

**中金中证优选 300 指数证券投资基金  
(LOF)  
A 类份额、C 类份额上市交易公告书**

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

登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2018 年 9 月 25 日

公告日期：2018 年 9 月 18 日

## 目 录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览.....	3
三、基金的募集与上市交易.....	4
四、持有人户数、持有人结构及前十大持有人.....	7
五、基金主要当事人简介.....	9
六、基金合同摘要.....	13
七、基金财务状况.....	38
八、基金投资组合.....	40
九、重大事件揭示.....	44
十、基金管理人承诺.....	44
十一、基金托管人承诺.....	45
十二、备查文件目录.....	45

## 一、重要声明与提示

《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）A 类份额、C 类份额上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）基金管理人中金基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2018 年 7 月 18 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及中金基金管理有限公司网站（[www.ciccfund.com](http://www.ciccfund.com)）上的《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。

## 二、基金概览

### （一）基金名称和基金代码

基金名称：中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）

基金简称：中金中证优选 300 指数（LOF）

A类基金份额（场内简称：金选 300A，基金代码：501060）

C类基金份额（场内简称：金选 300C，基金代码：501061）

## （二）基金份额总额

截至 2018 年 9 月 14 日，本基金份额总额为 274,597,597.22 份。其中，A 类份额 196,888,672.87 份，C 类份额 77,708,924.35 份。

## （三）基金份额净值

截至 2018 年 9 月 14 日，本基金 A 类份额净值为 0.9968 元，C 类份额净值为 0.9967 元。

## （四）本次上市交易份额

截至 2018 年 9 月 14 日，本次上市交易份额为 A 类份额 108,612,767.00 份，C 类份额 23,590,244.00 份。

## （五）上市交易的证券交易所

上海证券交易所

## （六）上市交易日期

2018 年 9 月 25 日

## （七）基金管理人

中金基金管理有限公司

**(八) 基金托管人**

中国建设银行股份有限公司

**(九) 登记结算机构**

中国证券登记结算有限责任公司

**三、基金的募集与上市交易**

**(一) 本基金募集情况**

1、基金募集申请的注册机构和准予注册文号

中国证券监督管理委员会证监许可[2018]722号

2、基金合同生效日

2018年8月30日

3、基金运作方式

上市契约型开放式（LOF）

4、基金合同期限

不定期

5、发售日期

2018年7月23日至2018年8月23日

6、发售价格

人民币1.00元

7、发售方式

场外、场内两种方式发售

8、发售机构

(1) 场外销售机构

直销机构：中金基金管理有限公司直销柜台、中金基金管理有限公司网上直销系统（www.ciccfund.com）

其他场外销售机构：中国中投证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、上海好买基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、上海挖财基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、北京肯特瑞基金销售有限公司。

## （2）场内销售机构

本基金办理场内认购、申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员。具体会员单位名单可在上海证券交易所网站查询。

## 9、验资机构名称

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

## 10、募集资金总额及入账情况

本次募集有效认购总户数为 2679 户，募集总金额为 274,597,920.52 元（包括募集资金在募集期间产生的利息共计 64,165.70 元）。其中，本基金 A 类份额场外认购的基金份额确认为 88,275,905.87 份（含场外募集期利息结转的份额 24,312.67 份）；场内认购的基金份额确认为 108,612,767.00 份（含场内募集期利息结转的份额 23,225.00 份）；C 类场外认购的基金份额确认为

54,118,680.35 份（含场外募集期利息结转的份额 11,181.73 份），场内认购的基金份额确认为 23,590,244.00 份（含场内募集期利息结转的份额 5,123.00 份）。

11、本基金募集备案情况

本基金于 2018 年 8 月 28 日验资完毕，并于当日向中国证监会办理基金备案手续。

12、基金合同生效日

2018 年 8 月 30 日。

13、基金合同生效日的基金份额总额

274,597,597.22 份。

**（二）本基金上市交易的主要内容**

1、基金上市交易的核准机构和核准文号

上海证券交易所自律监管决定书[2018]126 号

2、上市交易日期

2018 年 9 月 25 日

3、上市交易的证券交易所

上海证券交易所，投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金场内简称及基金代码（二级市场交易代码）：

