

中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF) 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 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

报告送出日期：2021 年 4 月 22 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 4 月 21 日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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中金中证优选 300 指数 (LOF)	
场内简称	金选 300LOF	
基金主代码	501060	
交易代码	501060	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2018 年 8 月 30 日	
报告期末基金份额总额	62, 778, 778. 18 份	
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。	
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。	
业绩比较基准	中证中金优选 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率 (税后) *5%	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	中金中证优选 300 指数 (LOF)A	中金中证优选 300 指数 (LOF)C
下属分级基金的交易代码	501060	501061
报告期末下属分级基金的份额总额	56, 573, 555. 03 份	6, 205, 223. 15 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年1月1日－2021年3月31日）	
	中金中证优选 300 指数(LOF)A	中金中证优选 300 指数(LOF)C
1. 本期已实现收益	5,282,506.41	1,218,073.94
2. 本期利润	4,312,254.93	1,120,352.40
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0695	0.0770
4. 期末基金资产净值	95,859,391.46	10,428,072.66
5. 期末基金份额净值	1.6944	1.6805

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（不含公允价值变动收益）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收益；

2. 本报告所列示的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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

中金中证优选 300 指数(LOF)A

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	3.05%	1.10%	2.16%	1.09%	0.89%	0.01%
过去六个月	11.72%	0.99%	9.30%	0.98%	2.42%	0.01%
过去一年	43.90%	1.08%	27.30%	1.08%	16.60%	0.00%
自基金合同生效起至今	69.44%	1.21%	33.77%	1.22%	35.67%	-0.01%

