

# 国金沪深 300 指数分级证券投资基金 招募说明书（更新）摘要

2017 年第 1 号

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

二〇一七年三月

## 重要提示

国金沪深 300 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）募集申请已于 2013 年 5 月 24 日获中国证监会证监许可[2013]694 号文核准，本基金的基金合同于 2013 年 7 月 26 日正式生效。

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

基金管理人建议基金投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资人在认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

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。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 1 月 26 日，有关财务数据和净值表现数据截止日为 2016 年 12 月 31 日

## 一、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

住所：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6

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

联系人：张丽

联系电话：010-88005888

注册资本：2.8 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 2.8 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

#### 1、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分析师、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、上海国金通用财富资产管理有限公司执行董事、中国证券业协会证券公司专业评价专家、四川证券业协会创新咨询委员会主任委员。2011 年 11 月至今任国金通用基金管理有限公司（2015 年 7 月起更名为“国金基金管理有限公司”）董事长。

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。现任国金证

券股份有限公司董事、总经理、国金期货有限责任公司董事、国金创新投资有限公司董事及国金鼎兴投资有限公司投资委员会委员。

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。2008 年至今任苏州工业园区资产管理有限公司董事长。

宁远喜先生，董事，硕士。历任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、董事会秘书。现任广东宝丽华新能源股份有限公司董事长、十一届全国人大代表、广东上市公司协会会长。

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。

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，国金通用基金管理有限公司筹备组拟任督察长，国金通用基金管理有限公司督察长。2012 年 7 月至今任国金通用基金管理有限公司（2015 年 7 月起更名为“国金基金管理有限公司”）总经理。

肖昌秀女士，独立董事，高级经济师。历任中国人民银行四川省分行信贷处科员，中国农业银行总行企业信贷局科员，中央财金学院科员，北京中医学院科员，中国人民银行总行信贷局科员、副处长，中国工商银行总行信贷部副主任、主任，中国工商银行总行纪委书记。现已退休。

张克东先生，独立董事，学士，注册会计师。历任中国国际经济咨询公司（中信会计师事务所）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。2001 年至今任信永中和会计师事务所副总经理、合伙人。

鲍卉芳女士，独立董事，法学硕士，律师。曾任职于最高人民检察院法纪厅，2003 年 5 月至今任北京市康达律师事务所律师。

## 2、监事会成员

张宝全先生，监事会主席，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。2015 年 9 月至今任苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司总裁助理。

刘兴旺先生，监事，硕士，经济师。历任广发证券股份有限公司投资银行部项目经理、高级经理，广发证券股份有限公司总裁秘书，广发证券股份有限公司投资自营部投资经理，香江投资有限公司总裁助理，香江投资有限公司副总裁，广东宝丽华新能源股份有限公司投资管理总监、宝新能源投资有限公司董事、副总经理；2007 年 10 月至今任广东宝丽华新能源股份有限公司投资管理总监、宝新能源投资有限公司董事、副总经理。

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、国金通用基金管理有限公司（2015 年 7 月起更名为“国金基金管理有限公司”）筹备组综合管理部总经理助理兼人力资本经理、综合管理部总经理、运营支持部总经理、运营总监兼运营支持部总经理，2014 年 12 月至今任北京千石创富资本管理有限公司监事会主席、2015 年 12 月至今任国金基金管理有限公司总经理助理兼运营总监、运营支持部总经理。

徐炜瑜先生，职工代表监事，硕士，通过国家统一司法考试。历任联想（北京）有限公司法律顾问、北京竞天公诚律师事务所专职律师等职。2012 年 11 月加入国金通用基金管理有限公司（2015 年 7 月起更名为“国金基金管理有限公司”），历任综合管理部高管秘书、监察稽核部总经理助理，2014 年 11 月至今任职于国金基金管理有限公司合规风控部。

### 3、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。

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、总经理助理等职。2016 年 5 月加入国金基金管理有限公司，任总经理助理；2016 年 8 月起担任固定收益投资总监兼上海资管事业部总经理；