A 类基金份额（场内简称：金选 300A，基金代码：501060）

C 类基金份额（场内简称：金选 300 C，基金代码：501061）

5、本次上市交易份额为 A 类份额 108,612,767.00 份，C 类份额 23,590,244.00 份。

6、基金资产净值的披露

在本基金上市交易并开始办理基金份额申购赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值，并在上海证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

#### 7、未上市交易份额的流通规定

未上市交易的份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人的开放式基金账户下，基金份额持有人将其转托管至上海证券交易所场内（即中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统）后，即可上市流通。

#### 8、本基金转托管的主要内容

基金份额持有人自 2018 年 9 月 25 日起可以开始办理本基金转托管业务，转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

### 四、持有人户数、持有人结构及前十大持有人

#### （一）持有人户数

截至 2018 年 9 月 14 日，本基金 A 类场外份额持有人户数为 935 户，平均每户持有的 A 类场外基金份额为 94,412.73 份；A 类场内份额持有人户数为 358 户，平均每户持有的 A 类场内基金份额为 303,387.62 份；本基金 C 类场外份额持有人户数为 951 户，平均每户持有的 C 类场外基金份额为 56,907.13 份；C 类场内份额持有人户数为 458 户，平均每户持有的 C 类场内基金份额为 51,507.08 份。



## （二）持有人结构

截至 2018 年 9 月 14 日，本基金份额持有人结构如下：

场外机构投资者持有的场外本基金 A 份额为 50,305,080.05 份，占场外 A 类基金总份额的 56.99%；个人投资者持有的场外本基金 A 份额为 37,970,825.82 份，占场外 A 类基金总份额的 43.01%。

场内机构投资者持有的场内本基金 A 份额为 93,762,697.00 份，占场内 A 类基金总份额的 86.33%；个人投资者持有的本基金 A 份额为 14,850,070.00 份，占场内 A 类基金总份额的 13.67%。

场外机构投资者持有的场外本基金 C 份额为 0 份，占场外 C 类基金总份额的 0；个人投资者持有的场外本基金 C 份额为 54,118,680.35 份，占场外 C 类基金总份额的 100%。

场内机构投资者持有的场内本基金 C 份额为 5,000,900.00 份，占场内 C 类基金总份额的 21.20%；个人投资者持有的本基金 C 份额为 18,589,344.00 份，占场内 C 类基金总份额的 78.80%。

## （三）前十名基金份额持有人

截至 2018 年 9 月 14 日，A 类份额前十名场内基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额 (份)	占场内基金总份 额比例 (%)
1	北京恒昌弘德资产管理有限 公司—恒德利得 2 号私募证 券投资基金	39,847,890.00	36.69%
2	北京神农投资管理股份有限	15,002,375.00	13.81%

	公司—神农瑞舟 1 号私募证 券投资基金		
3	北京恒昌弘德资产管理有限 公司—恒德利得 3 号私募证 券投资基金	14,942,925.00	13.76%
4	上海呈瑞投资管理有限公司 —一念空瑞舟 1 号私募证 券投资基金	5,999,605.00	5.52%
5	北京恒昌弘德资产管理有限 公司—恒德远征一号私募证 券投资基金	5,000,892.00	4.60%
6	永安国富资产管理有限公司 —永安国富—永富 8 号资产 管理计划	4,999,225.00	4.60%
7	北京朗辉信泽投资管理有限 公司—朗辉信泽珠璧联辉 1 期私募基金	4,981,200.00	4.59%
8	中国国际金融股份有限公司	2,988,585.00	2.75%
9	张晓红	943,400.00	0.87%
10	韦志铖	694,883.00	0.64%
合计		95,400,980.00	87.84%