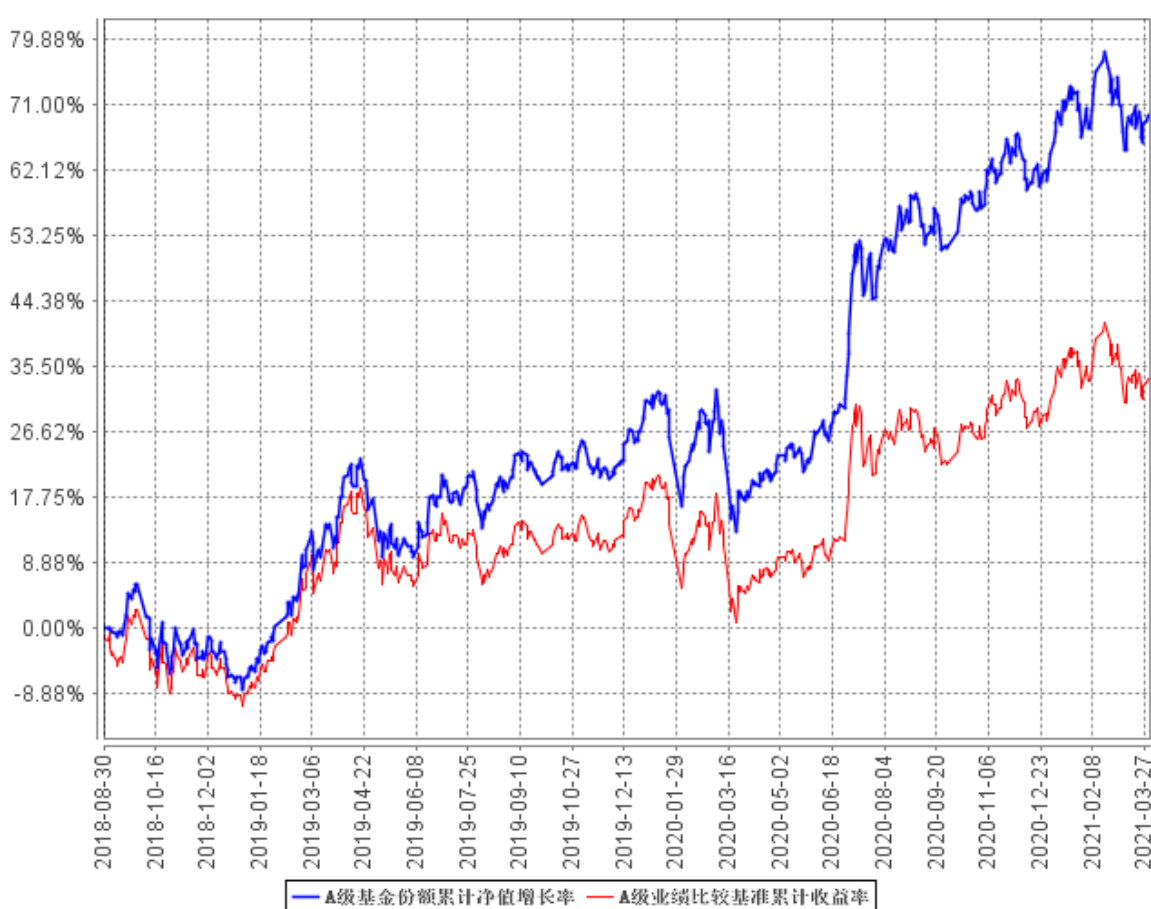
中金中证优选 300 指数(LOF)C

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	2.98%	1.10%	2.16%	1.09%	0.82%	0.01%

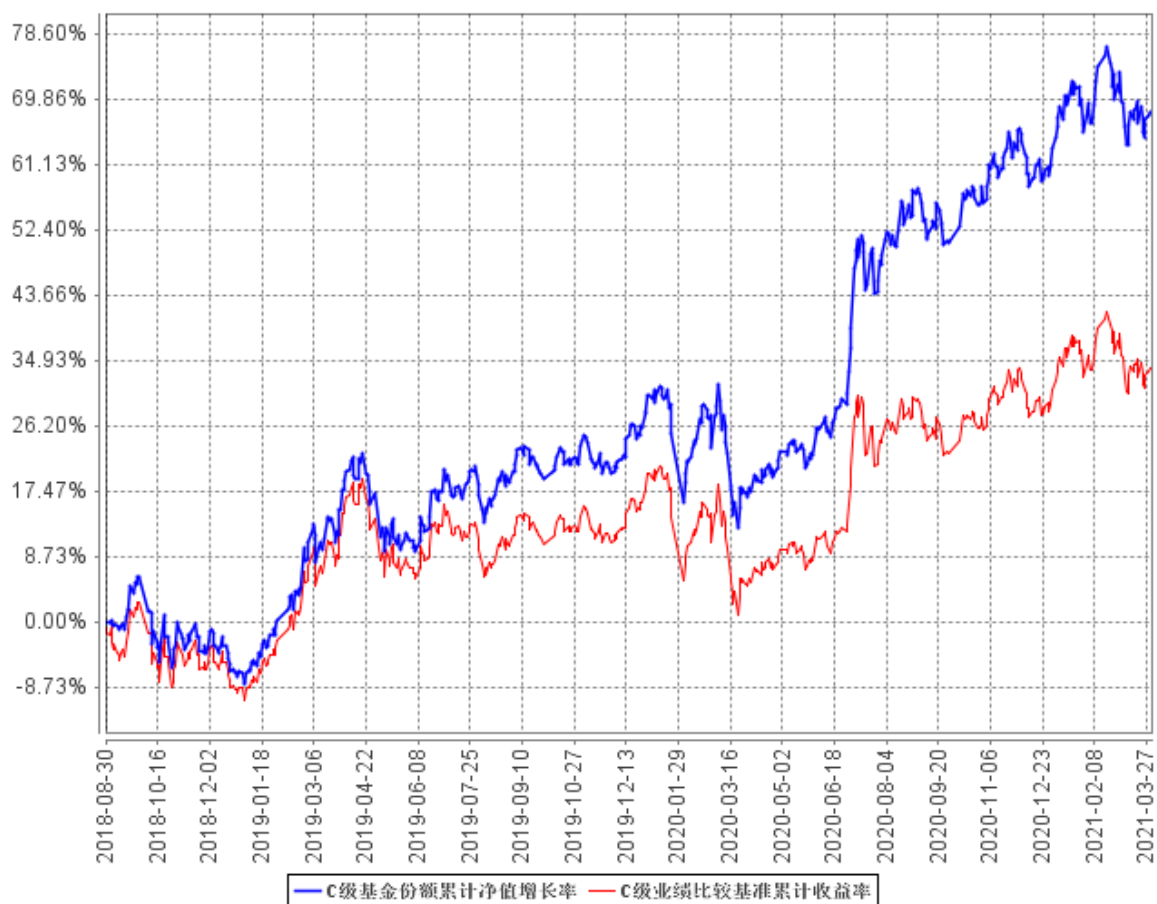
月						
过去六个月	11.59%	0.99%	9.30%	0.98%	2.29%	0.01%
过去一年	43.53%	1.08%	27.30%	1.08%	16.23%	0.00%
自基金合同生效起至今	68.05%	1.21%	33.77%	1.22%	34.28%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

