

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1号

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
二〇一五年三月

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,但不保证投资本金一定盈利,也不保证最低收益。当投资者赎回时,赎回资金可能低于投资者先前所支付的金额。本基金管理人建议基金投资者根据自身风险收益偏好,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,投资者在认购(或申购)本基金时应认真阅读读本基金的招募说明书和基金合同。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担负责。

本招募说明书所载内容截止日为2015年1月26日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2014年12月31日。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:国金通用基金管理有限公司
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:010-88005632
注册资本:2.8亿元人民币
股权结构:
国金通用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、中国通用技术(集团)控股有限责任公司,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
纪晓先生,董事长,硕士EMBA。历任博时基金管理有限公司分析师,国金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副总经理,现任国金通用基金管理有限公司副总经理,中国证券业协会上市公司专业评价专家、四川证券业协会创新咨询委员会委员主任委员。2011年11月至今任国金通用基金管理有限公司董事长。
金鹏先生,董事,研究生学历。历任涌金期货经纪有限公司总经理助理,上海金理财富顾问有限公司副总经理,河北证券有限责任公司总经理,瀚金实业(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鼎兴投资有限公司投资委员会委员。
林春海先生,董事,硕士。历任北京水利电力经济管理干部学院经济系教师,中国机械进出口总公司财会部科长、中机公司驻法国机构财务部负责人、中国通用技术(集团)控股有限责任公司财务管理总部金融部经理,中国通用技术(集团)控股有限责任公司金融事业部副部长。现任通用技术集团投资管理有限公司(金融事业部)党委书记、副总经理。
许强先生,董事,硕士。历任苏州期货交易所交易部、交割部,信息部总经理,中国通用物产集团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管理部总经理,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责任公司董事长。

“运喜先生,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,办公厅科研外事秘书,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主任督察长,国金通用基金管理有限公司督察长,2012年7月至今任国金通用基金管理有限公司总经理。

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科科员,中国农业银行总行企业信贷局科员,中央财经大学科员,中国医学科学院,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。
李强先生,独立董事,学士,注册会计师。历任中国国旅经济咨询公司(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董事长。2001年至今任中天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6月至今任北京市康达律师事务所律师。

2.监事会成员

刘兴旺先生,监事会主席,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副总裁,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。

袁玉祥先生,监事,学士,高级会计师,注册会计师,注册税务师。历任广州市食品公司(食品商场)财务主管,苏州高新区财政税务局税务专员、稽查员,国储苏州湾经济贸易发展公司财务部经理、财务收支(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集团有限公司财务总监。

聂武鹏先生,职工代表监事,硕士。历任虹虹商场股份有限公司培训专员,TCI集团股份有限公司招聘及培训经理,深圳讯盈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源经理,综合管理部总经理兼人力资源部经理,综合管理部总经理,运营支持部总经理。2014年12月至今任国金通用基金管理有限公司运营总监兼运营支持部总经理。

徐煊翰先生,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,北京鑫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法务、监察稽核部总经理助理。2014年11月至今任国金通用基金管理有限公司合规风控部总经理助理。

3.总经理及高级管理人员

纪晓先生,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。
张丽女士,督察长,硕士。通过国家司法考试,国金通用基金管理有限公司筹备组法律事务部内部法律顾问,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人力资源部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月至今任国金通用基金管理有限公司督察长。

4.基金经理

王程女士,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管理工作,任产品经理。2013年7月26日起担任本基金基金经理,截至2015年1月26日,管理期间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2日加盟国金通用基金管理有限公司,历任战略发展部产品部经理兼投资研究部行业分析师、产品与金融工程组高级量化分析师、产品与金融工程部副总经理,产品与金融工程组总经理兼指数投资部副总经理,产品与金融工程组总经理,2014年11月至今任国金通用基金管理有限公司总经理。

投资决策委员会成员名单
投资决策委员会包括公司总经理尹庆军先生,投资总监吴富佳先生,量化投资总监傅国良先生,量化投资部总经理陈伟先生,基金运营管理部李女士,基金经济齐达铮先生,基金经理徐艳芳女士,基金经理陈祖光先生。

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.依法募集基金,办理或者委托证券投资基金销售机构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,代表本基金基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为。

(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财产从事证券投资。
(2)不公平对待对待其管理的不同基金财产。
(3)承销证券。
(4)将基金财产用于担保、承销、资金拆借或者贷款。
(5)从事可能使基金财产承担无限责任的投资。
(6)依照法律、行政法规的有关规定,由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律法规禁止从事的其他行为。
4.基金管理人承诺加强从业人员管理,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)承销或承销证券。
(2)违反基金合同或托管协议。
(3)故意将本基金财产挪用于人或其他基金相关机构的合法权益。
(4)在包括中国中国证监会报送的资讯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,尚未依法公开基金投资内容、基金投资计划等信息。
(8)除按基金管理人制度进行基金运作投资外,直接或间接进行其他股票交易。
(9)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。
(10)违反证券交易所业务规则,利用对敲、对倒、倒仓等手段操

