

中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

二〇一八年一月

重要提示

中金丰沃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 4 月 1 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]447 号《关于准予中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，并于 2017 年 6 月 2 日经中国证监会证券基金机构监管部机构部函 [2017]1397 号《关于中金丰沃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 2017 年 6 月 2 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。

中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金投资于证券及期货市场，基金净值会因为证券及期货市场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、本基金特有风险、其他风险等。本基金的投资范围中包括中小企业私募债券，该券种具有较高的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。

投资有风险，投资人认/申购本基金时应认真阅读本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，由投资人自行负责。

基金管理人管理的其他基金的业绩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 2017 年 12 月 1 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 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 2 座 26 层 05 室

办公地址：北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际大厦 17 层

法定代表人：林寿康

成立时间：2014 年 2 月 10 日

批准设立机关：中国证监会

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：2 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：张显

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

1、基金管理人董事会成员

林寿康先生，董事长，货币经济学博士。历任国际货币基金组织国际部经济学家；香港金融管理局货币管理部高级经理；德意志摩根建富公司新兴市场部经济学家；中国信达资产管理公司国际部副主任。现任中国国际金融股份有限公司管理委员会委员、投资管理业务负责人、董事总经理。

孙菁女士，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总经理、公司管理部副总经理、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。

黄劲峰先生，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、核算见习生、副经理，经理等职务；香港汇丰银行资本市场财务经理、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、产品研发主管和董事总经理职务。现任中国国际金融股份有限公司董事总经理。

陈刚先生，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律师；中国国际金融有限公司合规律师、中国国际金融香港有限公司合规律师、中金美国证券有限公司法律部负责人；厚朴香港投资咨询有限公司法律合规事务负责人。陈刚先生是纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。现任中国国际金融股份有限公司合规总监、董事总经理。

赵璧先生，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助理；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公司交易员、风险监控员、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委员、自有资金投资委员会委员。现任中金基金管理有限公司副总经理。

张龙先生，独立董事，博士。历任内蒙康隆能源有限公司总经理，现任中宝睿信投资有限公司董事长、中国建设银行独立董事。

张春先生，独立董事，经济学和决策科学博士。历任美国明尼苏达大学卡尔森管理学院金融系终身教授；中欧国际工商学院金融和会计系讲席教授、系主任、副教务长。现任上海交通大学上海高级金融学院教授、执行院长。

颜羽女士，独立董事，经济法硕士、EMBA 硕士研究生。历任云南政法干部管理学院教师；四通集团条法

部法律咨询副主任；海问律师事务所证券业务律师；嘉和律师事务所合伙人。现任嘉源律师事务所创始合伙人。

2、基金管理人监事

夏静女士，执行监事，数学系理学硕士。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部经理；中国国际金融股份有限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

林寿康先生，董事长，货币经济学博士。简历同上。

孙菁女士，总经理。简历同上。

李永先生，副总经理。简历同上。

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总经理。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

石玉女士，管理学硕士。历任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高级研究员、投资经理助理、投资经理。

郭党钰先生，工商管理硕士。历任宁波镇海炼化投资经理；华泰证券项目经理；德恒证券高级经理；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。现任中金基金管理有限公司投资管理部执行总经理。

刘重晋先生，北京大学理学博士。历任 PineRiverCapitalManagement 高级量化研究员、副总经理；现任中金基金管理有限公司量化投资部高级经理，公募基金经理。于 2017 年 8 月 2 日担任中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金经理。

5、投资决策委员会成员

李永先生，工商管理硕士。简历同上。

石玉女士，管理学硕士。简历同上。

郭党钰先生，工商管理硕士。简历同上。

魏宇先生，香港大学统计专业博士。历任北京尊嘉资产管理有限公司量化研究员、高级量化研究员。现任中金基金管理有限公司量化公募投资部副总经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

名称：平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

成立日期：1987 年 12 月 22 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：17,170,411,366 元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037 号

联系人：高希泉

联系电话：(0755)22197701

平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业银行（深圳证券交易所简称：平安银行，证券代码 000001）。其前身是深圳发展银行股份有限公司，于 2012 年 6 月吸收合并原平安银行并于同年

7月更名为平安银行。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行58%的股份，为平安银行的控股股东。截至2017年6月末，在职员工31721人，通过全国64家分行、1081家营业机构为客户提供多种金融服务。

