

建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

招募说明书(更新)摘要

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

二〇一七年四月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2011 年 7 月 14 日证监许可[2011]1092 号文核准募集。本基金的基金合同于 2011 年 9 月 8 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准，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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。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，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为深证基本面 60ETF 的联接基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合

基金、债券型基金和货币市场基金。

投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 3 月 7 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 12 月 31 日（财务数据已经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

设立日期：2005 年 9 月 19 日

法定代表人：许会斌

联系人：郭雅莉

电话：010-66228888

注册资本：人民币 2 亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准设立。

公司的股权结构如下：

股东名称 股权比例

中国建设银行股份有限公司 65%

美国信安金融服务公司 25%

中国华电集团资本控股有限公司 10%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不得以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由 9 名董事组成，其中 3 名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会履行《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总裁等经营管理人员的监督 and 奖惩权。

公司设监事会，由 6 名监事组成，其中包括 3 名职工代表监事。监事会向股东会

负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高管尽职情况。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

许会斌先生，董事长。2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。自2011年3月至2015年3月，出任中国建设银行批发业务总监；自2006年5月至2011年3月任中国建设银行河南省分行行长；自1994年5月至2006年5月历任中国建设银行筹资储备部副主任，零售业务部副总经理，个人银行部副总经理，营业部主要负责人、总经理，个人银行业务部总经理，个人银行业务委员会副主任，个人金融部总经理。许先生是高级经济师，并是国务院特殊津贴获得者，曾荣获中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章等奖项。1983年辽宁财经学院基建财务与信用专业大学本科毕业。

孙志晨先生，董事，现任建信基金管理有限责任公司总裁，兼建信资本管理公司董事长。1985年获东北财经大学经济学学士学位，2006年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长，中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长，中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。

曹伟先生，董事，现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副总经理、北京分行安华支行副行长、北京分行西四支行副行长、北京分行朝阳支行行长、北京分行个人银行部总经理、中国建设银行个人存款与投资部总经理助理。

张维义先生，董事，现任信安北亚地区副总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院，获经济学学士学位，2012年获得华盛顿大学和复旦大学EMBA工商管理学硕士。历任新加坡公共服务委员会副处长，新加坡电信国际有限公司业务发展总监，信诚基金公司首席运营官和代总经理，英国保诚集团（马来西亚）资产管理公司首席执行官，宏利金融全球副总裁，宏利资产管理公司（台湾）首席执行官和执行董事。

袁时奋先生，董事，现任信安国际（亚洲）区域副总裁。1981年毕业于美国阿而比学院。历任香港汇丰银行投资银行部副经理，加拿大丰业银行资本市场部高级经理，香港铁路公司库务部助理司库，香港置地集团库务部司库，香港赛马会副集团司库，信安国际有限公司大中华区首席营运官。

殷红军先生，董事，现任中国华电融资租赁有限公司董事长兼总经理。1998年毕业于首都经济贸易大学数量经济学专业，获硕士学位。历任中国电力财务有限公司债券基金部项目经理、华电集团财务有限公司投资咨询部副经理（主持工作）、中国华电集团公司改制重组办公室副处长、体制改革处处长、政策与法律

事务部政策研究处处长、中国华电集团资本控股有限公司副总经理。

李全先生，独立董事，现任新华资产管理股份有限公司董事总经理。1985年毕业于中国人民大学财政金融学院，1988年毕业于中国人民银行研究生部。历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员、正大国际财务有限公司总经理助理/资金部总经理，博时基金管理有限公司常务副总经理，新华资产管理股份有限公司总经理。

王建国先生，独立董事，曾任大新人寿保险有限公司首席行政员，中银保诚退休金信托管理有限公司董事，英国保诚保险有限公司首席行政员，美国国际保险集团亚太区资深副总裁，美国友邦保险(加拿大)有限公司总裁兼首席行政员等。

