

建信深证 100 指数增强型证券投资基金招募说明书(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：交通银行股份有限公司

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 12 月 28 日证监许可[2011]2130 号文核准募集。本基金的基金合同于 2012 年 3 月 16 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。本招募说明书经中国证监会核准，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。

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，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人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。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 3 月 15 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

成立日期：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者的利益。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，董事会行使《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和奖惩权。

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、高级管理人员尽职情况。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

许会斌先生，董事长，高级经济师，享国务院特殊津贴，中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章获得者。1983年毕业于辽宁财经学院基建财务与信用专业，获学士学位。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，2006年5月起任中国建设银行河南省分行行长，2011年3月出任中国建设银行批发业务总监，2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。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、英格兰和威尔斯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战略研究部总经理。

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

梁洪昀先生，博士，特许金融分析师（CFA），金融工程及指数投资部总经理。

2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副

总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。
2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理；
2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2011年9月8日至2016年7月20日任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金基金经理；2015年3月25日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理；2015年7月31日起任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金基金经理；2015年8月6日至2016年10月25日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金基金经理。

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，权益投资部总经理。

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

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

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

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.62亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的

国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2016年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第13位，较上年上升4位；根据2016年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜，交通银行营业收入位列第153位，较上年上升37位。

截至2016年12月31日，交通银行资产总额为人民币84,031.66亿元。2016年1-12月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币672.10亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事，2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长，2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生2013年11月起任本行副董事长、执行董事，2013年10月起任本行行长；2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长；2004年9月至2005年8月任本行副行长；2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理；2001年9月至2004年6月任本行行长助理；1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁；2007年12月至2015年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2016 年 12 月 31 日，交通银行共托管证券投资基金 270 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

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）中国农业

银行股份有限公司 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 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 （4）交通银行股份有限公司 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 客服电话：95559 网址：

www.bankcomm.com （5）中国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 传真：010-83914283 客户服务电话：

95568 公司网站: www.cmbc.com.cn (6) 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 (7) 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 办公地址: 北京市西城区金融大街丙17号 法定代表人: 闫冰竹 客服电话: 95526 公司网站: www.bankofbeijing.com.cn (8) 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 传真: 0755-83195049 网址: www.cmbchina.com

(9) 渤海银行股份有限公司 注册地址: 天津市河西区马场道201-205号 办公地址: 天津市河东区海河东路218号 法定代表人: 李伏安 客服电话: 95541 网址: www.cbhb.com.cn (9) 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

(10) 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 (11) 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 (12) 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 (13) 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>

(14) 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 (15) 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 (16) 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 (17) 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 (18) 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 (19) 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 矫正中 客户服务电话: 0431-96688、0431-85096733 网址: www.nesc.cn (20) 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 (21) 广发证券股份有限公司 住所：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼 法定代表人：孙树明 客户服务电话：020-95575 网址：www.gf.com.cn (22) 华福证券有限责任公司 注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层 法定代表人：黄金琳 客服热线：0591-96326 网址：www.gfhfzq.com.cn (23) 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 (24) 兴业证券股份有限公司 注册地址：福州市湖东路 268 法定代表人：兰荣 客户服务电话：400888123 网址：www.xyzq.com.cn (25) 平安证券有限责任公司 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 (26) 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 (27) 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 (28) 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 (29) 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 (30) 中信证券（山东）有限责任公司 住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室） 法定代表人：杨宝林 客服电话：0532-96577 网址：www.zxwt.com.cn (31) 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 (32) 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 (33) 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 (34) 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 (35) 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：400888588 网址：www.longone.com.cn (36) 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 (37) 九州证券经纪有限公司 注册地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 18 楼 法定代表人：林小明 客服电话：0755-33331188 网址：www.tyzq.com.cn (38) 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/ (39) 国信证券股份有限公司 住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦 法定代表人：何如 客户服务电话：95536 网址：www.guosen.com.cn (40) 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 (41) 深圳众禄金融控股股份有限公司 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 (42) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司杭州数米基金销售有限公司 注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼 法定代表人：陈柏青 客户服务电话：4000766123 网址：www.fund123.cn (43) 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 (44) 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 (45) 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 (46) 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 (47) 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 (48) 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 (49) 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

务电话：400-820-2819 网址：www.chinapnr.com (50) 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：www.buyforyou.com.cn

(51) 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：www.noah-fund.com/ (52) 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：www.lufax.com/ (53) 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 客户服务电话：400-068-1176 网址：www.jimubox.com/ (54) 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：刘鹏宇齐小贺 客户服务电话：0755-83999913 网址：www.jinqianwo.cn/ (55) 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/> (56) 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 (57) 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 (58) 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 (59) 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> (60) 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 (61) 上海长量基金销售投资顾问有限公司 地址：上海浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层 法定代表人：张跃伟 电话：400-820-2899 网址：<http://www.erichfund.com/websiteII/html/index.html> (62) 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 (63) 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）注册登记人

