

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（更新）摘要

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

重要提示

1、本基金经中国证监会 2018 年 6 月 25 日证监许可【2018】1033 号文注册募集。

2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金经中国证监会注册，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、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。

3、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。

4、投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：基金特定的投资品种相关的特定风险，因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响的市场风险，因基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，因投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金投资过程中产生的运作风险以及不可抗力风险等。其中，基金特定的投资品种相关的特定风险指投资中小企业私募债等非公开发行的债券品种，由于该类债券采取非公开发行和交易，不公开各类材料（包括招募说明书、审计报告等），信息披露不充分，外部评级机构一般不对这类债券进行评级，从而影响这类债券的市场流动性等。本基金的一般风险及特有风险详见本招募说明书的“风险揭示”部分。

5、基金不同于银行储蓄与债券，基金投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的《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。

6、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。

7、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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

8、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，基金运营状况导致的投资风险，由投资者自行承担。

9、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。

10、本基金建立量化模型的数据来源以广泛覆盖各类信息源的数据库为基础，包括宏观经济数据、行业经济数据、证券与期货交易行情数据、上市公司财务数据等。这些数据通常来源于不同的数据提供商，并且因为不同的需要，在数据加工过程中可能遵循不同的规范。基金管理人以加工后的数据作为建立模型的数据来源，因此，源数据错误或预处理过程中出现的错误可能直接影响量化模型的输出结果，形成数据风险。

基金的量化投资模型仅用于选股，而非用于进行高频交易。本基金采用量化模型选择投资标的后，基金经理通过交易平台（例如恒生 O32 系统）发送投资指令给交易部门，交易部门依据集中交易的原则发送委托指令给交易所，完成买入卖出操作。由于模型所选主要因子为具有经济意义且较为稳定的因素，对组合构建具有较为长期的指导意义，因此本基金组合一旦构建，调仓换仓的频率较低。

此外，由于本基金采用量化模型指导投资决策，因此定量方法的缺陷在一定程度上也会影响本基金的表现。一方面，面对不断变换的市场环境，量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中；另一方面，在定量模型的具体设定中，核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性；最后，定量模型存在对历史数据的依赖。因此，在实际运作过程中，市场环境的变化可能导致遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 5 月 2 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2019 年 3 月 31 日。

一、基金管理人

一、基金管理人概况

名称：国金基金管理有限公司

成立日期：2011 年 11 月 2 日

住所：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6

办公地址：北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

法定代表人：尹庆军

组织形式：有限责任公司

联系电话：010-88005888

注册资本：3.6 亿元人民币

股权结构：

国金基金管理有限公司股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，四家企业共同出资 3.6 亿元人民币，出资比例分别为 49%、19.5%、19.5%和 12%。

二、主要人员情况

1、董事会成员

纪路先生，董事长，硕士 EMBA。历任博时基金管理有限公司研究员、金信证券有限责任公司投资研究中心总经理、国金证券股份有限公司研究所总经理。现任国金证券股份有限公司副总经理，国金基金管理有限公司董事长，国金证券（香港）有限公司董事，国金财务（香港）有限公司董事，国金证券上海投资咨询分公司总经理，上海国金理益财富基金销售有限公司执行董事。

金鹏先生，董事，研究生学历。历任涌金期货经纪有限公司总经理助理，上海涌金理财顾问有限公司副总经理，河北财金投资有限公司总经理，涌金实业（集团）有限公司副总裁，国金证券有限责任公司风险控制中心总经理，国金证券股份有限公司董事、副总经理、监事、监事会主席，国金期货有限责任公司董事长。现任国金证券股份有限公司董事、总经理，国金创新投资有限公司董事长，国金期货有限责任公司董事，国金基金管理有限公司董事，国金证券（香港）有限公

司董事。

黄艳女士，董事，硕士，高级经济师。历任华夏银行苏州支行国际业务部职员，苏州工业园区国有资产经营公司投资银行部职员，苏州工业园区地产经营管理公司综合部副总经理、总经理，苏州工业园区地产经营管理公司总裁助理、副总裁。现任苏州工业园区经济发展有限公司副总裁，国金基金管理有限公司董事。

