

建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金  
招募说明书（更新）摘要

2019 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：交通银行股份有限公司

二〇一九年十二月

**【重要提示】**

本基金于 2012 年 12 月 10 日经中国证监会证监许可字[2012]1650 号文核准募集。本基金的基金合同于 2013 年 3 月 28 日正式生效。

本基金管理人保证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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金各类份额（建信央视 50 份额、建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额）均不保本，在市场波动等因素的影响下可能发生亏损。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。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。

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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

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，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，开放式基金的巨额赎回风险，本基金的特定风险（包括指数投资风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中的特有风险）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、基金合同及基

金产品资料概要。

本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 10 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 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

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 月出任建信基金管理公司总裁，2018 年 4 月起任建信基金管理公司董事长。

张军红先生，董事，现任建信基金管理公司总裁。毕业于国家行政学院行政管理专业，获博士学位。历任中国建设银行总行筹资部储蓄业务处科员、副主任科员、主任科员，总行零售业务部主任科员，总行个人银行业务部个人存款处副经理、高级副经理，总行行长办公室秘书一处高级副经理级秘书、秘书、高级经理，总行投资托管服务部总经理助理、副总经理，总行投资托管业务部副总经理，总行资产托管业务部副总经理。2017 年 3 月出任建信基金管理公司监事会主席，2018 年 4 月起任建信基金管理公司总裁。

曹伟先生，董事。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，总行个人存款与投资部总经理助理、副总经理、总行个人金融部副总经理。

张维义先生，董事，现任信安亚洲区总裁。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、总裁，信安亚洲区总裁。

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，信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席营运官。

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，吉林省信托有限责任公司副总经理，光大证券财富管理中心总经理（MD），中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。

李全先生，独立董事，现任新华人寿保险股份有限公司首席执行官、总裁兼新华资产管理股份有限公司董事长。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裁，新华人寿保险股份有限公司首席执行官、总裁兼新华资产管理股份有限公司董事长。

史亚萍女士，独立董事，现任嘉浩控股有限公司首席运营官。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、中金资本、嘉浩控股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年加入中国建设银行，历任中国建设银行总行筹资储蓄部、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），总行个人金融部副总经理，总行个人存款与投资部副总经理。2018年5月起任建信基金管理公司监事会主席。

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。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。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。

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。曾供职于北京北奥有限公司，中进会计师事务所，中瑞华恒信会计师事务所。2004年加入中国华电集团，历任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计划财务部经理

、财务部经理，企业融资部经理、机构与风险管理部经理、机构与战略研究部经理。

安晔先生，职工监事，现任建信基金管理公司信息技术总监。1995年毕业于北京工业大学计算机应用系，获得学士学位。1995年8月加入中国建设银行，历任中国建设银行北京分行信息技术部干部，信息技术管理部北京开发中心项目经理、代处长；2005年8月加入建信基金管理公司，历任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，信息技术总监兼金融科技部总经理，信息技术总监。

严冰女士，职工监事，现任建信基金管理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，历任人力资源部专员、主管、总经理助理、副总经理、总经理。

刘颖女士，职工监事，现任建信基金管理公司审计部总经理。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，英国特许公认会计师公会（ACCA）资深会员。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月加入建信基金管理公司，历任监察稽核部监察稽核专员、稽核主管、资深稽核员、内控合规部副总经理、内控合规部副总经理兼内控合规部审计部（二级部）总经理、审计部总经理。

### 3、公司高管人员

张军红先生，总裁（简历请参见董事会成员）。

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；2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部；2005年9月加入建信基金管理公司，2015年8月6日起任副总裁，2019年7月18日起兼任首席信息官。

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

叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理，硕士。2008年5月至2011年9月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。2011年9月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理，2012年3月21日至2016年7月20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；2013年3月28日起任建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014年1月27日起任建信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理；2015年8月26日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016年8月9日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017年4月18日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017年5月22日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年1月10日起任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年8月24日起任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年11月22日起任建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。

#### 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

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/负责人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：上海市长宁区仙霞路18号

邮政编码：200336

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.63亿元

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2019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11位，连续五年跻身全球银行20强；根据2019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150位，较上年提升18位。

