

建信创业板交易型开放式指数  
证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2018 年 1 号

基金管理人：建信基金管理有限责任公司  
基金托管人：中国银河证券股份有限公司

二〇一八年九月

## 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2017 年 7 月 21 日证监许可

【2017】1331 号文注册募集。本基金合同已于 2018 年 2 月 6 日生效。

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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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、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。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动。本基金为被动式投资的指数型基金，主要采用完全复制策略，紧密跟踪创业板指数，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。投资人在投资本基金前，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。投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险以及基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、基金份额参考净值（IOPV）计算错误的风险、基金的退市风险、投资人申购、赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险以及股指期货等金融衍生品投资的风险等等。

投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件，了解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。

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

不构成新基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 8 月 5 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。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：孙志晨

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：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、高管尽职情况。

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

孙志晨先生，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。2005年9月出任建信基金公司总裁，2018年4月起任建信基金公司董事长。

张军红先生，董事，现任建信基金公司总裁。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月出任公司监事会主席，2018年4月起任建信基金公司总裁。

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，信安北亚地区副总裁。

郑树明先生，董事，现任信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席营运官。1989年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道高级审计经理，新加坡法兴资产管理董事总经理、营运总监、执行长，爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场行销总监。

华淑蕊女士，董事，现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于吉林大学，获经济学博士学位。历任《长春日报》新闻中心农村工作部记者，湖南卫视《听我非常道》财经节目组运营总监，锦辉控股集团有限公司副总裁、锦辉精细化工有限公司总经理，吉林省信托有限责任公司业务七部副总经理、理财中心总经理、财富管理总监兼理财中心总经理、副总经理，光大证券财富管理中心总经理（MD）。

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。

史亚萍女士，独立董事，现任中金资本跨境股权投资部顾问。1994年毕业于对外经济贸易大学，获国际金融硕士；1996年毕业于耶鲁大学研究生院，获经济学硕士。先后在标准普尔国际评级公司、英国艾比国民银行、野村证券亚洲、雷曼兄弟亚洲、中国投资有限公司、美国威灵顿资产管理有限公司等多家金融机构担任管理职务。

邱靖之先生，独立董事，现任天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)首席合伙人。毕业于湖南大学高级工商管理专业，获EMBA学位，全国会计领军人才，中国注册会计师，注册资产评估师，高级会计师，澳洲注册会计师。1999年10月加入天职国际会计师事务所，现任首席合伙人。

## 2、监事会成员

马美芹女士，监事会主席，高级经济师，1984年毕业于中央财政金融学院，获学士学位，2009年获长江商学院高级管理人员工商管理硕士。1984年加入建设银行，历任总行筹资储蓄部、零售业务部、个人银行部副处长、处长、资深客户经理（技术二级），个人金融部副总经理，个人存款与投资部副总经理。2018年5月起任建信基金公司监事会主席。

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、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内控合规部副总经理兼内控合规部审计部（二级部）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内控合规部。

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总监兼信息技术部总经理。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

张军红先生，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，2015年8月至2017年11月30日专任建信资本管理有限责任公司董事、总经理，2017年11月30日起兼任建信资本管理公司董事长。

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月加入建信基金管理公司，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，金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师（CFA），博士。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）的基金经理；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（ETF）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的基金经理；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的基金经理；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的基金经理；2018年2月6日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018年2月7日起任建信鑫



泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年4月19日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018年5月16日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2018年6月13日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

#### 6、投资决策委员会成员

张军红先生，总裁。

赵乐峰先生，总裁特别助理。

梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。

梁珉先生，资产配置与量化投资部总经理。

叶乐天先生，金融工程及指数投资部总经理助理。

张戈先生，资产配置及量化投资部总经理助理。

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

#### 1、基本情况

名称：中国银河证券股份有限公司（以下简称“银河证券”）

注册地址：中国北京西城区金融大街35号2-6层

法定代表人：陈共炎

成立日期：2007年1月26日

批准设立机关和批准设立文号：证监会、证监机构字[2007]25号

注册资本：101.37亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】629号

联系人：李蔚

联系电话：95551

中国银河证券股份有限公司是中国证券行业领先的综合性金融服务提供商，提供经纪、销售和交易、投资银行等综合证券服务。2007年1月26日，公司经中国证监会批准，由中国银河金融控股有限责任公司作为主发起人，联合

4 家国内机构投资者共同发起正式成立。中央汇金投资有限责任公司为公司实际控制人。公司本部设在北京，注册资本为人民币 101.37 亿元人民币。公司于 2013 年 5 月 22 日在香港联合交易所上市，控股股东为中国银河金融控股有限责任公司。

## （二）主要人员情况

银河证券托管部管理团队具有十年以上银行、公募基金、证券清算等金融从业经验，骨干员工从公司原有运营部门抽调，可为客户提供更多安全高效的资金保管、产品核算及产品估值等服务。

## （三）基金托管业务经营情况

银河证券托管部于 2014 年 1 月正式成立，在获得证券监管部门批准获得托管资格后已可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度，同时秉承公司“忠诚、包容、创新、卓越”的企业精神，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。

# 三、相关服务机构

## （一）基金份额发售机构

### 1、网下现金认购

#### （1）直销机构

本基金直销机构为基金管理人直销柜台。

#### 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：孙志晨

联系人：郭雅莉

电话：010-66228800

#### 发售代理机构

##### 1) 招商证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

客服电话：95565、4008888111

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

2) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

法定代表人：张佑君

客服电话：95558

网址：[www.citics.com](http://www.citics.com)

3) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：杨宝林

客服电话：95548

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

4) 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

客服电话：400-651-5988

网址：[www.bhzq.com](http://www.bhzq.com)

5) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

6) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

客服电话：400-8888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

7) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

8) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

9) 平安证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区金田路 4306 号荣超大厦 16-20 楼

法定代表人：詹露阳

客服电话：95511

网址：www.stock.pingan.com

10) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

11) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

客服电话：4008-888-999

网址：www.95579.com

12) 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

客服电话：95360

网址：www.nesc.cn

13) 长城证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

法定代表人：丁益

客服电话：0755-82288968

网址：www.cgws.com

14) 安信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层,28 层

A02 单元

法定代表人：王连志

客服电话：95517

网址：www.essence.com.cn

15) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：周杰

客服电话：95553

网址：www.htsec.com

16) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：毕明建

客服电话：(+86-10) 6505 1166

网址：www.cicc.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发售代理机构销售本基金，并及时公告。

## 2、网下股票认购

网下股票认购的发售代理机构具体名单详见基金份额发售公告。

## 3、网上现金认购

网上现金认购的发售代理机构具体名单详见基金份额发售公告。

### （二）基金份额登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-59378856

传真：010-59378907

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

（四）审计基金资产的会计师事务所

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦  
507 单元 01 室

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼

电话：021-2323 8888

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：许康玮、沈兆杰

联系人：沈兆杰

## 四、基金的名称

建信创业板交易型开放式指数证券投资基金。

## 五、基金的类型

股票型指数基金。

## 六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

## 七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、权证、股指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的相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产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%；权证、股指期货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

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来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化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金投资股指期货将主要遵循有效管理投资策略，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，谨慎参与股指期货投资。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数，即创业板指数收益率。

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，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，通过适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。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，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

## 十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪创业板指数，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。

## 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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 7 月 16 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 2018 年 6 月 30 日，本报告所列财务数据未经审计。

### 1、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	63,562,465.31	93.32
	其中：股票	63,562,465.31	93.32
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	4,215,647.30	6.19
8	其他资产	336,998.66	0.49
9	合计	68,115,111.27	100.00

## 2、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	5,049,097.92	7.63
B	采矿业	—	—
C	制造业	31,953,018.09	48.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	882,025.50	1.33
F	批发和零售业	515,984.00	0.78
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	15,733,333.54	23.77
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	480,510.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	542,136.00	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	1,735,939.00	2.62
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	3,135,772.92	4.74

R	文化、体育和娱乐业	3,534,648.34	5.34
S	综合	—	—
	合计	63,562,465.31	96.01

注：1、合计项不含可退替代款的估值增值。

2、以上行业分类以 2018 年 6 月 30 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

（3）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

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投资明细

（1）报告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	300498	温氏股份	229,296	5,049,097.92	7.63
2	300059	东方财富	219,040	2,886,947.20	4.36
3	300124	汇川技术	64,474	2,116,036.68	3.20
4	300003	乐普医疗	56,206	2,061,636.08	3.11
5	300015	爱尔眼科	50,348	1,625,736.92	2.46
6	300408	三环集团	67,182	1,578,777.00	2.38
7	300136	信维通信	49,000	1,505,770.00	2.27
8	300142	沃森生物	72,624	1,451,027.52	2.19
9	300024	机器人	76,400	1,329,360.00	2.01
10	300122	智飞生物	28,700	1,312,738.00	1.98

（2）报告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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

4、报告期末按债券品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投资明细

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序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投资  
明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、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。

10、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

本报告期本基金未投资国债期货。

11、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）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	287,750.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	986.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	48,261.70
8	其他	-
9	合计	336,998.66

## 12、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。

## 13、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未存在流通受限情况。

### （2）报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 14、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

# 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2018 年 6 月 30 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	净值增 长率①	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
基金合同生效之日 -2018 年 6 月 30 日	-9.28%	1.57%	-4.83%	1.86%	-4.45%	-0.29%

## 十三、基金的费用概览

### （一）认购费用

认购费用由投资人承担，认购费率如下表所示：

认购份额（M）	认购费率
$M < 100$ 万	1.0%
$100 \text{ 万} \leq M < 300 \text{ 万}$	0.6%
$300 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$	0.3%
$M \geq 500 \text{ 万}$	每笔 1,000 元

基金管理人办理网下现金认购及网下股票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、网下现金认购及网下股票认购时可参照上述费率结构，按照不高于 1.0% 的标准收取一定的佣金。

### （二）、申购和赎回对价、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。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，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

2、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人应交付给投资人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。申购赎回清单的内容与格式详见下文“七、申购赎回清单的内容与格式”。

4、投资人在申购或赎回本基金时，申购赎回代理机构可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

### （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、基金的指数许可使用费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易、结算费用；
- 8、基金的银行汇划费用、账户开户及维护费用；
- 9、基金上市费及年费；
- 10、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。（四）不列入基金费用的项目

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；
- 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。

#### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

- 1、更新了“第三部分：基金管理人”的“基金管理人概况”和“主要人员情况”中监事的信息。
- 2、更新了“第四部分：基金托管人”的主要人员情况及相关业务经营情况。
- 3、在“第五部分：相关服务机构”中，更新了基金份额登记机构的相关信息。
- 4、更新了“第十一部分：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“第十二部分：基金的业绩”，并经基金托管人复核。
- 6、更新了“第二十二部分：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。

建信基金管理有限责任公司

二〇一八年九月十五日