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

本基金名称：建信深证100指数增强型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型：股票型。

六、基金的投资目标

本基金为股票型指数增强基金，在对深证100指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的

日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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）。股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资于深证 100 指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%。现金或到期一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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

（一）投资策略

本基金采用指数增强型投资策略，以深证 100 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，在控制与比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。

1、资产配置策略

本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制与目标指数的跟踪误差的前提下，力争获得与所承担的主动风险相匹配的超额收益。

2、股票投资组合策略

本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。

（1）指数增强策略

1) 成份股权重优化增强策略。本基金在严格控制跟踪误差、跟踪偏离度的前提下，进行宏微观经济研究，综合运用 GARP 策略、建信多因子选股模型等量化投资技术，深入分析成份股的估值水平、公司业绩增长情况、资产盈利水平和财务状况及股票市场交易情况等，在考虑交易成本、流动性、投资比例限制等因素并结合基金管理人对市场研判后，将适度超配价值被低估的正超额收益预期的成份股以及低配或剔除价值被高估的负超额收益预期的成份股。

2) 非成份股优选增强策略。本基金将依托公司投研团队的研究成果, 综合采用数量化投资技术和深入调查研究相结合的研究方法, 自下而上精选部分成份股以外的股票作为增强股票库, 力争在最佳时机选择增强股票库中估值合理、基本面优良且具有持续成长潜力的股票进行适度的优化配置, 以获取超额收益。

1 行业精选

各行业之间的预期收益、风险及其相关性是制定行业配置决策时的根本因素, 本基金通过对各行业竞争结构、行业成长空间、行业周期性及景气程度、行业主要产品或服务的供需情况、上市公司代表性、行业整体相对估值水平等因素或指标的综合评估, 精选行业景气周期处于拐点或者行业景气度处于上升阶段的相关产业, 在行业内部进行个股选择。

② 个股精选

A、价值分析

价值分析包括公司的品质分析及估值水平分析。健康的品质是公司未来持续成长的良好基础, 也可以提高公司的抗风险能力, 因此本基金对上市公司的价值分析首先将分析公司的品质, 着重对公司进行财务分析, 考察每股收益率 (EPS)、净资产收益率 (ROE)、市盈率 (PE)、市净率 (PB)、市销率 (PS) 等指标, 另外将根据上市公司所处行业景气度及其在行业中的竞争地位等多方面的因素进行综合评估, 挖掘上市公司的投资价值。

B、成长性分析

对于成长性分析, 本基金将重点关注企业的持续增长潜力, 对公司内部因素进行深刻理解和分析, 挖掘上市公司保持高成长性和业绩增长的驱动因素 (如公司治理结构、商业盈利模式、核心竞争力等), 深入分析这些驱动因素是否具有可持续性, 从而优选出竞争力优良、成长潜力高于平均水平的上市公司。本基金选取的成长性指标主要包括: 销售收入增长率、每股收益增长率、净利润增长率、主营业务增长率、PEG 等。

3) 其他增强策略。本基金将及时把握一级市场新股申购、增发或配股在内的盈利机会, 提升投资组合的有效性。

(2) 组合调整策略

1) 定期调整

本基金将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整, 达到有效控制跟踪偏离度和跟踪误差的目的。

2) 不定期调整

①与指数相关的调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配、各类限售股获得流通权等原因而需要进行成份股权重调整时，本基金将参考标的指数最新权重比例，进行相应调整。

②限制性调整

根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，当基金投资组合中按标的指数权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时，本基金将对其进行实时的被动性卖出调整，并相应地对其他资产或个股进行微调，以保证基金合法规范运行。

③根据申购和赎回情况调整

本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，制定交易策略以应对基金的申购赎回，从而有效跟踪标的指数。

④其他调整

根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对该部分股票投资组合进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。

（3）跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

本基金为指数增强型基金，将通过适度的主动投资获取超越标的指数的超额收益，同时也将因承担相应的主动风险而导致较大的跟踪误差。

因此，本基金将每日跟踪基金组合与指数表现的偏离度，每月末定期分析基金组合与标的指数表现的累积偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案，实现有效控制跟踪误差。

3、 债券投资策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下管理策略：

（1）久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

（2）收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

（3）债券类属配置策略

根据国债、金融债、公司债、可转债、资产支持证券等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被相对高估的类属债券，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对公司债、可转债、资产支持证券等新品种的投资，主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和风险管理，获取适当的超额收益。