2016 年 12 月至今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。

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、国金通用基金管理有限公司（2015 年 7 月起更名为“国金基金管理有限公司”）筹备组监察稽核部法律顾问、国金通用基金管理有限公司监察稽核部法律顾问、国金通用基金管理有限公司监察稽核部副总经理兼法律顾问、国金通用基金管理有限公司监察稽核部总经理。2014 年 7 月至今任国金基金管理有限公司督察长。

#### 4、基金经理

宫雪女士，博士，毕业于中国科学院数学与系统科学研究院，管理科学与工程专业。2008 年 7 月至 2011 年 11 月在博时基金管理有限公司股票投资部工作，任产业分析师。2012 年 2 月加盟国金通用基金管理有限公司（2015 年 7 月起更名为“国金基金管理有限公司”），历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理，2016 年 4 月至今任量化投资事业三部总经理，目前同时兼任国金上证 50 指数分级证券投资基金、国金鑫安保本混合型证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员名单

截至本招募说明书更新公布之日，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，基金交易部总经理詹毛毛先生，量化研究总监林健武先生，基金经理宫雪女士，基金经理徐艳芳女士，基金经理滕祖光先生，基金经理李安心先生，固定收益投资部信用研究主管。

#### 6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

##### （三）基金管理人的职责

1、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。

2、办理本基金备案手续。

3、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。

4、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。

- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告。
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格。
- 8、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。
- 9、召集基金份额持有人大会。
- 10、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。
- 11、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。
- 12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### (四) 基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《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《证券法》行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事违反《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) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

4、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) 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。
- (9) 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。
- (10) 贬损同行，以提高自己。
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分。
- (12) 以不正当手段谋求业务发展。
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象。
- (14) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 5、基金经理承诺

- (1) 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。
- (2) 不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益。
- (3) 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。
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。
- (五) 基金管理人的内部控制制度

#### 1、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。



## 2、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，合规风控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。

## 3、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。

#### 4、基金管理人关于内部合规控制声明书

(1) 本基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

(2) 本基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

## 二、基金托管人

### (一) 基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司（简称“中国光大银行”）

住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

成立时间：1992 年 8 月 18 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：404.3479 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[2002]75 号

联系人：张建春

电话：010-63639180

传真：010-63639132

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

### (二) 主要人员情况

法定代表人唐双宁先生，历任中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长、中国人民银行沈阳市分行行长，中国人民银行信贷管理司司长、货币金银局局长、银行监管一司司长，中国银行业监督管理委员会副主席，中国光大（集团）总公司董事长、党委书记等职务。现任十二届全国人大农业与农村委员会副主任，十一届全国政协委员，中国光大集团股份公司董事长、党委书记，中国光大集团有限公司董事长，兼任中国光大银行股份有限公司董事长、党委书记，中国光大控股有限公司董事局主席，中国光大国际有限公司董事局主席。

行长张金良先生，曾任中国银行财会部会计制度处副处长、处长、副总经理兼任 IT 蓝图实施办公室主任、总经理，中国银行北京市分行行长、党委书记，中国银行副行长、党委委员。现任中国光大集团股份公司党委委员，兼任中国光大银行行长、党委副书记。

曾闻学先生，曾任中国光大银行办公室副总经理，中国光大银行北京分行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资托管部总经理。

### 三、证券投资基金托管情况

截至 2016 年 6 月 30 日,中国光大银行股份有限公司托管国投瑞银创新动力股票型证券投资基金、国投瑞银景气行业证券投资基金、国投瑞银融华债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)、摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、博时转债增强债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成货币市场基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金、泰信先行策略开放式证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)、国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、兴业商业模式优选股票型证券投资基金、工银瑞信保本 2 号混合型发起式证券投资基金、国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金、中加货币市场基金、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、鑫元一年定期开放债券型证券投资基金、江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、泓德优选成长混合型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、中融新动力灵活配置混合型证券投资基金、红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、财通多策略精选混合型证券投资基金、鹏华添利宝货币市场基金、江信同福灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、南方弘利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元兴利债券型证券投资基金、博时安泰 18 个月定期开放债券型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投

