国金通用沪深300指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2015年第2号

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

二〇一五年九月

重要提示

国金通用沪深300指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）募集申请已于2013年5月24日获中国证监会证监许可[2013]694号文核准。

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

基金管理人建议基金投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资人在认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2015年7月26日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2015年06月30日。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：国金基金管理有限公司

住所：北京市怀柔区府前街三号楼3-6

成立日期：2011年11月2日

注册地址：北京市怀柔区府前街三号楼3-6

办公地址：北京市海淀区西三环北路87号国际财经中心D座14层

法定代表人：尹庆军

组织形式：有限责任公司

联系人：张丽

联系电话：010-88005888

注册资本：2.8亿元人民币

股权结构：

国金基金管理有限公司股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，四家企业共同出资2.8亿元人民币，出资比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

纪路先生，董事长，硕士EMBA。历任博时基金管理有限公司分析师、金信证券有限责任公司投资研究中心总经理、国金证券股份有限公司研究所总经理。现任国金证券股份有限公司副总裁、上海国金通用财富资产管理有限公司执行董事、中国证券业协会证券公司专业评价专家、四川证券业协会创新咨询委员会主任委员。2011年11月至今任国金基金管理有限公司董事长。

金鹏先生，董事，研究生学历。历任浦金期货经纪有限公司总经理助理，上海浦金理财顾问有限公司副总经理，河北财金投资有限公司总经理，涌金实业（集团）有限公司副总裁，国金证券有限责任公司风险控制中心总经理。现任国金证券股份有限公司董事、总经理、国金期货有限责任公司董事、国金创新投资有限公司董事及国金黑兴投资有限公司投资委员会委员。

赵煜先生，董事，学士。历任北京合都汽车安全设备有限公司销售经理，北京顶峰贸易公司销售经理，上海浦东中软科技发展有限公司副总经理。现任涌金实业（集团）有限公司任董事长助理。

许强先生，董事，硕士。历任苏州商品交易所交易部、交割部、信息部总经理，中国华通物产集团经易期货经纪有限公司副总裁，苏州工业园区国有资产经营公司投资银行部总经理，苏州工业园区地产经营管理公司投资部总经理。2008年至今任苏州工业园区资产管理有限公司董事长。

宁远喜先生，董事，硕士。历任广东宝丽华集团有限公司广告部经理、广东宝丽华实业股份有限公司董事、董事会秘书。现任广东宝丽华新能源股份有限公司董事长、十一届全国人大代表、广东上市公司协会副会长。

尹庆军先生，董事，硕士。历任中央编译局世界所助理研究员、办公厅科研处事秘书，中央编译出版社出版部主任，博时基金管理有限公司人力资源部总经理、董事会秘书、监事，国金通用基金管理有限公司筹备组拟任督察长，国金通用基金管理有限公司督察长。2012年7月至今任国金基金管理有限公司总经理。

肖昌秀女士，独立董事，高级经济师。历任中国人民银行四川省分行信贷处科员，中国农业银行总企业信贷局科员，中央财金学院科员，北京中医学院科员，中国人民银行总行信贷局科员，副处长，中国工商银行总行信贷部副主任、主任，中国工商银行总行纪委书记。现已退休。

张克东先生，独立董事，学士，注册会计师。历任中国国际经济咨询公司（中信会计师事务所）项目经理，中信会计师事务所副主任，中天信会计师事务所副主任。2001年至今任信永中和会计师事务所副总经理、合伙人。

鲍卉芳女士，独立董事，法学硕士，律师。曾任职于最高人民检察院法纪厅，2003年5月至今任北京市康达律师事务所律师。

2、监事会成员

袁王祥先生，监事会主席，学士，高级会计师，注册会计师，注册税务师。历任苏州市食品公司（食品商场）财务主管，苏州新区财政税务局税务专管员，糖酒员，国融苏州鸿济贸易发展公司财务部经理，朋友化妆品（苏州）有限公司总务科/财务科科长，苏州工业园区教育发展投资有限公司财务投资部总经理，苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司财务总监。2008年8月至今任苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司财务总监。