1989年获 Pacific Southern University 工商管理硕士学位。

伏军先生，独立董事，法学博士，现任对外经济贸易大学法学院教授，兼任中国法学会国际经济法学研究会常务理事、副秘书长、中国国际金融法专业委员会副主任。

2、监事会成员

张军红先生，监事会主席。毕业于国家行政学院行政管理专业，获博士研究生学位。历任中国建设银行筹资部储蓄业务处科员、副主任科员、主任科员；零售业务部主任科员；个人银行业务部个人存款处副经理、高级副经理；行长办公室秘书一处高级副经理级秘书、秘书、高级经理；投资托管服务部总经理助理、副总经理；投资托管业务部副总经理；资产托管业务部副总经理。2017年3月起任公司监事会主席。

方蓉敏女士，监事，现任信安国际（亚洲）有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团新市场发展区域总监和美国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。方女士1990年获新加坡国立大学法学学士学位，拥有新加坡、英格兰和威尔士以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士，监事，高级会计师，现任中国华电集团资本控股有限责任公司机构与风险管理部经理。1992年获北京工业大学工业会计专业学士，2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北奥有限公司，中进会计师事务所，中瑞华恒信会计师事务所，中国华电集团财务有限公司计划财务部经理助理、副经理，中国华电集团资本控股（华电财务公司）计划财务部经理，中国华电集团财务有限公司财务部经理，中国华电集团资本控股有限公司企业融资部经理。

严冰女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司人力资源部副总经理。

2003年7月毕业于中国人民大学行政管理专业，获硕士学位。曾任安永华明会计师事务所人力资源部人力资源专员。2005年8月加入建信基金管理公司，历任人

力资源管理专员、主管、部门总经理助理、副总经理。

刘颖女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部副总经理，英国特许公认会计师公会（ACCA）资深会员。1997年毕业于中国人民大学会计系，获学士学位；2010年毕业于香港中文大学，获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师、华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。

2006年12月至今任职于建信基金管理有限责任公司监察稽核部。

安晔先生，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司信息技术部总经理。

1995年毕业于北京工业大学计算机应用系，获得学士学位。历任中国建设银行北京分行信息技术部，中国建设银行信息技术管理部北京开发中心项目经理、代处长，建信基金管理公司基金运营部总经理助理、副总经理，信息技术部执行总经理、总经理。

3、公司高管人员

孙志晨先生，总裁（简历请参见董事会成员）。

曲寅军先生，副总裁，硕士。1999年7月加入中国建设银行总行，历任审计部科员、副主任科员、团委主任科员、重组改制办公室高级副经理、行长办公室高级副经理；2005年9月起就职于建信基金管理公司，历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监和首席战略官；2013年8月至2015年7月，任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理。

2015年8月6日起任我公司副总裁，并专任建信资本管理有限责任公司董事、总经理。

张威威先生，副总裁，硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行，从事个人零售业务，2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部，从事证券投资基金销售业务，任高级副经理；2005年9月加入建信基金管理公司，一直从事基金销售管理工作，历任市场营销部副总监（主持工作）、总监、公司首席市场官等职务。

2015年8月6日起任我公司副总裁。

吴曙明先生，副总裁，硕士。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作；1999年7月加入中国建设银行，先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职；2006年3月加入我公司，担任董事会秘书，并兼任综合管理部总经理。2015年8月6日起任我公司督察长，2016年12月23日起任我公司副总裁。

吴灵玲女士，副总裁，硕士。1996年7月至1998年9月在福建省东海经贸股份有限公司工作；2001年7月加入中国建设银行总行人力资源部，历任副主任科员、

业务经理、高级经理助理；2005年9月加入建信基金管理公司，历任人力资源部总监助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016年12月23日起任我公司副总裁。

4、督察长

吴曙明先生，督察长（简历请参见公司高级管理人员）。

5、本基金基金经理

路龙凯先生，硕士。2008年8月至2011年11月在中国人民健康保险股份有限公司从事保险精算工作，历任主办、主管；2011年11月至2012年4月在中诚信国际信用评级有限公司工作，任结构融资分析师；2012年5月至2015年4月在泰达宏利基金管理有限责任公司工作，历任初级研究员、研究员、投资经理；2015年4月加入建信基金管理公司金融工程及指数投资部，任基金经理助理，2016年4月11日起任深证基本面60ETF及其联接基金的基金经理。