宁远喜先生，董事，硕士。历任三九集团工程有限公司办公室主任，深圳伯龙建筑工程有限公司总经理助理，广东宝丽华集团有限公司广告部经理，广东宝丽华实业股份有限公司董事会秘书。现任广东宝丽华新能源股份有限公司董事长，广东宝新资产管理有限公司执行董事，宝新融资租赁有限公司执行董事，广东信用宝征信管理有限公司执行董事，梅州客商银行股份有限公司董事长，百合佳缘网络集团股份有限公司副董事长，国金基金管理有限公司董事，深圳微金所金融信息服务有限公司董事，宝合金服投资管理股份有限公司董事。

赵煜先生，董事，学士。历任北京台都汽车安全设备有限公司销售经理，北京顶峰贸易公司销售经理，上海浦东中软科技发展有限公司副总经理。现任涌金实业（集团）有限公司董事长助理，国金基金管理有限公司董事。

尹庆军先生，董事，硕士。历任中央编译局世界所助理研究员、办公厅科研外事秘书，中央编译出版社出版部主任，博时基金管理有限公司人力资源部总经理、董事会秘书、监事，国金基金管理有限公司（筹）拟任督察长，国金基金管理有限公司督察长。现任国金基金管理有限公司董事、总经理，北京千石创富资本管理有限公司董事长。

张克东先生，独立董事，学士，注册会计师。历任煤炭工业部技术发展司、煤炭科学研究总院科员、主任科员，中国国际经济咨询公司、中信会计师事务所咨询员、项目经理，中信会计师事务所副主任，中天信会计师事务所副主任。现任信永中和会计师事务所副总经理、合伙人，国金基金管理有限公司独立董事。

鲍卉芳女士，独立董事，硕士。历任湖北省郧阳地区法律顾问处律师，最高人民检察院法纪厅书记员，北京市中银律师事务所律师，北京市博宇律师事务所律师，北京市大成律师事务所律师，北京市同维律师事务所律师。现任北京市康达律师事务所合伙人、律师，国金基金管理有限公司独立董事。

张勇先生，硕士，高级经济师。历任中国建设银行北京分行二处副处长，中

国建设银行北京信托公司总经理，中国信达资产管理股份有限公司托管清算部总经理，中国金谷国际信托有限责任公司董事长。现任国金基金管理有限公司独立董事。

2、监事会成员

刘泮先生，监事会主席，硕士。历任南方报业传媒集团资深记者，广东宝丽华新能源股份有限公司董事会秘书、董事。现任广东宝丽华新能源股份有限公司副董事长、总经理兼董事会秘书，国金基金管理有限公司监事会主席、股东代表监事。

许强先生，监事，硕士。历任苏州商品交易所交易部、交割部、信息部总经理，中国华通物产集团经易期货经纪有限公司副总裁，苏州工业园区国有资产经营公司投资银行部总经理，苏州工业园区地产经营管理公司投资部总经理。现任苏州工业园区资产管理有限公司董事长、国金基金管理有限公司股东代表监事。

聂武鹏先生，职工代表监事，硕士。历任天虹商场股份有限公司培训专员，TCL 集团股份有限公司招聘及培训经理，深圳迅雷网络技术有限公司高级招聘经理、国金基金管理有限公司（筹）综合管理部总经理助理兼人力资本经理，国金基金管理有限公司运营总监兼运营支持部总经理。现任国金基金管理有限公司总经理助理、运营总监兼运营支持部总经理、职工代表监事，北京千石创富资本管理有限公司监事会主席。

刘容女士，职工代表监事，硕士。历任北大方正物产集团农产品部期货研究员兼总办会助理，国金基金管理有限公司（筹）风险管理部风险分析师，国金基金管理有限公司风险管理部风险分析师兼董事会秘书、合规风控部总经理助理。现任国金基金管理有限公司合规风控部副总经理、职工代表监事，北京千石创富资本管理有限公司股东代表监事。

