

# 国金通用沪深300指数分级证券投资基金上市交易公告书

## 一、重要声明与提示

《国金通用沪深300指数分级证券投资基金上市交易公告书》(以下简称“本公告书”)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《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,国金通用基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)的职责及信息披露责任由本公告书所载资料存在虚假记载、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法律责任。国金通用沪深300指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)托管人中国光大银行股份有限公司对本公告书申基金财务会计资料内容的真实性、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。中国证监会基金募集监督委员会(以下简称“中国证监会”)和深圳证券交易所(以下简称“深交所”)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。凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2013年6月26日刊登在上海证券交易所、《中国证券报》、《证券时报》及国金通用基金管理有限公司网站(www.gfund.com)上的《国金通用沪深300指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)。

## 二、基金概况

- 1.基金名称:国金通用沪深300指数分级证券投资基金
- 2.基金类型:股票型指数基金
- 3.本基金的基金份额包括国金通用沪深300指数分级证券投资基金之基础份额(场内简称“国金300”,基金代码“167601”)、国金通用沪深300指数分级证券投资基金之A类份额(场内简称“国金300A”,基金代码“150140”)、国金通用沪深300指数分级证券投资基金之B类份额(场内简称“国金300B”,基金代码“150141”)。其中,国金300A和国金300B份额的基金份额初始比例为1:1的比例不变。
- 4.本基金存续期限为不定期。
- 5.国金300的申购和赎回:投资者可通过场内或场外两种方式对国金300份额进行申购与赎回;国金300A份额、国金300B份额上市交易,不接受申购赎回。
- 6.份额配对转换:份额配对转换是指国金300份额与国金300A份额、国金300B份额之间的配对转换,包括以下两种方式的对换将其:
  - (1)分拆:分拆是指基金份额持有人将其持有的每2份国金300场内份额申请转换成1份国金300A份额与1份国金300B份额的行为。
  - (2)合并:合并是指基金份额持有人将其持有的每1份国金300A份额和每1份国金300B份额申请转换成2份国金300场内份额的行为。
- 7.定期份额折算
  - 每个会计年度的第一个工作日(除基金合同生效日所在会计年度外)为定期份额折算基准日,本基金将对国金300A份额和国金300B份额进行一次会计年度约定收益的定期折算。国金300A份额每个期末的不定收益权益,即国金300A份额每个会计年度最后一日份额参与净值超出1.000元部分,将被折算为场内国金300A份额和国金300B份额持有人、国金300份额持有人持有的每份国金300份额获得新增1份国金300A份额和国金300B份额;持有场内国金300份额的基金份额持有人将按照折算方式获得新增场内国金300份额;持有场外国金300份额的基金份额持有人将按照新增场内国金300份额与中国光大银行股份有限公司公告的折算规则进行折算,国金300A份额的参与净值超出1.000元的基金份额价值将相应调整。有关定期份额折算的具体规定请在本基金招募说明书及本公告查看。
  - 8.不定期份额折算
    - 当国金300份额的基金份额净值大于或等于1.500元时,本基金将根据市场情况确定份额折算基准日后将对国金300A份额、国金300B份额和国金300份额进行不定期份额折算,份额折算后基金份额的确保国金300A份额和国金300B份额的比例为1:1,份额折算后国金300A份额、国金300B份额和国金300份额的基金份额净值调整为1.000元。
    - 当国金300份额的参与净值小于或等于0.250元时,本基金将根据市场情况确定份额折算基准日后将对国金300A份额、国金300B份额和国金300份额进行份额折算,份额折算后本基金将确国金300A份额和国金300B份额的比例为1:1,份额折算后国金300A份额的基金份额净值以及国金300A份额和国金300B份额的参与净值调整为1.000元。
  - 9.有关不定期份额折算的具体规定请见基金招募说明书及相关公告。
- 10.本基金资产净值的表现:本基金自2013年7月25日公开发售以来,本基金资产净值持续运行,该基金份额持有人有以大会决议变更本基金所有份额以特定决议的形式表达通过,目前经参加基金份额持有人大会表决的国金300A和国金300B基金份额持有人或其代理人所持国金300A和国金300B基金份额占表决权的2/3以上(含2/3)通过方有效。

截至2013年8月16日,本基金基金份额的总额为323,127,755.17份,其中:国金300为257,011,193.17份,国金300A为33,048,181份,国金300B为33,048,181份,国金300A和国金300B基金份额净值为1.000元,国金300基金份额净值为1.047元,国金300A的基金份额净值为1.044元,国金300B的基金份额净值为1.041元。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

