

中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) (A 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期: 2024 年 8 月 21 日

送出日期: 2024 年 9 月 6 日

本概要提供本基金的重要信息, 是招募说明书的一部分。

作出投资决定前, 请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	中金中证优选 300 指数 (LOF)	基金代码	501060	
下属基金简称	中金中证优选 300 指数 (LOF)A	下属基金交易代码	501060	
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	
基金合同生效日	2018 年 08 月 30 日	上市交易所及上市日期	上海证券交易所	2018 年 09 月 25 日
基金类型	股票型	交易币种	人民币	
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日	
基金经理	耿帅军	开始担任本基金基金经理的日期	2020 年 10 月 29 日	
		证券从业日期	2011 年 04 月 15 日	

二、基金投资与净值表现

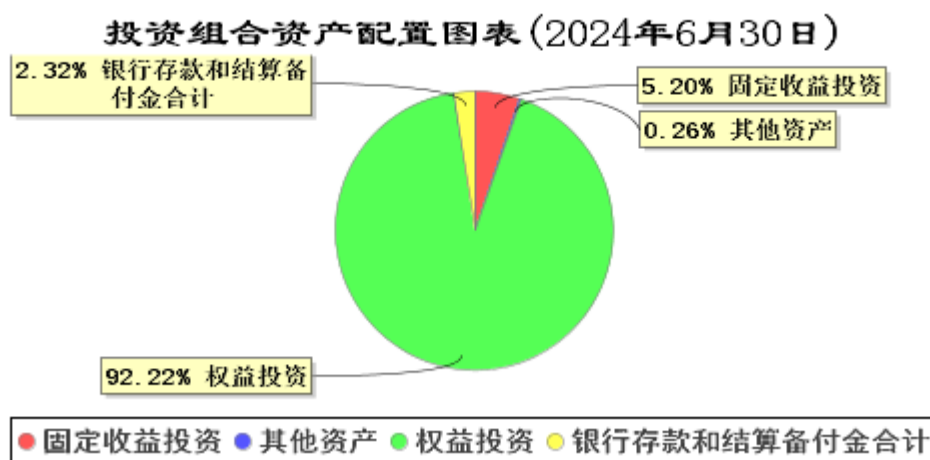
(一) 投资目标与投资策略

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。
投资范围	<p>标的指数: 中证中金优选 300 指数</p> <p>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)、存托凭证、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)。</p> <p>本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。</p> <p>基金的投资组合比例为: 本基金投资于股票及存托凭证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 (含存托凭证) 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。</p>

<p>主要投资策略</p>	<p>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。具体包括：1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、股票期权投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、可转换债券投资策略；8、权证投资策略；9、参与转融通证券出借业务投资策略。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证中金优选 300 指数收益率*95% + 银行活期存款利率（税后）*5%。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>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。</p>

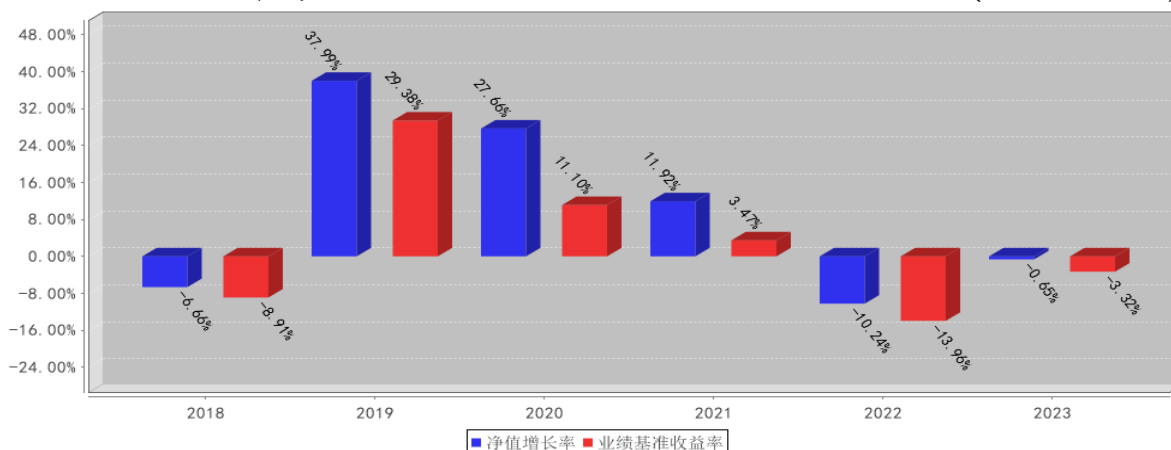
注：详见《中金中证优选 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》第九部分“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

中金中证优选300指数(LOF)A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2023年12月31日)



注：业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取:

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率
申购费 (前收费)	M < 1,000,000	1.00%
	1,000,000 ≤ M < 2,000,000	0.60%
	2,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.20%
	M ≥ 5,000,000	1,000 元/笔
赎回费	N < 7 日	1.50%
	7 日 ≤ N < 30 日	0.10%
	N ≥ 30 日	0.00%

注: 场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率或金额		收取方
管理费	0.50%		基金管理人和销售机构
托管费	0.15%		基金托管人
审计费用	45,000.00 元		会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元		规定披露报刊
指数许可使用费	0.02%	年下限金额: 200,000.00 元	指数编制公司
其他费用	费用的计算方式及支付方式详见招募说明书及相关公告		

注: 本基金交易证券等产生的费用和税负, 按实际发生金额从基金资产扣除。审计费用、信息披露费为基金整体承担费用, 非单个份额类别费用, 且年金额为预估值, 最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额, 在持有期间, 投资者需支出的运作费率如下表:

中金中证优选 300 指数(LOF)A

	基金运作综合费率 (年化)
持有期间	0.86%

注: 基金管理费率、托管费率、销售服务费率 (若有) 为基金现行费率, 其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险, 投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资于本基金的主要风险有:

1、市场风险, 主要包括: (1) 政策风险; (2) 经济周期风险; (3) 利率风险; (4) 收益率曲线风险; (5) 购买力风险; (6) 上市公司经营风险; (7) 再投资风险; (8) 债券回购风险; 2、信用风险; 3、流动性风险; 4、管理风险; 5、估值风险; 6、操作及技术风险; 7、合规性风险; 8、税负增加风险; 9、启用侧袋机制的风险; 10、其他风险;

11、本基金特有风险: (1) 跟踪指数投资风险: 1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险; 2)

目标指数波动的风险; 3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险; 4) 目标指数变更的风险; 5) 跟踪误差控制未达约定目标的风险; 6) 指数编制机构停止服务的风险; 7) 成份股停牌的风险; (2) 期货投资风险; (3) 资产支持证券投资风险; (4) 股票期权投资风险; (5) 科创板股票投资风险; (6) 转融通证券出借业务风险; (7) 存托凭证投资风险; (8) 流动性受限证券投资风险。

(二) 重要提示

本基金的募集申请于 2018 年 4 月 17 日经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。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作出实质性判断或保证, 也不表明投资于本基金没有风险。

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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额, 即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的, 基金管理人将在三个工作日内更新, 其他信息发生变更的, 基金管理人每年更新一次。因此, 本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后, 如需及时、准确获取基金的相关信息, 敬请同时关注基金管理人发布的临时相关公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站: www.ciccfund.com, 客服电话: 400-868-1166

基金合同、托管协议、招募说明书

定期报告, 包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料

六、其他情况说明

无。