

建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)摘要

建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

招募说明书 (更新) 摘要

2018 年第 2 号

基金管理人: 建信基金管理有限责任公司

基金托管人: 中国工商银行股份有限公司

二〇一八年十二月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2009 年 9 月 1 日证监许可[2009]882 号文核准募集。本基金的基金合同于 2009 年 11 月 5 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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写, 并经中国证监会核准。

本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 11 月 4 日, 有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 9 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

设立日期: 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

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责任公司企业融资部经理。

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。

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。

3、公司高级管理人员

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 日至 2018 年 11 月 1 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。

马勇先生，副总裁，硕士。1993 年 8 月至 1995 年 8 月在江苏省机械研究设计院工作。1998 年 7 月加入中国建设银行总行，历任副主任科员、主任科员、秘书、高级经理级秘书，高端客户部总经理助理，财富管理与私人银行部总经理助理、副总经理，建行黑龙江省分行副行长等职务。2018 年 8 月 30 日加入建信基金管理有限责任公司，2018 年 11 月 13 日起任副总裁；2018 年 11 月 1 日起兼任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事长。

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、基金经理

梁洪响先生，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日至2018年7月31日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。

梁洪响先生，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）基金托管人情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至2018年6月，中国工商银行资产托管部共有员工212人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、

QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2018 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 874 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 61 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

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

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

（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、场外代销机构

（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：田国立

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

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）中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：陈四清

客服电话：95566

网址: www.boc.cn

(5) 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: 彭纯

客服电话: 95559

网址: www.95559.com.cn

(6) 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

(7) 中信银行股份有限公司

住所: 北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

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

(8) 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

(9) 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: 张东宁

传真: 010-66226045

客户服务电话: 95526

公司网站: www.bankofbeijing.com.cn

(10) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 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: 马勇

客户服务热线: 400-166-1188

网址: <http://www.jrj.com.cn/>

(11) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人: 冷飞

客户服务热线: 021-50810673

网址: <http://www.wacaijijin.com>

(12) 深圳众禄基金销售股份有限公司

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.zfund.cn, www.jjmmw.com

(13) 上海天天基金销售有限公司

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

(14) 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

(15) 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

(16) 上海利得基金销售有限公司

注册地址: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人: 李兴春

客户服务热线: 400-921-7755

网址: www.leadbank.com.cn

(17) 嘉实财富管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

法定代表人: 赵学军

客户服务热线: 400-021-8850

网址: <https://www.harvestwm.cn>

(18) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人: 刘汉青

客户服务热线: 95177

网址: <http://www.snjijin.com>

(19) 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

(20) 北京微动利基金销售有限公司

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: 季长军

客户服务电话: 400-819-6665

网址: www.buyforyou.com.cn

(21) 上海陆金所基金销售有限公司

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：王之光

客户服务电话：400-821-9031

网址：www.lufunds.com/

(22) 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/>

(23) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

法定代表人：毛淮平

客户服务热线：400-817-5666

网址：<https://www.amcfortune.com>

(24) 国泰君安证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦

法定代表人：杨德红

客服电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

(25) 中信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区湖贝路1030号海龙王大厦

法定代表人：张佑君

客服电话：95558

网址：www.citics.com

(26) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市市南区东海西路28号

法定代表人：姜晓林

客服电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

(27) 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：周健男

客服电话：10108998

网址：www.ebscn.com

(28) 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：霍达

客户服务热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

(29) 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：丁益

客服电话：0755-82288968

网址：www.cc168.com.cn

(30) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客户服务电话：400-8888-001

网址：www.htsec.com

(31) 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：陈共炎

客户服务电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

(32) 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：尤习贵

客户服务电话：4008-888-999

公司网址：www.95579.com

(33) 中信建投证券有限责任公司

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

(34) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

客户服务电话：0755-82825555

公司网址：www.essences.com.cn

(35) 华泰证券股份有限公司

办公地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：周易

客户服务电话：400-8888-168、025-84579897

网址：www.htsc.com.cn

(36) 国元证券有限责任公司

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

(37) 中泰证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

客户服务热线：95538

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

(38) 申万宏源西部证券有限公司

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：李琦客服电话：4008-000-562 网址：www.hysec.com

