

中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（C 类份额）

基金产品资料概要

编制日期：2025 年 7 月 7 日

送出日期：2025 年 7 月 8 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 联接 | 基金代码 | 023146 |
| 下属基金简称 | 中金沪深 300ETF 联接 C | 下属基金交易代码 | 023147 |
| 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 | 2025 年 07 月 09 日 | 上市交易所及上市日期 | - |
| 基金类型 | 基金中基金 | 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 | 2025 年 07 月 09 日 |
| | | 证券从业日期 | 2012 年 02 月 22 日 |

注：中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金由中金沪深 300 指数型证券投资基金变更而来。自 2025 年 7 月 9 日起，中金沪深 300 指数型证券投资基金变更为中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资范围 | <p>标的指数：沪深 300 指数</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、股票期权、国债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）。</p> <p>本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和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：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。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，本基</p> |

| | |
|---------------|--|
| | 金保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如果法律法规或中国证监会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 | 在正常市场情况下，本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。具体包括：1、资产配置策略；2、目标 ETF 投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、债券和货币市场工具投资策略；6、股指期货、国债期货及股票期权的投资策略；7、转融通证券出借业务投资策略；8、融资投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为 ETF 联接基金，且目标 ETF 为采用指数化操作的股票型基金，因此本基金的预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

注：详见《中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》第九部分“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 |
|-----------------|---------------------|---------|
| 申购费（前收费） | 本基金 C 类基金份额不收取申购费 | |
| 赎回费 | N < 7 天 | 1.50% |
| | N ≥ 7 天 | 0% |

(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 |
| 销售服务费 | 0.20% | 销售机构 |
| 审计费用 | 45,000.00 元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 元 | 规定披露报刊 |
| 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：（1）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。审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（2）本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费、托管费。

（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、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险；9、其他风险；

10、本基金特有风险：（1）联接基金投资于目标 ETF 的相关风险；（2）与目标 ETF 业绩差异的风险；（3）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险；（4）标的指数波动的风险；（5）跟踪偏离风险；（6）跟踪误差控制未达约定目标的风险；（7）成份股停牌的风险；（8）指数编制机构停止服务的风险；（9）期货投资风险；（10）资产支持证券投资风险；（11）期权投资风险；（12）流动性受限证券投资风险；（13）转融通证券出借业务风险；（14）参与融资业务的风险；（15）存托凭证投资风险；（16）启用侧袋机制的风险。

（二）重要提示

中金沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金由中金沪深 300 指数型证券投资基金变更而来。中国证监会对中金沪深 300 指数型证券投资基金募集的注册，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。