截至2017年上半年，平安银行收入、利润、规模保持稳健发展。营业收入540.73亿元、准备前营业利润401.84亿元（同比增长11.14%）、净利润125.54亿元（同比增长2.13%）、资产总额30,921.42亿元（较上年末增长4.70%）、吸收存款余额19,123.33亿元、发放贷款和垫款总额（含贴现）15,942.81亿元（较上年末增幅8.03%）。

平安银行总行设资产托管事业部，下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、资金清算处、规划发展处、IT系统支持处、督察合规处、基金服务中心8个处室，目前部门人员为60人。

（二）主要人员情况

陈正涛，男，中共党员，经济学硕士、高级经济师、高级理财规划师、国际注册私人银行家，具备《中国证券业执业证书》。长期从事商业银行工作，具有本外币资金清算，银行经营管理及基金托管业务的经营管理经验。1985年7月至1993年2月在武汉金融高等专科学校任教；1993年3月至1993年7月在招商银行武汉分行任客户经理；1993年8月至1999年2月在招行武汉分行武昌支行任计划信贷部经理、行长助理；1999年3月—2000年1月在招行武汉分行青山支行任行长助理；2000年2月至2001年7月在招行武汉分行公司银行部任副总经理；2001年8月至2003年2月在招行武汉分行解放公园支行任行长；2003年3月至2005年4月在招行武汉分行机构业务部任总经理；2005年5月至2007年6月在招行武汉分行硚口支行任行长；2007年7月至2008年1月在招行武汉分行同业银行部任总经理；自2008年2月加盟平安银行先后任公司业务部总经理助理、产品及交易银行部副总经理，一直负责公司银行产品开发与管理，全面掌握银行产品包括托管业务产品的运作、营销和管理，尤其是对商业银行有关各项监管政策比较熟悉。2011年12月任平安银行资产托管部副总经理；2013年5月起任平安银行资产托管事业部副总裁（主持工作）；2015年3月5日起任平安银行资产托管事业部总裁。

（三）基金托管业务经营情况

2008年8月15日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。

截至2017年9月底，平安银行股份有限公司托管净值规模合计6.17万亿，托管证券投资基金共110只，具体包括华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、招商保证金快线货币市场基金、平安大华日增利货币市场基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、东吴中证可转债债券指数分级证券投资基金、平安大华财富宝货币市场基金、红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华活期添利货币市场证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、鹏华安盈宝货币市场基金、平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、中海进取收益灵活配置混合型证券投资基金、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、嘉合磐石混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金、鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金、博时裕泰纯债债券型证券投资基金、德邦增利货币市场基金、中海顺鑫保本混合型证券投资基金、民生加银新收益债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、浙商汇金转型升级灵活配置混合型证券投资基金、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金、博时裕景纯债债券型证券投资基金、平安大华惠盈纯债债券型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、平安大华安盈保本混合型证券投资基金、嘉实稳丰债券型证券投资基金、嘉实稳盛债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、华润元大现金货币市场基金、平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金、平安大华鼎泰灵活配置混合型证券投资基金、南方荣欢定期开放混合型发起式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、中海合嘉增强收益债券型证券投资基金、鹏华丰安债券型证券投资基金、富兰克林国海新活力灵活配置混合型证券投资基金、南方颐元债券型发起式证券投资基金、鹏华弘惠灵活配置混合型证券投资基金、鹏华兴安定

期开放灵活配置混合型证券投资基金、西部利得天添利货币市场基金、鹏华弘腾灵活配置混合型证券投资基金、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠享纯债债券型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、博时丰达纯债 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠利纯债债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金、鹏华丰盈债券型证券投资基金、平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、平安大华金管家货币市场基金、平安大华鑫利定期开放灵活配置混合型证券投资基金、博时泰安债券型证券投资基金、新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金、国联安睿智定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、平安大华量化灵活配置混合型证券投资基金、平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、前海开源聚财宝货币市场基金、招商招弘纯债债券型证券投资基金、招商稳阳定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金、前海开源沪港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠益纯债债券型证券投资基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、西部利得汇享债券型证券投资基金、鹏华丰玉债券型证券投资基金、华安睿安定期开放混合型证券投资基金、西部利得久安回报灵活配置混合型证券投资基金、广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、上投摩根岁岁金定期开放债券型证券投资基金、平安大华转型创新灵活配置混合型证券投资基金、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金、南方和元债券型证券投资基金、长盛盛通纯债债券型证券投资基金、平安大华添益债券型证券投资基金、平安大华惠元纯债债券型证券投资基金、中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金、兴银消费新趋势灵活配置混合型证券投资基金、南方高元债券型发起式证券投资基金、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金、中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金、中金丰鸿灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠泽纯债债券型证券投资基金、南方智造未来股票型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、嘉实稳悦纯债债券型证券投资基金。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销中心