截至2019年9月30日，交通银行资产总额为人民币99,328.79亿元。2019年1-9月，交通银行实现净利润（归属于母公司股东）人民币601.47亿元。

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

任德奇先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

任先生2018年8月起任本行副董事长、执行董事、行长；2016年12月至2018

年6月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015年10月至2018年6月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016年9月至2018年6月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014年7月至2016年11月任中国银行副行长，2003年8月至2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988年7月至2003年8月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

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2019年9月30日，交通银行托管证券投资基金436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、QDIE资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII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、场外发售机构

##### 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。

**场外销售机构**

(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) 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（邮政编码：200120）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

法定代表人：任德奇(代)

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(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) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

(5) 中国民生银行股份有限公司

住所：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

网址：[www.cmbc.com.cn](http://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

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

客户服务电话：95526

公司网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(7) 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/>

(8) 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>

(9) 北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼

法定代表人：张旭阳

客户服务热线：95055-9

网址：<https://www.baiyingfund.com/>

(10) 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/](http://www.noah-fund.com/)

(11) 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：[http:// www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn), [http:// www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(12) 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：[http:// www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(13) 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：[http:// www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(14) 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：[http:// www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(15) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899

网址：<http://www.erichfund.com/>

(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：[http:// www.leadbank.com.cn](http://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) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块  
新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：赵芯蕊

客户服务热线：010-62675369

网址：<https://trade.xincai.com/web/promote>

(20) 北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区德胜门外大街 13 号院 1 号楼 5 层 505 室

法定代表人：曲阳

客户服务热线：400-803-1188

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

(21) 上海汇付基金销售有限公司

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：[http:// www.chinapnr.com](http://www.chinapnr.com)

(22) 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：400-188-5687

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

(23) 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：[http:// www.lufunds.com /](http://www.lufunds.com/)

(24) 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：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：姚杨

客户服务热线：400-928-2266

网址：<https://www.dtfunds.com/>

(25) 珠海盈米基金销售有限公司

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/>

(26) 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>

(27) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

法定代表人：陈宏

客户服务热线：95357

网址：<http://www.18.cn>

(28) 国泰君安证券股份有限公司

地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：王松（代）

客服电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

(29) 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

(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，（021）962503

网址：www.htsec.com

(31) 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：李新华

客户服务电话：4008-888-999

公司网址：www.95579.com

(32) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号

法定代表人：杨华辉

客户服务电话：4008888123

网址：www.xyzq.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：杨玉成

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.sywg.com

(34) 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](http://www.hysec.com)

(35) 上海证券有限责任公司

地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：李俊杰

客服电话：021-962518

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

(36) 浙商证券股份有限公司

地址：浙江省杭州市江干区五星路 201 号

法定代表人：吴承根

客服热线：95345

网址：<https://www.stocke.com.cn/zszq/index/index.jsp>

(37) 中信证券股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

法定代表人：张佑君

客服电话：95558

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

(38) 中信证券（山东）有限责任公司

地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：姜晓林

客服电话：0532-96577

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

(39) 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

(40) 中泰证券股份有限公司

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

(41) 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

(42) 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：4008-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

(43) 东北证券股份有限公司

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

(44) 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

(45) 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](http://www.cindasc.com)

(46) 平安证券股份有限公司

地址：深圳市金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：何之江

客服热线：4008866338

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(47) 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](http://www.guosen.com.cn)

(48) 安信证券股份有限公司

地址：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

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

(49) 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：刘宛晨

客户服务电话：0731-4403340

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

(50) 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](http://www.newone.com.cn)

(51) 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：曹宏

客服电话：0755-82288968

网址：[www.cc168.com.cn](http://www.cc168.com.cn)

(52) 九州证券股份有限公司

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：魏先锋

客服电话：0755-33331188

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

(53) 中国中投证券有限责任公司

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](http://www.china-invs.cn)

