

中金中证优选300指数证券投资基金(LOF)
更新招募说明书摘要
(2019年第2号)

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

二〇一九年十月

重要提示

中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 的募集申请于 2018 年 4 月 17 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[2018]722 号《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 注册的批复》注册, 并于 2018 年 8 月 30 日经中国证监会证券基金机构监管部部函[2018]2023 号《关于中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)备案确认的函》备案。本基金的基金合同于 2018 年 8 月 30 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价值和收益做出实质性判断或保证, 也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等做出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场及期货市场, 基金净值会因为证券及期货市场波动等因素产生波动, 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、税负增加风险和其他风险等。本基金可投资科创板股票, 科创板股票的主要风险包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、监管规则及政策变化风险等。本基金为股票型证券投资基金, 预期风险与预期收益高于混合型证券投资基金、债券型基金与货币市场基金, 具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金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、债券、货币市场工具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的相关规定), 在政策市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下, 如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能遇见的特殊情形下, 可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击, 发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

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。

投资有风险,投资人认/申购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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。

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 2019 年 9 月 30 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2019 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: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

法定代表人: 楚钢

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

组织形式: 有限责任公司

注册资本: 人民币 3.5 亿元

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

楚钢先生, 董事长, 理论物理学博士, 特许金融分析师。历任花旗集团副总裁、新兴市场风控经理、地方政府债券自营交易员、基金经理、拉丁美洲股票期权交易负责人及另类投资董事总经理等职务。现任中国国际金融股份有限公司首席运营官、管理委员会成员。

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首席财务官、管理委员会成员。

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；中国国际金融股份有限公司合规律师、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。陈刚先生是美国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。

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。

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；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、副教授。现任上海交通大学上海高级金融学院教授、执行院长，并兼任上海人寿股份有限公司及上海证券有限责任公司独立董事。

冒大卫先生，独立董事，哲学博士，历任北京大学光华管理学院团委书记、党委副书记、党委书记，北京大学医学部副主任、财务部部长，北京大学副总会计师等职务。现任神州泰岳软件股份有限公司总裁。

王元先生，法学硕士。历任北京君合律师事务所上海分所、上海市耀良律师

事务所、北京市嘉源律师事务所上海分所律师。现任北京市嘉源律师事务所高级合伙人、管委会成员，兼任上海思华科技股份有限公司独立董事。

2、基金管理人监事

白娜女士，执行监事，管理学硕士。历任航天信息股份有限公司内审部审计主管；长盛基金管理有限公司基金会计；中国国际金融股份有限公司资产管理部高级经理。现任中金基金管理有限公司基金运营部负责人。

3、基金管理人高级管理人员

楚钢先生，董事长。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。

汤琰女士，管理学硕士。历任中国工商银行深圳分行高级理财经理，华安基金管理有限公司零售业务部副总经理。现任中金基金管理有限公司副总经理。

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。

夏静女士，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公司稽核部高级经理。现任中金基金管理有限公司首席信息官、风险管理部负责人。

4、本基金基金经理

魏李先生，统计学博士。2010年8月至2014年10月，在北京尊嘉资产管理有限公司从事A股量化策略开发。2014年11月加入中金基金管理有限公司，历任高级经理，量化专户投资经理，现任量化公募投资部基金经理。

5、投资决策委员会成员

李永先生，副总经理，工商管理硕士。简历同上。

王雁杰先生，经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部行业研究员，定向资产管理业务投资经理，集合资产管理计划投资经理，中金基金管理有限公司专户投资部投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理、董事总经理。

石玉女士, 管理学硕士。历任中国科技证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司职员; 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资产管理部高级研究员、投资经理助理、投资经理。2016 年 7 月加入中金基金管理有限公司, 现任投资管理部基金经理。

郭党钰先生, 工商管理硕士。历任宁波镇海炼化股份有限公司投资经理; 华泰证券股份有限公司项目经理; 德恒证券有限责任公司高级经理; 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。2014 年 4 月加入中金基金管理有限公司, 现任投资管理部基金经理。

杨立先生, 经济学硕士。历任民生证券股份有限公司证券投资助理、证券投资经理; 华融证券股份有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理。

朱宝臣先生, 理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资产管理部投资经理、量化投资总监; 2017 年 10 月加入中金基金管理有限公司, 现任量化投资团队负责人。

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)。

2018 年末, 集团资产规模 23.22 万亿元, 较上年增长 4.96%。2018 年度, 集团实现净利润 2,556.26 亿元, 较上年增长 4.93%; 平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13% 和 14.04%; 不良贷款率 1.46%, 保持稳中有降; 资本充足率 17.19%, 保持领先同业。