(39) 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：高涛

开放式基金咨询电话：4006008008

网址：www.china-invs.cn

(40) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客户服务电话：0431-96688、0431-85096733

网址：www.nesc.cn

(41) 财富证券有限责任公司

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：蔡一兵

网址：www.cfzq.com

(42) 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.bhjq.com

(43) 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

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。

3、场内发售机构

本基金场内交易机构是指深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站（www.szse.cn）。

(二) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：金颖

办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

联系电话：0755-25938095

传真：0755-25987538

联系人：任瑞新

(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

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

建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，投资于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 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资策略

本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

本基金对标的指数的跟踪目标：力争使得日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。

1、资产配置策略

本基金跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的 90%；投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的资产不低于基金资产净值的 5%。

如因标的指数成份股调整、股票停牌限制、股票流动性不足、基金申购或赎回等各种基金管理人之外的因素，致使基金无法依指数权重购买某成份股时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整。

2、股票投资组合策略

（1）投资组合的构建

本基金股票资产投资以沪深 300 指数为标的指数，原则上采用完全复制的方法，首先按照标的指数中的行业权重为基准权重，确定行业配置比例；再进一步根据各行业中的个股基准权重，确定行业内的个股配置比例。

（2）投资组合的调整

本基金为指数型基金，基金所构建的指数化投资组合原则上将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、成份股公司信息、新股增发因素等变化，对基金投资组合进行实时调整，以实现基金净值增长率与基准指数收益率之间的跟踪误差最小化。

（3）替代投资策略

因特殊情况（如成份股投资受限制、市场流动性不足等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他适当方法（如买入其他成份股或备选成份股、非成份股等）进行替代。

(4) 跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

指数基金跟踪误差的来源包括：对受限成份股的替代投资、成份股调整时的交易策略以及基金每日现金流入或流出的建仓或变现策略、成份股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。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款利率}$ 。

十、基金的风险收益特征

本基金属于采用指数化操作的股票型基金，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，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 24 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 9 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 473,826,952.32 92.49

其中：股票 473,826,952.32 92.49

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 37,941,423.24 7.41

8 其他资产 556,217.34 0.11

9 合计 512,324,592.90 100.00

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 703,674.00 0.14

B 采矿业 16,438,895.70 3.22

C 制造业 186,357,865.84 36.54

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 13,367,136.52 2.62

E 建筑业 16,558,666.61 3.25

F 批发和零售业 8,791,678.11 1.72

G 交通运输、仓储和邮政业 14,150,709.23 2.77

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 16,912,368.84 3.32

J 金融业 163,710,969.85 32.10
 K 房地产业 21,846,059.58 4.28
 L 租赁和商务服务业 6,846,864.74 1.34
 M 科学研究和技术服务业 --
 N 水利、环境和公共设施管理业 1,286,913.00 0.25
 O 居民服务、修理和其他服务业 --
 P 教育 --
 Q 卫生和社会工作 2,363,405.50 0.46
 R 文化、体育和娱乐业 2,155,142.34 0.42
 S 综合 --
 合计 471,490,349.86 92.45

以上行业分类以 2018 年 9 月 30 日的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 349,906.72 0.07
 B 采掘业 --
 C 制造业 1,986,695.74 0.39
 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 2,336,602.46 0.46

以上行业分类以 2018 年 9 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

(3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
 本基金本报告期末未投资港股通股票。

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 601318 中国平安 490,032 33,567,192.00 6.58
 2 600519 贵州茅台 22,642 16,528,660.00 3.24
 3 600036 招商银行 506,883 15,556,239.27 3.05
 4 601166 兴业银行 588,901 9,392,970.95 1.84

5	600016	民生银行	1,476,678	9,362,138.52	1.84
6	601288	农业银行	2,357,299	9,169,893.11	1.80
7	000651	格力电器	217,612	8,748,002.40	1.72
8	000333	美的集团	201,740	8,487,201.80	1.66
9	601328	交通银行	1,283,720	7,496,924.80	1.47
10	600887	伊利股份	274,972	7,061,280.96	1.38

(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

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	601318	中国平安	490,032	33,567,192.00	6.58
2	600519	贵州茅台	22,642	16,528,660.00	3.24
3	600036	招商银行	506,883	15,556,239.27	3.05
4	601166	兴业银行	588,901	9,392,970.95	1.84
5	600016	民生银行	1,476,678	9,362,138.52	1.84