截至2013年8月16日,本基金基金份额持有人数量为1,041,499人,其中:国金300A和国金300B基金份额持有人数量为1,041,499人,国金300基金份额持有人数量为0人。

## 基金管理人:国金通用基金管理有限公司

## 基金托管人:中国光大银行股份有限公司

## 注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

## 上市地点:深圳证券交易所

## 上市日期:2013年8月23日

## 公告日期:2013年8月20日

### 14. 本基金基金经理

雷智女士,博士,毕业于中国科学院数学与系统科学研究院,管理科学与工程专业。2008年7月至2011年11月在博时基金管理有限公司股票投资部工作,任产品经理。2012年1月加盟国金通用基金管理有限公司,任股指期货部副经理兼股指期货部行业分析研究员。2012年7月调入产品与金融工程管理部,现任产品与金融工程管理部副经理。

### (二)基金合同当事人

1.名称:中国光大银行股份有限公司(简称“中国光大银行”)  
2.成立日期:1992年8月18日  
3.注册地址:北京市西城区太平桥大街25号,甲25号中国光大中心  
4.办公地址:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心  
5.注册资本:404,349.92亿元人民币  
6.法定代表人:唐双宁  
7.资产管理业务批准文号:证监基金字[2012]75号  
8.资产管理部信息披露负责人:张建春  
9.联系电话:010-66394180

10.主要人员情况  
雷智女士,博士,毕业于中国科学院数学与系统科学研究院,管理科学与工程专业。2008年7月至2011年11月在博时基金管理有限公司股票投资部工作,任产品经理。2012年1月加盟国金通用基金管理有限公司,任股指期货部副经理兼股指期货部行业分析研究员。2012年7月调入产品与金融工程管理部,现任产品与金融工程管理部副经理。

行长郭友先生,历任国家外汇管理局外汇储备业务中心外汇交易部主任,中国投资公司(新加坡)总经理,中国光大银行金融市场部副总经理,中国光大银行投行部、中国光大银行(集团)总公司执行董事、副总经理兼中国光大银行行政总裁,曾任中国光大(集团)总公司副董事长,中国光大银行股份有限公司副董事长、行长。

陈勇先生,博士,北京大学法学学士,硕士,曾任中共中央联络部干部,四川光大资产管理公司董事,常务副总经理,中国光大银行投行部副部长,现任中国光大银行股份有限公司资产管理部总经理。

### 11. 基金托管人业务情况

截至2013年6月30日,中国光大银行股份有限公司托管国投瑞银创新动力股票型证券投资基金,国投瑞银景气行业证券投资基金,国投瑞银稳健增信债券型证券投资基金,摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金,国投瑞银沪深300指数分级证券投资基金,工银瑞信保本混合型证券投资基金,博时转债增强债券型证券投资基金,光大保德信量化核心证券投资基金,光大保德信添天利货币开短期理财债券型证券投资基金,国联安安享信用分级债券型证券投资基金,国联安添利证券投资基金,招商安本增利债券型证券投资基金,农银汇理沪深100指数增强型证券投资基金,国联基金增长灵活配置混合型证券投资基金,建信纯债债券型证券投资基金,兴银基金优势优选股票证券投资基金,工银瑞信安享混合型发起式证券投资基金,兴业中证行业轮动基金,托管基金规模达423.94亿元,同时,开展了证券公司集合资产管理计划、专户理财产品、企业年金基金、QDII、银行理财、保险权益投资计划等受托和信托公司资金信托计划,产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

### (一)基金管理人

1.名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)  
2.法定代表人:吴洪平  
3.注册地址:中国北京市朝阳区东长安街1号东方广场安永大楼16层  
4.经办注册会计师:王莉娜、李惠民  
5.联系电话:010-58152145

### 六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

### 七、基金财务状况

深圳证券交易所根据国金通用沪深300指数分级证券投资基金认购确认未收取基金财产任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书约定的费率或佣金比率收取认购费。  
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

国金通用沪深300指数分级证券投资基金截至2013年8月16日资产负债表如下:

资产		负债及所有者权益	
资产	期末数	负债及所有者权益	期末数
货币存款	16,074,333.86	负债	-
结算备付金	2,523,060.41	交易性金融资产负债	-
应收款项	131,465.47	衍生金融资产	-
交易性金融资产	32,054,116.16	卖出回购金融资产款	-
其中:股票投资	32,054,116.16	应付证券融资	-
其他证券投资	-	应付短期融资	-
支付拆入证券投资	-	应付资产管理	117,174.00
基金投资	-	基金投资	29,428.51
衍生金融资产	-	衍生金融负债	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	-
应收利息	62,255.58	买入返售金融资产	216,370.11
应收股利	-	应付账款	-
应收利息	28,829.21	应付利息	-
其他应收款	-	其他负债	32,884.38
其他资产	-	负债合计	396,705.67
		所有者权益	
		实收基金	323,127,755.17
		未分配利润	15,437,318.47
		所有者权益合计	338,475,073.64