2018 年, 本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”; 美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号, 并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部, 下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室, 在安徽合肥设有托管运营中心, 在上海设有托管运营中心上海分中心, 共有员工 300 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。

(二) 主要人员情况

蔡亚蓉, 资产托管业务部总经理, 曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职, 并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅, 资产托管业务部资深经理(专业技术一级), 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。

黄秀莲, 资产托管业务部资深经理 (专业技术一级), 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。

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。

原玘, 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。

(三) 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、存托业务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 2019 年二季度末, 中国建设银行已托管 924 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。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”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”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、场外销售机构

(1) 直销机构

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: 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 层

法定代表人: 楚钢

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) 中国建设银行股份有限公司

客户服务电话: 95533

网址: www.ccb.com

2) 上海挖财金融信息服务有限公司

客服电话: 021-50810673

网站: <http://www.wacai.com/>

3) 腾安基金销售 (深圳) 有限公司

网址: www.tenganxinxi.com

电话: 95017 (拨通后转 1 转 8)

4) 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>

5) 上海好买基金销售有限公司

客服电话: 400-700-9665

网址: www.ehowbuy.com

6) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

客服电话: 4000-766-123

网址: <http://www.fund123.cn>

7) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

网址: www.erichfund.com

电话: 400-820-2899

8) 浙江同花顺基金销售有限公司

网站: www.5ifund.com

电话: 4008-773-772

9) 南京苏宁基金销售有限公司

网站: www.snjjjin.com

电话: 95177

10) 北京恒天明泽基金销售有限公司

客服电话: 400-898-0618

网址: <http://www.chtfund.com>

11) 北京汇成基金销售有限公司

网址: www.hcjijin.com

电话: 400-619-9059

12) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

客服电话: 4008199868

网址: www.tdyhfund.com

13) 上海联泰资产管理有限公司

网址: www.66zichan.com

电话: 400-166-6788

14) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司

网址: www.taichengcaifu.com

电话: 400-0411-001

15) 上海基煜基金销售有限公司

网站: www.jiyufund.com.cn

电话: 400-820-5369

16) 北京虹点基金销售有限公司

网址: www.hongdianfund.com

电话: 400-618-0707

17) 珠海盈米基金销售有限公司

网址: www.yingmi.cn

电话: 020-89629099

18) 北京肯特瑞基金销售有限公司

网址: <http://fund.jd.com>

电话: 95118

19) 北京蛋卷基金销售有限公司

网址: danjuanapp.com

电话: 400-061-8518

20) 中信建投证券股份有限公司

网址: www.csc108.com

电话: 4008-888-108

21) 招商证券股份有限公司

网址: www.newone.com.cn

电话: 95565

22) 中国银河证券股份有限公司

网址: www.chinastock.com.cn

电话: 95551

23) 长城证券股份有限公司

网址: www.cgws.com

电话: 400-6666-888

24) 平安证券股份有限公司

网址: www.stock.pingan.com

电话: 95511-8

25) 中泰证券股份有限公司

客服电话: 95538

网址: www.qlzq.com.cn

26) 中国国际金融股份有限公司

客户服务电话: 010-65051166

网址: www.cicc.com.cn

27) 中国中投证券有限责任公司

客服电话: 95532

网址: <http://www.china-invs.cn>

28) 西藏东方财富证券股份有限公司

网址: <http://www.18.cn>

电话: 95357

29) 通华财富 (上海) 基金销售有限公司

客服电话: 400-101-9301

网址: www.tonghuafund.com

30) 中银国际证券股份有限公司

网址: www.bocichina.com

电话: 400-620-8888

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销售机构销售本基金, 并及时公告。

2、场内销售机构

(1) 本基金的场内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单位 (具体名单可在上海证券交易所网站查询)。

(2) 本基金募集结束前获得基金销售资格的上海证券交易所会员单位可新增为本基金的场内销售机构。

(二) 登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

住所: 北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人: 周明

联系电话: 010-59378835

传真: 010-59378839

联系人: 朱立元

(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: 陆奇

(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: 010-85087916

传真: 010-85185111

签章注册会计师: 张君一、丁时杰

联系人: 程海良

四、基金的名称

中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF)。

五、基金的类型与运作方式

(一) 基金的类型

股票型证券投资基金。

(二) 基金的运作方式

上市契约型开放式 (LOF)。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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。

八、基金的投资策略

本基金采用被动式指数化投资方法,按照标的指数的成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,以更好地实现本基金的投资目标。