截至 2018 年 9 月 14 日，C 类份额前十名场内基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内基金总份
----	-----------	--------	---------

		(份)	额比例 (%)
1	中国国际金融股份有限公司	5,000,900.00	21.20%
2	欣妍妍	1,500,270.00	6.36%
3	李作明	1,000,045.00	4.24%
4	刘秀丽	1,000,045.00	4.24%
5	董引芳	500,130.00	2.12%
6	陈敏	500,022.00	2.12%
7	张莉丽	500,022.00	2.12%
8	温学会	300,081.00	1.27%
9	彭启明	300,013.00	1.27%
10	彭晓强	250,202.00	1.06%
合计		10,851,730.00	46.00%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的持有人信息编制。

## 五、基金主要当事人简介

### (一) 基金管理人

#### 1、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

总经理：孙菁

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

工商登记注册的法人营业执照文号：911100000918666422

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币3亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

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%

## 2、内部组织结构及职能

公司设置了合理的组织结构，并根据业务需要进行了合理的人员配置。

公司业务部门主要分为投研部门、风险管理部、监察稽核部、市场部及后台运作部门等。其中投研部门主要负责投资研究、投资管理、投资交易等工作；风险管理部主要负责对投资组合投资及公司运营过程中产生的或潜在的风险进行有效管理和控制等；监察稽核部主要负责监督检查投资组合和公司运作的合规情况及公司内部风险控制情况，提供法务支持；市场部主要负责销售业务、营销策划、客户服务及电子商务等工作；后台运作部门主要负责会计估值与核算、注册登记等日常运营业务以及信息系统的管理和维护等工作。

## 3、主要人员情况

截止 2018 年 6 月 30 日，公司共有员工 65 人，其中博士及博士以上有 3 人，硕士 47 人，本科 15 人。

#### 4、信息披露负责人

李虹，联系电话：010-63211122

#### 5、基金管理业务情况

截至 2018 年 8 月末，公司管理 20 只开放式证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线，包括中金纯债债券型证券投资基金、中金现金管家货币市场基金、中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中金消费升级股票型证券投资基金、中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、中金金利债券型证券投资基金、中金新安灵活配置混合型证券投资基金、中金丰沃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、中金金泽量化精选混合型发起式证券投资基金、中金价值轮动灵活配置混合型证券投资基金、中金丰硕混合型证券投资基金、中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金、中金金序量化成长混合型证券投资基金、中金衡优灵活配置混合型证券投资基金、中金浙金 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）。

#### 6、本基金基金经理

魏亨先生，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。

## (二) 基金托管人

### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

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[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2017 年 6 月末，本集团资产总额 216,920.67 亿元，较上年末增加 7,283.62 亿元，增幅 3.47%。上半年，本集团实现利润总额 1,720.93 亿元，较上年同期增长 1.30%；净利润较上年同期增长 3.81%至 1,390.09 亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016 年，本集团先后获得国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016 中国最佳银行”，《环球金融》“2016 中国最佳消费者银行”

、“2016 亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016 年“世界银行 1000 强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第 2；在美国《财富》2016 年世界 500 强排名第 22 位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2、主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，

长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2017 年二季度末，中国建设银行已托管 759 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

### （三）验资机构

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：010-85087916

传真：010-85185111

签章注册会计师：程海良、李砾

联系人：程海良

## 六、基金合同摘要

### (一) 基金合同当事人及权利义务

#### 1、基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审

议事项行使表决权；

6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7) 监督基金管理人的投资运作；

8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主作出投资决策，自行承担投资风险；

3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

8) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；

9) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

10) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 2、基金管理人的权利与义务

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- 1) 依法募集资金；
- 2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- 3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- 4) 销售基金份额；
- 5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- 9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- 10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- 11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- 12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- 14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者

实施其他法律行为；

15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资、转托管和非交易过户等业务规则；

17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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) 办理基金备案手续；