纵市场操纵,扰乱市场秩序。
(11)操纵市场,以提高自己。
(12)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈性内容。
(13)以不正当手段谋求业务发展的。
(14)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象。
(15)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,尚未依法公开的基本投资内容、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。
(5)基金管理人内部控制制度

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,渗透各项业务操作流程和业务环节。
(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,对内部控制负完全和最终的职责。
(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用,制定本基金的投资配置方案和基本投资原则。
(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:负责对公司的风险管理政策和措施的执行情况进行监控,并为每一个部门的风险管理系统的运行提供协助,使公司在一种风险和可控的环境中实现业务目标;对投资事前及事中的风险监控,具体落实针对投资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,对发现异常及/或异常情况向相关部门反馈,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重要的责任,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.内部控制措施
(1)建立、健全内控体系,完善内控制度,建立、健全了内部控制,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,确保监察稽核工作独立性和有效性,得到高级管理人员的支持,同时置备操作手册,并定期更新。
(2)建立相互分离、相互制约的内控机制,建立、健全了各项制度,做到基金经理分开,投资决策分开,基金业务集中,形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制,从制度上防止和防范风险。
(3)建立、健全岗位职责,建立、健全了岗位责任制,使每个员工都明确自己的任务、责任和权力,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:分别建立了公司运营和投资的合规风险控制委员会,使用标准化的程序,确认评估与公司运作和投资有关的风险;公司建立了自上而下的风险评估程序,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处理决策。
(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方位和实时的监控。
(6)使用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)提供培训及咨询: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,使其明确其职责所在,控制投资风险。

4.基金管理人关于内部控制制度声明书
(1)基金管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。
(2)基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制和风险控制。

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:中国证监会证监基金字[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,中国人民银行资产管理委员会委员,中国人民银行光大集团董事主席,中国光大银行董事长、党委书记,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。现任中国光大银行行长,中国光大(集团)总公司执行董事、党委书记,兼任中国光大银行党委副书记。

曾同辉先生,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2014年12月31日,中国光大银行股份有限公司托管国投瑞银锐创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、国投瑞银新增长保本混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫鑫源优选混合型证券投资基金(OP)、摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、工银瑞信回报混合型证券投资基金、博时转债增强债券型证券投资基金、大成策略保本投资股票证券投资基金、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、光大保德信添利季度开放短期理财产品证券投资基金、国联安双债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、招商安增债券型证券投资基金、中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)、国金通用鑫惠灵活配置混合型发起式证券投资基金、农银汇理深证100指数增强证券投资基金、益民核心成长灵活配置混合型证券投资基金、建信信用债2号证券投资基金、兴业商业模式优选股票型证券投资基金、工银瑞信保本2号证券投资基金、国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金、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、汇安基金定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元德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、鑫元合孚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,共32只证券投资基金,托管基金资产规模432.844亿元。同时,开展了对企事业单位集合资产管理计划、专户理财、企业年金基金、ODI、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、股权基金等产品的托管业务。

(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,保证基金托管业务的稳健运行;保护基金份额持有人的合法权益。
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,防范于未然,尽量避免业务操作中出现各种问题的产生。
(3)及时性原则:建立健全各项控制制度,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、各类业务的风险控制和内部控制负责,管理和协调、建立横向的内部控制管理体制。各部门负责管理体系内部的控制措施的实施,建立纵向的内部控制管理制度。投资托管部建立了完善的内控监察体系,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,完善了四十多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风险和防范基金托管业务风险为主线,在重固旧制(基金清算、基金核算、交易监督)还建立了安全保密区,安装了录像监控系统 and 录音监听系统,以保障基金信息的安全。

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,以及以书面或电子形式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,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)国金通用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
法定代表人:石迎春
联系电话:010-88005812
客服信箱:service@gtfund.com
客服电话:4000-2000-18
传真:010-88005816
公司网站:www.gtfund.com

2)国金通用基金网上直销系统
交易系统网址:https://trade.gtfund.com
目前支持的网上直销支付方式:建行卡、天添盈、支付宝、工行卡。
客户服务电话:4000-2000-18
客户服务信箱:service@gtfund.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,甲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:朱虹
电话:010-63636153
客服电话:95566
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:尹庆军
联系人:刘一宏
电话:028-86690070
客服电话:4006-600-109
网址:www.gjqz.com