本基金力争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%。

(一) 股票投资策略

1、投资组合构建

本基金通过完全复制策略进行被动式指数化投资,根据标的指数成份股的基准权重构建股票资产组合。在初始建仓期或者为申购资金建仓时,本基金按照标的指数各成份股所占权重逐步买入。在买入过程中,本基金采取相应的交易策略降低建仓成本,力求跟踪误差最小化。在投资运作过程中,本基金以标的指数权重为标准配置个股,并根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整。

2、投资组合调整

(1) 定期调整

本基金所构建的投资组合将定期根据所跟踪标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。标的指数的样本股每年定期调整,指数调整方案公布后,本基金将及时对现有组合的构成进行相应的调整,若成份股的集中调整短期内会对跟踪误差产生较大影响,将采用逐步调整的方式。

(2) 不定期调整

1) 根据指数编制规则,当标的指数成份股发生增发、配股等股权变动而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

2) 根据基金申购赎回情况,调整股票投资组合,以有效跟踪标的指数;

3) 当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置, 基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益, 选择相关股票进行适当的替代。

(3) 股票替代

通常情况下, 本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量。但在如标的指数成份股流动性严重不足或停牌、标的指数成份股因法律法规的相关规定而为本基金限制投资的股票等特殊情况下, 本基金可以选择其他股票或股票组合对标的指数中的成份股进行替换。

在选择替代股票时, 为尽可能的降低跟踪误差, 本基金将采用定性与定量相结合的方法, 在对替代股票与被替代股票的基本面、股价技术面等指标进行相关性分析的基础上, 优先从标的指数成份股及备选成份股中选择基本面良好, 流动性充裕的股票进行替代投资。

(二) 债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要, 参与债券投资, 其投资目的是保证基金资产流动性, 有效利用基金资产, 降低跟踪误差。

1、利率策略

本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析, 积极主动的预测未来的利率趋势。根据相关因素的研究判断调整组合久期。如果预期利率下降, 本基金将增加组合的久期; 反之, 如果预期利率上升, 本基金将缩短组合的久期。

2、债券类属配置策略

本基金将根据国债、金融债、公司债、企业债、短期融资券和中期票据等不同债券板块之间的相对投资价值分析, 增持价值被相对低估的债券板块, 减持价值被相对高估的债券板块, 借以取得较高收益。

3、信用债券投资策略

本基金将根据国民经济运行周期阶段, 分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素, 进行个债的精选, 结合适度分散的行业配置策略, 构造和优化组合。

(三) 股指期货投资策略

为有效控制指数的跟踪误差,本基金在进行股指期货投资时,根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,通过对证券市场和期货市场运行趋势的定量化研究,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。本基金通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整,提高投资组合的运作效率。

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。

(四) 股票期权投资策略

本基金投资股票期权将按照风险管理的原则,结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时,基金管理人股票期权投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种,本基金将在履行适当程序后,纳入投资范围并制定相应投资策略。

(五) 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。

(六) 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。

(七) 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,基金管理人将通过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。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证中金优选 300 指数收益率*95% + 银行活期存款利率(税后)*5%。

基于本基金资产配置比例,选用该业绩比较基准能够反映本基金的风险收益特征。如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布,或者上述标的指数由其他指数代替,或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本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,通过适当的程序变更本基金的标的指数,并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若标的指数、业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告。

十、风险收益特征

本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型证券投资基金和混合型证券投资基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。

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。

以下内容摘自中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 2019 年第 3 季度报告。

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	215,200,376.73	89.92
	其中: 股票	215,200,376.73	89.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,901,470.00	5.39
	其中: 债券	12,901,470.00	5.39
	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	10,472,727.07	4.38
8	其他资产	751,392.02	0.31
9	合计	239,325,965.82	100.00

2、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	195,738.00	0.09
B	采矿业	4,356,112.00	1.93
C	制造业	81,100,234.94	35.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,446,577.81	3.29
E	建筑业	9,374,043.56	4.14
F	批发和零售业	5,063,819.62	2.24
G	交通运输、仓储和邮政业	5,206,436.00	2.30
H	住宿和餐饮业	187,216.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,700,627.35	0.75
J	金融业	82,853,214.19	36.62
K	房地产业	12,833,424.62	5.67
L	租赁和商务服务业	3,070,199.64	1.36
M	科学研究和技术服务业	47,160.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	142,610.00	0.06
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,015,118.00	0.45
S	综合	-	-
	合计	214,592,531.73	94.86

(2) 报告期末积极投资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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	384,715.60	0.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	223,129.40	0.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	607,845.00	0.27

(3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末，本基金未持有港股通投资股票。

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

(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	600519	贵州茅台	11,901	13,686,150.00	6.05