3、总经理及其他高级管理人员

纪路先生，董事长，硕士 EMBA。简历请见上文。

尹庆军先生，总经理，硕士。简历请见上文。

张丽女士，督察长，硕士，通过国家司法考试，国际注册内部审计师。历任科学出版社法律事务部内部法律顾问，国金基金管理有限公司（筹）监察稽核部法律顾问，国金基金管理有限公司监察稽核部法律顾问、监察稽核部副总经理兼

法律顾问、监察稽核部总经理。现任国金基金管理有限公司督察长。

索峰先生，副总经理，学士。历任重庆润庆期货服务有限公司业务部副总经理，重庆星河期货经纪公司业务部投资顾问，上海申银万国证券投资咨询人员，君安证券有限责任公司重庆民生路营业部交易部经理，中国银河证券有限责任公司重庆民族路营业部、重庆管理部研发部经理，银河基金管理有限公司基金经理、固定收益部总监、总经理助理，国金基金管理有限公司总经理助理、固定收益投资总监兼上海资管事业部总经理。现任国金基金管理有限公司副总经理兼固定收益投资总监、上海资管事业部总经理。

韩东霞女士，副总经理，硕士。历任《中外产品报》河北记者站财经记者，河北国际信托投资公司投资部项目经理，新华社中国经济信息社财经记者，联合证券有限责任公司投资银行部、资产管理部总经理助理，富兰克林坦伯顿基金集团坦伯顿国际股份（美国）北京代表处副代表，华宝基金管理有限公司北京分公司总经理、机构及海外销售部总经理、市场副总监、市场总监，北京天星资本股份有限公司副总经理、主管合伙人，平安银行电子信息与智能制造金融事业部投行业务部（北京）副总监，北京浩蓝雷音投资有限公司副总经理，国金基金管理有限公司市场总监。现任国金基金管理有限公司副总经理兼市场总监。

4、基金经理

徐艳芳女士，硕士，CFA。历任香港皓天财经公关公司咨询师、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理，国金基金管理有限公司投资研究部基金经理、固定收益投资部总经理兼基金经理。现任国金基金管理有限公司投资管理部总经理。截至本招募说明书更新公布之日，徐艳芳女士兼任国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第七天理财债券型证券投资基金、国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金的基金经理。

杨雨龙先生，硕士。历任招商银行股份有限公司计划财务部管理会计，博时基金管理有限公司交易部股票交易员，兴业证券股份有限公司研究所金融工程高级分析师，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司量化投资部副总监、基金经理。现任国金基金管理有限公司量化投资事业二部总经理。截至本招募说明书更新公布之日，杨雨龙先生兼任国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金、国

金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金的基金经理。

尹海峰先生，硕士。历任中债资信评估有限责任公司信用评级部任研究员，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，国金基金管理有限公司固定收益部信用研究主管。现任国金基金管理有限公司研究部总经理兼基金经理。

5、投资决策委员会成员名单

投资决策委员会成员包括公司总经理尹庆军先生，副总经理兼固定收益投资总监索峰先生，总经理助理兼联席固定收益投资总监于涛先生，交易总监兼基金交易部总经理詹毛毛先生，量化投资事业二部总经理杨雨龙先生，量化投资事业三部总经理宫雪女士，主动权益投资总监兼主动权益投资部总经理潘九岩先生，研究部总经理尹海峰先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。

2、办理本基金备案手续。

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资。

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益。

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

6、编制季度、半年度和年度基金报告。

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格。

8、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务。

9、按照规定召集基金份额持有人大会。

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

11、以基金管理人名义，代表本基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

12、中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资。
- （2）不公平地对待其管理的不同基金资产。
- （3）承销证券。
- （4）将基金财产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款。
- （5）从事承担无限责任的投资。
- （6）利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益。
- （7）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失。
- （8）侵占、挪用基金财产。
- （9）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动。

（10）玩忽职守，不按照规定履行职责。

（11）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- （1）越权或违规经营。
- （2）违反基金合同或托管协议。
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益。
- （4）在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露。
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管。
- （6）玩忽职守、滥用职权。
- （7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的

基金投资内容、基金投资计划等信息。

（8）除按基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资。

（9）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（10）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序。

