国金量化多策略灵活配置混合型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：中国光大银行股份有限公司

重要提示

1、本基金经中国证监会2017年9月1日证监许可【2017】1615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、本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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。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。

本招募说明书所载内容截止日为2019年2月1日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2018年12月31日。

第一部分基金管理人

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
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
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

（一）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。

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。

（二）监事会成员

刘沣先生，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。

（三）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。

（四）基金经理

林健武先生，博士。历任美国摩根史坦利量化分析师，美国高盛股票投资战略副总裁、首席组合算法分析师，美国迈格尼塔投资公司资深量化分析师和全球量化投资战略交易总监，清华大学深圳研究生院金融学教授、量化投资研究中心主任，国信证券发展研究总部博士后工作站导师和研究员。现任国金基金管理有限公司总经理助理、量化投资总监兼量化研究部总经理、量化投资事业一部总经理。截至本招募说明书更新公布之日，林健武先生兼任国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金的基金经理。

郭晓先生，硕士。历任宝盈基金管理有限公司金融工程部研究员、权益投资部基金经理，国金基金管理有限公司量化研究部总经理助理。现任量化研究部基金经理。

（五）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，总经理助理兼量化投资总监林健武先生，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，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，量化投资事业三部总经理兼基金经理宫雪女士。

（六）上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

（一）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。
（二）办理本基金备案手续。
（三）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。
（四）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。
（五）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。
（六）编制季度、半年度和年度基金报告。
（七）计算并公告基金资产净值，每万份基金已实现收益，7日年化收益率。
（八）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。
（九）召集基金份额持有人大会。
（十）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。
（十一）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。
（十二）中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

（一）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《中华人民共和共证券法》行为的发生。

（二）基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券投资基金法》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、违反规定向他人贷款或者提供担保。
5、从事可能使基金财产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。

（三）基金管理人承诺不从事法规规定禁止从事的其他行为。

（四）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。

五、基金经理承诺

（一）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。
（二）不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益。
（三）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。
（四）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、基金管理人的内部控制制度

（一）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。

（二）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，监察稽核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；同时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。

（三）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。

（四）基金管理人关于内部合规控制声明书

1、本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

2、本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

第二部分基金托管人

一、基金托管人概况

1、基本情况
名称：中国光大银行股份有限公司
住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街25 号、甲25 号中国光大中心
成立日期：1992年6月18日
批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7号
组织形式：股份有限公司
注册资本：466.79095亿元人民币
法定代表人：李晓鹏
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75号
投资与托管业务部总经理：张博
电话：（010）63636363
传真：（010）63639132
网址：www.cebbank.com

2、投资与托管业务部部门及主要人员情况

法定代表人李晓鹏先生，曾任中国工商银行河南省分行党组成员、副行长，中国工商银行总行营业部总经理，中国工商银行四川省分行党委书记、行长，中国华融资产管理公司党委委员、副总裁，中国工商银行党委委员、行长助理兼北京市分行行长，中国工商银行党委委员、副行长，中国工商银行股份有限公司党委委员、副行长、执行董事；中国投资有限责任公司党委副书记、监事长；招商局集团副董事长、总经理、党委副书记。曾兼任工银国际控股有限公司董事长，工银金融租赁有限公司董事长，工银瑞信基金管理公司董事长，招商银行股份有限公司副董事长，招商局能源运输股份有限公司董事长，招商局港口控股有限公司董事会主席，招商局华建公路投资有限公司董事长，招商局资本投资有限责任公司董事长、招商局联合发展有限公司董事长、招商局投资发展有限公司董事长等职务。现任中国光大集团股份公司党委书记、董事长，兼任中国光大银行股份有限公司党委书记、董事长，中国光大集团有限公司董事长，中国旅游协会副会长、中国城市金融学会副会长、中国农村金融学会副会长。武汉大学金融学博士研究生，经济学博士，高级经济师。

行长葛海蛟先生，曾任中国农业银行辽宁省分行国际业务部总经理助理、副总经理、总经理，中国农业银行辽宁省辽阳市分行党委书记、行长，中国农业银行大连市分行党委委员、副行长，中国农业银行新加坡分行总经理，中国农业银行国际业务部副总经理（部门总经理级），中国农业银行黑龙江省分行党委副书记、党委书记、行长兼任悉尼分行海外高管，黑龙江省第十二届人大代表。曾兼任中国光大实业（集团）有限责任公司董事长，光大证券股份有限公司董事，中国光大集团股份公司上海总部主任，中国光大集团股份公司文旅健康事业部总经理。现任中国光大银行股份有限公司党委副书记、行长，中国光大集团股份公司党委委员。南京农业大学农业经济管理专业博士研究生，管理学博士，高级经济师。