资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、中欧强盈定期开放债券型证券投资基金、华夏恒利 6 个月定期开放债券型证券投资基金、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金、博时安怡 6 个月定期开放债券型证券投资基金、江信汇福定期开放债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、鹏华兴华定期开放灵活配置混合型证券投资基金共 64 只证券投资基金，托管基金资产规模 1,381.42 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）基金托管人的内部控制制度

### 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。投资托管部建立了严密的内控督察体系，设有风险管理处，通过“全员全程”风险控制体系，加强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托管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》等法律、法规的要求，并根据相关法律法规制订、完善了四十余项规章制度和实施细则，逐年重检，将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行股份有限公司投资托管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、交易监督）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）基金托管人对基金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。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

##### 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。投资托管部建立了严密的内控督察体系，设有风险管理处，通过“全员全程”风险控制体系，加强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托管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》等法律、法规的要求，并根据相关法律法规制订、完善了四十余项规章制度和实施细则，逐年重检，将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行股份有限公司投资托管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、交易监督）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。

#### (五) 基金托管人对基金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行为违反法律、行政法规和其他有关规定，

---

或者违反基金合同约定的，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。



### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额发售机构

##### 1、场外发售机构

###### (1) 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

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

公司网站：[www.gfund.com](http://www.gfund.com)

###### 2) 国金基金网上直销系统

交易系统网址：<https://trade.gfund.com>

目前支持的网上直销支付渠道：建行卡、工行卡、天天盈、通联支付

客户服务电话：4000-2000-18

客户服务信箱：service@gfund.com

###### (2) 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：唐双宁

联系人：朱红

电话：010-63636153

客服电话：95595

网址：[www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

###### 2) 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、贾鹏

电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

客服电话：95310

网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

3) 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](http://www.chinastock.com.cn)

4) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：魏明

电话：010-85130588

客服电话：4008-888-108

公司网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

5) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

客户服务电话：95565，4008-888-111

网址: [www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

6) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人: 王东明

联系人: 侯艳红

电话: 010-60838995

客服电话: 95548

网址: [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

7) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人: 杨德红

联系人: 芮敏祺

电话: 021-38676666

客服电话: 95521

公司网址: [www.gtja.com](http://www.gtja.com)

8) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市淮海中路 98 号

办公地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人: 王开国

联系人: 李笑鸣

电话: 021-23219000

客服电话: 95553 或拨打各城市营业网点咨询电话。

网址: [www.htsec.com](http://www.htsec.com)

9) 信达证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人: 高冠江

联系人：唐静

电话：010-63080985

客服电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

10) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

11) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

客服电话：95548

网址：www.citicssd.com

12) 华创证券有限责任公司

注册地址：贵州省贵阳市中华北路 216 号华创大厦

办公地址：贵州省贵阳市中华北路 216 号华创大厦

法定代表人：陶永泽

联系人：赵瑾

电话：0851-8652599

客服电话：400-866-6699

网址：www.hczq.com

13) 申万宏源证券有限公司

注册地址:上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址:上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层(邮编:200031)

法定代表人:李梅

客服电话:95523 或 4008895523

网址:www.swhysc.com

14)申万宏源西部证券有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

办公地址:北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人:许建平

客服电话:4008-000-562

网址:www.hysec.com

15)中泰证券股份有限公司

注册地址:济南市经七路 86 号

办公地址:济南市经七路 86 号

法定代表人:李玮

客服电话:95538

网址:www.zts.com.cn

16)中山证券有限责任公司

注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址:深圳市华侨城深南大道 9010 号

法定代表人:黄扬录

客服电话:400-102-2011

网址:www.zszq.com.cn

17)中国国际金融股份有限公司

注册地址: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

邮政编码:100004

法定代表人:丁学东

联系人:杨涵宇

电话：010-65051166

客服电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com.cn

18)平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

客服电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

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

19)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

20)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

21)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：4000-888-6661

网址：www.myfund.com

22) 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

23) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：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