本基金历任基金经理：

梁洪昀先生：2011年9月8日至2016年7月20日。

路龙凯先生：2016年4月11日至今。

6、投资决策委员会成员

孙志晨先生，总裁。

梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。

钟敬棣先生，固定收益投资部首席固定收益投资官。

李菁，固定收益投资部总经理

姚锦女士，权益投资部副总经理兼研究部首席策略分析师。

许杰先生，权益投资部副总经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

1. 基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

成立时间：1996年2月7日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

中国民生银行于 1996 年 1 月 12 日在北京正式成立，是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行，同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度，使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行，而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了快速健康的发展势头。

2000 年 12 月 19 日，中国民生银行 A 股股票（600016）在上海证券交易所挂牌上市。2003 年 3 月 18 日，中国民生银行 40 亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004 年 11 月 8 日，中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了 58 亿元人民币次级债券，成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005 年 10 月 26 日，民生银行成功完成股权分置改革，成为国内首家完成股权分置改革的商业银行，为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。

2009 年 11 月 26 日，中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来，按照“团结奋进，开拓创新，培育人才；严格管理，规范行为，敬业守法；讲究质量，提高效益，健康发展”的经营发展方针，在改革发展与管理等方面进行了有益探索，先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新，实现了低风险、快增长、高效益的战略目标，树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

2009 年 6 月，民生银行在“2009 年中国本土银行网站竞争力评测活动”中获 2009 年中国本土银行网站“最佳服务质量奖”。

2009 年 9 月，在大连召开的第二届中国中小企业融资论坛上，中国民生银行被评为“2009 中国中小企业金融服务十佳机构”。在“第十届中国优秀财经证券网站评选”中，民生银行荣膺“最佳安全性能奖”和“2009 年度最佳银行网站”两项大奖。

2009 年 11 月 21 日，在第四届“21 世纪亚洲金融年会”上，民生银行被评为“2009 年亚洲最佳风险管理银行”。

2009 年 12 月 9 日，在由《理财周报》主办的“2009 年第二届最受尊敬银行评选暨 2009 年第三届中国最佳银行理财产品评选”中，民生银行获得了“2009 年中国最受尊敬银行”、“最佳服务私人银行”、“2009 年最佳零售银行”多个奖项。

2010年2月3日，在“卓越2009年度金融理财排行榜”评选活动中，中国民生银行一流的电子银行产品和服务获得了专业评测公司、网友和专家的一致好评，荣获卓越2009年度金融理财排行榜“十佳电子银行”奖。

2010年10月，在经济观察报主办的“2009年度中国最佳银行评选”中，民生银行获得评委会奖——“中国银行业十年改革创新奖”。这一奖项是评委会为表彰在公司治理、激励机制、风险管理、产品创新、管理架构、商业模式六个方面创新表现卓越的银行而特别设立的。

2011年12月，在由中国金融认证中心（CFCA）联合近40家成员行共同举办的2011中国电子银行年会上，民生银行荣获“2011年中国网上银行最佳网银安全奖”。这是继2009年、2010年荣获“中国网上银行最佳网银安全奖”后，民生银行第三次获此殊荣，是第三方权威安全认证机构对民生银行网上银行安全性的高度肯定。

2012年6月20日，在国际经济高峰论坛上，民生银行贸易金融业务以其2011-2012年度的出色业绩和产品创新最终荣获“2012年中国卓越贸易金融银行”奖项。这也是民生银行继2010年荣获英国《金融时报》“中国银行业成就奖—最佳贸易金融银行奖”之后第三次获此殊荣。

2012年11月29日，民生银行在《The Asset》杂志举办的2012年度AAA国家奖项评选中获得“中国最佳银行-新秀奖”。

2013年度，民生银行荣获中国投资协会股权和创业投资专业委员会年度中国优秀股权和创业投资中介机构“最佳资金托管银行”及由21世纪传媒颁发的2013年PE/VC最佳金融服务托管银行奖。

2013年荣获中国内部审计协会民营企业内部审计优秀企业。

在第八届“21世纪亚洲金融年会”上，民生银行荣获“2013亚洲最佳投资金融服务银行”大奖。

在“2013第五届卓越竞争力金融机构评选”中，民生银行荣获“2013卓越竞争力品牌建设银行”奖。

在中国社科院发布的《中国企业社会责任蓝皮书（2013）》中，民生银行荣获“中国企业上市公司社会责任指数第一名”、“中国民营企业社会责任指数第一名”、“中国银行业社会责任指数第一名”。

