

中金金序量化成长混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告出具日期：2018年11月22日

报告公告日期：2018年12月20日

1 重要提示

重要提示

中金金序量化成长混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2017]1007号文核准注册，2018年2月8日基金合同生效。本基金的基金管理人为中金基金管理有限公司，本基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《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“《运作管理办法》”）和《中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关规定，中金基金管理有限公司经与本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会，审议《关于终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并由参加大会的基金份额持有人对本次会议议案进行表决。根据2018年10月29日经公证的计票结果，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。基金管理人于2018年10月30日在指定媒介和基金管理人网站（www.ciccfund.com）上发布了《中金基金管理有限公司关于中金金序量化成长混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。

本基金自2018年10月30日起进入清算期，由基金管理人中金基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2 基金概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------------------------|-------------------|
| 基金名称 | 中金金序量化成长混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 中金金序量化成长 |
| 基金主代码 | 005355 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年2月8日 |
| 基金管理人 | 中金基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 最后运作日（2018年10月29日） 基金份额总额 | 94,994,988.39 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 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，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过量化建模的方式综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行深入分析，确定当前市场环境下的主要投资方向和资产配置比例。同时，量化模型通过持续跟踪宏观经济变量、风险预警指标等，判断不同资产类别在当前市场环境下的风险收益状态，根据市场环境变化时，动态调整投资组合结构、各类资产配置比例。</p> <p>2、量化选股策略</p> <p>本基金将通过量化建模的方式综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行深入分析，根据市场环境变化时，动态调整投资组合结构。</p> <p>本基金选股策略以量化成长多因子选股为主，充分借助基金管理人大数据量化平台的研究成果，有效整合了传统多因子研究的模型和大数据分析，根据融合的量化模型进行股票投资。本基金采用的选股策略包括多因子选股策略、风格轮动策略、行业轮动策略、动量反转量化选股策略、趋势追踪量化选股策略等。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>在债券投资方面，本基金将深入研究国民经济运行状况、货币市场及资本市</p> |

场资金供求关系，采取利率策略、信用策略、相对价值策略以及正逆回购进行杠杆操作等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

4、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。

5、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。

6、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。

7、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。

8、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。在进行权证投资时，基金管理人将对权证标的证券基本面的研究，结合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

| | |
|--------|---|
| | <p>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。</p> <p>9、中小企业私募债券的投资策略</p> <p>本基金对中小企业私募债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。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率*75%+中债综合指数收益率*25%。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，其预期的风险和预期收益高于货币市场基金、债券证券投资基金，低于股票型证券投资基金。 |

3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）

3.1 资产负债表

会计主体：中金金序量化成长混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 10 月 29 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2018 年 10 月 29 日 (基金最后运作日) |
|------------|--------------------------------------|
| 资产： | - |
| 银行存款 | 831,122.30 |
| 结算备付金 | 2,704,735.56 |
| 存出保证金 | 37,191.15 |
| 交易性金融资产 | 48,980,525.12 |
| 其中：股票投资 | 42,446,075.12 |
| 基金投资 | |
| 债券投资 | 6,534,450.00 |
| 资产支持证券投资 | |
| 贵金属投资 | |

| | |
|-------------------|--|
| 衍生金融资产 | |
| 买入返售金融资产 | 24,500,000.00 |
| 应收证券清算款 | 1,627.75 |
| 应收利息 | 144,291.55 |
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | - |
| 递延所得税资产 | - |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 77,199,493.43 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018年10月29日 (基金最后运作日) |
| 负债: | - |
| 短期借款 | - |
| 交易性金融负债 | - |
| 衍生金融负债 | - |
| 卖出回购金融资产款 | - |
| 应付证券清算款 | - |
| 应付赎回款 | 2,004.66 |
| 应付管理人报酬 | 94,948.64 |
| 应付托管费 | 15,824.76 |
| 应付销售服务费 | 54.44 |
| 应付交易费用 | 93,664.12 |
| 应交税费 | |
| 应付利息 | |
| 应付利润 | |
| 递延所得税负债 | |
| 其他负债 | 150,821.66 |
| 负债合计 | 357,318.28 |
| 所有者权益: | - |
| 实收基金 | 94,994,988.39 |
| 未分配利润 | -18,152,813.24 |
| 所有者权益合计 | 76,842,175.15 |
| 负债和所有者权益总计 | 77,199,493.43 |