（11）贬损同行，以提高自己。

（12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分。

（13）以不正当手段谋求业务发展。

（14）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象。

（15）其他法律、行政法规禁止的行为。

5、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规、规章和基金合同的规定，本着勤勉谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。

（2）不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益。

（3）不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动。

（4）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

五、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

（1）全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

（2）独立性原则：设立独立的合规风控部，合规风控部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。

（3）相互制约原则：各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对内部控制负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，合规风控部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

（2）督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；及时向董事会及/或董事会下设的相关专门委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告。

（3）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略。

（4）风险控制委员会：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控。

（5）合规风控部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标，并负责对投资事前及事中的风险监控，具体落实针对投研运作的相关法律法规、公司制度及日常的投研风控决策，设置相应的投研风控措施，并对各投资组合风险进行分析，对发现的异常及时向相关部门反馈，以作为调整投资决策的依据。

（6）业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门负责人对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

3、内部控制的措施

（1）建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

（3）建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：分别建立了公司营运风险和投资风险控制委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作和投资有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

（5）建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

（6）使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。

（7）提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

4、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

（2）基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

二、基金托管人

一、基金托管人概况

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

成立时间：1988 年 8 月 22 日

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

托管部门联系人：曾思琦

电话：021-52629999

传真：021-62159217

二、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 207.74 亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2017 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 6.42 万亿元，实现营业收入 1399.75 亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润 572.00 亿元。根据 2017 年英国《银行家》杂志“全球银行 1000 强”排名，兴业银行按一级资本排名第 28 位，按总资产排名第 30 位，跻身全球银行 30 强。按照美国《财富》杂志“世界 500 强”最新榜单，兴业银行以 426.216 亿美元总营收排名第 230 位。同时，过去一年在国内外权威机构组织的各项评比中，先后获得“亚洲卓越商业银行”“年度最佳股份制银行”“中国最受尊敬企业”等多项殊荣。

三、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合处、运行管理处、稽核

监察处、产品管理处、市场处、委托资产管理处、企业年金中心等处室，，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

四、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2018 年 12 月 31 日，兴业银行已托管证券投资基金 248 只，，托管基金的基金资产净值合计 8964.38 亿元，基金份额合计亿 8923.86 亿份。

五、基金托管人的内部风险控制制度说明

（一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

（三）内部风险控制原则

1、全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一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。

2、独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

3、相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

4、定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

5、防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作

部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

6、有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

7、审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设；

8、责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

六、内部控制制度及措施

（一）制度建设：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。

（二）建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

（三）风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

（四）相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

（五）人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

（六）应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

七、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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关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。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。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项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，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

三、相关服务机构

一、基金份额发售机构

（一）直销机构

国金基金管理有限公司直销中心

注册地址：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6

办公地址：北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

法定代表人：尹庆军

联系人：石迎春

联系电话：010-88005812

客服信箱：service@gfund.com

客服电话：4000-2000-18

传真：010-88005816

网站：<http://www.gfund.com>

（二）其他销售机构

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：国金基金管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6

办公地址：北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

法定代表人：尹庆军

联系人：刘雪

联系电话：010-88005921

传真：010-88005876

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

注册地址：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：黎明、陆奇

联系人：陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

法定代表人：毛鞍宁

经办注册会计师：徐艳、王海彦

联系人：张晖

联系电话：010-58152145

传真：010-85188298

四、基金的名称

本基金名称：国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：债券型证券投资基金。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券）、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、债券回购、国债期货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。

本基金投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每次开放期前十五个工作日、开放期及开放期结束后十五个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限。基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。

开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。在封闭期内本基金不受上述5%限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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

本基金在封闭期和开放期采取不同的投资策略

1、封闭期投资策略

（1）债券投资策略

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。

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。

1) 可转换债券投资策略

本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证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