(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 2 座 26 层 05 室

办公地址：北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际大厦 17 层

法定代表人：林寿康

电话：010-63211122

传真：010-66159121

联系人：张显

客户服务电话：400-868-1166

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) 包商银行股份有限公司

客服电话:95352

网站:www.bsb.com.cn

(2) 和讯信息科技有限公司

客服电话:400-920-0022

网站:licaike.hexun.com

(3) 上海天天基金销售有限公司

客服电话: 400-991-8918

网址: <http://fund.eastmoney.com>

(4) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

客服电话:4000-766-123

网站:www.fund123.cn

(5) 通华财富(上海)基金销售有限公司

客服电话:95156 转 5

网站:<https://www.tonghuafund.com>

(6) 上海基煜基金销售有限公司

客服电话:400-820-5369

网站:www.jiyufund.com.cn

(7) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

客服电话:400-098-8511

网站:<http://jdd.jr.jd.com/index.html>

(8) 北京蛋卷基金销售有限公司

客服电话:400-061-8518

网站:<https://danjuanapp.com/>

(9) 洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司

客服电话: 4006706863

网址: www.hongtaiwealth.com

(10) 银河证券股份有限公司

客服电话:95551

网站:<http://www.chinastock.com.cn/>

(11) 太平洋证券股份有限公司

客服电话:400-665-0999

网站:www.tpyzq.com

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: 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2座26层05室

办公地址: 北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层

法定代表人: 林寿康

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：安冬

（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：邹俊

电话：010-85085000

传真：010-85185111

签章注册会计师：程海良、李砾

联系人：程海良

四、基金的名称

中金丰沃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

运作方式为契约型开放式，存续期限为不定期。

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、基金的投资方向

本基金的投资范围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、央行票据、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（含分离交易可转换债券）、可交换债券、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、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，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 0-95%；在每个交易日日终，在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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。

八、基金的投资策略

（一）资产配置策略

本基金的资产配置策略主要是基于对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策分析等宏观基本面研究，结合对各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等因素的评估，在约定的投资比例范围内确定各大类资产的中长期基本配置比例并进行调整。

（二）普通债券投资策略

1、债券类属配置策略

本基金将通过研究国民经济运行状况、货币市场及资本市场资金供求关系，分析国债、金融债、公司债、企业债、短融和中期票据等不同债券板块之间的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例并根据市场变化进行调整。

2、期限结构配置策略

本基金对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下，确定最优的期限结构。本基金期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略等。

3、利率策略

本基金通过对经济运行状况，分析宏观经济运行可能情景的研判，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。组合久期是反映利率风险最重要的指标，根据对市场利率水平的变化趋势的预期，可以制定出组合的目标久期。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，本基金将缩短组合的久期，以减小债券价格下降带来的风险。

4、信用债券投资策略

本基金通过自下而上的策略，在信用类固定收益金融工具中精选个券，结合适度分散的行业配置策略，构造并优化投资组合。

（1）买入并持有策略

买入并持有策略是指选择信用风险可承担，期限与收益率相对合理的信用类产品持有到期，获取票息收益。选择买入并持有策略时，基金选券的原则包括：

- 1) 债券的信用风险可承担。通过对债券的信用风险和收益进行分析，选择收益率较高、信用风险可承担的债券品种。
- 2) 债券的信用利差合理。债券信用利差有明显的周期性变化，本基金可在信用利差较高并有减小趋势的情况下，加大买入并持有策略的力度。
- 3) 债券的期限合理。根据利率市场的波动性，在相对高利率环境下，选择期限较长的品种，在相对低利率环境下，选择期限较短的品种。

（2）行业配置策略

基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面研究，本基金将运用定性定量模型，在自下而上的个债精选策略基础上，采取适度分散的行业配置策略，从组合层面动态优化风险收益。