注:本报告截至日2013年8月16日,国金300基金份额净值人民币1.047元,基金份额总额323,127,755.17份,国金300A基金份额净值人民币1.044元,基金份额总额33,048,181.00份,国金300B基金份额净值人民币1.041元,基金份额总额33,048,181.00份。

### 八、基金投资组合

国金通用沪深300指数分级证券投资基金的基金投资组合如下:

(一)截至2013年8月16日,基金资产配置情况

资产项目	金额(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
银行存款/存放同业/拆出资金	18,597,394.27	5.49
债券投资	32,054,116.16	94.45
股票投资	-	-
其他证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
其他资产	-	-
合计	338,871,470.69	100

(二)截至2013年8月16日,指数投资按行业分类的股票投资组合:

分 类	持仓市值(元)	占持仓市值比例
A股,农林,农产品	1,927,782.05	0.57%
B采矿业	23,360,829.70	6.90%
C制造业	113,260,658.88	34.00%
D电力,热力,燃气及供水和供应	10,380,670.31	3.07%
E建筑业	12,258,493.14	3.62%
F批发和零售业	8,520,468.38	2.52%
G交通运输,仓储和邮政业	6,951,646.77	2.05%
H住宿和餐饮业	-	-
I信息技术,软件和信息技术服务业	7,650,888.60	2.26%
J金融业	107,059,898.92	31.83%
K房地产业	18,071,405.41	5.34%
L医药生物和医疗服务	21,222,284.00	6.63%
M科学研究和技术服务业	-	-
N批发和零售业和邮政业	2,089,493.00	0.62%
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,休闲和娱乐业	1,034,807.00	0.31%
合计	337,878,500.00	1.00%
融券业务	-	-
其他资产	-	-
总计	320,054,116.16	94.56%

(三)截至2013年8月16日,积极投资按行业分类的股票投资组合:

截至2013年8月16日,本基金未持有积极投资股票组合。

(四)截至2013年8月16日,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	600016	民生银行	1,508,000	13,602,160.00	4.02
2	600036	招商银行	943,601	10,370,174.99	3.06
3	601166	兴业银行	763,100	7,791,251.00	2.30
4	601318	中国平安	223,600	7,689,040.00	2.27
5	000002	万科A	646,300	6,391,907.00	1.89
6	600000	浦发银行	747,314	6,210,179.34	1.83
7	600837	海通证券	540,300	6,062,166.00	1.79
8	600030	中信证券	459,700	5,061,207.00	1.50
9	600519	贵州茅台	27,645	4,821,288.00	1.42
10	000651	格力电器	160,600	4,304,800.00	1.27

(五)截至2013年8月16日,积极投资按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细:

截至2013年8月16日,本基金未持有积极投资股票组合。

(六)截至2013年8月16日,按持仓分类的债券投资组合:

(七)截至2013年8月16日,按持仓市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细:

(八)截至2013年8月16日,本基金未持有债券投资。

(九)截至2013年8月16日,按市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:

截至2013年8月16日,本基金未持有资产支持证券。

(十)投资组合报告附注

截至2013年8月16日,本基金未持有资产支持证券。

(十一)报告期内本基金投资于前十大名证券的发行主体本期是否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、被监管部门采取监管措施或处罚的情况:

报告期内本基金投资的十大名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(十二)报告期内本基金投资于前十大名证券的发行主体本期是否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、被监管部门采取监管措施或处罚的情况:

报告期内本基金投资的十大名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(十三)报告期内本基金投资于前十大名证券的发行主体本期是否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、被监管部门采取监管措施或处罚的情况:

报告期内本基金投资的十大名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(十四)报告期内本基金投资于前十大名证券的发行主体本期是否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、被监管部门采取监管措施或处罚的情况:

报告期内本基金投资的十大名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(十五)报告期内本基金投资于前十大名证券的发行主体本期是否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、被监管部门采取监管措施或处罚的情况:

报告期内本基金投资的十大名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(十六)报告期内本基金投资于前十大名证券的发行主体本期是否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、被监管部门采取监管措施或处罚的情况:

报告期内本基金投资的十大名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(十七)报告期内本基金投资于前十大名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在