张博先生，曾任中国光大银行厦门分行副行长，西安分行行长，乌鲁木齐分行筹备组组长、分行行长，青岛分行行长，光大消费金融公司筹备组组长。曾兼任中国光大银行电子银行部副总经理（总经理级），负责普惠贷款团队业务。现任中国光大银行投资与托管业务部总经理。

3、证券投资基金托管情况

截至2018年12月31日，中国光大银行股份有限公司托管华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金等共128只证券投资基金，托管基金资产规模3091.02亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

二、托管业务的内部控制制度

1、内部控制目标

确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金托管人有关基金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金财产安全；保证基金托管业务稳健运行；保护基金份额持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

2、内部控制的原则

（1）全面性原则。内部控制必须渗透到基金托管业务的各个操作环节，覆盖所有的岗位，不留任何死角。

（2）预防性原则。树立“预防为主”的管理理念，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

（3）及时性原则。建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，及时处理，堵塞漏洞。

（4）独立性原则。基金托管业务内部控制机构独立于基金托管业务执行机构，业务操作人员和内控人员分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

3、内部控制组织结构

中国光大银行股份有限公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会，委员会委员由相关部门的负责人担任，工作重点是对总行各部门、各类业务的风险和内控进行监督、管理和协调，建立横向的内控管理制约体制。各部门负责分管系统内的内部控制的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。投资与托管业务部建立了严密的内控督察体系，设立了风险管理处，负责证券投资基金托管业务的风险管理。

4、内部控制制度

中国光大银行股份有限公司投资与托管业务部自成立以来严格遵照《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》等法律、法规的要求，并根据相关法律法规制订、完善了《中国光大银行证券投资基金托管业务内部控制规定》、《中国光大银行投资与托管业务部保密规定》等十余项规章制度和实施细则，将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行投资与托管业务部以控制和防范基金托管业务风险为主线，在重要岗位（基金清算、基金核算、监督稽核）还建立了安全保密区，安装了录像监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的安全。

三、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据法律、法规和基金合同等的要求，基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合等方式方法，对基金投资品种、投资组合比例每日进行监督；同时，对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反法律、法规和基金合同等规定的行为，及时以书面或电话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确认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。基金管理人对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。

第三部分相关服务机构

一、基金份额发售机构

（一）直销机构

1、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

2、国金基金管理有限公司网上直销系统
交易系统网址：https://trade.gfund.com
目前支持的网上直销支付渠道：工行卡、建行卡、通联支付。
客户服务电话：4000-2000-18
客户服务信箱：service@gfund.com

3、国金基金移动客户端
移动客户端（APP）名称：及第理财
目前支持的移动客户端支付渠道：通联支付
客户服务电话：4000-2000-18
客户服务信箱：service@gfund.com

（二）其他销售机构

（1）中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人：李晓鹏
联系人：朱红
电话：010-63636153
客服电话：95595
网址：www.cebbank.com

（2）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
联系人：陈鹤
电话：010-57092851
传真：010-57092611
客服电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn

（3）兴业银行股份有限公司
注册地址：福建省福州市湖东路154号
办公地址：福建省福州市湖东路154号
法定代表人：高建平
联系人：唐斌，陈志伟
电话：0591-87824863，0591-87857530
客服电话：95561
网址：www.cib.com.cn

（4）中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：陈四清
客服电话：95566
网址：www.boc.cn
联系人：陈洪源

（5）深圳前海微众银行股份有限公司
注册地址：广东省深圳市前海深港合作区前湾一路 1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座
法定代表人：顾敏
联系人：张建霖
电话：0755-84354739
客服电话：400-999-8800
网址：www.webank.com

（6）国金证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市东城根上街95号
办公地址：四川省成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
联系人：刘婧漪
电话：028-86690057
传真号码：028-86690126
客服电话：95310
网址：www.gjzq.com.cn

（7）银河证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座
办公地址：北京市西城区金融大街35号2-6层
联系人：宋明
电话：010-66568450
客服电话：4008-888-888
网址：www.chinastock.com.cn

（8）光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
联系人：刘晨、李芳芳
电话：021-22169999
客服电话：95525
网址：www.ebscn.com