刘兴旺先生，监事，硕士，经济师。历任广发证券股份有限公司投资银行部项目经理、高级经理，广发证券股份有限公司总裁秘书，广发证券股份有限公司投资自营部投资经理，香江投资有限公司总裁助理，香江投资有限公司副总裁。2007年10月至今任广东宝丽华新能源股份有限公司投资管理总监、宝新能源投资有限公司董事、副总经理。

聂武鹏先生，职工代表监事，硕士。历任天虹商场股份有限公司培训专员、TCL集团股份有限公司招聘及培训经理、深圳迅雷网络技术有限公司高级招聘经理、国金通用基金管理有限公司筹备组综合管理部总经理助理兼人力资本经理、综合管理部副总经理兼人力资本经理、综合管理部总经理、运营支持部总经理。2014年12月至今任国金基金管理有限公司运营总监兼运营支持部总经理、北京千石创富资本管理有限公司监事会主席。

徐祥瑜先生，职工代表监事，硕士，通过国家统一司法考试。历任联想（北京）有限公司法律顾问、北京竞天公诚律师事务所专职律师、国金通用基金管理有限公司综合管理部高管秘书、监察稽核部总经理助理。2014年11月至今任国金基金管理有限公司合规风控部总经理助理。

3、总经理及其他高级管理人员

纪路先生，董事长，硕士EMBA。简历请见上文。

尹庆军先生，总经理，硕士。简历请见上文。

吴富佳先生，副总经理，博士。历任重庆广播电视大学继续教育学院副院长，泰康人寿保险公司研究部研究经理，金元证券研究所所经理，中邮创业基金管理有限公司研究主管，国金通用基金管理有限公司筹备组总经理助理兼首席经济学家、战略发展部总经理、投资研究部研究总监、长安基金管理有限公司研究总监兼基金经理，国金通用基金管理有限公司总经理助理兼投资总监。2013年1月至今任北京千石创富资本管理有限公司总经理。2015年4月至今任国金基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

张丽女士，督察长，硕士，通过国家司法考试，国际注册内部审计师。历任科学出版社法律事务部内部法律顾问、国金通用基金管理有限公司筹备组监察稽核部法律顾问、国金通用基金管理有限公司监察稽核部法律顾问、国金通用基金管理有限公司监察稽核部副总经理兼法律顾问、国金通用基金管理有限公司监察稽核部总经理。2014年7月至今任国金基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

宫雪女士，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，任产业分析师。2013年7月26日起担任本基金基金经理，截至2015年1月26日，宫雪同时兼任国金通用鑫安保本混合型证券投资基金的基金经理。2012年2月加盟国金通用基金管理有限公司，历任战略发展部产品经理兼投资研究部行业分析师、产品与金融工程部量化分析师、产品与金融工程部副总经理，产品与金融工程部副总经理兼投资研究部副总经理、产品与金融工程部总经理，2014年11月至今任指数投资事业部总经理。

5、投资决策委员会成员名单

投资决策委员会成员包括公司总经理尹庆军先生，副总经理兼投资总监吴富佳先生，量化投资总监欧阳立先生，量化投资事业部总经理陈伟先生，基金经理宫雪女士，基金经理徐艳芳女士，基金经理滕祖光先生，基金经理彭俊斌先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。

2、办理本基金备案手续。

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资。

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益。

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

6、编制季度、半年度和年度基金报告。

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格。

8、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务。

9、召集基金份额持有人大会。

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

11、以基金管理人名义，代表本基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资。

（2）不公平地对待其管理的不同基金资产。

（3）承销证券。

（4）违反规定向他人贷款或者提供担保。

（5）从事可能使基金财产承担无限责任的投资。

（6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营。

（2）违反基金合同或托管协议。

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益。

（4）在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露。

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管。

（6）玩忽职守、滥用职权。

（7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

（8）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（9）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序。

（10）贬损同行，以提高自己。

（11）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分。

（12）以不正当手段谋求业务发展。

（13）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象。

（14）其他法律、行政法规禁止的行为。

5、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规、规章和基金合同的规定，本着勤勉谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益。

（2）不利用职务之便为自己，受雇人或任何第三者谋取利益。

（3）不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

（4）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

（1）全面性原则：内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

（2）独立性原则：设立独立的监察稽核部与风险管理部，监察稽核与风险管理部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。