在2013年第十届中国最佳企业公民评选中，民生银行荣获“2013年度中国最佳企业公民大奖”。

2013年还获得年度品牌金博奖“品牌贡献奖”。

2014 年获评中国银行业协会“最佳民生金融奖”、“年度公益慈善优秀项目奖”。

2014 年荣获《亚洲企业管治》“第四届最佳投资者关系公司”大奖和“2014 亚洲企业管治典范奖”。

2014 年被英国《金融时报》、《博鳌观察》联合授予“亚洲贸易金融创新服务”称号。

2014 年还荣获《亚洲银行家》“中国最佳中小企业贸易金融银行奖”，获得《21 世纪经济报道》颁发的“最佳资产管理私人银行”奖，获评《经济观察报》“年度卓越私人银行”等。

2015 年度，民生银行在《金融理财》举办的 2015 年度金融理财金貔貅奖评选中荣获“金牌创新力托管银行奖”。

2015 年度，民生银行荣获《EUROMONEY》2015 年度“中国最佳实物黄金投资银行”称号。

2015 年度，民生银行连续第四次获评《企业社会责任蓝皮书（2015）》“中国银行业社会责任发展指数第一名”。

2015 年度，民生银行在《经济观察报》主办的 2014-2015 年度中国卓越金融奖评选中荣获“年度卓越创新战略创新银行”和“年度卓越直销银行”两项大奖。

2、主要人员情况

杨春萍：女，北京大学本科、硕士。资产托管部副总经理。曾就职于中国投资银行总行，意大利联合信贷银行北京代表处，中国民生银行金融市场部和资产托管部。历任中国投资银行总行业务经理，意大利联合信贷银行北京代表处代表，中国民生银行金融市场部处长、资产托管部总经理助理、副总经理等职务。具有近三十年的金融从业经历，丰富的外资银行工作经验，具有广阔的视野和前瞻性的战略眼光。

3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 68 人，平均年龄 36 岁，100%员工拥有大学本科以上学历，80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员 100%都具有基金从业资格。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营

理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至 2016 年 12 月 31 日，中国民生银行已托管 147 只证券投资基金，托管的证券投资基金总净值达到 2946.99 亿元。中国民生银行于 2007 年推出“托付民生·安享财富”托管业务品牌，塑造产品创新、服务专业、效益优异、流程先进、践行社会责任的托管银行形象，赢得了业界的高度认可和客户的广泛好评，深化了与客户的战略合作。自 2010 年至今，中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”和“金牌创新力托管银行”奖，荣获《21 世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

（1）直销机构

本基金直销机构为本公司设在北京的直销柜台以及网上交易平台。

（1）直销柜台

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

法定代表人：许会斌

联系人：郭雅莉

电话：010-66228800

（2）网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回、定期投资等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址：

www.ccbfund.cn。

（2）代销机构

（1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号办公

地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼(长安兴融中心)

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

（2）中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(3) 中信银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

法定代表人：李庆萍

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

(4) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(5) 民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

(6) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

法定代表人：闫冰竹

客户服务电话：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

(7) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

客户服务电话：95555（或拨打各城市营业网点咨询电话）

网址：www.cmbchina.com

(8) 中国农业银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

（9）中国银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

（10）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：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

客服电话：400-8888-666 网址：www.gtja.com

（11）中信证券股份有限公司

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：张佑君

客服电话：95558

网址：www.citics.com

（12）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

客服电话：10108998

网址：www.ebscn.com

（13）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A座38—45层

法定代表人：宫少林

客户服务热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

（14）中信期货有限公司

地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层

法定代表人：张皓

客服电话：400 9908 826

网址：http://www.citicsf.com

(15) 长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

客服电话：0755-82288968

网址：www.cc168.com.cn

(16) 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

客户服务电话：400-8888-001，(021) 962503

网址：www.htsec.com

(17) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务电话：4008-888-999 公司

网址：www.95579.com

(18) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

(19) 中泰证券有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客户服务热线：95538

网址：www.qlzq.com.cn

(20) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李福春

客户服务电话：0431-96688、0431-85096733

网址：www.nesc.cn

(21) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

客户服务电话：4006515988

网址：www.bhzq.com

（22）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号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（23）平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

