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

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
二〇一八年十月
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,由投资者自行负担。

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。

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险规定》”)等有关法律法规以及《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》编写。

本招募说明书阐述了国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解本基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金
2、基金管理人:指国金基金管理有限公司
3、基金托管人:指兴业银行股份有限公司
4、基金合同:指《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》及对基金合同的任何有效修订和补充
5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《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》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6、招募说明书、《招募说明书》或本招募说明书:指《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》及其定期的更新
7、基金份额发售公告:指《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告》
8、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
9、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,经2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施,并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改(中华人民共和国港口法)等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
10、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
11、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13、《流动性风险规定》:指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
14、中国证监会:指中国证券监督管理委员会
15、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
16、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
17、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
18、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
19、合格境外机构投资者:指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
20、投资人、投资者:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称。
21、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
22、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
23、销售机构:指国金基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议,办理基金销售业务的机构
24、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
25、登记机构:指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为国金基金管理有限公司或接受国金基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
26、基金账户:指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
27、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
28、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期
29、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,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的日期
30、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月
31、存续期:指基金合同生效日至终止日之间的不定期期限
32、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
33、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
34、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日),n=1,2,3,4,5……
35、开放日:指在开放期内,为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
36、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
37、《业务规则》:指《国金基金管理有限公司开放式基金业务规则》,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则,由基金管理人和投资人共同遵守
38、认购:指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
39、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
40、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额予以现金的行为
41、基金转换:指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为
42、转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作
43、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式
44、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一工作日基金总份额的20%
45、元:指人民币元
46、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
47、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和
48、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
49、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
50、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
51、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
52、摆动定价机制:指当本基金份额遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
53、发起式基金:指符合中国证监会有关规定,由基金管理人、基金管理人股东、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员承诺认购一定金额并持有一定期限的证券投资基金
54、发起资金:指基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或者基金经理(指基金管理人员工中依法具有基金经理资格者,包括但不限于本基金的基金经理,同时也可以包括基金经理之外的投研人员,下同)等人员参与认购的资金。发起资金认购本基金的金额不低于1000万元,且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年
55、发起资金提供方:指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员
56、封闭期:本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(包含基金合同生效日)或自每一开放期结束之日次日起(包含该日)6个月的期间。本基金的首个封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)至6个月的对日的前一日止,首个封闭期结束之后第一个工作日起进入首个开放期,下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起(包括首个开放期结束之日次日)至6个月的对日的前一日止,以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易
57、开放期:本基金每次开放期最长不超过10个工作日,最短不少于2个工作日,本基金的首个开放期的首日为基金合同生效日起6个月的对日(包含该日),后续开放期首日为前一个封闭期首日起6个月的对日(包含该日),如该对应日为非工作日或不存在对应日期的,则顺延至下一个工作日。开放期的具体起止时间以基金管理人届时公告为准,且基金管理人最迟应于开放期开始前2个工作日进行公告
58、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介
59、不可抗力:指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、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
联系人:张丽
联系电话:010-88005888
注册资本:2.8亿元人民币
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2.8亿元人民币,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
纪晓先生,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,河北财政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。
许强先生,董事,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。历任湖北省鄂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
刘洋先生,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。
张宝全先生,监事,硕士,会计师。历任哈尔滨翔鸿电子有限公司成本会计,哈尔滨八达科技有限公司主办会计,国巨电子(中国)有限公司内审专员,苏州工业园区财政局项目资金管理处副处长。现任苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司总裁助理,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
纪晓先生,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。

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,截至本招募说明书公布之日,徐艳芳女士兼任国金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数量化投资部副总监、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。截至本招募说明书公布之日,杨雨龙先生兼任国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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,基金交易部总经理詹毛毛先生,量化投资总监林健武先生,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,投资管理部总经理徐艳芳女士,基金经理滕祖光先生,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

(下转A14版)

国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告

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
二零一八年十月
[重要提示]

1、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”)的发售已获中国证监会证监许可(2018)1033号文核准准予募集。中国证监会对本基金的核准并不代表中国证监会对本基金的风险和收益做出实质性判断,推荐或者保证。

2、本基金为债券型定期开放发起式证券投资基金。

3、本基金的管理人为国金基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”),基金托管人为兴业银行股份有限公司,基金份额注册登记机构为国金基金管理有限公司。