（3）相互制约原则：各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对内部控制负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。

（2）督察长：独立行使督察权利；直接对董事会负责；及时向董事会及/或董事会下设的相关专门委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告。

（3）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略。

（4）风险控制委员会：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控。

（5）合规风控部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；同时负责对投资事前及事中的风险监控，具体落实针对投研运作的相关法律法规、公司制度及日常的投研风控决策，设置相应的投研风控措施，并对各投资组合风险进行分析，对发现的异常及时向相关部门反馈，以作为调整投资决策的依据。

（6）业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门负责人对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

3、内部控制的措施

（1）建立、健全内控体系，完善内控制度；公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

（3）建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：分别建立了公司营运风险和投资风险控制委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作和投资有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

（5）建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

（6）使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。

（7）提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

4、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

（2）本公司人承诺根据市场变化和本公司发展不断完善内部合规控制。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司（简称“中国光大银行”）

住所：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

成立时间：1992年8月18日

组织形式：股份有限公司

注册资本：404.3479亿元人民币

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[2002]75号

联系人：张建春

电话：010-63639180

传真：010-63639132

网址：www.cebbank.com

（二）主要人员情况

法定代表人唐双宁先生，历任中国人民建设银行辽宁省分行办公室副主任（主持工作），中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长，中国人民银行沈阳市分行副行长、党组副书记，中国人民银行辽宁省分行党组成员兼沈阳市分行行长、党组书记，中国人民银行信贷管理司司长，中国人民银行货币金银局局长，中国人民银行银行监管一司司长，中国银行业监督管理委员会党委委员、副主席。现任中国光大集团董事长、党委书记，中国光大银行董事长、党委书记，光大证券股份有限公司董事长，中国光大控股有限公司董事会主席，中国光大国际有限公司董事会主席。

行长赵欢先生，曾任中国建设银行信贷部业务管理处副处长、处长、公司业务部综合管理处处长，公司业务部副总经理，厦门市分行副行长、公司业务部副总经理、总经理，上海市分行行长，中国建设银行副行长、党委委员。现任中国光大集团股份公司党委委员，兼任中国光大银行执行董事、行长、党委副书记。

曾闻学先生，曾任中国光大银行办公室副总经理，中国光大银行北京分行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资托管部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

截至2015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、国投瑞银融华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(LOF)、摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、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、大成策略回报股票型证券投资基金、大成货币市场基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金、泰信先行策略开放式证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、中欧新动力股票型证券投资基金（LOF）、国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、农银汇理深证100指数增强型证券投资基金、益民核心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、兴业商业模式优选股票型证券投资基金、工银瑞信保本2号混合型发起式证券投资基金、国金通用沪深300指数分级证券投资基金、中加货币市场基金、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、鑫元一年定期开放债券型证券投资基金、江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、泓德优选成长混合型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、中融新动力灵活配置混合型证券投资基金、红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金，共42只证券投资基金，托管基金资产规模881.83亿元。同时，开展了证券公司管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及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。

（四）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金托管人有关基金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；确保基金财产安全；保证基金托管业务稳健运行；保护基金份额持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

2、内部控制的原则

（1）全面性原则。内部控制必须渗透到基金托管业务的各个操作环节，覆盖所有的岗位，不留任何死角。

（2）预防性原则。树立“预防为主”的管理理念，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

（3）及时性原则。建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，及时处理，堵塞漏洞。

（4）独立性原则。基金托管业务内部控制机构独立于基金托管业务执行机构，业务操作人员和内控人员分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

3、内部控制组织结构

中国光大银行股份有限公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会，委员会委员由相关部门的负责人担任，工作重点是对总行各部门、各类业务的风险和内控进行监督、管理和协调，建立横向的内控管理制约体制。各部门负责分管系统内的内部控制的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。投资托管部建立了严密的内控督察体系，设有风险管理处，通过“全员全程”风险控制体系，加强证券投资基金托管业务的风险管理。