3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7) 依法接受基金托管人的监督；

8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方

法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

11) 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；

12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13) 按《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基金收益；

14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26) 建立并保存基金份额持有人名册；

27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利与义务

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算；

5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

- 7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- 8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
- 9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- 12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- 15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- 17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- 19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿



责任不因其退任而免除；

20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## **(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会未设日常机构。在本基金存续期内，根据本基金的运作需要，基金份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

### **1、召开事由**

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，除法律法规或中国证监会另有规定外，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止《基金合同》；
- 2) 更换基金管理人；
- 3) 更换基金托管人；
- 4) 转换基金运作方式；
- 5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费；
- 6) 变更基金类别；

- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- 9) 变更基金份额持有人大会程序；
- 10) 终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
- 11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- 13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- 14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(2) 以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式、调整基金份额类别设置；
- 3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- 4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- 5) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期

定额投资、非交易过户、转托管等业务规则；

6) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金推出新业务或服务；

7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 2、会议召集人及召集方式

(1) 除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

(3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

(4) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当

自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

(5) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- 6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 7) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### 4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

(1) 现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新

召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

4) 上述第3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出

具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

(3) 在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

(4) 基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

## 5、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### (2) 议事程序

#### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未

能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## 2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(2) 特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并



以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 7、计票

### (1) 现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异议，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重

新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和

调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### （三）基金收益分配原则、执行方式

#### 1、基金收益分配原则

（1）由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

（2）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（3）本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。本基金场内收益分配方式仅为现金分红：登记在证券登记系统的场内基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

（4）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（5）同一类别每一基金份额享有同等分配权；

（6）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可法律法规允许的前提下并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调

整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

## 2、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

## 3、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 4、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为该类基金份额。红利再投资的计算方法，依照相关业务规则执行。对于场内份额，现金分红的计算方法等有关事项遵循上海证券交易所及登记机构的相关规定。

### （四）与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### 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》生效后的标的指数许可使用费；
- (5) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (6) 《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；
- (7) 基金份额持有人大会费用；
- (8) 基金的证券、期货交易费用；
- (9) 基金的银行汇划费用；
- (10) 基金的开户费用及账户维护费用；
- (11) 基金上市费用和年费；
- (12) 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 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付

日支付。

### (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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### (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 0.25%。

本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日

内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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

#### (4) 标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付标的指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。在通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币50,000元，计费区间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年1月、4月、7月、10月将上季度标的指数许可使用费支付给标的指数许可方。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述“（一）基金费用的种类中第 5—12 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。

### 3、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。

### 4、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## （五）基金财产的投资方向和投资限制

### 1、投资目标

本基金跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内，实现对标的指数的有效跟踪。

### 2、投资范围

本基金投资范围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、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、股票期权、同业存单、银行存款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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产不低于基金资产的 80%；投资于标的指数成份股、备选成份股不低于基金资产净值的 90%；在每个交易日日终，在扣除股指期货和股票期权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；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 3、投资限制

#### (1) 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 本基金投资于股票资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股不低于基金资产净值的 90%；

2) 每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者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；

3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5% ;

6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10% ;

7) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20% ;

8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10% ;

9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10% ;

10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出 ;

11) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量 ;

12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40% ; 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期 ;

13) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140% ;

14) 本基金参与股指期货交易, 需遵守下列投资比例限制 :

A : 在任何交易日日终, 本基金持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10% ;

B：在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

C：在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

D：在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一个交易日基金资产净值的 20%；

E：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

15) 本基金投资流通受限证券，基金管理人事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在托管协议中明确本基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

16) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本条规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

17) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

18) 本基金参与股票期权交易，应遵守下列投资比例限制：

A：因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

B：开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

C：未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

19) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第 2)、10)、16)、17) 项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会另有规定或上述各项另有约定的除外。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，无需经基金份额持有人大会审议，但应提前公告。如本基金增加投资品种，投资限制以法律法规和中国证监会的规定为准。