（3）利差轮动策略

信用债券的利差受到经济周期、行业周期等因素的影响具有周期性变化的特征，本基金将结合对经济周期和行业周期的判断，在预期利差将变大的情况下卖出此类债券，在预期利差缩小的情况下买入此类债券，以获取利差收益。

5、骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时，即相邻期限利差较大时，本基金将适当买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，即收益率水平处于相对高位的债券。随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

6、息差策略

息差策略是指利用回购等方式融入低成本资金，购买较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。

（三）中小企业私募债券的投资策略

本基金对中小企业私募债券的投资策略主要基于信用品种投资，在此基础上重点分析信用风险及流动性风险。首先，确定经济周期所处阶段，研究中小企业私募债券发行人所处行业在经济周期中所受的影响，以确定行业总体信用风险的变动情况，并投资具有积极因素的行业；其次，对中小企业私募债券发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析；最后，结合中小企业私募债券的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素，综合评价中小企业私募债券的信用风险和流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。

（四）可转换债券投资策略

在分析宏观经济运行特征并对各类市场大势做出判断的前提下，本基金对可转债所对应的基础股票进行分析和研究，从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注，对可转债投资价值进行有效的评估，选择投资价值较高的个券进行投资。

（五）可交换债券投资策略

可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期价值，本基金管理人将对可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可交换债券进行投资。此外，本基金还将根据新发可交换债券的预计中签率、模型定价结果，积极参与可交换债券新券的申购。

（六）资产支持证券投资策略

本基金将持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展，将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，制定周密的投资策略。在具体投资过程中，重点关注标的证券发行条款、基础资产的类型，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，加强对未来现金流稳定性的分析。本基金将严格控制资产支持证券的总量规模，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，实现资产支持证券对基金资产的最优贡献。

（七）国债期货投资策略

本基金投资国债期货以套期保值、回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

（八）股票投资策略

本基金的股票投资策略主要采纳两种选股投资思路，一种是纯粹的自下而上的个股精选策略，一种是运用量化模型自上而下的选股策略。

1、个股精选策略

本基金采取自下而上的个股精选策略，投资于治理结构完善、估值水平合理、内生性增长超出市场预期、符合国家政策导向的公司的股票。本基金将基于公司基本面分析，运用多因素选股思路，综合考察股票所属行业发展前景、上市公司行业地位、竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，对个股予以动态配置，追求在可控风险前提下的稳健回报。

2、量化选股策略

本基金采取量化选股模型自上而下选股，在注重基本面研究的同时，通过构建行业因子库和风格因子库，包括，价值因子、动量因子、交易活动因子、波动性因子、规模因子以及指数关联性因子等，结合因子的经济意义、投资者交易行为等，分析因子的历史表现，自上而下的确定因子组合，并根据定期分析和评估结果动态调整，精选出一篮子具有基本面良好、估值适当、投资者预期较好等特性的股票进行投资。

（九）股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的量化研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，并与现货资产进行匹配，在法律法规允许的范围内，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

（十）权证投资策略

在进行权证投资时，基金管理人将通过对权证标的证券基本面的研究，辅助运用权证定价模型寻求其合理估值水平，根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性，通过限量投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

中证 800 指数收益率 50%+中债综合指数收益率 50%。

中证 800 指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，市场代表性较强，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果指数编制单位停止计算编制该指数、或今后法律规发生变化或更改指数名称、或有更适当的、更能为市场普遍接受业绩比较基准推出，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，经履行适当程序，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。

十、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。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人根据本基金合同规定，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。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 9 月 30 日，报告期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 30 日。本报告财务数据未经审计。

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 39,226,395.12 20.49

其中：股票 39,226,395.12 20.49

2 基金投资 --

3 固定收益投资 117,563,410.80 61.41

其中：债券 117,563,410.80 61.41

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 30,000,000.00 15.67

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 2,150,281.07 1.12

8 其他资产 2,485,450.07 1.30

9 合计 191,425,537.06 100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

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	60,435.00	0.03
B	采矿业	963,917.00	0.51
C	制造业	8,479,832.07	4.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	418,495.00	0.22
E	建筑业	2,746,839.00	1.44
F	批发和零售业	425,418.95	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	601,096.91	0.31
H	住宿和餐饮业	--	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,220.00	0.00
J	金融业	20,813,916.20	10.91
K	房地产业	4,284,602.00	2.25
L	租赁和商务服务业	55,608.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	--	
N	水利、环境和公共设施管理业	231,211.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	--	
P	教育	--	
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.06
R	文化、体育和娱乐业	21,504.00	0.01
S	综合	--	
	合计	39,226,395.12	20.56