4、内部控制制度

中国光大银行股份有限公司投资托管部自成立以来严格遵照《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《信息披露办法》、《运作办法》等法律、法规的要求，并根据相关法律法规制订、完善了四十余项规章制度和实施细则，逐年重检，将风险控制落实到每一个工作环节。中国光大银行股份有限公司投资托管部以控制和防范基金托管业务风险为主线，在重要岗位（基金清算、基金核算、交易监督）还建立了安全保密区，安装了录像监视系统和录音监听系统，以保障基金信息的安全。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据法律、法规和基金合同等的要求，基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合等方式方法，对基金投资品种、投资组合比例每日进行监督；同时，对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反法律、法规和基金合同等规定的行为，及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、场外发售机构

（1）直销机构

1）国金基金管理有限公司直销中心

注册地址：北京市怀柔区府前街三号楼3-6

办公地址：北京市海淀区西三环北路87号国际财经中心D座14层

联系人：石迎春

联系电话：010-88005812

客服信箱：service@gfund.com

客服电话：4000-2000-18

传真：010-88005816

公司网站：www.gfund.com

2）国金基金网上直销系统

交易系统网址：https://trade.gfund.com

目前支持的网上直销支付渠道：建行卡、工行卡、天天盈、支付宝。

客户服务电话：4000-2000-18

客户服务信箱：service@gfund.com

2、其他销售机构

（1）中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

联系人：朱红

电话：010-63636153

客服电话：95595

网址：www.cebbank.com

（2）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街95号

办公地址：成都市青羊区东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘一兵

电话：028-86690070

客服电话：4006-600-109

网址：www.gjzq.com.cn

（3）银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

联系人：宋明

电话：010-66568450

客服电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

（4）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街188号

法定代表人：王常青

联系人：魏明

电话：010-85130588

客服电话：4008-888-108

公司网站：www.csc108.com

（5）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

客户服务电话：95565，4008-888-111

网址：www.newone.com.cn

（6）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

电话：010-60838995

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

（7）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

客服电话：95521

公司网址：www.gtja.com

（8）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话：021-23219000

客服电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话。

网址：www.htsec.com

（9）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

电话：010-63080985

客服电话：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（10）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：庞晓芸

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

（11）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

客服电话：95548

网址：www.citicsd.com

（12）华创证券有限责任公司

注册地址：贵州省贵阳市中华北路216号华创大厦

办公地址：贵州省贵阳市中华北路216号华创大厦

法定代表人：陶永泽

联系人：赵瑾

电话：0851-86525999

客服电话：400-866-6699

网址：www.hczq.com

（13）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（邮编：200031）

法定代表人：李梅

客服电话：95523或4008895523

国际互联网网址：www.swhysc.com

（14）申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人：许建平

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

（15）齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市经七路86号

办公地址：济南市经七路86号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（16）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

办公地址：深圳市华侨城深南大道9010号

法定代表人：黄扬录

客服电话：400-102-2011

网址：www.zsjn.com.cn

（17）杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：朱晓超

电话：021-60897840

客服电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

（18）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：汪林林

联系电话：0571-88911818

客服电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

（19）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

（20）北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系人：翟飞飞

电话：010-62020088

客服电话：4000-888-6661

网址：www.myfund.com

（21）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼东方财富大厦2楼

法定代表人：其实

联系人：丁珊珊

电话：010-85718402

客服电话：400-181-8188

网址：www.1234567.com.cn

（22）万银财富（北京）基金销售有限公司

注册（办公）地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元

法定代表人：李招弟

联系人：张莉

电话：010-59393923

客服电话：400-808-0069

网址：www.wy-fund.com

（23）深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦25层J单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦25层J单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

（24）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋

法定代表人：汪静波

联系人：王建辉

联系电话：021-38509612

客服电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

（25）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法定代表人：梁越

联系人：张晔

电话：010-56810792

客服电话：4007-868-868-5

网址：www.chtfund.com

（26）北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：车茜茜

电话：010-56183769

客服电话：400-678-5095

网址：www.niiji.net

（27）中信建投期货有限公司

注册地址：重庆渝中区中山二路107号上站大楼平街11-B

办公地址：重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼

法定代表人：彭文德

联系人：张斌

电话：021-58302346

客服电话：400-8877-780 023-63600049

网址：www.cfc108.com

（28）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

邮政编码：200127

法定代表人：沈继伟

联系人：吴鸿飞

电话：13764082541

客服电话：4000676266

网址：www.leadfund.com.cn

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机构销售基金，并及时公告。

3、场内发售机构

本基金的场内发售机构为具有基金销售资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深圳证券交易所网站查询）。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区太平桥大街17号