注：报告截止日 2018 年 10 月 29 日(基金最后运作日)，中金金序量化成长 A 基金份额净值 0.8089 元，中金金序量化成长 C 基金份额净值 0.8073 元；基金份额总额 94,994,988.39 份，中金金序量化成长 A 基金的份额总额 94,772,291.56 份，中金金序量化成长 C 基金的份额总额 222,696.83 份。

3.2 利润表

会计主体：中金金序量化成长混合型证券投资基金

本报告期：2018年2月8日至2018年10月29日（基金最后运作日）

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年2月8日至2018年10月 29日（基金最后运作日）止期间 |
|----------------------------|---|
| 一、收入 | -22,585,786.26 |
| 1.利息收入 | 1,391,865.29 |
| 其中：存款利息收入 | 395,810.28 |
| 债券利息收入 | 144,115.88 |
| 资产支持证券利息收入 | - |
| 买入返售金融资产收入 | 851,939.13 |
| 其他利息收入 | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -17,293,338.49 |
| 其中：股票投资收益 | -18,468,112.11 |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | -6,000 |
| 资产支持证券投资收益 | - |
| 贵金属投资收益 | - |
| 衍生工具收益 | - |
| 股利收益 | 1,180,773.62 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -6,950,602.95 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 266,289.89 |
| 减：二、费用 | 2,410,696.02 |
| 1. 管理人报酬 | 1,605,490.60 |
| 2. 托管费 | 267,581.76 |
| 3. 销售服务费 | 321.77 |
| 4. 交易费用 | 380,523.62 |
| 5. 利息支出 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - |
| 6. 其他费用 | 156,778.27 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -24,996,482.28 |
| 减：所得税费用 | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -24,996,482.28 |

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

中金金序量化成长混合型证券投资基金(以下简称“中金金序量化成长”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2017年6月22日证监许可[2017]1007号《关于准予中金金

序量化成长混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金金序量化成长混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“说明书”)和《中金金序量化成长混合型证券投资基金份额发售公告》公开募集。中金金序量化成长为契约型开放式基金，存续期限为不定期。中金金序量化成长的管理人为中金基金，托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

中金金序量化成长通过中金基金直销中心、包商银行股份有限公司、北京汇成基金销售有限公司等共同发售，募集期为2017年11月21日至2018年1月31日。经向中国证监会备案，《中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)于2018年2月8日正式生效，合同生效日基金实收份额为200,328,909.09份，发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据经中国证监会备案的《基金合同》和说明书的相关内容，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时，收取认购/申购费用，但从本类别基金资产中不计提销售服务费的，称为A类基金份额；不收取认购/申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

中金金序量化成长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)。

根据《基金合同》和说明书的规定以及中金基金发布的《中金基金管理有限公司关于中金金序量化成长混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》，中金金序量化成长自2018年10月29日基金份额持有人大会决议生效后的下一个工作日起(即2018年10月30日)进入清算程序。中金基金和中国建设银行按照《基金合同》的规定对中金金序量化成长进行终止清算，清算工作于2018年11月9日完成。中金金序量化成长的清算期间为自2018年10月30日(“清算起始日”)开始至2018年11月9日(“清算结束日”)止期间。

4.2 清算原因

随着市场环境变化，为更好的维护基金份额持有人利益，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，本公司拟终止中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同。

4.3 清算起始日

根据生效的本基金基金份额持有人大会决议，本基金于 2018 年 10 月 30 日起进入清算期，清算期为 2018 年 10 月 30 日至 2018 年 11 月 9 日。

4.4 清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

5 清算情况

自 2018 年 10 月 29 日至 2018 年 11 月 9 日清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 清算费用

按照《中金金序量化成长混合型证券投资基金基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用由基金管理人代为支付。

5.2 资产处置情况

(1) 银行存款、备付金、保证金及应收款项资产处置情况

| 序号 | 项目 | 运作终止日 账面价值 | 清算金额 | 清算期期末 账面价值 |
|----|---------|---------------|---------------|---------------|
| 1 | 银行存款 | 831,122.30 | 77,130,992.98 | 77,962,115.28 |
| 2 | 结算备付金（注 | 2,704,735.56 | -110,452.40 | 2,594,283.16 |

| | | | | |
|---|-------------|-----------|-----------|-----------|
| | 1) | | | |
| 3 | 存出保证金（注1） | 37,191.15 | 6,065.69 | 43,256.84 |
| 4 | 应收证券清算款 | 1627.75 | -1,627.75 | 0.00 |
| 5 | 应收利息（注1, 2） | 4949.36 | 14,509.58 | 19,458.94 |

