国金沪深300指数增强证券投资基金 2017年度报告摘要

基金管理人:国金基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2018年3月27日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告正文中一切关于数字等内容,均以人民币为单位,除非另有说明。

基金管理人保证以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告对财务报告作出审计的,应当同时阅读审计报告的全文。

[2017年1月1日至2017年12月31日]至[2017年12月31日]

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(单位:人民币元)

基金名称	国金沪深300指数增强证券投资基金
基金简称	国金300指数增强
场内简称	-
基金主代码	167601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月1日
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
报告期末基金份额总额	184,086,364.18份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注:1.国金沪深300指数增强证券投资基金(以下简称"国金300指数增强")于2017年9月1日生效。

2.2 基金基本情况(单位:人民币元)

基金名称	国金沪深300指数分级证券投资基金
基金简称	国金300
场内简称	国金300
基金主代码	167601
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月26日
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
报告期末基金份额总额	196,694,895.56份
基金合同存续期(若有)	不定期
基金份额上市的证券交易所(若有)	深圳证券交易所
上市日期(若有)	2013年8月23日

| 下属分级基金的基金简称 | 国金300A | 国金300B | 国金300 |
ⁿ
|---|---|---|---|
下属分级基金的场内简称	国金300A	国金300B	国金300
下属分级基金的交易代码	150140	150141	167601
报告期末下属分级基金份额总额	78,389,667.00份	78,389,667.00份	39,915,561.56份

注:1.国金300指数增强证券投资基金(以下简称"国金300指数增强")于2017年9月1日生效。

2.2 基金产品说明(转型前)

投资目标	本基金为股票指数增强型基金,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化方法进行标配的指数权重管理与风险控制,力争实现超越业绩比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以指数化投资为主,增强型投资为辅,力求投资收益能够跟踪并超越标的指数。
业绩比较基准	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)。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

注:1.国金300指数增强证券投资基金(以下简称"国金300指数增强")于2017年9月1日生效。

2.2 基金产品说明(转型后)

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。
投资策略	本基金采用指数完全复制方法,按照标的指数成份股及权重构建基金的投资组合,并根据标的指数成份股及权重的变动进行相应的调整,以达到跟踪和复制标的指数的目的。力争每日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过8%。如遇特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资、投资基金、股指期货、融资融券交易品种等投资品种等数量限制)基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整,并运用投资经验予以弥补,以实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	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)。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,从基金所分离的两类基分别来看,国金沪深300A分额具有较高的风险、较低的预期收益;国金沪深300B分额具有较高的风险、较高的预期收益。
下属分级基金的风险收益特征	从本基金所分离的两类基分别来看,国金沪深300A分额具有较低的风险、较低的预期收益;国金沪深300B分额具有较高的风险、较高的预期收益。

注:1.国金300指数增强证券投资基金(以下简称"国金300指数增强")于2017年9月1日生效。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨海燕	石立平
	联系电话	010-88006970	010-63639180
	电子邮箱	yanghaiyan@gfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95595
传真		010-88006666	010-63639132

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金管理人管理的基金情况

3.2 主要会计数据和财务指标(转型前)

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年9月1日(基金合同生效日)至2017年12月31日)
	转型后
本期已实现收益	13,419,593.96
本期利润	12,907,227.14
加权平均基金份额本期利润	0.0666
本期加权平均净值利润率	6.36%
本期基金份额净值增长率	6.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年12月31日)
期末可供分配利润	-9,486,411.26
期末可供分配基金份额利润	-0.0515
期末基金资产净值	196,299,409.69
期末基金份额净值	1.0663
3.1.3 期末指标	报告期末(2017年12月31日)
基金份额累计净值增长率	6.63%

注:本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润计算方法:如期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润为期末未分配利润的未实现部分与期末未分配利润的未实现部分之和;如期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润为期末未分配利润的未实现部分与期末未分配利润的未实现部分之差。

3.2 基金管理人管理的其他基金情况

| 基金名称 | 基金类型 | 投资范围 | 日净值规模(亿元) | 业绩比较基准 | 成立日 | 年度末基金份额净值 | 年度末基金份额总额 | 年度末基金资产净值 | 年度末基金份额净值增长率 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | 年度末基金份额持有人户数 | 年度末基金份额持有人户数变化 | 年度末基金份额持有人户数变化率 | 年度末基金份额持有人户数变化率 | 年度末基金份额持有人户数变化率