客服热线：4008866338

网址：stock.pingan.com

（24）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：龙增来

开放式基金咨询电话：4006008008

网址：www.china-invs.cn

（25）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心20层

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：0755-82825555

网址：www.axzq.com.cn

（26）国元证券股份有限公司

注册地址：合肥市寿春路179号

法定代表人：蔡咏

客户服务热线：400-8888-777

网址：www.gyzq.com.cn

（27）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

客户服务电话：4008-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

（28）华泰证券股份有限公司

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

客户咨询电话：025-84579897

网址：www.htsc.com.cn

（29）申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成

国家大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李季

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

（30）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

客服电话：021-962518

网址：www.962518.com

（31）财富证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉中路 2 段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：周晖

客户服务电话：0731-4403340

网址：www.cfzq.com

（32）东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

法定代表人：朱科敏

客服热线：4008888588

网址：www.longone.com.cn

（33）申万宏源证券有限公司

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523 或 4008895523

网址: www.sywg.com

(34) 浙商证券股份有限公司

办公地址: 杭州杭大路 1 号黄龙世纪广场 A6/7

法定代表人: 吴承根

客服电话: 0571-967777

网址: <http://www.stocke.com.cn>

(35) 广州证券有限责任公司

注册地址: 广州市珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19、20 层

法定代表人: 刘东

客服电话: 020-88836999

网址: www.gzs.com.cn

(36) 红塔证券有限责任公司

住所: 云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人: 况雨林

客服电话: 0871-3577930

网址: <http://www.hongtastock.com/>

(37) 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 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人: 薛峰

客户服务电话: 4006788887

网址: www.zlfund.cn, www.jjmmw.com

(38) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

法定代表人: 陈柏青

客户服务电话: 4000766123

网址: www.fund123.cn

(39) 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 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人: 杨文斌

客户服务电话: 400-700-9665

网址: www.ehowbuy.com

(40) 上海天天基金销售有限公司概况

注册地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客户服务电话：4001818188

网址：www.1234567.com.cn

（41）和讯信息科技有限公司概况

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：4009200022

（42）浙江同花顺基金销售有限公司概况

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：400-877-3772

网址：www.5ifund.com

（43）北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

客户服务电话：4008188866

网址：www.shengshiview.com

（44）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 号五层 5122 室

法定代表人：梁越

客户服务电话：4007868868

网址：www.chtfund.com

（45）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

客户服务热线：400-910-1166

网址：www.cicc.com.cn

（46）上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室

法定代表人：张晶

客户服务热线：400-820-2819

网址：www.chinapnr.com

（47）北京微动利投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：梁洪军

客户服务电话：400-819-6665

网址：<http://www.buyforyou.com.cn>

(48) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

网址：<http://www.noah-fund.com>

(49) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

客户服务电话：400-866-6618

网址：<https://www.lufax.com>

(50) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾路 1 号 A 栋 201 室

法定代表人：刘鹏宇

客户服务电话：0755-83999907

网址：www.jinqianwo.cn

(51) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人：董浩

客服电话：400-068-1176

网址：www.jimubox.com

(52) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

客户服务热线：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn/>

(53) 北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

客户服务热线：010-56282140

网址: www.fundzoe.cn

(54) 天津国美基金销售有限公司

地址: 北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层

法定代表人: 丁东华

客户服务热线: 400-111-0889

网址: www.gomefund.com

(55) 上海利得基金销售有限公司

地址: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人: 沈继伟

客户服务热线: 400-033-7933

网址: www.leadbank.com.cn

(56) 奕丰金融服务(深圳)有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

法定代表人: TAN YIK KUAN

客户服务热线: 400-684-0500

网址: <https://www.ifastps.com.cn>

(57) 上海万得投资顾问有限公司

地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人: 王廷富

客户服务热线: 400-821-0203

网址: www.windmoney.com.cn

(58) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人: 张彦

客户服务热线: 400-166-1188

网址: <http://www.jrj.com.cn/>

(59) 大泰金石基金销售有限公司

地址: 南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

法定代表人: 袁顾明

客户服务热线: 400-928-2266

网址: <https://www.dtfunds.com/>

基金管理人可以根据相关法律法规要求, 选择其他符合要求的机构代理销售本基

金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：许会斌

联系人：郑文广

电话：010-66228888

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：北京德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层