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

24) 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：400-059-8888

网址：www.zscffund.com

25) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

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

26) 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

27) 北京钱景财富投资管理有限公司

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

联系人：车茜茜

电话：010-56183769

客服电话：400-678-5095

网址：www.niuji.net

28) 中信建投期货有限公司

注册地址：重庆渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B

办公地址：重庆市渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼

法定代表人：彭文德



客服电话：400-8877-780 023-63600049

网址：[www.cfc108.com](http://www.cfc108.com)

29) 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](http://www.leadfund.com.cn)

30) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

邮政编码：200010

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

电话：021-33323999

客服电话：400-820-2819

网址：<https://tty.chinapnr.com/>

31) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层  
4609-10 单元

邮政编码：200120

法定代表人：赵学军

联系人：余永键

电话：010-85097570

客服电话：400-021-8850

网址：[www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

32) 珠海盈米财富管理有限公司

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

33) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层

1303-1305 室、14 层

邮政编码：518048

法定代表人：张磊

客服电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

34) 上海陆金所资产管理有限公司

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

35) 浙江金观诚财富管理有限公司

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

36) 大泰金石投资管理有限公司

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

37) 上海联泰资产管理有限公司

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：4000-466-788

网址：www.66zichan.com

38) 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

39) 深圳富济财富管理有限公司

公司地址：深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒大厦二期 418 室

邮政编码：528057

法人代表：刘鹏宇

联系人：刘勇

电话：0755-83999907

网址：www.jinqianwo.cn

40) 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.lingxianfund.com

41)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：4006-411-999

网址：www.taichengcaifu.com

42)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

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：陈珍珍

电话：010-59336529

客服电话：400-890-9998

网址：www.jnlc.com

45) 奕丰金融服务（深圳）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：0755-8946 0500

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 A 座 1108 室

邮政编码：110190

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：18001102931

客服电话：400-619-9059

网址：www.fundzone.cn

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：吴翠

电话：010-62676405

客服电话：010-62675369

网址：[www.xincai.com](http://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.dianyingfund.com](http://www.dianyingfund.com)

49)一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街 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](http://www.yilucaifu.com)

50)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： 何昶

电话： 021-20691922

客服电话： 4008202899

网址： [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

51)和耕传承基金销售有限公司

注册地址： 郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层

邮政编码： 450000

法定代表人： 李淑慧

联系人： 罗聪

电话： 0371-55213196

传真： 0371-85518397

客服电话： 4000-555-671

网址： <http://www.hgccpb.com>

52)北京懒猫金融信息服务有限公司

注册地址： 北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119

邮政编码： 100124

法定代表人： 许现良

联系人： 李雪

电话： 010-58527835

客服电话： 4001-500-882

网址： [www.lanmao.com](http://www.lanmao.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  
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](http://www.gomefund.com)

54) 深圳盈信基金销售有限公司

注册地址: 深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1

邮政编码: 518000

法定代表人: 苗宏升

联系人: 王清臣

电话: 0411-6688-9822

客服电话: 4007-903-688

网址: [www.fundying.com](http://www.fundying.com)

55) 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](http://danjuanapp.com)

56) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

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>

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。

2、场内发售机构



本基金的场内发售机构为具有基金销售资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单可在深圳证券交易所网站查询)。

(二) 注册登记机构

注册登记机构:

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

住所: 北京西城区太平桥大街 17 号

办公地址: 北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人: 周明

电话: (010) 50938856

传真: (010) 50938991

(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

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: 汤骏、王珊珊

联系电话: 010-58152145

传真: 010-58114645

## 四、基金的名称

本基金名称：国金沪深 300 指数分级证券投资基金。

## 五、基金的类型

本基金类型：股票型基金。

## 六、基金的投资目标

本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪沪深 300 指数,在严格控制基金的日均跟踪误差偏离度和年跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相似的投资收益。

