

# 国金沪深300指数分级证券投资基金管理说明书(更新)摘要

2016年第1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  
二〇一六年三月

重要提示

国金沪深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21日获中国证监会证监许可[2013]694号文批准。

本基金管理人承诺招募说明书中内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会不对本基金的投资价值及风险作出实质性判断,

并不表明其对本基金的投资价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明其对本基金没有风险。

本基金管理人和基金销售机构已就本基金的风险特征及其可能存在的投资风险和收益向投资人进行了充分揭示,投资人认购、申购或赎回本基金时,所

得的金额将高于或低于投资人先前支付给基金管理人的金额。

本基金管理人根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并长期持有。

(1)建立健全内控体系,完善内控制度,建立健全了内控结构,高管人员在内控中的风险管理分工,确保各项业务活动有适当的组织和授权,确保监察稽核工作是独立的,并得到高级管理人员的支持,同时设置操作手册,并定期更新。

(2)建立岗位责任制,负责对投资前事及事中的风险监控,具体落实针对投资项目的相关决策机制,公司制度对日常的投研决策控制,设置相应的投研风控措施,并根据各自职责进行分析,对发现的异常及时向相关部门反馈,以作为投资决策的参考。

(3)建立岗位责任制,每一个部门的首要责任,部门负责人对本部门的内控负全部责任,负责履行公司的风险管理程序,负责本部门的风险管理。

(4)建立风险控制委员会,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体系提供协助,使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标;负责对投资前事及事中的风险监控,具体落实针对投资项目的相关决策机制,公司制度对日常的投研决策控制,设置相应的投研风控措施,并根据各自职责进行分析,对发现的异常及时向相关部门反馈,以作为投资决策的参考。

(6)业务部门:风险管理是每一个部门的首要责任,部门负责人对本部门的内控负全部责任,负责履行公司的风险管理程序,负责本部门的风险管理。

(7)建立内部控制系统,建立了内部的内部控制制度,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(8)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(9)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(10)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(11)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(12)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(13)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职责,承担起各自的岗位工作中的风险隐患,以防范和减少风险。

(14)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(15)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(16)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(17)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(18)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(19)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(20)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(21)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职责,承担起各自的岗位工作中的风险隐患,以防范和减少风险。

(22)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(23)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(24)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(25)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(26)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(27)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(28)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(29)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(30)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(31)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(32)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(33)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(34)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(35)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(36)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(37)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(38)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(39)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(40)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(41)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(42)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(43)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(44)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(45)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(46)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(47)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(48)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(49)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(50)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(51)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(52)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(53)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(54)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(55)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(56)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(57)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(58)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(59)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(60)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(61)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(62)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(63)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(64)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(65)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(66)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(67)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(68)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(69)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(70)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(71)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(72)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司及

时采取有效的措施对风险进行分析、控制和规避,尽可能地减少损失。

(73)提供足量的培训,制定了充足的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使之明确其所在岗位的控制风险。

(74)建立风险分类、识别、评估、报告、提示和缓释,分别建立了公司营运风险

和投资风险管理委员会,对风险进行定期评估与投资有关的

风险;公司建立了自上而下的风险报告程序,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,从而以最快的速度作出决策。

(75)建立内部控制系统,建立了所有的内部监控系统,如风险预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行实时的监控。

(76)使用数量化的风险管理手段,采取相一致性的风险管理手段,建立数据量化的风险管理模型,以提示和指导趋势、行业及个股的走势,以便公司