负责人：王丽

联系人：徐建军

电话：010-66575888

传真：010-65232181

经办律师：徐建军、刘焕志

（四）审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：陈熹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：许康玮、陈熹

四、基金的名称

建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

五、基金的类型

ETF联接基金。

六、基金的投资目标

本基金将绝大部分基金资产投资于目标ETF，密切跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金以目标ETF、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象，其中投资于

目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；同时，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）及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），该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

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。

八、基金的投资策略

本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖目标 ETF 或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金管理人将对投资组合进行适当调整，以降低跟踪误差。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、资产配置策略

本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股，采取自上而下的资产配置策略，先保留现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，然后主要通过一级市场将剩余的大部分资产投资于目标 ETF 并使该投资比例不低于基金资产净值的 90%。同时，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。

如因目标 ETF 及股票停牌限制、目标 ETF 及股票流动性不足、基金申购或赎回等基金管理人之外的因素，致使本基金各类资产的投资比例在上述范围之外，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，依法进行处理和调整。

2、目标 ETF 投资策略

（1）基金组合的构建原则

本基金对基金的投资仅限于目标 ETF，现时目标 ETF 指深证基本面 60ETF。

（2）基金组合的构建方法

本基金可通过成份股实物形式在一级市场申购及赎回目标 ETF 份额；本基金可在二级市场上买卖目标 ETF 份额，本基金在二级市场上买卖目标 ETF 份额仅出于基

金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，而不以套利为目的。

（3）基金组合的调整

本基金为ETF联接基金，基金所构建的ETF投资组合将根据目标ETF的变动而发生相应变化。本基金将根据法律法规中的投资比例限制、申购和赎回情况、现金头寸，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3、成份股投资策略

（1）股票组合的构建原则

成份股组合的构建主要是基金经理根据标的指数，结合研究报告和基金组合的构建情况，以抽样复制法构建组合。

（2）股票组合的构建方法

本基金将以追求跟踪误差最小化为目标进行标的指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用抽样复制基准指数的方法，在综合考虑个股的市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与标的指数的相关性等因素的基础上，采用重点抽样的方法，选择标的指数的成份股构建股票投资组合。

（3）股票组合的调整

1) 定期调整

本基金股票组合根据标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

2) 不定期调整

基金经理将跟踪标的指数变动，基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

对个别成份股，若其存在严重的流动性困难、或者财务风险较大、或者面临重大不利的司法诉讼、或者基金管理人充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用备选股、甚至现金来代替。

针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购。

4、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性和有效利用基金资产。通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、短期金融工具等产品的比例，并灵活地采用收益率曲线方法、品种选择方法等构建有效的固定收益类证券组合。

5、权证投资策略

本基金可根据法律法规规定，并基于谨慎原则运用权证对基金投资组合进行管理，

以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资权证必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

6、跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

本基金跟踪误差的来源包括：留存现金及债券部分、成份股和备选成份股的投资、基金每日现金流入或流出的建仓或变现策略、股息的再投资策略等。

基金管理人将通过对上述因素的有效管理，追求跟踪误差最小化。本基金每日跟踪基金组合与基准表现的偏离度，每月末定期分析基金组合与基准表现的累积偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，及时优化跟踪偏离度管理方案。

九、基金的业绩比较标准

本基金以深证基本面 60 指数为标的指数。若本基金标的指数发生变更，则本基金业绩比较基准随之改变。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{深证基本面 60 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率}$ 。

随着市场环境的变化，如果标的指数不适用于本基金或投资的目标 ETF 变更标的指数时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，履行适当的程序变更本基金的标的指数，同时变更本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定的媒体上刊登公告；若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为深证基本面 60ETF 的联接基金，风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时，本基金为指数型基金，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，属于证券投资基金中较高风险—收益的品种。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内