## (2) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1) 承销证券；
- 2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- 5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管机构取消上述禁止行为的，则本基金投资不再受相关限制。

#### **(六) 基金资产净值的计算方法和公告方式**

##### **1、基金资产总值**

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收款项以及其他投资所形成的价值总和。

##### **2、基金资产净值**

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 3、基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在本基金基金份额开始上市交易前或开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额净值。

在本基金基金份额开始上市交易后或开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、各类基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

## （七）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 1、《基金合同》的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定或本基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

（2）关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### 2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- (3) 《基金合同》约定的其他情形；
- (4) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 3、基金财产的清算

(1) 基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(4) 基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 制作清算报告；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

7) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### 4、清算费用

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。

#### 5、基金财产清算剩余资产的分配

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。

#### 6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### (八) 争议的处理和适用的法律

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国



国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。

仲裁裁决是终局的对各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖并从其解释。

### **(九) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## **七、基金财务状况**

### **(一) 基金募集期间费用**

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

### **(二) 基金上市前重要财务事项**

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### **(三) 基金资产负债表**

本基金 2018 年 9 月 14 日资产负债表如下：

单位：人民币元

资 产：	期末余额
银行存款	15,700,112.72
结算备付金	461,744.47
存出保证金	19.12
交易性金融资产	178,064,944.18
其中：股票投资	178,064,944.18
基金投资	-
债券投资	-
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	80,000,000.00
应收证券清算款	4,168,964.16
应收利息	42,039.55
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	64,165.70
<b>资产总计</b>	<b>278,501,989.90</b>
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	4,554,951.98
应付赎回款	-
应付管理人报酬	52,502.65
应付托管费	15,750.82
应付销售服务费	7,428.64
应付交易费用	130,837.30
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	28,050.56
<b>负债合计</b>	<b>4,789,521.95</b>
所有者权益：	
实收基金	274,597,597.22
未分配利润	-885,129.27
所有者权益合计	273,712,467.95
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>278,501,989.90</b>

## 八、 基金投资组合

截止到 2018 年 9 月 14 日，本基金的投资组合如下：

□□□ 基金资产组合情况

资产类别	市 值 （元）	占总资产的比例(%)
股票	178,064,944.18	63.94
基金		
债券		
其中：央票		
国债		
政策性金融债		
金融债（商业银行次 级债、商业银行普通债券、证 券公司短期融资券、其他金融 债券）		
企业债		
企业短期融资券		
可转债		
权证		
资产支持证券		
货币市场工具（票据、CD）		
现金（银行存款及清算备付金）	16,161,857.19	5.80
银行定期存款（定期存款、通 知存款、大额存单）		

其他资产（交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券等）	84,275,188.53	30.26
其中：买入返售证券	80,000,000.00	28.73
资产合计	278,501,989.90	100.00

## （二）按行业分类的股票组合投资

分 类	市值（元）	占净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	2,364,215.00	0.86
B 采矿业	4,809,944.04	1.76
C 制造业	69,127,159.71	25.26
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,538,721.42	3.12
E 建筑业	9,644,497.36	3.52
F 批发和零售业	3,992,667.44	1.46
G 交通运输、仓储和邮政业	6,456,119.00	2.36
H 住宿和餐饮业	174,075.00	0.06
I 信息传输、软件和信息技术服务业	1,072,966.00	0.39
J 金融业	58,322,740.64	21.31
K 房地产业	9,977,097.17	3.65
L 租赁和商务服务业	2,624,125.40	0.96
M 科学研究和技术服务业	45,323.00	0.02

N 水利、环境和公共设施管理业	80,364.00	0.03
O 居民服务、修理和其他服务业		
P 教育		
Q 卫生和社会工作		
R 文化、体育和娱乐业	748,824.00	0.27
S 综合	86,105.00	0.03
合计	178,064,944.18	65.06