（4）个券精选策略

个券精选策略指基于对信用质量、期限和流动性等因素的考察，重点关注具有以下特征的债券：较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善、期权价值被低估，或者属于创新品种而价值尚未被市场充分发现。通过深入研究，发掘这些具有较高当期收益率或者较高升值潜力的债券，可为投资者创造超额投资回报。

4、 权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

5、 资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

6、 其他金融衍生产品的投资策略

本基金将根据公募基金的特点和要求，结合该类金融衍生产品的特征，在进行充分风险控制和遵守法律法规的前提下，制定合适的投资策略，以控制并降低投资组合风险，提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

（二）投资管理程序

1、 投资决策依据

- （1）国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定。
- （2）宏观经济发展环境、证券市场走势。

2、 投资管理程序

（1）研究分析

研究部依托公司研究平台，整合外部信息及外部研究力量的研究成果进行指数跟踪、成份股公司及非成份股公司行为等信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策

投资决策委员会根据法律法规、基金合同、研究报告以及基金监控指标和调整指标等，召开投资决策会议，确定基金投资组合是否需要进行调整以更好地跟踪标的指数，审批总体投资方案及重大投资事项。

基金经理根据标的指数，结合研究报告，构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将根据投资决策委员会确定的投资组合调整方案采取适当的方法调整组合，以降低交易成本、控制投资风险，同时适当进行增强投资。对于超出权限范围的投资，基金经理按照公司权限审批流程，提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

（3）交易执行

交易部接收到基金经理下达的交易指令后，首先应对指令予以审核，然后具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或者不合规的，交易部可以暂不执行指令，并即时通知基金经理或相关人员。

交易部应根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况及对该项交易的判断和建议，以便基金经理及时调整交易策略。

（4）投资回顾

风险管理部定期对基金的绩效进行评估，并对基金的跟踪误差、跟踪偏离度、信息比率、流动性风险等进行评估。同时，评估信息将以绩效评估报告的形式及时反馈至投资决策委员会、监察稽核部、投资管理部等相关部门，为制定和调整投资策略、评估风险水平提供依据。

九、业绩比较基准

$95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}$ 。

深证 100 指数是中国证券市场第一只定位投资功能和代表多层次市场体系的指数。由深圳证券交易所委托深圳证券信息公司编制维护，此指数包含了深圳市场 A 股流通市值最大、成交最活跃的 100 只成份股。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金管理人与基金托管人协商一致，履行适当程序，并在报中国证监会备案后，可以变更业绩比较基准并及时公告。

十、风险收益特征

本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

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。

基金托管人交通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。

(一) 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 66,454,750.95 89.88

其中：股票 66,454,750.95 89.88

2 基金投资 --

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 7,197,061.22 9.73

8 其他资产 289,282.31 0.39

9 合计 73,941,094.48 100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 2,836,618.80 3.98

B 采矿业 --

C 制造业 23,781,259.23 33.37

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 694,111.00 0.97

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	5,826,707.60	8.18
J 金融业	9,752,084.68	13.69
K 房地产业	4,311,832.60	6.05
L 租赁和商务服务业	1,018,375.00	1.43
M 科学研究和技术服务业	--	--
N 水利、环境和公共设施管理业	1,625,968.74	2.28
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	1,652,368.00	2.32
S 综合	--	--
合计	51,499,325.65	72.27

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

2、报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业	171,882.00	0.24
B 采掘业	789,458.00	1.11
C 制造业	10,165,380.84	14.27
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,336.00	0.05
E 建筑业	459,875.00	0.65
F 批发和零售业	1,718,401.50	2.41
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	1,483,670.96	2.08
J 金融业	--	--
K 房地产业	128,421.00	0.18
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 14,955,425.30 20.99

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

(三) 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投资明细

(1) 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资
明细

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	000333	美的集团	110,687	3,118,052.79	4.38
2	300498	温氏股份	80,540	2,836,618.80	3.98
3	000001	平安银行	296,420	2,697,422.00	3.79
4	000651	格力电器	107,754	2,652,903.48	3.72
5	000002	万科A	108,392	2,227,455.60	3.13
6	002142	宁波银行	131,400	2,186,496.00	3.07
7	002594	比亚迪	37,772	1,876,512.96	2.63
8	300251	光线传媒	169,300	1,652,368.00	2.32
9	300017	网宿科技	29,100	1,560,051.00	2.19
10	000776	广发证券	91,370	1,540,498.20	2.16

(2) 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资
明细

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	000967	002007 华兰生物	27,900	997,425.00	
2	300086	600335 国机汽车	76,890	934,213.50	
3	002493	002709 天赐材料	20,500	864,485.00	
4	601998	002410 广联达	52,600	767,960.00	
5	002376	000983 西山煤电	82,700	699,642.00	