（9）国融证券股份有限公司
注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼
邮政编码：011700
法定代表人：张智河
客服电话：95385
网址：http://www.grzq.com

（10）安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人：王连志
注册资本：352500万元
联系人：陈剑虹
电话：0755-82558305
传真：0755-82558355
客服电话：4008-001-001
网址：www.essence.com.cn

（11）华金证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号30层
邮政编码：200127
法定代表人：宋卫东
联系人：秦臻
电话：021-20655593
传真：021-20655577
客服电话： 4008211357
网址：www.huajinsc.cn

（12）东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
邮政编码：213000
法定代表人：赵俊
联系人：王一彦
电话：021-20333910
传真：021-50498825
客服电话：400-8888-588
网址：www.longone.com.cn

（13）联讯证券股份有限公司
注册地址：惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址：深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层
邮政编码：518000
法定代表人：徐刚
联系人：彭莲
电话：0755-83331195
客服电话：95564
网址： www.lxsec.com

（14）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢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6楼
法定代表人：陈柏青
客服电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn

（15）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区场中路 685弄 37号 4号楼 449室
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
客服电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

（16）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人：凌顺平
电话：0571-88911818
客服电话：4008-773-772
网址：www.5ifund.com

（17）北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号
办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
电话：010-62020088
客服电话：400-818-8000
网址：www.myfund.com

（18）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路 190号 2号楼 2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼
法定代表人：其实
联系人：丁珊珊
电话：010-85718402
客服电话：400-181-8188
网址：www.1234567.com.cn

（19）深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25 层 IJ 单元
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
客服电话：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

（20）众升财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人：李招弟
联系人：李艳
电话：010-59497361
客服电话：400-876-9988
网址：www.zscffund.com

（21）北京增财基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人：罗细安
联系人：钟苓玉
电话：010-67000988
客服电话：400-001-8811
网址：www.zcvc.com.cn

（22）诺亚正行基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋
法定代表人：汪静波
客服电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com

（23）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园4 栋10 层1006#
办公地址：北京市西城区金融大街35 号国企大厦C 座9 层
法定代表人：马令海
客服电话：400-166-1188
网址：https:// 8.jrj.com.cn

（24）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人：梁越
联系人：张晔
电话：010-56810792
客服电话：4007-868-868-5
网址：www.chtfund.com

（25）北京钱景基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人：赵荣春
客服电话：400-893-6885
网址：www.qianjing.com

（26）宜信普泽（北京）基金销售有限公司
注册地址：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9号楼15层1809
法定代表人：沈伟桦
联系人：程刚
电话：010-52855713
客服电话：400 6099 200
网址： www.yixinfund.com

（27）济安财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
法定代表人：杨健
联系人：李海燕
电话：010-65309516
客服电话：400-673-7010
网址：www.jianfortune.com

（28）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
邮政编码：200127
法定代表人：李兴春
客服电话：400-921-7755
网址：www.leadfund.com.cn

（29）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：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）
邮政编码：201913
法定代表人：王翔
联系人：俞申莉
电话：021-65370077
客服电话：400-820-5369
网址：www.jiyufund.com.cn

（30）珠海盈米基金销售有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室 -3491
邮政编码：510308
法定代表人：肖雯
联系人：吴煜浩
电话：020-89629099
客服电话： 020-89629066
网址：www.yingmi.cn

（31）上海陆金所基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
邮编：200120
法定代表人：郭坚
联系人：宁博宇
客服电话：400-821-9031
网址：www.lufunds.com

（32）浙江金观诚基金销售有限公司
注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室
邮政编码：310015
法定代表人：徐黎云
联系人：孙成岩
电话：0571-88337717
客服电话：400-068-0058
网址：www.jincheng-fund.com

（33）大泰金石基金销售有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
邮政编码：210000
法定代表人：袁顾明
联系人：朱海涛
电话：15921264785
客服电话：400-928-2266
网址： www.dtfunds.com

（34）上海联泰基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
邮政编码：200335
法定代表人：燕斌
联系人：陈东
电话：021-52822063
客服电话：400-166-6788
网址：www.66zichan.com

（35）厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址：厦门市思明鹭江道2号第一广场1501-1504室
邮政编码：361002
法定代表人：陈洪生
客服电话：400-9180808
网址：www.xds.com.cn

（36）深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址：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
邮政编码：518000
法定代表人：赖任军
联系人：刘昕霞
电话：0755-29330513
传真：0755-26920530
客服电话：400-930-0660
网址：www.jfzinv.com/