容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 12 月 31 日，本报告所列财务数据已经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 30,460.00 0.03

其中：股票 30,460.00 0.03

2 基金投资 93,294,000.00 93.55

3 固定收益投资 --

其中：债券 --

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7 银行存款和结算备付金合计 6,390,228.46 6.41

8 其他资产 14,429.66 0.01

9 合计 99,729,118.12 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码 行业类别 公允价值 占基金资产

净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业 --

B 采矿业 --

C 制造业 30,460.00 0.03

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 --

F 批发和零售业 --

G 交通运输、仓储和邮政业 --

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 --

J 金融业 --
 K 房地产业 --
 L 租赁和商务服务业 --
 M 科学研究和技术服务业 --
 N 水利、环境和公共设施管理业 --
 O 居民服务、修理和其他服务业 --
 P 教育 --
 Q 卫生和社会工作 --
 R 文化、体育和娱乐业 --
 S 综合 --
 合计 30,460.00 0.03

注：以上行业分类以 2016 年 12 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	000538	云南白药	400	30,460.00	0.03
---	--------	------	-----	-----------	------

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	------	-----	------	--------------

1 深 F60 股票型 交易型开放式指数基金 建信基金管理有限责任公司

93,294,000.00 93.95

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资于国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未投资于国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

12、投资组合报告附注

(1) 本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2) 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

(3) 其他资产的构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	3,308.48
---	-------	----------

2	应收证券清算款	-
---	---------	---

3	应收股利	-
---	------	---

4	应收利息	1,436.83
---	------	----------

5	应收申购款	9,684.35
---	-------	----------

6	其他应收款	-
---	-------	---

7	待摊费用	-
---	------	---

8	其他	-
---	----	---

9	合计	14,429.66
---	----	-----------

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 12 月 31 日。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率① 份额净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

2011 年 9 月 8 日—2011 年 12 月 31 日 -13.59% 0.93% -17.25% 1.32% 3.66% -0.39%

2012 年 1 月 1 日—2012 年 12 月 31 日 2.28% 1.30% 2.12% 1.31% 0.16% -0.01%

2013 年 1 月 1 日—2013 年 12 月 31 日 -7.66% 1.38% -7.61% 1.39% -0.05% -0.01%

2014 年 1 月 1 日—2014 年 12 月 31 日 51.73% 1.22% 50.64% 1.23% 1.09% -0.01%

2015 年 1 月 1 日—2015 年 12 月 31 日 18.11% 2.38% 17.27% 2.41% 0.84% -0.03%

2016 年 1 月 1 日—2016 年 12 月 31 日 -4.67% 1.26% -2.96% 1.29% -1.71% -0.03%

自基金合同生效起—2016 年 12 月 31 日 39.42% 1.54% 33.85% 1.58% 5.57% -0.04%

十三、基金的费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- (4) 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；

- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金的证券交易费用；
- (7) 基金的银行汇划费用；
- (8) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、基金费用的费率、计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提基金管理费。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提基金托管费。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费率、基金托管费率，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但基金管理人必须最迟于新的费率实施前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。提

高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

本条第1款第(3)至第(8)项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(二) 基金销售时发生的费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“六、基金的募集”中的相关规定。本基金申购费、赎回费的费率水平、计算方式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”中的相关规定。不同基金间转换的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定确定并公告。

(三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

十四、对招募说明书更新部分的说明

- 1、更新了“三、基金管理人”“主要人员情况”中监事的信息;
- 2、更新了“四、基金托管人”的“基金托管业务经营情况”;
- 3、更新了“五、相关服务机构”中的相关变动信息,更新了“代销机构”;
- 4、更新了“九、基金的投资”的投资组合报告的内容,并经基金托管人复核;
- 5、更新了“十、基金的业绩”,并经基金托管人复核;
- 6、更新了“二十二、其他应披露事项”,添加了报告期间涉及本基金和基金管理人相关临时公告。

上述内容仅为本招募说明书(更新)摘要,投资人欲查询本更新招募说明书正文,可登陆基金管理人网站 www.ccbfund.cn。

建信基金管理有限责任公司

二〇一七年四月二十日