(四) 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。

(五) 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。

(六) 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。

(七) 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。

(八) 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投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

(九) 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。

(十) 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

(十一) 投资组合报告附注

1、本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，宁波银行股份有限公司(002142)于2016年7月7日发布公告：宁波银行深圳分行原员工违规办理票据业务，共涉及3笔，金额合计人民币32亿元。目前该3笔票据业务已结清，银行没有损失，公安机关已立案侦查。广发证券股份有限公司(000776)于2016年11月28日发布公告称11月26日收到中国证监会行政处罚决定书：2015年1月16日，中国证监会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司因存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题，且涉及客户数量较多，受到责令限期改正的行政监管措施。2015年8月24日，收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(鄂证调查字2015023号)。因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立案调查。2015年9月12日，因在接入恒生HOMES系统期间未采取有效措施严格审查客户身份的真实性，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，因此受到中国证监会责令整改，给予警告，没收违法所得6,805,135.75元，并处以

20,415,407.25 元罚款等处罚。

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

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 11,469.68

2 应收证券清算款 253,550.03

3 应收股利 -

4 应收利息 3,164.29

5 应收申购款 21,098.31

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 289,282.31

4、本报告期末本基金持有处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

（1）报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

（2）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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

2012年3月16日——2012年12月31日 -10.30% 1.19% -9.18% 1.29% -1.12%
-0.10%

2013年1月1日——2013年12月31日 -1.65% 1.32% -4.53% 1.35% 2.88% -
0.03%

2014年1月1日—2014年12月31日 37.77% 1.13% 30.59% 1.15% 7.18% -
0.02%

2015年1月1日-2015年12月31日 30.15% 2.68% 21.11% 2.46% 9.04% 0.22%

2016年1月1日—2016年12月31日

-13.40%

1.81%

-15.64%

1.57%

2.24%

0.24%

自基金合同生效起——2016年12月31日 37.00% 1.74% 15.69% 1.64% 21.31%
0.10%

十三、基金的费用概览

(一) 申购费率与赎回费率

1、本基金申购费率随申购金额的增加而递减。具体费率如下表所示：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	1.5%
100 万元 ≤ M < 500 万元	1.0%
M ≥ 500 万元	每笔 1,000 元

2、本基金赎回费率随申请份额持有期限增加而递减。具体如下表所示：

持有期限 (Y)	赎回费率
Y < 1 年	0.5%
1 年 ≤ Y < 2 年	0.25%
Y ≥ 2 年	0

注：1 年指 365 天。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日的 2 日前在至少一家中国证监会指定的媒体及基金管理人网站公告。

(二) 申购份数与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

申购本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者投资 5 万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.05 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50000 / (1 + 1.5\%) = 49261.08 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50000 - 49261.08 = 738.92 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49261.08 / 1.05 = 46915.31 \text{ 份}$$

即：投资者投资 5 万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.05 元，则其可得到 46915.31 份基金份额。

2、赎回净额的计算

基金份额持有人在赎回本基金时缴纳赎回费，基金份额持有人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回净额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者赎回本基金 10000 份基金份额，赎回适用费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10000 \times 1.148 = 11480 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11480 \times 0.5\% = 57.40 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 11480 - 57.40 = 11422.60 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 10000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11422.60 元。

3、基金份额净值计算

T 日基金份额净值 = T 日基金资产净值 / T 日发行在外的基金份额总数。基金份额

净值单位为人民币元，计算结果保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

（三）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、标的指数使用费；
- 4、基金的证券交易费用；
- 5、基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费；
- 8、基金银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

（四）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费率为年费率 1.0%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为年费率 0.2%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、标的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。指数使用费自本《基金合同》生效之日起开始计提，每年计提标准为前一日基金资产净值的万分之二。基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度5万元，即不足5万元时按照5万元收取。

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的指数使用费

E为前一日的基金资产净值

指数使用费每日计提，逐日累计，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划款指令，基金托管人复核后于次季初10个工作日内从基金财产中一次性支付给指数所有人。

4、本条第（一）款第4至第9项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

（五）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

（六）基金管理费和基金托管费的调整

在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站上刊登公告。

（七）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

（八）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

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”信息中董事、监事的信息。
- 2、更新了“四、基金托管人”的主要人员情况及相关业务经营情况。

- 3、在“五、相关服务机构”中，更新了相关代销机构的变动信息。
- 4、更新了“九、基金的投资”，更新了基金投资组合报告，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”，添加了期间涉及本基金和基金管理人的相关临时公告。

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

二〇一七年四月二十九日