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 国际金融中心A座C 座
办公地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人:陈有安
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号写字楼
办公地址:北京东城区朝内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:魏明
电话:010-85130579
客服电话:4008-888-108
网址: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:李南生
联系人:黄辉群
电话:0755-82960167
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:侯晓红
电话:010-60838995
客服电话:95558
网址:www.csc108.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:上海市浦东新区世纪大道168号上海银行大厦29楼
法定代表人:王建华
联系人:卢敏祺
电话:021-38768666
客服电话:400-8888-666
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:李奕明
电话:021-23219275
客服电话:95553或拨打客户营业网点咨询电话。
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:唐国
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:万鸣
电话:025-83290979
传真:025-84979763
客服电话:95597
网址:www.htsc.com

11)中银证券(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1楼
第20层
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠
电话:0532-85022326
客服电话:95548
网址:www.bocis.com

12)中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人:沈强
联系人:李瑞端
电话:0571-87072507
客服电话:0571-95268
网址:www.bigsun.com

13)华信证券有限责任公司
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:赵峰
电话:0851-8862590
客服电话:400-866-6699
网址:www.hczq.com

14)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:李杨
联系人:张帆
电话:021-60897940
传真:021-7166-123
客服电话:95523
网址:www.swhysc.com

15)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:许建建
客服电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com

16)齐鲁证券有限公司
注册地址:济南市经七路66号
办公地址:济南市经七路66号
法定代表人:李扬
联系人:李杨
电话:0531-95538
网址:www.zsqa.com

17)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研发大楼7层,8层
办公地址:深圳市福田区深南大道9010号
法定代表人:黄扬流
客服电话:400-102-2011
网址:www.zszq.com

18)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:张帆
电话:021-60897940
传真:021-7166-123
客服电话:95523
网址:www.fund123.com

19)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:胡煜
联系人:胡煜
电话:0571-89911178
客服电话:4007-7788-778
网址:www.5ifund.com

20)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695弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区 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
21)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号民族大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:董云飞
电话:010-22020088
客服电话:4000-888-6661
网址:www.myfund.com

22)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
电话:010-85718402
客服电话:400-181-8188
网址:www.1224667.com.cn

23)广发银行(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
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:魏广
电话:010-60939223
客服电话:400-808-0069
网址:www.gyfund.com

24)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L1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L1单元
法定代表人:曹峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
客服电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.com/www.jmmw.com

25)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号东明园C栋
法定代表人:汪静波
联系人:王健辉
联系电话:021-3850 9612
客服电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com

26)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3层1522室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路口乐成中心A座23层
法定代表人:梁越
联系人:陈娜
电话:010-57761009
客服电话:4007-868-868-5
网址:www.chtfund.com

27)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:赵春春
联系人:魏善
电话:010-57418829
客服电话:400-678-5096
网址:www.niuinjie.com

28)中信建投期货有限公司
注册地址:重庆渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B
办公地址:重庆渝中区中山三路107号上站大楼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.citic108.com

基金管理人可根据法律法规的要求,选择其他符合要求的机构销售本基金,并及时公告。
2.场内发售机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京西城区太平桥大街17号
法定代表人:金磊
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:上海通石律师事务所
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:吕斌、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:王珊珊、李俊良
联系电话:010-58152415
传真:010-58114645

四、基金的名称

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,在严格控制投资标的日均跟踪误差偏离度和年度跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相仿的投资收益。

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投资)、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和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履约保证金后,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

本基金采用指数化复制策略,按照标的指数成份股及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的调整。
1.组合调整
根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,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增发、分红、配股、增发、停牌、复牌等事件时,基金将根据根据指数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),基金将根据指数的临时调整公告对投资组合进行相应调整。
③根据本基金申购赎回情况,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,基金无法购得相应数量基金的股票时,基金将按使用其他合理方法对指数股票进行合理替代并对投资组合进行调整。
⑤在基金影响本基金复制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.建仓的替代
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辅助调整及优化,以提高投资效率,控制本基金投资组合风险并更好地实现本基金的投资目标。具体操作,本基金将运用股指期货来控制大额申购赎回等情况下的流动性风险,有效减少基金组合仓位调整与跟踪标的之间的差距,确保投资组合对跟踪标的效果。本基金管理人运用股指期货是以追求基金充分投资,减少交易成本,降低跟踪误差为目的,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.跟踪误差的控制与管理
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将每日跟踪基金组合与标的指数投资回报率之间的偏离度。月末、季末对本基金投资组合与标的指数收益率间的累积跟踪误差进行原因分析,并对控制跟踪误差提出解决方案。

九、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:中证综合指数成份股的沪深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