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。

6) 权证投资策略

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。

2、开放期投资策略

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。

九、基金的业绩比较基准

中债总全价指数收益率 $\times$ 80%+中证500指数收益率 $\times$ 20%

中债总全价指数由中央国债登记结算公司编制并发布，在发布主体上保证中债总指数比较客观和专业，能够反映我国债券市场整体价格和投资回报情况。该指数具有广泛的市场代表性，能综合反映债券市场的总体走势。中证500指数有市场中流动性较好、代表性强的中小盘股票，综合反映了沪深市场中中小市值公司的情况，对沪深市场中小盘的整体走势具有较强的代表性和较高认可度。

如果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时，基金管理人经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后变更本基金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。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

本报告期为 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 3 月 31 日止。

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	-	-
3	固定收益投资	220,686,474.50	96.71
	其中：债券	212,686,474.50	93.20
	资产支持证券	8,000,000.00	3.51
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	2,690,396.72	1.18
8	其他资产	4,821,609.49	2.11
9	合计	228,198,480.71	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票投资。

（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。

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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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	30,757,000.00	20.01
	其中：政策性金融债	30,757,000.00	20.01
4	企业债券	150,941,494.00	98.20
5	企业短期融资券	15,367,640.00	10.00
6	中期票据	10,320,000.00	6.71

7	可转债（可交换债）	5,300,340.50	3.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	212,686,474.50	138.37

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	180211	18 国开 11	200,000	20,282,000.00	13.20
2	143553	18 市政 02	100,000	10,643,000.00	6.92
3	180204	18 国开 04	100,000	10,475,000.00	6.81
4	124456	13 闽投债	100,000	10,337,000.00	6.73
5	101458032	14 天津港 MTN002	100,000	10,320,000.00	6.71

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	156771	19 裕源 04	80,000	8,000,000.00	5.20

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。

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。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

注：报告期内本基金未进行国债期货投资。

（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。

（3）本期国债期货投资评价

注：报告期内，本基金未参与国债期货交易。

10、投资组合报告附注

(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

注：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。

(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

注：本基金本报告期末未开展股票投资。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	17,198.90
2	应收证券清算款	500,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	4,304,410.59
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,821,609.49

(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	128036	金农转债	576,350.00	0.38
2	110040	生益转债	362,070.00	0.24
3	128020	水晶转债	223,900.00	0.15
4	113017	吉视转债	222,220.00	0.14
5	128021	兄弟转债	178,545.00	0.12
6	110045	海澜转债	158,100.00	0.10
7	127004	模塑转债	145,110.00	0.09
8	113009	广汽转债	133,414.60	0.09
9	110038	济川转债	124,157.00	0.08
10	113019	玲珑转债	112,970.00	0.07
11	110034	九州转债	110,420.00	0.07
12	128017	金禾转债	107,440.00	0.07
13	123002	国祯转债	98,288.00	0.06
14	127007	湖广转债	84,175.00	0.05

15	113507	天马转债	68,450.00	0.04
16	127003	海印转债	66,930.00	0.04
17	123015	蓝盾转债	62,525.00	0.04
18	110042	航电转债	61,525.00	0.04
19	128024	宁行转债	61,415.00	0.04
20	128034	江银转债	58,110.00	0.04
21	128035	大族转债	54,975.00	0.04
22	113505	杭电转债	53,935.00	0.04
23	127006	敖东转债	53,995.00	0.04
24	113015	隆基转债	36,744.00	0.02
25	128028	赣锋转债	35,777.30	0.02