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

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	601166	兴业银行	167,900	2,902,991.00	1.52
2	601318	中国平安	49,500	2,680,920.00	1.40
3	600036	招商银行	93,200	2,381,260.00	1.25
4	600016	民生银行	286,500	2,297,730.00	1.20
5	601328	交通银行	250,600	1,583,792.00	0.83
6	601288	农业银行	334,900	1,279,318.00	0.67
7	601668	中国建筑	136,000	1,262,080.00	0.66
8	600000	浦发银行	97,500	1,254,825.00	0.66
9	601398	工商银行	188,200	1,129,200.00	0.59
10	000002	万科 A	41,400	1,086,750.00	0.57

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	9,993,000.00	5.24
2	央行票据	--	

3	金融债券	--
	其中：政策性金融债	--
4	企业债券	87,287,500.00 45.74
5	企业短期融资券	--
6	中期票据	20,199,000.00 10.58
7	可转债（可交换债）	83,910.80 0.04
8	同业存单	--
9	其他	--
10	合计	117,563,410.80 61.61

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	101559008	15 太阳 MTN001	100,000	10,107,000.00	5.30
2	041759001	17 京机电 CP001	100,000	10,100,000.00	5.29
3	101464041	14 复星 MTN001	100,000	10,092,000.00	5.29
4	041667016	16 富兴 CP002	100,000	10,060,000.00	5.27
5	011780002	17 盈峰 SCP002	100,000	10,059,000.00	5.27

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

本报告期末，本基金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

本报告期末，本基金未持有贵金属。

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

本报告期末，本基金未持有权证。

9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.1 本期国债期货投资政策

本报告期末，本基金未持有国债期货。

9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

9.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

10.投资组合报告附注

10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

10.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	60,441.46
2	应收证券清算款	9,589.04
3	应收股利	-
4	应收利息	2,415,019.57
5	应收申购款	400.00

- 6 其他应收款 -
- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 2,485,450.07

10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末，本基金未持有股票。

10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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预示其未来表现。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。

1、基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示：

中金丰沃 A

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	—	—
2017年6月2日（基金合同生效日）至2017年9月30日	3.10%	0.17%	3.87%	0.41%	-0.77%	-0.24%
基金合同生效日起至2017年9月30日	3.10%	0.17%	3.87%	0.41%	-0.77%	-0.24%

中金丰沃 C

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	—	—
2017年6月2日（基金合同生效日）至2017年9月30日	2.88%	0.17%	3.87%	0.41%	-0.99%	-0.24%
基金合同生效日起至2017年9月30日	2.88%	0.17%	3.87%	0.41%	-0.99%	-0.24%

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

十三、基金的费用与税收

（一）与基金有关的费用

1、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）C类基金份额的销售服务费；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金的证券、期货交易费用；
- （8）基金的银行汇划费用；
- （9）基金相关账户的开户及维护费用；
- （10）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。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(3) C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.60%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \times \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

C 类基金份额销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述一、基金费用的种类中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

(二) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(三) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》及其他有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2017 年 4 月 20 日刊登的《中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新，并

根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

- 1、在重要提示部分更新了相关内容；
- 2、在第三部分基金管理人中，对基金管理人中金基金管理有限公司的主要人员情况进行了更新；
- 3、在第四部分基金托管人部分更新了相关内容；
- 4、在第五部分相关服务机构中，增加了部分销售机构并更新了相关服务机构的内容；
- 5、在第六部分基金的募集部分中，删除了相关募集方案，增加了本基金的募集情况说明；
- 6、在第七部分基金合同的生效中，删除了基金的备案条件和募集失败内容，增加了基金合同生效日期；
- 7、在第八部分基金份额的申购与赎回中，更新了申购与赎回的数额限制；
- 8、在第九部分基金的投资中，增加了基金投资组合报告内容；
- 9、增加了第十部分基金的业绩，相关数据内容截止时间为2017年9月30日；
- 10、在第二十二部分其他应披露事项中，增加了其他应当披露的事项。

中金基金管理有限公司

2018年1月13日