利定期开放债券型发起式证券  
投资基金  
2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 23 日

## § 1 重要提示

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2019 年 10 月 22 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日至 2019 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国金量化添利
场内简称	-
交易代码	006189
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 日
报告期末基金份额总额	106,465,149.89 份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金在封闭期和开放期采取不同的投资策略。</p> <p>1、封闭期投资策略</p> <p>(1) 债券投资策略</p> <p>债券类资产投资主要用于提高非股票资产的收益率，基金管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。</p> <p>在债券投资方面，基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。</p> <p>1) 可转换债券投资策略</p> <p>本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证</p>

券的估值与价格变化的研究，采用买入低转换溢价率的债券并持有的投资策略，密切关注可转换债券市场与股票市场之间的互动关系，选择恰当的时机进行套利，获得超额收益。

#### 2) 资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### 3) 中小企业私募债策略

由于中小企业私募债券整体流动性相对较差，且整体信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。

#### (2) 股票投资策略

本基金股票部分以“量化投资”为主要投资策略，“阿尔法多因子选股模型”进行股票选择并据此构建股票投资组合。在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。

1) 本基金股票部分的构建主要采用阿尔法多因子选股模型。根据对中国证券市场运行特征的长期研究，利用长期积累并最新扩展的大量因子信息，引入先进的因子筛选技术，动态捕捉市场热点，快速适应新的市场环境，对全市场股票进行筛选，增大组合的超市场收益。本基金在股票投资过程中，强调投资纪律，降低随意性投资带来的风险，力争实现基金资产长期稳定增值。

#### 2) 统计套利策略

本基金通过对大量股票数据的回溯研究，用量化统计分析工具找出市场内部个股之间的稳定性关系，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，尝试以较高的成功概率进行套利。

#### 3) 事件驱动套利策略

本基金通过挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的时间以及对过往事件的数据检测，获取时间影响所带来的超额投资回报。

#### 4) 投资组合优化

本基金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。

#### 5) 国债期货投资策略

	<p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将以套期保值为目的，按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>6) 权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略主要包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>
业绩比较基准	中债总全价指数收益率×80%+中证 500 指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

注：无

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年7月1日—2019年9月30日）
1. 本期已实现收益	1,053,320.27
2. 本期利润	1,782,080.31

3. 加权平均基金份额本期利润	0.0167
4. 期末基金资产净值	111,860,774.09
5. 期末基金份额净值	1.0507

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

2、所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。

## 3.2 基金净值表现

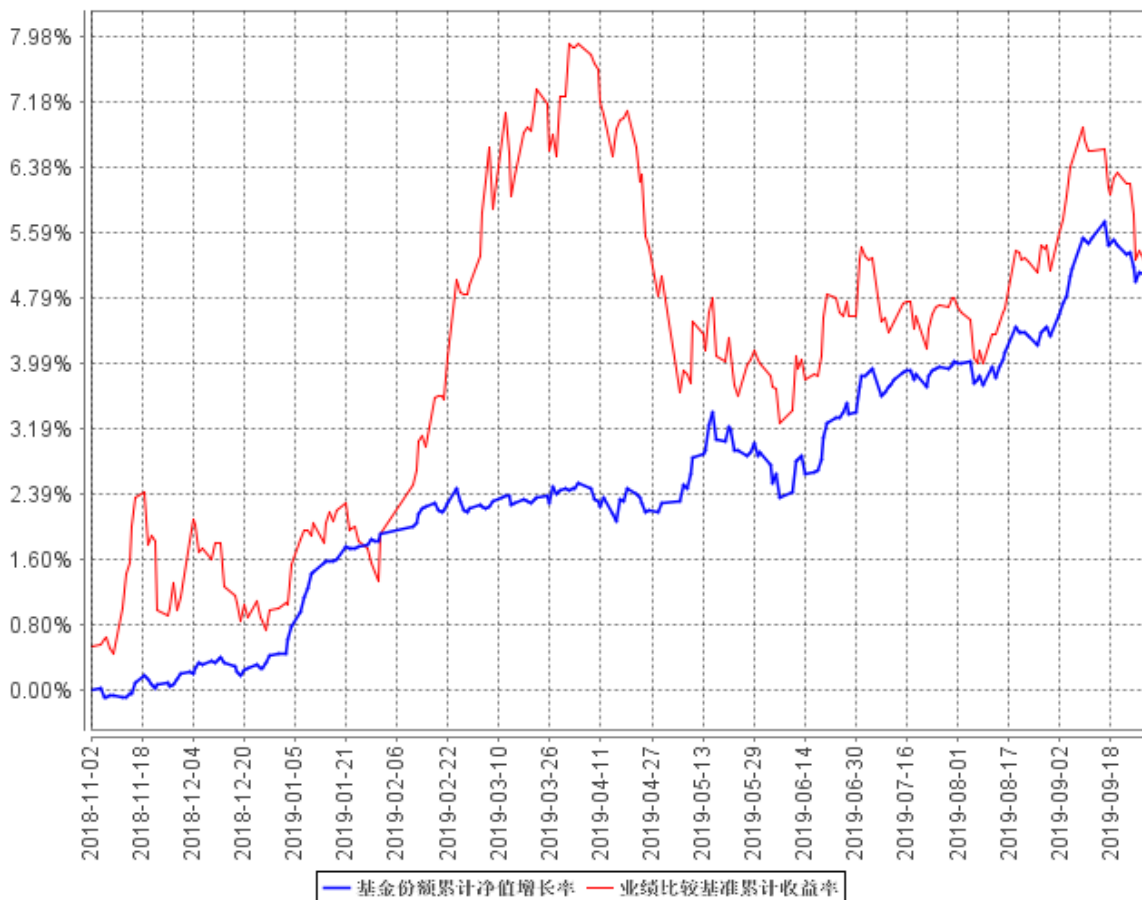
### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	1.62%	0.13%	0.53%	0.25%	1.09%	-0.12%

