

中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要

编制日期: 2025 年 3 月 18 日

送出日期: 2025 年 3 月 26 日

本概要提供本基金的重要信息, 是招募说明书的一部分。
作出投资决定前, 请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	中金沪深 300ETF	基金代码	510320
基金管理人	中金基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	-	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 -
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	刘重晋	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2012 年 02 月 22 日
其他	场内简称: 300 中金 (扩位简称: 沪深 300ETF 中金)		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资目标	紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内, 年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资范围	<p>标的指数: 沪深 300 指数</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股 (含存托凭证)。</p> <p>为更好地实现投资目标, 本基金还可投资于非成份股 (包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券 (包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款 (包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具 (包括股指期货、国债期货、股票期权等)、现金等, 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的相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为: 本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股 (含存托凭证) 的比例不低于基金资产净值的 90%, 且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权合约的投资比例遵循国家相关法律法规。</p>

	如果法律法规或中国证监会允许基金变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，预期年化跟踪误差不超过 2%。具体包括：1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券和货币市场工具投资策略；4、衍生品投资策略；5、参与融资与转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

注：详见《中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》第十一部分“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

注：暂无。

(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

注：暂无。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率
认购费	S < 50 万份	0.80%
	50 万份 ≤ S < 100 万份	0.50%
	S ≥ 100 万份	1,000 元/笔
申购费 (前收费)	投资人在申购本基金时，申购赎回代理机构可按照不超过 0.5% 的标准向投资人收取佣金，其中包含证券/期货交易所、登记机构等收取的相关费用。	
赎回费	投资人在赎回本基金时，申购赎回代理机构可按照不超过 0.5% 的标准向投资人收取佣金，其中包含证券/期货交易所、登记机构等收取的相关费用。	

注：1、基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购及网下现金认购时可参照上述费率结构，按照不超过认购份额 0.80% 的标准收取一定的佣金。

2、场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.15%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
其他费用	费用的计算方式及支付方式详见招募说明书及相关公告	

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生金额从基金资产扣除。

(三) 基金运作综合费用测算

注：暂无。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资于本基金的主要风险有：

1、市场风险，主要包括：（1）政策风险；（2）经济周期风险；（3）利率风险；（4）债券收益率曲线风险；（5）上市公司经营风险；（6）购买力风险；（7）再投资风险；（8）债券回购风险；2、信用风险；3、流动性风险；4、管理风险；5、估值风险；6、操作及技术风险；7、合规性风险；8、其他风险；

9、本基金特有风险：（1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险；（2）成份股停牌的风险；（3）标的指数波动的风险；（4）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险；（5）跟踪误差控制未达约定目标的风险；（6）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险；（7）参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险；（8）退市风险；（9）投资者申购失败的风险；（10）投资者赎回失败的风险；（11）基金份额赎回对价的变现风险；（12）套利风险；（13）申购赎回清单差错风险；（14）二级市场流动性风险；（15）第三方机构服务的风险；（16）退补现金替代方式的风险；（17）期货投资风险；（18）资产支持证券投资风险；（19）期权投资风险；（20）流动性受限证券投资风险；（21）转融通证券出借业务风险；（22）参与融资业务的风险；（23）存托凭证投资风险。

(二) 重要提示

本基金的募集申请于 2024 年 12 月 11 日经中国证监会证监许可[2024]1814 号文注册。中国证监会对本基金募集的注册，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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的临时相关公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：www.ciccfund.com，客服电话：400-868-1166

基金合同、托管协议、招募说明书

定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料

六、其他情况说明

无。