

中金衡优灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2019年第2号)

基金管理人:中金基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
二〇一九年七月

重要提示

中金衡优灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请于2017年11月9日经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2022号《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,并于2018年6月8日经中国证监会证券机构监管部函[2018]1330号《中金衡优灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》备案。本基金的基金合同于2018年6月8日生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。
本招募说明书经中国证监会注册,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、收益及市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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债券、非金融企业债务融资工具、股票及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但符合中国证监会的相关规定),在正常市场环境下本基金的流动性风险适中,在特殊市场条件下,如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下,可能导致基金资产变现困难或变现时资产价格造成较大冲击,发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资策略等风险。本基金投资于证券及期货市场,基金价值会因为证券及期货市场价格波动等因素产生波动,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于:市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、估值风险、操作及技术风险、合规性风险、本基金特定风险、其他风险。本基金的投资范围中包括中小企业私募债券,该券种具有较高流动性风险和信用风险,可能增加本基金总体风险水平。本基金为混合型证券投资基金,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。

投资人在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,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,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

本基金基金份额分为A、C两类,其中A类基金份额收取认/申购费,不计提销售服务费;C类基金份额不收取认/申购费,但计提销售服务费。A、C两类基金份额适用不同的赎回费率。

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。

除法律法规、投资人本人/申购赎回基金时认真阅读招募说明书及其更新。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

基金管理人管理的其他基金的不构成对本基金业绩表现的保证。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本更新招募说明书已经本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为2019年6月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:中金基金管理有限公司
住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼26层06室
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层
法定代表人:赵钢
成立时间:2014年2月10日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监许可[2014]97号
组织形式:有限责任公司
注册资本:3.5亿元人民币
存续期间:持续经营
联系人:张煜
联系电话:010-63211122
公司的股权结构如下:

股东名称	持股比例
中国国际金融股份有限公司	100%

(二)主要人员情况

基金管理人董事会成员:

赵钢先生,董事长,理论物理学博士,特许金融分析师,历任花旗银行副总裁、新兴市场风控经理、地方政府债券自营交易员、基金经理,拉丁美洲股票期权交易负责人及另类投资董事总经理等职务。现任中国国际金融股份有限公司首席运营官、管理委员会委员。

黄剑峰先生,董事,机械工程专业学士。历任英国毕马威会计师事务所(英国及香港)审计、核算员及经理,先后负责香港汇丰银行资本市场服务经理、货币及外汇市场财务经理职务;高盛(亚洲),高盛集团(日本东京)固定收益外汇及大宗商品产品财务控制负责人、权益类产品财务控制负责人、日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责人、执行董事等职务;北京高华证券有限责任公司中后台协调、风险管理岗位;高盛(亚洲)有限责任公司资产管理部亚太区首席营运官、亚太(除日本)首席营运官、产品研发主管兼董事总经理等职务。现任中国国际金融股份有限公司首席财务官、董事总经理。

陈朔先生,董事,法学博士。历任国务院发展研究中心技术经济研究所研究人员;北京世泽律师事务所,中国国际金融股份有限公司合规律师,中国国际金融(香港)有限公司合规律师,中金美国证券法律部负责人,厚朴香港投资咨询有限公司法律合规事务负责人。陈朔先生是美国纽约州执业律师并具有中国法律职业资格证。现任中国国际金融股份有限公司合规总监、董事总经理。

孙蓓女士,董事,管理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资本市场部副经理、公司管理部副经理、运营支持部执行总经理及负责人等职务。现任中金基金管理有限公司总经理。

赵毅先生,董事,经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司投资银行部经理、中信产业基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司总经理助理。

李永先生,董事,工商管理硕士。历任中国人保资产管理有限责任公司交易员、风险监控专员、投资经理;中国人寿资产管理有限公司养老金及机构业务部投资经理、固定收益团队负责人、固定收益部投资经理、高级投资经理,一级团队负责人;中国人寿资产管理有限公司固定收益投资委员会、自有资金投资决策委员会。现任中金基金管理有限公司副总经理。

