

国金基金管理有限公司关于旗下指数基金指数信息查询路径的公告

为落实《公开募集证券投资基金运作指引第3号—指数基金指引》的规定，国金基金管理有限公司（以下简称“本公司”）就旗下三只指数基金的指数信息查询路径信息公告如下：

一、旗下三只指数基金信息及指数信息查询路径

基金名称	国金沪深 300 指数增强证券投资基金	国金标普中国 A 股低波红利指数增强证券投资基金（LOF）	国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）
基金代码（主）	167601	501072	502020
成立时间	2017 年 9 月 1 日	2019 年 6 月 5 日	2019 年 10 月 14 日
标的指数	沪深 300 指数	标普中国 A 股低波红利指数	上证 50 指数
指数简介	沪深 300 指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只证券组成，于 2005 年 4 月 8 日正式发布，以反映沪深市场上市公司证券的整体表现。	标普中国 A 股低波红利指数旨在衡量在中国 A 股市场中 100 只低波动率及高股息收益的股票表现。该指数旨在作为 A 股市场中寻求收益的投资者的基准。	上证 50 指数以上证 180 指数样本为样本空间，挑选上海证券市场规模大、流动性好的最具代表性的 50 只证券作为样本，综合反映上海证券市场最具市场影响力的一批龙头企业的整体表现。
指数编制方法等指数信息查询路径	中证指数有限公司网站查询具体网址为： http://www.csindex.com.cn/zh-CN/indices/index-detail/000300	标普道琼斯指数有限公司网站查询具体地址为： https://chinese.spindices.com/indices/strategy/sp-china-a-share-low-volatility-high-dividend-index-cny （英文） 本公司网站查询具体地址为： www.gfund.com （中文）	上海证券交易所网站查询具体网址为： http://www.sse.com.cn/market/sseindex/indexlist/

二、指数基金可能存在的风险

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险。标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2、标的指数变更或不符合要求以及指数编制机构退出或停止服务的风险

如出现指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致标的指数不宜继续作为标的指数的情形或标的指数不符合要求，本公司在履行适当程序后，进行适当调整并及时公告。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离或跟踪误差控制未达约定目标的风险

以下因素可能引发上述风险：

(1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；

(2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；

(3) 成份股派发现金红利等将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度；

(4) 由于成份股停牌、违约、摘牌或因标的指数流通市值过小、流动性差等原因，使基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差；

(5) 由于指数成份股发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未做出调整时，基金管理人会履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整，从而影响基金对标的指数的跟踪程度；

(6) 由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等费用的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差；

(7) 在基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的

水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金的收益产生影响，从而影响基金对标的指数的跟踪程度；

（8）其他因素，如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话 4000-2000-18 咨询，或至本公司网站 www.gfund.com 获取相关信息。

风险提示：

本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书、产品资料概要等文件并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等选择与自身风险承受能力相匹配的基金产品。敬请投资人注意投资风险。

特此公告。

国金基金管理有限公司

2021 年 2 月 1 日