

中融量化多因子混合型发起式证券投资基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2018年03月30日

重要提示
基金管理人承诺:不从事任何有损基金持有人利益的行为,不从事任何有损基金资产的行为...

基金概况
基金名称:中融量化多因子混合型发起式证券投资基金
基金简称:中融量化多因子混合
基金代码:004065

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2016年12月29日
基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额:50,157,413.49份
基金合同存续期限:不定期

基金投资目标:本基金通过多因子量化选股模型,精选具有超额收益的股票组合进行投资...

投资策略
1.资产配置策略
2.股票投资策略
3.债券投资策略
4.衍生品投资策略

业绩比较基准:中证500指数收益率*95%+同期银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征:本基金为混合型股票基金,理论上长期来看,其预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币型基金。

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
姓名:袁芸
孟波
联系电话:010-56517128, 010-83574679

3.2 基金投资分析
基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

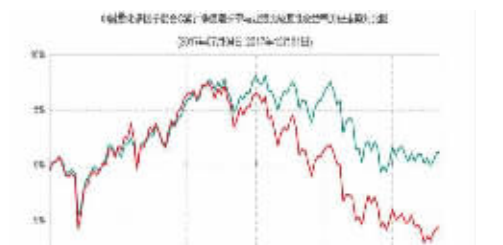


图1:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

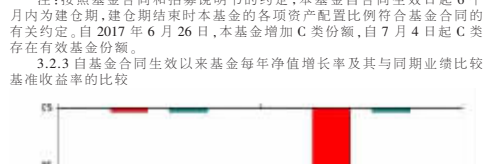


图2:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较



图3:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较



图4:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

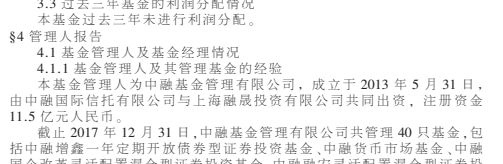


图5:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

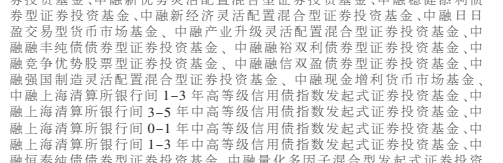


图6:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

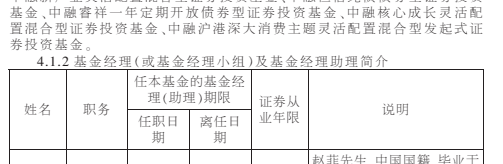


图7:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较



图8:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

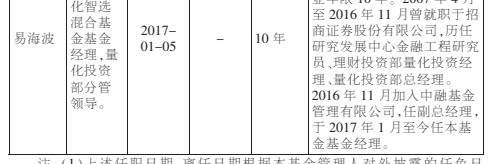


图9:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

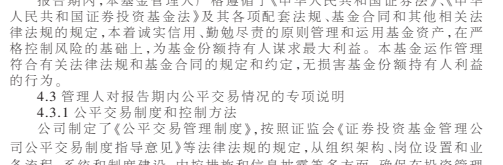


图10:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

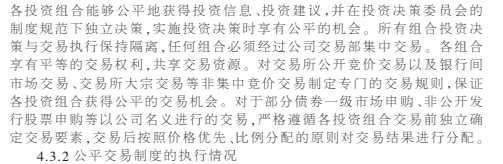


图11:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

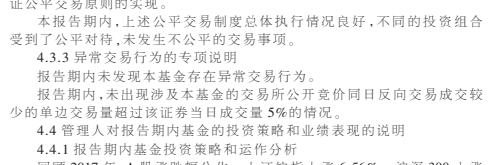


图12:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

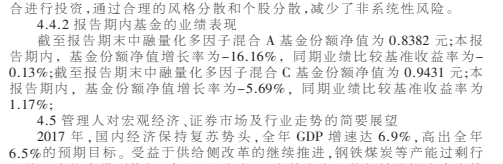


图13:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

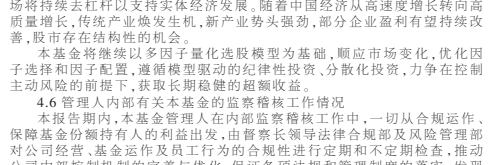


图14:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

图15:基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

内部控制制度的适时性、全面性和合法性,并加强内部监督,将风险意识贯穿于各岗位及各业务环节。

2.日常监督和专项监督相结合,通过定期和不定期专项检查、专项调查等工作方法,加强对基金日常业务的合规审核和合规培训,并加强对重要业务和关键业务环节的监督和风险控制。

3.规范基金销售业务,保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中,严格执行基金销售业务,按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法律法规制定审查和推材料,逐步落实反洗钱法律法规要求,并开展投资者教育。

4.规范基金投资管理,保证基金投资管理工作的合法合规性。公司制定了严格的基金投资管理流程和决策机制,以投资决策委员会为最高投资决策机构,投资决策委员会按照基金合同及基金管理人内部的基金投资管理流程,对基金投资管理工作的合法合规性进行审核。

5.以外部审计、内部审计等多种手段加强对基金投资管理工作的监督和风险控制,及时向公司传递基金相关的法律法规;加强了员工行为的监督和培训,从源头上防止不合规风险,防范利益冲突。公司自成立以来,各项业务运作正常,内部控制和风险防范措施逐步完善并有效执行,内部控制体系持续优化,风险防范措施逐步完善并有效执行。

6.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

7.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

8.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

9.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

10.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

11.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

12.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

13.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

14.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

15.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

16.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

17.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

18.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

19.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

20.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

21.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

22.基金管理人建立了估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部、法律合规部等部门组成,负责审核和监督基金估值业务,基金管理人估值委员会成员具有专业胜任能力和相关工作经验。

报告截止日期:2017年12月31日
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

报告截止日期:2017年12月31日
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.

资产负债表
单位:人民币元

Table showing financial data for 2017 and 2016, including assets, liabilities, and equity.