注1：结算备付金、存出保证金、应收利息由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

注2：应收利息不含应收债券利息和应收买入返售金融资产利息。

（2）金融资产处置情况

| 序号 | 项目 | 运作终止日 账面价值 (注1) | 运作终止日 数量 (股/份/张) | 清算期 内最后 处置日 | 清算金额 | 清算期期 末账面价 值 (注2) | 清算期 期末数 量(股 /份/张) |
|----|--------------|-----------------------|------------------------|-------------------|---------------|---------------------------|----------------------------|
| 1 | 股票投资 | 42,446,075.12 | 2,890,152.00 | 2018/11/8 | 46,146,996.41 | 0.00 | 0.00 |
| 2 | 债券投资 | 6,673,792.19 | 65,000.00 | 2018/10/31 | 6,669,931.83 | 0.00 | 0.00 |
| 3 | 买入返售 金融资产 | 24,500, 000.00 | - | 2018/10/30 | 24,501,634.45 | 0.00 | 0.00 |

注1：债券投资和买入返售金融资产运作终止日公允价值包含相应的应收利息。

注2：债券投资和买入返售金融清算期期末公允价值包含相应的应收利息。

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 2,004.66 元，该款项已于 2018 年 10 月 31 日支付完毕。

(2) 本基金最后运作日应付管理费为人民币 94,948.64 元，该款项已于 2018 年 11 月 5 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 15,824.76 元，该款项已于 2018 年 11 月 5 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 54.44 元，该款项已于 2018 年 11 月 5 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 93,664.12 元。其中应付佣金为 93,664.12 元，于 2018 年 11 月 2 日支付 122,265.70 元，剩余 5,187.57 元于 2018 年 11 月 12 日支付完毕。

(6) 本基金最后运作日其他负债人民币 150,821.66 元，该款项为预提信息披露费和审计费，

将由基金管理人在清算款划出前扣除。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年10月30日(基金清算起始日)至2018年 11月9日(基金清算结束日)止期间 |
|----------------------------|---|
| 一、资产处置损益 | 3,706,356.06 |
| 1.利息收入 | 17,490.34 |
| 其中：存款利息收入 | 14,509.58 |
| 债券利息收入 | 1,346.31 |
| 买入返售金融资产收入 | 1,634.45 |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -3,261,751.94 |
| 其中：股票投资收益 | -3,178,591.94 |
| 债券投资收益 | -26,000.00 |
| 股利收益 | -57,160.00 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6,950,602.95 |
| 4.其他收入（损失以“-”号填列） | 14.71 |
| 二、清算费用 | 50,503.96 |
| 1.交易费用 | 84,085.54 |
| 2.其他费用 | -33,581.58 |
| 三、清算净损益（净亏损以“-”号填列） | 3,655,852.10 |

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位：人民币元

| 项目 | 金额 |
|-------------------------------------|----------------------|
| 一、最后运作日2018年10月29日基金净资产 | 76,842,175.15 |
| 加：清算期间净收益 | 3,655,852.10 |
| 减：基金净赎回金额（于2018年10月30日确认的投资者申购赎回申请） | 980.68 |
| 二、2018年11月9日基金净资产 | 80,497,046.57 |

资产处置及负债清偿后，于2018年11月9日本基金剩余财产为人民币80,497,046.57元，根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算期结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息归份额持有人所有。于清算划款日的应收利息余额由基金管理人以自有资金先行垫付，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。除清算划款产生的

银行汇划费从基金资产中支付外，其他与本次清算相关产生的银行汇划费由基金管理人承担。

由于截止2018年11月9日的基金净资产中包含了备付金、保证金、应收利息等，将在划付本次清算金额（含费用）后对基金剩余财产进行后续清算，直至全部基金财产清算完毕。

5.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- （1）中金金序量化成长混合型证券投资基金资产负债表及审计报告
- （2）《中金金序量化成长混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

中金金序量化成长混合型证券投资基金财产清算小组

二〇一八年十二月二十日