4、本基金募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

5、本基金募集期限自2018年10月15日起至2018年10月26日,投资者可通过基金管理人指定的销售机构(包括直销机构及其他销售机构)认购本基金。

6、投资者通过基金管理人直销中心首次认购最低金额为10,000元(含认购费,下同),追加认购最低金额为1,000元。投资者通过其他销售机构首次认购最低金额为1,000元,追加认购最低金额为1,000元。各销售机构可根据自己的情况调整首次最低认购金额和最低追加认购金额限制。各销售机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。

7、如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%,基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的,基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

8、本基金不设募集规模上限。

9、有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。

10、基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应主动在基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购份额。

11、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在中国证监会指定信息披露媒体及本公司网站(www.gfund.com)上的《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》及《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》。

12、投资者可以拨打本公司的客户服务电话(4000-2000-18)咨询购买事宜。

13、本基金募集期间,除本公告所列示的销售机构外,如增加销售机构,本公司将另行公告。各销售机构可能增加部分基金销售网点,具体网点名单及开户认购事项详见各销售机构有关公告或拨打各销售机构客户服务电话咨询,具体规定以各销售机构说明为准。

14、基金管理人可综合各种情况对募集期限做适当调整。

15、风险提示

本基金投资于证券市场,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:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等等。

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。投资者应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资者在认购(或申购)本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和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。

一、本次募集基本情况

1、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
(基金代码:006189,基金简称:国金量化添利)
2、基金运作方式及类型:契约型定期开放式、债券型证券投资基金
3、基金存续期:不定期
4、基金份额面值:基金份额的初始面值为人民币1.00元。
5、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。
6、基金的投资范围:
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。

7、募集对象

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

8、募集时间安排与基金合同生效

(1)募集时间安排

本基金的募集期限不超过3个月,自基金份额开始发售之日起计算。

自2018年10月15日到2018年10月26日,本基金同时对个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者进行发售(具体业务办理时间以直销机构及其他销售机构的业务办理规则为准)。

基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

(2)基金合同生效

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在使用发起资金认购本基金的金额不少于1000万元且发起资金提供方承诺其认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于3年的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,验资机构需在验资报告中对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明。基金管理人自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,基金合同生效;否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

(3)基金募集失败

基金募集期限届满,未达到基金合同的生效条件,或基金募集期限内发生不可抗力使基金合同无法生效,则基金募集失败。如基金募集失败,基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息(税后)。

(4)如遇突发事件,以上基金募集期的安排可以依法适当调整。

二、发售方式及相关规定

1、本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资者公开发售,具体情况和联系方法详见本公告第七部分。

2、认购程序

投资者可以通过各销售机构的基金销售网点办理基金认购手续。投资者开户需提供销售机构要求提供的材料申请开立国金基金开放式基金账户。投资者认购所需提交的文件和办理的具体手续由基金管理人和销售机构约定,详见本公告第三部分、第四部分及销售机构的相关公告。

3、认购的方式及确认

(1)本基金认购采取金额认购的方式,投资者认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。

(2)基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由于投资人怠于查询而产生的任何损失由投资人自行承担。

(3)投资者在募集期内可以多次认购,认购一经受理不得撤销。

(4)若认购申请被确认为无效,基金管理人应当将投资者已支付的认购金额本金退还投资者。

4、认购的限额

(1)在募集期内,投资者可多次认购,对单一投资者在认购期间累计认购份额不设上限,但单一投资者经登记机构确认的认购份额不得达到或者超过本基金确认总份额的50%,且不得变相规避50%集中度要求,对于超过部分的认购份额,登记机构不予确认。

(2)认购最低限额:投资者通过基金管理人直销中心首次认购最低金额为10,000元(含认购费,下同),追加认购最低金额为1,000元。投资者通过其他销售机构首次认购最低金额为1,000元,追加认购最低金额为1,000元。各销售机构可根据自己的情况调整首次最低认购金额和最低追加认购金额限制。各销售机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。

(3)基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对认购的金额限制,基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定予以公告并报中国证监会备案。

5、基金份额初始面值、认购费用及认购份额的计算

(1)本基金的基金份额初始面值为人民币1.00元,基金份额的认购价格为1.00元/份。

(2)本基金在认购时收取基金认购费用。本基金对认购设置级差费率,认购费率随认购金额的增加而递减,本基金具体认购费率如下:

认购金额(M)	认购费率
M<50万元	0.60%
50万元≤M<100万元	0.50%
100万元≤M<200万元	0.40%
200万元≤M<500万元	0.20%
M≥500万元	1000元/笔

募集期内投资者多次认购的,认购费用按每笔认购金额对应的费率档次分别计算。

基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

(3)认购份额的计算

认购份额的计算保留到小数点后2位,小数点2位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

当投资人选择认购基金份额时,认购份额的计算方法如下:

1)认购费用适用比例费率时,认购份额的计算方法如下:

认购费用=认购金额×认购费率/(1+认购费率)

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=(净认购金额+认购利息)/基金份额初始面值

2)认购费用适用固定金额时,认购份额的计算方法如下:

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=(净认购金额+认购利息)/基金份额初始面值

举例说明:某投资者投资100,000元认购本基金,对应认购费率为0.60%,在募集期间产生利息50.00元,则其可得到的认购份额计算方法为:

认购费用=100,000.00×0.60%/(1+0.60%)=596.42元

净认购金额=100,000.00-596.42=99,403.58元

认购份额=(99,403.58+50.00)/1.00=99,453.58份

即:该投资者投资100,000元认购本基金,假设募集期间产生利息50.00元,可得到99,453.58份基金份额。

三、个人投资者的开户及认购程序

(一)基金管理人直销柜台

1、业务办理时间

直销柜台办理时间:2018年10月15日至2018年10月26日,9:30-17:00(周六、周日及法定节假日不受理)

2、开户及认购程序

(1)直销柜台办理认购申请的起点资金为人民币10,000元,追加认购最低金额1,000元,直销柜台可根据投资者的具体需求对以上起点资金作适当调整。

(2)个人普通投资者办理开户申请时须提供下列资料:

1)本人有效身份证件(居民身份证、中国护照等)原件及复印件。

2)指定银行账户的银行存折、借记卡等原件。

3)填妥的《个人开户业务申请表》。

4)填妥的《个人投资者风险承受能力评估问卷》。

5)填妥的《证券投资基金投资人权益须知》。

6)填妥的《个人税收居民身份声明文件》。

注:上述2)项中“指定银行账户”是指:在直销柜台办理开户的客户需指定一个银行账户作为投资者赎回、分红以及认购/申购无效资金退款等资金结算汇入账户。此账户可为投资者在任一银行的存款账户,账户名称必须与投资者姓名严格一致。

(3)认购时将足额认购资金汇入本公司以下直销账户:

账户名称:国金基金管理有限公司
银行账号:1100107980005300696 2
开户银行:中国建设银行股份有限公司北京苏州桥支行
银行联行行号:105100012091

在办理汇款时,投资者必须注意以下事项:

1)投资者必须使用其预留账户(投资者在本公司直销柜台开立交易账户时登记的银行账户)办理汇款,如使用非预留账户或其他无法及时识别投资者身份的方式汇款,则汇款资金无效;本公司直销柜台不接受现金缴纳认购款。

2)投资者应在“汇款人”栏中填写其在本公司直销柜台开立基金账户时登记的名称。

3)投资者所填写的汇款用途须注明购买的基金简称或基金代码(基金简称:国金量化添利、基金代码:006189),并确保在规定时间前到账。

4)投资者汇款金额必须与申请的认购金额一致。

5)投资者若未按上述规定划付,造成认购无效的,本公司及直销账户的开户银行不承担任何责任。

(4)办理基金认购手续

个人投资者办理认购手续须提供下列资料:

1)本人有效身份证件原件及复印件。

2)加盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件。

3)填妥的《交易业务申请表》。

3、注意事项

(1)投资者可以同时开立基金账户和办理认购申请,如基金账户开户失败,则认购申请也失败,认购资金退回投资者的指定银行账户上。

(2)若投资者认购资金在当日17:00之前未到本公司银行直销账户的,则当日提交的申请顺延受理,受理日期(即有效申请日)以资金到账日为准;若由于银行原因,当日无法确认到账资金的投资者信息,则当日提交的申请顺延至投资者信息确认后受理。以上情况最迟延至认购截止日。本公司直销柜台可综合各种突发事件对上述安排作适当调整。

(3)基金募集期结束,以下将被认定为无效认购:

1)投资者划入资金,但未办理开户手续或开户不成功。

2)投资者划入资金,但逾期未办理认购手续的。