独立董事:王健,经济学及公共政策委员会主席。曾任美国明尼苏达大学卡鲁森管理学院的金融系统终身教授;中欧国际工商学院金融和会计系讲席教授、系主任、副教授长。现任上海交大学士工商管理高级学院教授、执行院长,并兼任上海人寿股份有限公司及上海证券有限责任公司独立董事。

曹大卫先生,独立董事,哲学博士。历任北京大学光华管理学院团委书记、党委副书记、党委书记;北京大学医学部副主任、财务部部长,北京大学副总会计师等职务。现任神州泰丰软件股份有限公司副总裁。

王元先生,法学硕士。历任北京君合律师事务所上海分所、上海市耀良律师事务所、北京君合律师事务所上海分所律师。现任北京君合律师事务所高级合伙人、管委会成员,现任上海耀良科技股份有限公司独立董事。

2、基金管理人监事

夏静女士,执行监事,管理学硕士。历任普华永道(深圳)咨询有限公司北京分公司风险管理及内部控制服务经理;中国国际金融股份有限公司公司稽核部高级经理。现任中金基金管理有限公司风险管理部负责人。

3、基金管理人高级管理人员

赵钢先生,董事长。简历同上。

孙蓓女士,总经理。简历同上。

李永先生,副总经理。简历同上。

汤敏女士,管理学硕士。历任中国工商银行深圳分行高级理财经理;华安基金管理有限公司零售业务部副经理。现任中金基金管理有限公司副经理。

李虹女士,督察长,法学硕士。历任美国众达律师事务所北京代表处律师;中国国际金融股份有限公司合规管理部副经理。李虹女士是美国纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。

4、本基金基金经理

魏宇先生,统计学博士。2010年8月至2014年10月,在北京嘉实资产管理有限公司从事A股量化策略开发。2014年11月加入中金基金管理有限公司,历任高级经理,量化专户投资经理,现任量化公募投资部基金经理。

陈诗昆女士,金融学硕士。历任嘉实基金管理有限公司财富管理部职员;鹏扬基金管理有限公司交易员、固定收益研究员、投资经理。2018年10月加入中金基金管理有限公司,现任组合投资部基金经理。

5、投资决策委员会成员

李永先生,副总经理。简历同上。

王耀杰先生,经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部行业研究员,定向资产管理业务投资经理,集合资产管理计划投资经理。现任中金基金管理有限公司权益投资部负责人、董事总经理。

郭晓女士,工商管理硕士。历任宁波梅海绿色石化股份有限公司基金投资经理,华泰证券资产管理有限公司项目助理;德恒证券有限责任公司高级经理;华策投资有限公司投资副总经理;招商基金管理有限公司投资经理。2014年4月加入中金基金管理有限公司,现任投资管理部基金经理。

石玉女士,管理学硕士。历任中国科技证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司职员;天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员;中国国际金融股份有限公司资产管理部高级研究员、投资经理助理。投资经理。2016年7月加入中金基金管理有限公司,现任投资管理部基金经理。

朱宝臣先生,理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部投资经理、量化投资总监。2017年10月加入中金基金管理有限公司,现任量化投资团队负责人。

杨立先生,经济学硕士。历任民生证券股份有限公司证券投资助理、证券投资经理;华融证券股份有限公司投资经理。现任中金基金资产管理部基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况
名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万玖仟叁佰陆拾壹元整

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人:王长林

传真:(010) 66594942

中国银行股份有限公司:95566

(二)主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1990年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具备海外工作、学习或留学经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金(基金—一对多、一对一)、社保基金、保险资金、OFII、ROFI、ODI、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)基金托管业务经营情况

截至2019年3月31日,中国银行已托管710只证券投资基金,其中境内基金670只,ODI基金40只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、商品型、指数型、QDII等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销柜台

名称:中金基金管理有限公司

住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼26层06室

办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层

法定代表人:赵钢

电话:010-63211122

联系人:张煜

客户服务热线:400-968-1166

网站:www.ciccfund.com

(2)网上直销

交易系统:中金基金网上交易系统

交易系统网址:trade.ciccfund.com

2、其他销售机构

(1) 济安财富(北京)基金销售有限公司

客服电话:400-673-7010

网站:http://www.jianfortune.com

(2)中国国际金融股份有限公司

注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人:毕明建(代履职)