A级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



C级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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏宇	本基金基金经理	2018 年 8 月 30 日	-	10 年	魏宇先生，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，现任量化指数部基金经理。
耿帅军	本基金基金经理	2020 年 10 月 29 日	-	9 年	耿帅军先生，理学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所金融工程分析师，中信证券股份有限公司研究部副总裁、金融工程分析师，中国国际金融股份有限公司研究部执行总经理、金融工程分析师。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。

注：1、对本基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为本基金管理人对外披露的基金经理离任日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”为本基金管理人对外披露的任免日期。

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金采用完全复制中证中金优选 300 指数的策略，股票保持 95%左右的仓位，余下资金做流动性管理。我们将继续采用完全复制指数的策略，力争更小的跟踪误差。

2021 年一季度，A 股市场整体经历了较大的波动。以春节为界，节前市场情绪高涨，大盘成长风格延续了过去两年强势表现，带动市场整体走高；节后风险偏好回落，大/小市值、成长/价值风格明显切换。整个一季度内，沪深 300 指数由 5211.29 下跌 3.13%至 5048.36 点，中证 500 指数由 6367.12 点下跌 1.78%至 6254.07 点，本基金跟踪的中金 300 指数由 4163.27 点上涨 2.25%至 4257.14 点，表现优于沪深 300 指数和中证 500 指数。

展望未来，在经历了春节后投资者情绪快速降温的市场阶段之后，A 股市场结构性估值偏高的风险已有所释放；但考虑到流动性边际收紧预期依然存在，外围市场的不确定性仍然较高，A 股市场微观结构尚有整理需求等，我们认为：短期来看，市场整体或正逐渐步入以震荡走势为主的“盘整期”。期间，市场或有阶段性反弹行情，但整体出现趋势上行或下行走势的概率可能不

算太高；自下而上的结构性机会可能主要来自于业绩增长预期与估值水平匹配度较高的行业板块。

而以长期战略视角来看，我们认为：以下两方面的结构性变化仍值得投资者关注，一是反映中国经济消费升级、产业升级等长期趋势的泛消费、高端制造、研发创新等行业或将继续受益于中国经济高质量发展趋势，仍具有长期战略配置价值；二是中国资本市场的机构化、国际化等长线趋势对 A 股的市场生态、投资行为等影响深远，重视基本面变化、关注配置价值的价值投资、长期投资理念将使得基本面高质量公司依然是中长线资金的战略配置标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金中证优选 300 指数(LOF)A 基金份额净值为 1.6944 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.05%；截至本报告期末中金中证优选 300 指数(LOF)C 基金份额净值为 1.6805 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.98%；同期业绩比较基准收益率为 2.16%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	100,884,500.60	89.71
	其中：股票	100,884,500.60	89.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,522,000.00	6.69
	其中：债券	7,522,000.00	6.69
	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	3,550,681.78	3.16
8	其他资产	493,913.43	0.44
9	合计	112,451,095.81	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	50,500.00	0.05
B	采矿业	3,847,497.40	3.62
C	制造业	43,366,351.53	40.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,782,847.68	5.44
E	建筑业	5,171,375.84	4.87
F	批发和零售业	1,677,644.00	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	1,084,222.00	1.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	379,454.00	0.36
J	金融业	28,082,242.20	26.42
K	房地产业	8,265,045.40	7.78
L	租赁和商务服务业	1,555,328.00	1.46
M	科学研究和技术服务业	260,404.00	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	245,937.00	0.23

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	633,073.45	0.60
S	综合	-	-
	合计	100,401,922.50	94.46