（37）上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
邮政编码：200002
法定代表人：陈继武
联系人：李晓明
电话：021-63333319
客服电话：4006-433-389
网址：www.vstonewealth.com

（38）成都万华源基金销售有限责任公司
注册地址：四川省成都市成华区建设北路三段88号1栋5层510号
邮政编码：610051
法定代表人：陈建林
联系人：赵燕娟
电话：15101510587
客服电话：028-69587448
网址：www.whuayuan.com

（39）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
邮政编码：116000
法定代表人：林卓
联系人：李春光
电话：0411-88891212
客服电话：400-041-1001
网址：www.taichengcaifu.com

（40）武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号
邮政编码：430000
法定代表人：陶捷
联系人：陆锋
电话：027-87006003
客服电话：400-027-9899
网址：www.buyfunds.cn

（41）北京晟视天下基金销售有限公司
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
邮政编码：101404
法定代表人：蒋煜
联系人：曲哲伦
电话：010-58170820
客服电话：400-818-8866
网址：www.shengshiview.com

（42）深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址：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）
邮政编码：518000
法定代表人：高锋
联系人：廖苑兰
电话：0755-83655588
客服电话：4008048688
网址：www.keynesasset.com

（43）海银基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
邮政编码：200127
法定代表人：刘惠
联系人：毛林
电话：021-80133597
客服电话：400-808-1016
网址：www.fundhaiyin.com

（44）中证金牛（北京）投资咨询有限公司
注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
邮政编码：100052
法定代表人：钱昊旻
联系人：沈晨
电话：010-59336544
客服电话：400-890-9998
网址：www.jnlc.com

（45）奕丰基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
邮政编码：518054
法定代表人：TAN YIK KUAN
联系人：叶健
电话：0755-89460500
客服电话：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn

（46）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108室
邮政编码：110190
法定代表人：王伟刚
联系人：丁向坤
电话：010-56282140
传真：010-62680827客服电话：400-619-9059
网址：www.hcjijin.com

（47）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：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
邮政编码：100193
法定代表人：李昭琛
联系人：李唯
电话：010-62676979
客服电话：010-62675369
网址：www.xincai.com

（48）北京电盈基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1号楼36层3603室
邮政编码：100020
法定代表人：程刚
联系人：张旭
电话：010-56176117
客服电话：400-100-3391
网址：www.bjdyfund.com

（49）一路财富（北京）基金销售股份有限公司
注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208
邮政编码：100037
法定代表人：吴雪秀
联系人：徐越
电话：010-88312877
客服电话：400-001-1566
网址：www.yilucaifu.com

（50）上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
邮政编码：200120
法定代表人：王廷富
联系人：徐亚丹
电话：021-51327185
客服电话：400-821-0203
网址：www.520fund.com.cn

（51）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
邮政编码：200120
法定代表人：张跃伟
联系人：何昳
电话：021-20691922
客服电话：4008202899
网址：www.erichfund.com

（52）乾道盈泰基金销售（北京）有限公司
注册地址：北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302
邮政编码：100088
法定代表人：王兴吉
联系人：宋子琪
电话：010-62062880
客服电话：400-088-8080
网址：www.qiandaojr.com

（53）天津国美基金销售有限公司
注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-124室
邮政编码：100016
法定代表人：丁东华
联系人：郭宝亮
电话：010-59287984
客服电话：400-111-0889
网址：www.gomefund.com

（54）北京格上富信基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
邮政编码：100020
法定代表人：李悦章
联系人：曹庆展
电话：010-65983311
客服电话：400-066-8586
网址：www.igesafe.com

（55）北京微动利基金销售有限公司
注册地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心金融商业楼341室
邮政编码：100041
法定代表人：季长军
客服电话：400-188-5687
网址： www.buyforyou.com.cn

（56）上海中正达广基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
邮政编码：200232
法定代表人：黄欣
联系人：戴珉微
电话：021-33768132-801
客服电话：400-6767-523
网址：www.zhongzhengfund.com

（57）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
邮政编码：100102
法定代表人：钟斐斐
联系人：戚晓强
电话：010-61840688
客服电话：4000-618-518
网址：danjuanapp.com

（58）北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
通信地址：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
注册资本：2000万元
法定代表人：陈超
电话：4000988511/ 4000888816
传真： 010-89188000
客服电话：个人业务：95118 企业业务：400-088-8816
网址：http://fund.jd.com

（59）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
邮政编码：210042
法定代表人：钱燕飞
联系人：王锋
电话：025-66996699-887226
客服电话：95177
网址：www.snjijin.com