## 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,包括沪深 300 指数的成份股、备选成份股(包括中小板、创业板及其它中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、债券回购、资产支持证券、权证、股指期货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)。

本基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%,其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 85%;每个交易日日终在扣除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 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。

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。

本基金可以根据届时有有效的有关法律法规和政策的规定,在履行适当的程序之后,进行融资融券。

## 八、基金的投资策略

本基金采用指数完全复制方法，按照标的指数成份股及权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复制指数的目的，力争保持日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如遇特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整，并运用股指期货等金融衍生工具，以实现跟踪误差的有效控制。

### 1、投资组合的构建

本基金采用指数完全复制方法构建基金的股票投资组合，即根据个股在标的指数中相应的权重构建基金的指数化股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。

### 2、组合的调整

#### 1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和对备选股的预期，对股票投资组合及时进行调整。

#### 2) 不定期调整

①当标的指数成份股发生包括股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等事件时，基金将根据指数公司的指数修正公告对投资组合进行相应调整。

②当成份股发生重大变化时（收购合并、分拆、退市等），基金将根据指数公司的临时调整公告对投资组合进行相应调整。

③根据本基金的申购赎回情况，对基金的股票投资组合进行调整，以实现对标指数的有效跟踪。

④因成份股流动性不足、停牌等市场因素影响或法律法规及基金合同限制，基金无法购得相应足够数量的股票时，基金将搭配使用其他合理方法对相应股票进行合理替代并对投资组合进行相应调整。

⑤在其他影响本基金复制并跟踪标的指数的情况下，本基金管理人可根据市场情况，在以跟踪误差最小化的前提下，对基金的投资组合进行合理调整。

⑥如法律法规对指数型基金投资比例的规定进行调整,本基金将在履行适当程序后,对本基金的投资组合进行调整,无需召开持有人大会。

### 3、股票的替代

在建仓阶段和基金后续运作过程中,如遇到特殊情况(如:市场流动性不足、成份股被限制投资等)导致基金无法购得足够数量的股票时,基金管理人将根据市场情况以跟踪误差最小化为原则,以行业、规模、历史表现相似度为标准,采用合理的方法进行适当调整和替代。

### 4、股指期货投资策略

本基金将适度运用股指期货,对本基金投资组合的跟踪效果进行调整及优化,以提高投资效率,控制基金投资组合风险并更好的实现本基金的投资目标。具体来说,本基金将运用股指期货来控制预期大额申购赎回等情况下的流动性风险,有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距,确保投资组合对指数跟踪的效果。本基金管理人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,不得应用于投机交易目的,或用作杠杆工具放大基金的投资。

### 5、跟踪误差的监控与管理

跟踪误差的管理将作为本基金主要的风险控制手段之一,基金经理及风险控制部门将每日跟踪投资组合与标的指数投资回报率之间的偏离度。月末、季末定期对基金投资组合与标的指数收益率间的累积偏离程度进行归因分析,并对控制跟踪误差提出解决方案。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为中证指数有限公司发布的沪深 300 指数。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率（税后）}$

沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由中证指数公司编制和维护，是在上海和深圳证券交易所中选取 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。关于指数值和成份股名单的所有版权归属中证指数有限公司。

如果法律法规发生变化，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，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时，基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，经基金管理人和基金托管人协商一致，可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准，并及时按照《信息披露办法》的规定公告，而无需召开基金份额持有人大会。



## 十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，国金沪深 300A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；国金沪深 300B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

## 十一、基金的投资组合报告<sup>1</sup>

### (一) 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	27,064,947.20	90.16
	其中:股票	27,064,947.20	90.16
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	-	-
	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	2,517,952.32	8.39
8	其他资产	436,970.83	1.46
9	合计	30,019,870.35	100.00