电话:010-65051166

传真:010-65058065

联系人:杨涵宇

网站:www.cicc.com.cn

(3)中国中投证券有限责任公司

客服电话:400-600-8008、95532

网站:http://www.china-invs.cn

(4)银河证券股份有限公司

客服电话:95551

网站:http://www.chinastock.com.cn/

(5)平安证券有限责任公司

客服电话:95511-8

网站:http://stock.pingan.com

(6)上海挖财金融信息服务有限公司

客服电话:021-50810673

网站:www.wacaijin.com

(7)中国银河证券股份有限公司

地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人:陈共泗

客服电话:95566

网站:www.boc.cn

(8)包商银行股份有限公司

客服电话:010-64618038

网站:http://www.bsb.com.cn/

(9)北京恒天明泽基金销售有限公司

客服电话:400-898-0618

网站:http://www.chtfund.com/

(10)上海陆金所资产管理有限公司

客服电话:400-821-9031

网站:www.lufunds.com

(11)长城证券股份有限公司

客服电话:400-6666-888

网站:http://www.cwgws.com/

(12)上海天天基金销售有限公司

客服电话:400-981-0818

网站:http://fund.eastmoney.com/

(13)上海好基基金销售有限公司

注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址:上海市浦东新区南1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人:杨文斌

联系人:张凯

电话:021-20613999

传真:021-68969919

客服电话:400-700-9665

网站:www.ehowbuy.com

(14)北京汇金基金销售有限公司

客服电话:400-619-9069

网站:www.fundzone.cn

(15)上海基煜基金销售有限公司

客服电话:4008-205-369

网站:https://www.jiyufund.com.cn/

(16)渤海银行股份有限公司

网站:www.cbhb.com.cn

电话:95541

(17)泰诚财富基金销售(大连)有限公司

网站:www.taichengcaifu.com

电话:400-0411-001

(18)中信建投证券股份有限公司

网站:www.csc108.com

电话:4008-988-108

(19)北京汇金基金销售有限公司

客服电话:400-068-1176

网站:www.jimutund.com

(20)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

客服热线:400-198-9868

网站:www.tdyhtund.com

(21)平安银行股份有限公司

网站:bank.pingan.com

电话:95511-3

(22)珠海裘佳基金销售有限公司

网站:www.yingmi.cn

电话:020-89629099

(23)阳光人寿保险股份有限公司

网站:fund.sinosig.com

电话:95510

(24)南京苏宁基金销售有限公司

客服电话:95177

网站:www.snjijin.com

(25)上海陆基金销售有限公司

网站:www.erichfund.com

电话:400-820-2899

(26)阳光人寿财产保险股份有限公司

网站:http://www.18.cn

电话:95357

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销售机构销售本基金,并及时公告。

(二)登记机构

名称:中金基金管理有限公司

住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼26层06室

办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层

法定代表人:赵钢

电话:010-63211122

传真:010-66155573

联系人:白娜

(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

经办律师:安冬、陆奇

联系人:陆奇

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层

办公地址:中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层

执行事务合伙人:邵继

电话:010-58508500

传真:010-58185111

签字注册会计师:吴娜、丁时杰

联系人:吴娜

四、基金的名称

中金衡优灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型与运作方式

(一)基金的类型

混合型证券投资基金

(二)基金的运作方式

契约开放式

六、基金的投资目标

在严格控制风险和保持流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产长期稳健的增值。

七、基金的投资范围

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、创业板及其他经中国证监会核准发行上市)的股票、债券(包括国

债、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换

债券、资产支持证券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、债券回购、

货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、银行存单、同业存单以

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,基金管理人可在履行适当

程序后,将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围0%-95%;在每个交易

日终,在扣除股指期货和股指期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于基金资产

净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;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

(一)大类资产配置策略

本基金主要采用专业的投资理念和严谨的分析方法,以系统化的量化模型和深

入的基本面研究,基于对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场分析等

宏观基本面研究,结合对各类资产的预期收益、流动性及波动性等因素的分析,严格

遵守各项法律法规,合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例

,并随着各类金融工具的风险收益特征的相对变化,适时动态调整各类金融工具

的投资