（60）北京植信基金销售有限公司
注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
邮政编码：101500
法定代表人：杨纪锋
联系人：吴鹏
电话：010-56075718
客服电话：400-680-2123
网址：www.zhixin-inv.com

（61）通华财富（上海）基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室
邮政编码：200083
法定代表人：马刚
联系人：祝捷
电话：021-60818588
传真：021-60818187
客服电话：400-66-95156
网址：https://www.tonghuafund.com

（62）上海云湾基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
邮政编码：200127
法定代表人：戴新装
联系人：朱学勇
电话：021-20538888
传真：021-20538999
客服电话：400-820-1515
网址：http://www.zhengtongfunds.com/

（63）和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室
邮政编码：100020
法定代表人：王莉
联系人：刘洋
电话：8610-85650628
传真：8610-65884788
客服电话：400-920-0022
网址：http://licaike.hexun.com/

（64）上海挖财金融信息服务有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
邮政编码：200000
法定代表人：胡艳亮
联系人：樊晴晴
电话：021-50810687
传真：021-58300279

（65）喜鹊财富基金销售有限公司
注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
邮政编码：100044
法定代表人：陈皓
联系人：张萌
电话：4006997719
传真：010-88371180
客服电话：0891-6177483
网址：www.xiquefund.com

（66）天津万家财富资产管理有限公司
注册地址：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
邮政编码：100032
法定代表人：李修辞
联系人：王芳芳
电话：010-59013842
传真：010-59013707
客服电话：010-59013842
网址：http://www.wanjiawealth.com/

（67）深圳信诚基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前港一路1号A栋201室
邮政编码：518000
法定代表人：周文
联系人：杨涛
电话：0755-23946579
传真：0755-82786863
客服电话：0755-23946579
网址：www.ecpefund.com

（68）杭州科地瑞富基金销售有限公司
注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心1604室
邮政编码： 310000
法定代表人：陈刚
联系人：张丽琼电话：0571-86655920
传真：0571-85269200
客服电话：0571-86655920
网址：www.cd121.com

（69）大河财富基金销售有限公司
注册地址：贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号
邮政编码：550002
法定代表人：王荻
联系人：方凯鑫
电话：0851-88405606
传真：0851-88405599
客服电话：0851-86235678
网址：www.urainf.com

（70）凤凰金信（银川）基金销售有限公司
注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402
邮政编码：750000
法定代表人：程刚
联系人：张旭
电话：010-58160168
传真：010-58160173
客服电话：400-810-5919
网址：www.fengfd.com

（71）中民财富基金销售（上海）有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
邮政编码：200010
法定代表人：弭洪军
联系人：李娜
电话：021-33357030
传真：021-63353736
客服电话：400-876-5716
网址：www.cmiwm.com

（72）北京君德汇富基金销售有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号2-2-1
邮政编码：100027
法定代表人：李振
联系人：彭雪琳
电话：010-85610733
客服电话：400-829-1218
网址：www.kstreasure.com

（73）大连网金基金销售有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2楼
邮政编码：116021
法定代表人：樊怀东
联系人：辛志辉
电话：0411-39027817
传真：0411-39027835
客服电话：4000-899-100
网址：http://www.yibaijin.com

（74）阳光人寿保险股份有限公司
注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层
邮政编码：100020
法定代表人：李科
联系人：杨超
客服电话：95510
网址：fund.sinosig.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机构销售基金，并及时公告。

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、贺耀
联系人：张晖
联系电话：010-58152145
传真：010-85188298

第四部分基金的名称

本基金名称：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

第五部分基金的类型

本基金类型：混合型证券投资基金。

第六部分基金的投资目标

本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在严格控制投资风险的前提下力求实现超越业绩比较基准的回报。

第七部分基金的投资方向

本基金的投资范围主要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、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权、权证）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。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。

本基金的投资比例为：股票资产投资比例为基金资产的0-95%；权证投资比例为基金资产净值的0-3%；每个交易日日终，在扣除国债期货、股指期货合约和股票期权需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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

一、资产配置策略

本基金采用自主开发的量化风险模型对市场的系统性风险进行判断，作为股票、债券、现金等金融工具大类配置的依据，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，动态地调整各金融工具的投资比例。同时，本基金将适时地采用股指期货对冲策略做套期保值，以达到控制下行风险的目标。