### (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 1、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	79,958.56	0.27
B	采矿业	941,163.76	3.20
C	制造业	8,824,512.38	29.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	737,995.10	2.51
E	建筑业	1,228,051.02	4.17
F	批发和零售业	589,140.89	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	783,213.14	2.66
H	住宿和餐饮业	14,730.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,769,522.61	6.01
J	金融业	9,610,883.13	32.65
K	房地产业	1,432,073.23	4.87
L	租赁和商务服务业	310,548.90	1.06

<sup>1</sup>本招募说明书摘要(更新)中,“基金的投资组合报告”部分所述的“报告期”指2016年10月1日至2016年12月31日,“报告期末”指2016年12月31日。

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	212,264.01	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	35,670.70	0.12
R	文化、体育和娱乐业	368,901.15	1.25
S	综合	126,318.62	0.43
	合计	27,064,947.20	91.96

注：以上行业分类以 2016 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

## 2、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

## 3、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

## (三) 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

### 1、报告期末指数投资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	601318	中国平安	31,872	1,129,224.96	3.84
2	601166	兴业银行	39,332	634,818.48	2.16
3	600016	民生银行	69,693	632,812.44	2.15
4	600036	招商银行	30,382	534,723.20	1.82
5	600519	贵州茅台	1,441	481,510.15	1.64
6	601328	交通银行	80,903	466,810.31	1.59
7	600000	浦发银行	25,463	412,755.23	1.40
8	000002	万科A	20,051	412,048.05	1.40
9	601668	中国建筑	44,161	391,266.46	1.33
10	600837	海通证券	23,819	375,149.25	1.27

### 2、报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股 票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## (四) 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。

(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资  
 明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持  
 证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七)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

本基金本报告期末未持有贵金属。

(八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资  
 明细

本基金本报告期末未持有权证。

(九) 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
IF1701	IF1701	2	1,975,200.00	-47,400.00	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)					-47,400.00
股指期货投资本期收益(元)					127,740.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-54,960.00

#### 2、本基金投资股指期货的投资政策

报告期,本基金运用股指期货来控制预期大额申购赎回等情况下的流动性风险,有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距,确保投资组合对指数跟踪的效果。

## (十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## (十一) 投资组合报告附注

(1) 本期基金投资组合前十名证券的发行主体中海通证券(600837.SH)于2016年11月28日,发布公告称收到中国证监会《行政处罚决定书》([2016]127号),其中提及:中国证监会对海通证券未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为进行了立案调查、审理,该案现已调查、审理终结。中国证监会对海通证券责令改正,给予警告,没收违法所得28,653,000元,并处以85,959,000元罚款。

由于海通证券(600837.SH)是沪深300指数的成份股,故将其纳入本基金的投资组合。

(2) 本期基金投资组合前十名股票未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	435,989.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	485.70
5	应收申购款	495.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	436,970.83

## (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可转换债券。

## (5) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## (6) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通限售情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## (7) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## 十二、基金的业绩<sup>2</sup>

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。

### (一) 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期( 2016 年 10 月 1 日 — 2016 年 12 月 31 日 )
1. 本期已实现收益	-529,903.00
2. 本期利润	368,451.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0107
4. 期末基金资产净值	29,431,888.96
5. 期末基金份额净值	0.8668