注：本基金的业绩比较基准为：中债总全价指数收益率×80%+中证 500 指数收益率×20%。

### 3.2.2 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

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



注：1、本基金基金合同生效日为 2018 年 11 月 2 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2018 年 11 月 2 日至 2019 年 5 月 1 日，建仓期结束时本产品各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.3 其他指标

注：无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尹海峰	本基金基金经理，研究部总经理	2019年2月12日	-	8	尹海峰先生，中央财经大学硕士。2011年7月至2016年6月历任中债资信评估有限责任公司信用评级部研究员，泰康资产管理有限责任公司信用评估部担任信用评估研究总监、信用评估研究高级经理。2016年6月6日加入国金基金管理有限公司，历任固定收益部信用研究主管；现任研究部总经理。
徐艳芳	本基金基金经理，国金及第七天理财、国金民丰回报、国金众赢货币、国金惠鑫短债基金经理，固定收益投资部总经理	2018年11月2日	-	11	徐艳芳女士，清华大学硕士。2005年10月至2012年6月历任皓天财经公关公司财经咨询师、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理。2012年6月加入国金基金管理有限公司，历任投资研究部基金经理；现任固定收益投资部总经理兼基金经理。
杨雨龙	本基金基金经理，国金量化多因子、国金鑫瑞灵活、国金量化多策略、国	2018年11月2日	-	10	杨雨龙先生，北京大学硕士。2007年7月至2009年9月在招商银行股份有限公司计划财务部任管理会计，2009年10月至2011年9月在博时基金管理有限公司交易

	金民丰 回报基金 经理，量 化投资 事业二 部总经 理				部任股票交易员，2011 年 10 月至 2014 年 7 月在兴业证券股份有限公司研究所任金融工程高级分析师，2014 年 7 月至 2017 年 6 月在摩根士丹利华鑫基金管理有限公司任量化投资部副总监、基金经理。2017 年 6 月加入国金基金管理有限公司，任量化投资事业二部总经理。
--	---	--	--	--	---

注：（1）任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》《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》《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。



### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度国内债券市场多空信号反复博弈，市场焦点主要在经济下行中的政策托底效果、通胀抬升压力以及对货币政策操作方向的判断，总体走势表现为震荡格局。本基金固收部分三季度继续坚持稳健操作，严格管控流动性风险和信用风险，择机开展利率债波段交易，增配高等级长久期高流动性个券，优选基本面较好、估值有性价比的转债品种，推动组合收益水平获得提升。

本基金股票部分目前保持中等仓位，具体来讲：在权益市场方面，三季度市场维持震荡，贸易战等不确定因素的影响基本已经在当前的点位有所体现，北上资金持续流入，因此总体来说大盘蓝筹股强于中小盘成长股。量化模型的选股效果未能充分体现。总体来说，组合在分散投资、量化精选的基础上，运用基于 A 股自身特点开发的量化多因子选股模型进行选股投资，着重量化的方法精选高成长性的公司。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金单位份额净值 1.0507 元，累计单位净值 1.0507 元。本报告期基金份额净值增长率 1.62%，同期业绩比较基准增长率 0.53%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 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	10,168,742.91	5.65
	其中：股票	10,168,742.91	5.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	162,501,581.90	90.32
	其中：债券	162,501,581.90	90.32
	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	1,601,792.24	0.89
8	其他资产	5,649,602.14	3.14
9	合计	179,921,719.19	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	200,124.16	0.18
B	采矿业	164,159.28	0.15
C	制造业	6,620,802.17	5.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	558,109.37	0.50
E	建筑业	335,363.54	0.30
F	批发和零售业	622,514.74	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	267,430.00	0.24
H	住宿和餐饮业	29,400.50	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	561,316.00	0.50
J	金融业	189,123.02	0.17
K	房地产业	347,847.04	0.31
L	租赁和商务服务业	89,953.72	0.08
M	科学研究和技术服务业	83,430.00	0.07
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	91,784.00	0.08
S	综合	7,385.37	0.01