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

十二、基金的业绩

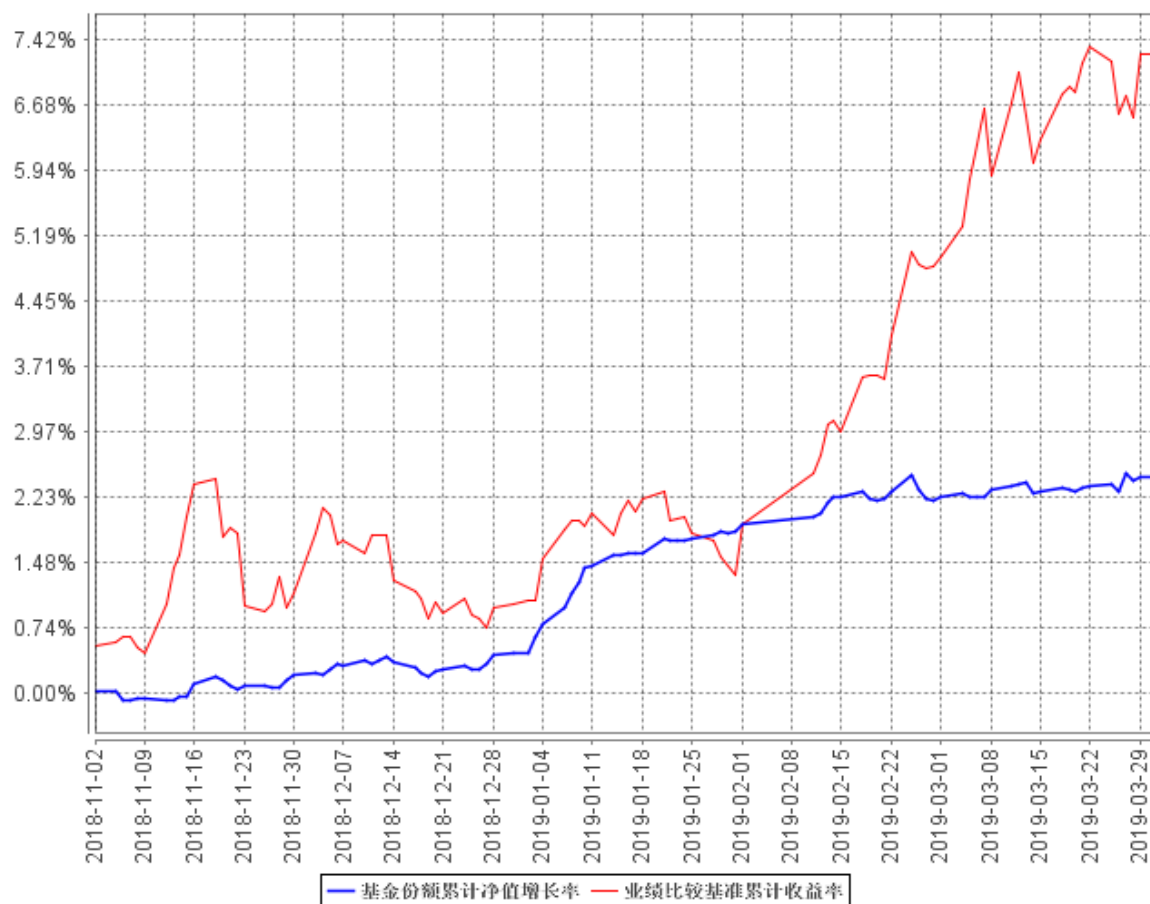
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

（一）本基金合同生效日为2018年11月2日，基金合同生效以来（截至2019年3月31日）的基金份额净值收益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
2018年11月2日（基金合同生效日）至2018年12月31日	0.45%	0.05%	1.02%	0.30%	-0.57%	-0.25%
2019年1月1日至2019年3月31日	2.00%	0.08%	6.18%	0.32%	-4.18%	-0.24%
2018年11月02日（基金合同生效日）至2019年3月31日	2.46%	0.07%	7.26%	0.31%	-4.80%	-0.24%

（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

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：本基金基金合同生效日为2018年11月2日，图示日期为2018年11月2日至2019年3月31日。

(三) 其他指标

注：无

十三、费用概览

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、诉讼费和仲裁费；
- 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、基金账户开户费用、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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）招募说明书（更新）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》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2018 年 10 月 11 日刊登的本基金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”中相关内容。
- （二）更新了“三、基金管理人”中相关内容。
- （三）更新了“四、基金托管人”中相关内容。
- （四）更新了“五、相关服务机构”中相关信息。
- （五）更新了“九、基金的投资”中相关内容。
- （六）更新了“十、基金的业绩”中相关内容。

（七）更新了“二十二、其他应披露事项”，披露了自上次招募说明书发布以来涉及本基金的相关公告。

国金基金管理有限公司

二〇一九年六月十六日