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### (二) 基金净值表现

#### 1、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

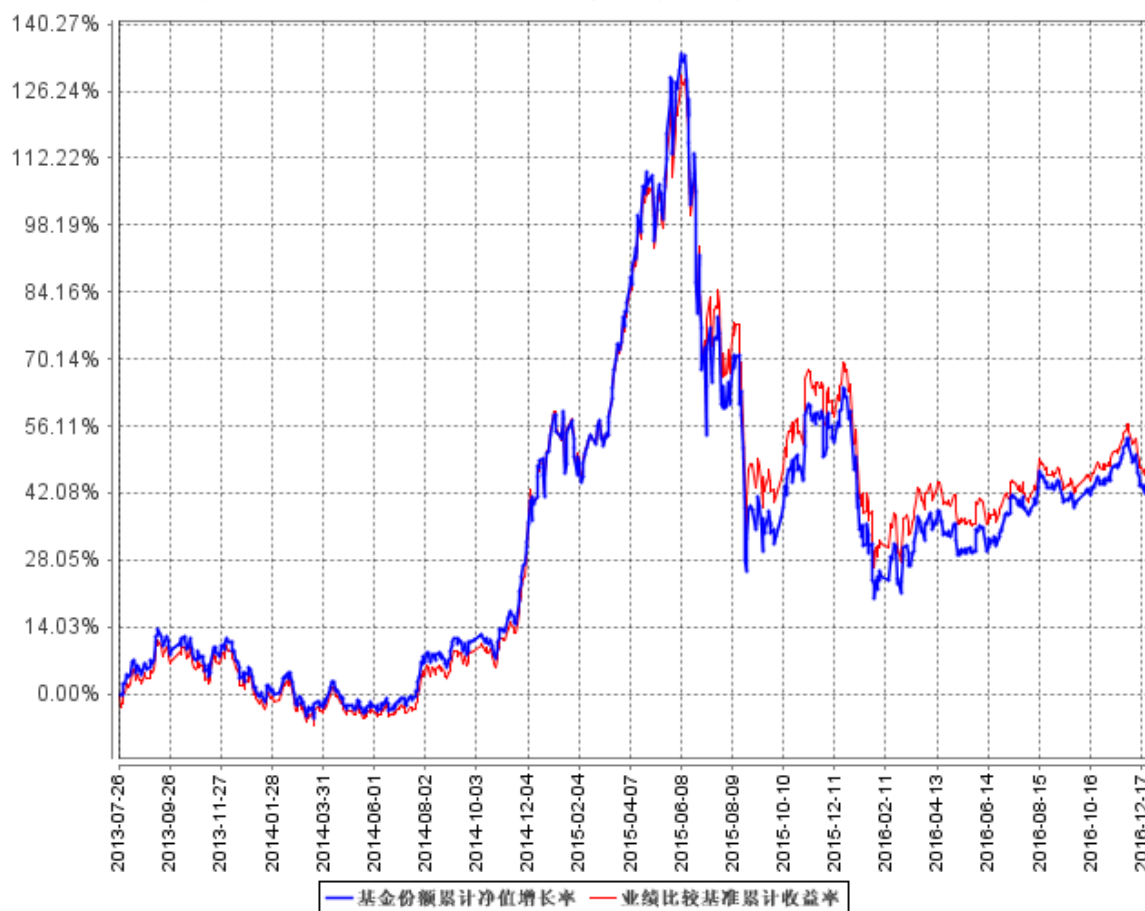
阶段	净值增长率 ①	净值增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②- ④
过去三个月	1.12%	0.71%	1.67%	0.67%	-0.55%	0.04%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%

2、自基金合同生效以来基金份额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：

<sup>2</sup>本招募说明书摘要（更新）中，“基金的业绩”部分所述的“报告期”指 2016 年 10 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日，“报告期末”指 2016 年 12 月 31 日。

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2013 年 7 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日。

## 十三、费用概览

### (一) 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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用。
- 4、基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费。
- 5、基金份额持有人大会费用。
- 6、基金的证券交易费用。
- 7、基金的开户费用、账户维护费用。
- 8、基金上市费用。
- 9、基金合同生效以后的标的指数使用许可费。
- 10、基金的银行汇划费用。
- 11、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。



## 十四、对招募说明书更新部分的说明

国金沪深 300 指数分级证券投资基金（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》、《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 2016 年 9 月 11 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“十三、基金的投资”中相关内容。
- （六）更新了“十四、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

二零一七年三月九十一日