办公地址：北京西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

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：上海通力律师事务所

注册地址：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：吕红、黎明

联系人：黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

办公地址：中国北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

法定代表人：吴港平

经办注册会计师：汤骏、王珊珊

联系电话：010-58152145

传真：010-58114645

四、基金的名称

本基金名称：国金通用沪深300指数分级证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：股票型基金。

六、基金的投资目标

本基金的投资目标：本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深300指数，在严格控制基金的日均跟踪误差偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括沪深300指数的成份股、备选成份股（包括中小板、创业板及其它中国证监会核准上市的股票）、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、债券回购、资产支持证券、权证、股指期货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）。

本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的85%；每个交易日日终在扣除股指期货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5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%。

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。

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定，在履行适当的程序之后，进行融资融券。

八、基金的投资策略

本基金采用指数完全复制方法，按照标的指数成分股及权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复制指数的目的，力争保持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%。如遇特殊情况（如市场流动性不足、个别成分股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将对投资组合进行适当变通和调整，并运用股指期货等金融衍生工具，以实现对跟踪误差的有效控制。

1、投资组合的构建

本基金采用指数完全复制方法构建基金的股票投资组合，即根据个股在标的指数中相应的权重构建基金的指数化股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。

2、组合的调整

1）定期调整

根据标的指数的调整规则和对备选股的预期，对股票投资组合及时进行调整。

2）不定期调整

①当标的指数成份股发生包括股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等事件时，基金将根据指数公司的指数修正公告对投资组合进行相应调整。

②当成份股发生重大变化时（收购合并、分拆、退市等），基金将根据指数公司的临时调整公告对投资组合进行相应调整。

③根据本基金的申购赎回情况，对基金的股票投资组合进行调整，以实现对标的指数的有效跟踪。

④因成份股流动性不足、停牌等市场因素影响或法律法规及基金合同限制，基金无法购得相应足够数量的股票时，基金将搭配使用其他合理方法对相应股票进行合理替代并对投资组合进行相应调整。

⑤在其他影响本基金复制并跟踪标的指数的情况下，本基金管理人可根据市场情况，在以跟踪误差最小化的前提下，对基金的投资组合进行合理调整。

⑥如法律法规对指数型基金投资比例的规定进行调整，本基金将在履行适当程序后，对本基金的投资组合进行调整，无需召开持有人大会。

3、股票的替代

在建仓阶段和基金后续运作过程中，如遇到特殊情况（如：市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将根据市场情况以跟踪误差最小化为原则，行业、规模、历史表现相似度为标准，采用合理的方法进行适当调整和替代。

4、股指期货投资策略

本基金将适度运用股指期货，对本基金投资组合的跟踪效果进行调整及优化，以提高投资效率，控制基金投资组合风险并更好的实现本基金的投资目标。具体来说，本基金将运用股指期货来控制预期大额申购赎回等情况下的流动性风险，有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距，确保投资组合对指数跟踪的效果。

本基金管理人运用股指期货是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

5、跟踪误差的监控与管理

跟踪误差的管理将作为本基金主要的风险控制手段之一，基金经理及风险控制部门将每日跟踪投资组合与标的指数投资回报率之间的偏离度。月末、季末定期对基金投资组合与标的指数收益率间的累积偏离程度进行归因分析，并对控制跟踪误差提出解决方案。

九、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为中证指数有限公司发布的沪深300指数。

本基金的业绩比较基准为：95%×沪深300指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）

沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数，由中证指数公司编制和维护，是在上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的，指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。关于指数值和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司。

如果法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的指数时，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，经基金管理人和基金托管人协商一致，可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准，并及时按照《信息披露办法》的规定公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，国金沪深300A份额具有低风险、收益相对稳定的特征