二、量化选股模型

1、多因子选股策略

本基金股票部分的构建主要采用 Alpha 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，力争实现基金资产超越业绩基准的回报。

2、统计套利策略

本基金通过对股票大量数据的回测研究，利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进行套利操作。

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。

三、债券投资策略

债券投资主要用于提高非股票资产的收益率，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。

1、在债券投资方面，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。

2、可转债投资策略

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。

四、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。

五、股指期货投资策略

本基金将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，以套期保值为主要目的，通过对证券市场和期货市场进行定量化研究，结合股指期货定价模型寻求其合理的估值水平，在法律法规允许的范围内进行相应投资操作。

六、股票期权合约投资策略。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，主要选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

基金管理人将根据审慎原则，建立期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项，以防范股票期权投资的风险。

七、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。管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，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，力求实现超额回报。

八、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。

第九部分基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率＋40%×中证全债指数收益率

沪深300指数由中证指数公司在上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的，指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性；中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。

若未来法律法规发生变化，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，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整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，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

第十一部分投资组合报告

本投资组合报告期为2018年10月1日至2018年12月31日。

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	207,172,164.14	79.64
	其中：股票	207,172,164.14	79.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	20,000,000.00	7.69
	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	32,729,638.22	12.58
8	其他资产	232,781.58	0.09
9	合计	260,134,583.94	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

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	686,875.00	0.27
B	采矿业	4,681,502.85	1.82
C	制造业	126,246,654.90	48.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,440,848.00	3.66
E	建筑业	5,590,242.26	2.17
F	批发和零售业	11,839,610.20	4.59
G	交通运输、仓储和邮政业	3,116,163.00	1.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,159,040.00	0.84
J	金融业	27,207,411.69	10.56
K	房地产业	6,165,847.00	2.39
L	租赁和商务服务业	4,961,106.24	1.92
M	科学研究和技术服务业	1,418,724.00	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	3,658,139.00	1.42
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	207,172,164.14	80.39

注：以上行业分类以2018年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

（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

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	601328	交通银行	768,671	4,450,605.09	1.73
2	601398	工商银行	829,100	4,385,939.00	1.70
3	601229	上海银行	373,900	4,183,941.00	1.62
4	601009	南京银行	647,300	4,181,558.00	1.62
5	601688	华泰证券	192,300	3,115,260.00	1.21
6	000415	渤海租赁	851,500	3,065,400.00	1.19
7	601318	中国平安	53,208	2,984,968.80	1.16
8	600585	海螺水泥	97,515	2,855,239.20	1.11
9	600016	民生银行	492,200	2,820,306.00	1.09
10	000651	格力电器	72,304	2,580,529.76	1.00

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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。

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股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	报告期内，本基金运用股指期货是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，总体风险可控且符合既定的投资政策和投资目标。
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					603,660.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，以套期保值为主要目的，通过对证券市场和期货市场进行定量化研究，结合股指期货定价模型寻求其合理的估值水平，在法律法规允许的范围内进行相应投资操作。

本报告期内，本基金阶段性地持有一定比例的股指期货空头仓位，以对冲股票组合的市场风险，符合基金既定的投资政策和投资目标。

10、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

本基金本报告期未投资国债期货。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期未投资国债期货。

（3）本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

11、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。

（2）本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	150,555.83
2	应收证券清算款	22,684.93
3	应收股利	-
4	应收利息	55,537.42
5	应收申购款	4,003.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	232,781.58

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

（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。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

第十二部分基金的业绩

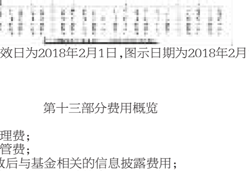
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

（一）本基金合同生效日为2018年2月1日，基金合同生效以来（截至2018年12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2月1日（基金合同生效日）至2018年12月31日	-26.69%	1.18%	-15.83%	0.82%	-10.86%	0.36%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%

（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：本基金基金合同生效日为2018年2月1日，图示日期为2018年2月1日至2018年12月31日。

（三）其他指标

注：无

第十三部分费用概览

一、基金费用的种类
（一）基金管理人的管理费；
（二）基金托管人的托管费；
（三）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
（四）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
（五）基金份额持有人大会费用；
（六）基金的证券、期货交易费用；
（七）基金的银行汇划费用；
（八）基金的账户开户费用、账户维护费用；
（九）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。

第十四部分对招募说明书更新部分的说明

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（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2019年3月18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更新截止日以来涉及本基金的相关公告。

国金基金管理有限公司
二零一九年三月十八日