2	601318	中国平安	129,800	11,297,792.00	4.99
3	600036	招商银行	293,371	10,194,642.25	4.51
4	000651	格力电器	134,609	7,713,095.70	3.41
5	000858	五粮液	56,216	7,296,836.80	3.23
6	601166	兴业银行	412,500	7,231,125.00	3.20
7	000333	美的集团	137,258	7,013,883.80	3.10
8	600030	中信证券	224,800	5,053,504.00	2.23
9	600887	伊利股份	170,279	4,856,357.08	2.15
10	601328	交通银行	779,100	4,246,095.00	1.88

(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

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	688028	沃尔德	2,965	223,442.40	0.10
2	688368	晶丰明源	2,557	144,930.76	0.06
3	688033	天宜上佳	4,587	130,179.06	0.06
4	603927	中科软	884	78,198.64	0.03
5	300790	宇瞳光学	671	31,094.14	0.01

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	12,901,470.00	5.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,901,470.00	5.70

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	019611	19 国债 01	83,000	8,299,170.00	3.67
2	019615	19 国债 05	46,000	4,602,300.00	2.03

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

本报告期末, 本基金未持有股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末, 本基金未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末, 本基金未持有国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

本报告期末, 本基金未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

12、其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
----	----	--------

1	存出保证金	113,372.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	180,379.74
5	应收申购款	457,639.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	751,392.02

13、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

14、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1) 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

报告期末，本基金指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

(2) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688368	晶丰明源	144,930.76	0.06	新股锁定

15、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。

本基金基金合同生效日为 2018 年 8 月 30 日，基金业绩数据截至 2019 年 9 月 30 日。

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

中金金选 300A

阶段	净值收	净值收	业绩比较	业绩比较基	① - ③	② - ④
	益率标	益率标	基准收益	准收益率标		

	益率①	准差②	率③	准差④		
基金合同生效日起至 2018 年 12 月 31 日	-6.66%	1.39%	-8.91%	1.42%	2.25%	-0.03%
2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 09 月 30 日	28.08%	1.21%	21.04%	1.21%	7.04%	0.00%
基金合同生效日起至 2019 年 09 月 30 日	19.55%	1.27%	10.26%	1.28%	9.29%	-0.01%

中金金选 300C

阶段	净值收 益率①	净值收 益率标 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
基金合同生效日起至 2018 年 12 月 31 日	-6.74%	1.39%	-8.91%	1.42%	2.17%	-0.03%
2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 09 月 30 日	27.62%	1.21%	21.04%	1.21%	6.58%	0.00%
基金合同生效日起至 2019 年 09 月 30 日	19.02%	1.27%	10.26%	1.28%	8.76%	-0.01%

注：上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。

十三、基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用

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“1、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。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购

(1) 场外申购

本基金 C 类基金份额不收取申购费, A 类基金份额场外申购费用按照申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低。本基金 A 类基金份额的场外具体申购费率如下:

A 类基金份额的场外申购费率表

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万	1.00%
100 万 ≤ M < 200 万	0.60%
200 万 ≤ M < 500 万	0.20%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

基金申购费用由投资者承担,在申购基金份额时收取,基金申购费用不列入基金资产,主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

(2) 场内申购

本基金 C 类份额不收取场内申购费, A 类份额的场内申购费率由上海证券交易所会员单位按照场外申购费率设定。投资者可以多次申购本基金,申购费按每笔认购申请单独计算。

基金申购费用由投资者承担, 在申购基金份额时收取, 不列入基金财产, 主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

2、赎回

本基金 A 类份额和 C 类份额采用相同的场内外赎回费率结构, 如下表所示:

本基金场内外赎回费率如下:

持有期限 (T)	赎回费率
0<T<7 日	1.50%
7 日≤T<30 日	0.10%
T≥30 日	0.00%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 在基金份额持有人赎回基金份额时收取。基金份额赎回费计入基金财产比例: 对持续持有期少于 7 日的投资人, 将赎回费全额计入基金财产; 对于持有期少于 30 日且不少于 7 日的投资人, 将不低于 25% 的赎回费计入基金财产。

(三) 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。

(四) 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。

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 2019 年 4 月 13 日刊登

的《中金中证优选 300 指数证券投资基金（LOF）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，对基金管理人的情况进行了更新；
- 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，更新了相关服务机构的内容；
- 5、在“第十部分 基金的投资”中，更新了“基金投资组合报告”内容；
- 6、更新了“第十一部分 基金的业绩”；
- 7、在“第十八部分 风险揭示”部分更新了相关内容；
- 8、在“第二十三部分 其他应披露事项”中，增加了其他应当披露的事项。
- 9、在“附件 2 托管协议的内容摘要”中，更新了相关内容；

中金基金管理有限公司

2019 年 10 月 26 日