5.2.2 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	采矿业	-	-
C	制造业	434,541.56	0.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,036.12	0.02
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	24,000.42	0.02
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	482,578.10	0.45

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

5.3 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

5.3.1 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	601166	兴业银行	237,200	5,714,148.00	5.38
2	000333	美的集团	57,200	4,703,556.00	4.43
3	600887	伊利股份	99,200	3,970,976.00	3.74
4	000002	万科A	110,997	3,329,910.00	3.13
5	600900	长江电力	148,332	3,180,238.08	2.99
6	601398	工商银行	571,845	3,168,021.30	2.98
7	601328	交通银行	448,100	2,218,095.00	2.09
8	601899	紫金矿业	224,200	2,156,804.00	2.03
9	000100	TCL 科技	228,900	2,137,926.00	2.01
10	600000	浦发银行	191,510	2,104,694.90	1.98

5.3.2 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	688129	东来技术	5,033	86,466.94	0.08
2	688578	艾力斯	2,534	67,176.34	0.06
3	688630	芯碁微装	2,227	33,917.21	0.03
4	688662	富信科技	2,155	33,639.55	0.03
5	688195	腾景科技	1,620	26,616.60	0.03

5.4 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	7,505,600.00	7.06
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）	16,400.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,522,000.00	7.08

5.5 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	019640	20 国债 10	55,000	5,497,800.00	5.17
2	019645	20 国债 15	20,000	2,007,800.00	1.89
3	127031	洋丰转债	84	8,400.00	0.01
4	113622	杭叉转债	80	8,000.00	0.01

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，除兴业银行股份有限公司（兴业银行）、交通银行股份有限公司（交通银行）、中国工商银行股份有限公司（工商银行）外，本报告期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。

2020 年 9 月 11 日，中国人民银行福州中心支行发布行政处罚决定书（福银罚字〔2020〕35

号),对兴业银行股份有限公司为无证机构提供转接清算服务、为支付机构超范围(超业务、超地域)经营提供支付服务等违法违规事实进行处罚。

2020 年 5 月 9 日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书(银保监罚决字(2020)6 号),对交通银行股份有限公司监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在理财产品数量漏报、资金交易信息漏报严重等违法违规事实进行处罚。

2021 年 1 月 8 日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书(银保监罚决字(2020)71 号),对中国工商银行股份有限公司未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告、关键岗位未进行实质性轮岗、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞等违法违规事实进行处罚。2020 年 5 月 9 日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书(银保监罚决字(2020)7 号),对中国工商银行股份有限公司监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在理财产品数量漏报、资金交易信息漏报严重、信贷资产转让业务漏报、贷款核销业务漏报、分户账明细记录应报未报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,兴业银行、交通银行、工商银行属于中证中金优选 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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	49,081.22
2	应收证券清算款	161,813.86
3	应收股利	-
4	应收利息	105,616.91
5	应收申购款	177,401.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	493,913.43

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 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	688129	东来技术	86,466.94	0.08	流通受限
2	688578	艾力斯	67,176.34	0.06	流通受限
3	688630	芯碁微装	33,917.21	0.03	新股锁定
4	688662	富信科技	33,639.55	0.03	新股锁定
5	688195	腾景科技	26,616.60	0.03	流通受限

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金中证优选 300 指数(LOF)A	中金中证优选 300 指数(LOF)C
报告期期初基金份额总额	77,148,010.72	31,491,254.38
报告期期间基金总申购份额	12,423,536.47	2,253,473.75
减:报告期期间基金总赎回份额	32,997,992.16	27,539,504.98
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	56,573,555.03	6,205,223.15

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有份额比例达到或超过总份额 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金依法合规参与了部分基金管理人股东中金公司承销期内承销的证券，具体情况请见本基金本报告期内发布的有关重大关联交易的公告。本基金为完全按照有关指数构成比例进行证券投资的基金，本报告期内依法合规买卖基金托管人发行的股票，总买入量 15,500，总卖出量 109,053。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)募集注册的文件
- 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、中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)申请募集注册的法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 7、报告期内中金中证优选 300 指数证券投资基金(LOF)在指定媒介上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件和复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：（86）010-63211122 400-868-1166

传真：（86）010-66159121

中金基金管理有限公司

2021 年 4 月 22 日