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名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名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持有股指期货。

(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

本基金报告期内未投资于国债期货。

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) 其他各项资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 40,029.92

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

- 4 应收利息 9,153.73
- 5 应收申购款 507,033.69
- 6 其他应收款 -
- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 556,217.34

(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

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

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 000333 美的集团 8,487,201.80 1.66 重大资产重组

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

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 600485 信威集团 1,134,460.04 0.22 重大资产重组

2 601118 海南橡胶 349,906.72 0.07 重大资产重组

(6) 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 9 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 基金净值收益率① 基金净值收益率标准差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 5 月 6 日—2011 年 12 月 31 日 -15.50% 0.92% -23.81% 1.24% 8.31% -0.32%

2012 年 1 月 1 日—2012 年 12 月 31 日 11.14% 1.23% 7.29% 1.22% 3.85% 0.01%

2013 年 1 月 1 日—2013 年 12 月 31 日 13.01% 1.38% -7.16% 1.32% 20.17% 0.06%

2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 23.80% 1.13% 48.69% 1.15% -24.89% -0.02%

2015 年 1 月 1 日—2015 年 12 月 31 日 22.06% 2.55% 5.70% 2.36% 16.36% 0.19%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 -7.99% 1.44% -10.63% 1.33% 2.64% 0.11%

2017 年 1 月 1 日—2017 年 12 月 31 日 24.03% 0.60% 20.63% 0.60% 3.40% 0.00%

2018 年 1 月 1 日—2018 年 9 月 30 日 -11.25% 1.11% -13.94% 1.17% 2.69% -0.06%

自基金合同生效之日至 2018 年 9 月 30 日 9.46% 1.40% 0.89% 1.40% 8.57% 0.00%

十三、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) 基金上市费用;
- (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和律师费;
- (6) 基金份额持有人大会费用;
- (7) 基金的证券交易费用;

(8) 银行汇划费用;

(9) 按照法律、法规规定和《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

在通常情况下, 基金管理费按前一日基金资产净值 0.75% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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付指令, 基金托管人复核后于次月首日起 2 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、休息日, 支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

在通常情况下, 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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付指令, 基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日, 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。

本条第 1 款第 (3) 至第 (9) 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

1、申购费

本基金对申购设置级差费率, 场内申购和场外申购执行统一收费标准。申购费率随申购金额的增加而递减, 最高申购费率不超过 1.2%:

申购金额 (M) 申购费率

M < 100 万元 1.2%

100 万元 ≤ M < 500 万元 0.8%

500 万元 ≤ M < 1000 万元 0.4%

M ≥ 1000 万元 1000 元/笔

申购费用由申购人承担, 不列入基金资产, 申购费用用于本基金的市场推广、注册登记和销售。

2、赎回费

场外赎回费率按照持有期限设置级差费率, 最小赎回费率为零; 场内赎回费率为固定的 0.5%。

持有期限 (Y) 场外赎回费率 场内赎回费率

持有期 < 7 日 1.5% 1.5%

持有期 < 1 年 0.5% 0.5%

1 年 ≤ 持有期 < 2 年 0.25%

持有期 ≥ 2 年 0%

赎回费用由赎回人承担, 对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产; 对持有期长于 7 日的基金份额所收取的赎回费, 赎回费中 25% 归入基金资产, 其余部分作为本基金用于支付注册登记费

和其他必要的手续费。（注：1 年指 365 天）

3、基金管理人可以根据相关法律、法规以及本基金基金合同的规定决定开办本基金和基金管理人管理的其他基金之间的转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体事项可以由基金管理人届时另行规定且公告。

4、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前 2 个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告。

（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“第三部分：基金管理人”的“主要人员情况”信息。
- 2、更新了“第四部分：基金托管人”的基本情况及相关业务经营情况。
- 3、更新了“第五部分：相关服务机构”中代销机构的变动信息。
- 4、更新了“第十一部分：基金的投资”中“基金的投资组合报告”的相关内容，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核。
- 5、更新了“第十二部分：基金的业绩”，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核。
- 6、更新了“第二十四部分：其他应披露事项”，添加了自上次本基金招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

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

建信基金管理有限责任公司

二〇一八年十二月