### (三) 按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

指数基金若兼具基金投资和指数投资的，应分别按积极投资和指数投资列示前五名股票明细。

#### 3.1 指数投资按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

股票代码	股票名称	数量 (股)	股票市值 (元)	占净值比例(%)
601318	中国平安	163,600.00	10,355,880.00	3.78
600519	贵州茅台	14,103.00	9,066,818.70	3.31
600036	招商银行	296,700.00	8,271,996.00	3.02
601166	兴业银行	359,400.00	5,344,278.00	1.95
000651	格力电器	136,600.00	5,065,128.00	1.85
600016	民生银行	820,100.00	4,904,198.00	1.79
601328	交通银行	791,800.00	4,434,080.00	1.62
601288	农业银行	1,107,100.00	4,018,773.00	1.47
600887	伊利股份	171,900.00	3,993,237.00	1.46
600030	中信证券	227,000.00	3,559,360.00	1.30

### 3.2 积极投资按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金未进行积极投资。

#### (四) 按券种分类的债券投资组合

本基金未投资债券。

#### (五) 按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金未投资债券。

#### (六) 投资组合报告附注

6.1 本基金投资的前十名证券的发行主体，除招商银行（600036）、兴业银行（601166）外，没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018年5月4日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银监罚决字[2018]1号），对招商银行内控管理严重违反审慎经营规则；违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；高管人员在获得任职资格核准前履职；未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；未严格审查贸易背景真实性开立信用证；违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；非真实转让信贷资产；违规向典当行发放贷款；违规向关系人发放信用贷款等违法违规事实进行处罚。

2018年5月4日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银监罚决字[2018]1号），对兴业银行重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；非真实转让信贷资产；无授信额度或超授信额度办理同业业务；内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；债券卖出回购业务违规出表；个人理财资金违规投资；提供日期倒签的材料；部分非现场监管统计数据与事实不符；个别董事未经任职资格核准即履职；变相批量转让个人贷款；向四证不全的房地产项目提供融资等违法违规事实进行处罚。

中金中证优选300基金采用完全复制中证中金优选300指数的投资策略，招商银行（600036）、兴业银行（601166）属于中证中金优选300指数的前十大成分股，我们判断所列处罚对其投资价值不会产生重大影响，故依然按照完全复制指数的投资策略持有该股。

6.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

6.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	19.12
2	应收证券清算款	4,168,964.16
3	应收股利	-
4	应收利息	42,039.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	64,165.70
7	买入返售证券	80,000,000.00



8	其他	-
9	合计	84,275,188.53

#### 6.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 6.5 前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 6.5.1 指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

#### 6.6 积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金未进行积极投资，不存在流通受限情况。

## 九、重大事件揭示

(一) 2018年7月18日发布中金中证优选300指数证券投资基金

(LOF) 基金合同、中金中证优选300指数证券投资基金(LOF) 招募说明书、中金中证优选300指数证券投资基金(LOF) 托管协议、中金中证优选300指数证券投资基金(LOF) 基金合同内容摘要、中金中证优选300指数证券投资基金(LOF) 基金份额发售公告。

(二) 2018年8月8日发布关于中金中证优选300指数证券投资基金

(LOF) 新增销售机构的公告。

(三) 2018年8月31日发布中金中证优选300指数证券投资基金

(LOF) 基金合同生效公告。

(四) 2018年9月4日发布中金基金管理有限公司副总经理任职公告。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《证券投资基金法》、《证券投资基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《证券投资基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证

监会报告。

## 十二、备查文件目录

### （一）本基金备查文件包括下列文件

- 1、中国证监会准予中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）注册的文件
- 2、《中金中证优选 300 指数证券投资基金（（LOF）基金合同》
- 3、《中金中证优选 300 指数证券投资基金（（LOF）托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、注册登记协议
- 8、中国证监会要求的其他文件

### （二）备查文件的存放地点和投资者查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

中金基金管理有限公司

2018 年 9 月 18 日