合计	10,168,742.91	9.09
----	---------------	------

注：以上行业分类以 2019 年 9 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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	603730	岱美股份	5,190	131,877.90	0.12
2	002241	歌尔股份	7,300	128,334.00	0.11
3	600446	金证股份	5,800	121,220.00	0.11
4	002237	恒邦股份	9,200	120,980.00	0.11
5	603019	中科曙光	3,500	120,155.00	0.11
6	002182	云海金属	14,000	119,700.00	0.11
7	300033	同花顺	1,200	119,040.00	0.11
8	600570	恒生电子	1,600	118,288.00	0.11
9	000413	东旭光电	20,800	118,144.00	0.11
10	300710	万隆光电	4,300	117,777.00	0.11

### 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	5,009,000.00	4.48
	其中：政策性金融债	5,009,000.00	4.48
4	企业债券	90,982,086.90	81.34
5	企业短期融资券	5,321,200.00	4.76
6	中期票据	55,542,500.00	49.65
7	可转债（可交换债）	5,646,795.00	5.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	162,501,581.90	145.27

**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	143553	18 市政 02	100,000	10,784,000.00	9.64
2	152065	18 湘高速	100,000	10,222,000.00	9.14
3	101900134	19 首钢 MTN001	100,000	10,159,000.00	9.08
4	155037	18 电投 13	100,000	10,150,000.00	9.07
4	1280375	12 绍袍江 债	500,000	10,150,000.00	9.07
5	101900051	19 华润 MTN001	100,000	10,074,000.00	9.01

**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**

注：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**

注：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**

注：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国债期货交易情况说明****5.9.1 本期国债期货投资政策**

报告期内本基金未进行国债期货投资。

**5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末投资国债期货。

**5.9.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本期基金投资组合前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	24,918.05
2	应收证券清算款	1,399,855.26
3	应收股利	-
4	应收利息	4,224,828.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,649,602.14

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	127012	招路转债	858,080.00	0.77
2	113009	广汽转债	855,375.00	0.76
3	110053	苏银转债	759,080.00	0.68
4	113011	光大转债	567,600.00	0.51
5	110048	福能转债	465,400.00	0.42
6	113019	玲珑转债	364,110.00	0.33
7	113008	电气转债	344,100.00	0.31
8	113508	新风转债	333,472.00	0.30
9	113013	国君转债	293,625.00	0.26

10	110051	中天转债	266,550.00	0.24
11	113517	曙光转债	102,303.00	0.09

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	106,465,149.89
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	106,465,149.89

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	11,456,449.89
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,456,449.89
报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例（%）	10.76

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	11,456,449.89	10.76	10,000,600.00	9.39	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,456,449.89	10.76	10,000,600.00	9.39	3 年

注：本基金成立后有 11,456,449.89 份额为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 3 年。

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019 年 7 月 1 日至 2019 年 9 月 30 日	45,005,300.00	0.00	0.00	45,005,300.00	42.27%
	2	2019 年 7 月 1 日至 2019 年 9 月 30 日	40,003,800.00	0.00	0.00	40,003,800.00	37.57%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过 20%的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《证券时报》、指定互联网网站及基金管理人网站进行了如下信息披露：

- 1、2019 年 07 月 03 日《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》
- 2、2019 年 07 月 09 日《国金基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告》
- 3、2019 年 07 月 12 日《关于增加基煜基金、长量基金、蛋卷基金、国信嘉利、汇成基金、中信证券、中信证券（山东）、中信期货为国金基金旗下基金销售机构的公告》
- 4、2019 年 07 月 16 日《国金基金管理有限公司关于增加联储证券、招商证券为国金基金旗下基金销售机构的公告》
- 5、2019 年 07 月 18 日《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年第 2 季度报告》
- 6、2019 年 07 月 22 日《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》
- 7、2019 年 08 月 02 日《国金基金管理有限公司关于增加华瑞保险销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》
- 8、2019 年 08 月 20 日《关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》
- 9、2019 年 08 月 27 日《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告》
- 10、2019 年 08 月 27 日《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告摘要》
- 11、2019 年 08 月 28 日《国金基金管理有限公司关于增加汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告》
- 12、2019 年 08 月 29 日《关于增加珠海盈米基金销售有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》
- 13、2019 年 09 月 18 日《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》



本报告期内，基金管理人在基金开放期每个开放日公布基金份额净值和累计份额净值。2019 年 7 月 1 日至 2019 年 8 月 30 日，基金管理人在基金封闭期内至少每周公告 1 次基金的资产净值和份额净值；2019 年 9 月 1 日至 2019 年 9 月 30 日，基金管理人在基金封闭期内至少每周公告 1 次基金的份额净值和份额累计净值。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 10.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层。

### 10.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2019 年 10 月 23 日