(54) 广州证券股份有限公司

地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

客服热线：95396

网址：<http://www.gzs.com.cn>

(55) 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：周易

客户咨询电话：025-84579897

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

(56) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路 13 号

法定代表人：何春梅

客服电话：95563

网址：<http://www.ghzq.com.cn>

(57) 华融证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 至 18 层

法定代表人：祝献忠

客户服务电话：95390

网址：<http://www.hrsec.com.cn>

（58）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>

（59）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>

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，并在基金管理人网站公示。

## 2、场内发售机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单详见基金份  
额发售公告或相关业务公告）。

### （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：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：韩炯

电话：021- 31358666

传真：021- 31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：（010）58153000

传真：（010）85188298

联系人：王珊珊

经办注册会计师：徐艳、王珊珊。

## 四、基金的名称

建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金

## 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，实现对央视财经 50 指数的有效跟踪。

## 七、基金的投资方向

本基金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（包括央视财经 50 指数成份股、备选成份股、一级市场初次发行或增发的新股）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等）、货币市场工具、股指期货、权证以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。

本基金投资于股票的资产不低于基金资产净值的 85%，其中投资于央视财经 50 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；股指期货、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本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

## 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，并原则上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%。如因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，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

### （一）资产配置策略

本基金投资于央视财经 50 指数成份股、备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期一年以内的政府债券。

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。

## （二）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央视财经 50 指数为标的指数，原则上采用完全复制的方法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，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。

### 2、投资组合调整

#### （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

##### A. 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，本基金将按照标的指数最新权重比例，进行相应调整。

##### B. 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。

##### C. 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。

##### D. 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

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。

同时，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。

### （三）股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资，达到有效控制跟踪误差。

#### 1、确定套期保值目标现货组合、期限以及交易方向

套期保值的目标现货组合是指需要进行套期保值的股票资产，这部分资产可以是基金持有或者将要持有的所有股票资产，也可以是部分股票资产。本基金将通过对国内外宏观经济运行趋势、财政以及货币政策、市场资金供需状况、股票市场估值水平、固定收益类资产收益水平等因素进行分析，结合对股票头寸的流动性、风险程度等因素的测评，以确定需要进行套期保值的股票组合和套期保值期限。

根据期货合约的交易方向不同，套期保值分为两类：买入套期保值、卖出套期保值。买入套期保值（又称多头套期保值）是在期货市场买入期货合约，用期货市场多头对冲现货市场上行风险，主要用于降低基金建仓期股票价格大幅上涨的风险；卖出套期保值（又称空头套期保值）是在期货市场中卖出期货合约，用期货市场空头对冲现货市场的下行风险，以规避基金运作期间股票价格下跌的风险。本基金将根据实际需要确定交易方向。

#### 2、选择股指期货合约开仓种类

在期货合约选择方面，本基金将遵循品种相同或相近以及月份相同或相近的原则。如果市场上存在以不同指数为标的的股票指数期货，则将选择与目标现货组合相关性较强的指数为标的的股票指数期货进行套期保值。本基金将综合权衡所承担的基差风险、合约的流动性以及展期成本等因素，确定最有利的合约或者合约组合进行开仓。

### 3、根据最优套期保值比例确定期货头寸

本基金将通过最优套期保值比例来确定期货头寸，以当前投资组合和目标投资组合的差与期货标的指数之间的  $\beta$  系数作为最优套期保值比例。

### 4、初始套期保值组合的构建及调整

计算得到最优的套期保值比例后，本基金将其转换为具体的期货合约数，计算得到合约数量后，本基金根据选择股指期货合约开仓种类构建套期保值组合。

### 5、合约的展期

当标的指数期货存在两种及两种以上近月合约时，本基金将利用各类近期合约的择机转换策略从而获取一定的套保收益，原则上本基金将以基差的大小程度作为合约转换的主要依据。

### 6、动态调整

本基金将基于现货组合市值、股票组合  $\beta$  值的变动情况，动态确定套期保值过程中的最优套期保值比例，并适时对组合中的期货头寸进行调整。

因此本基金将根据目标资产  $\beta$  值的稳定性和调整成本，设定一定的阈值，当套期保值比例变化率超过该阈值时，调整期货合约数，以达到较好的套期保值效果。

## 九、基金的业绩比较基准

### 1、标的指数

本基金的标的指数为央视财经 50 指数。

央视财经 50 指数是一只基于基本面因素选股的创新型指数，由中央电视台财经频道与深圳证券信息公司合作开发，于 2012 年 6 月 6 日正式发布。央视财经 50 指数是以“成长、创新、回报、公司治理、社会责任”五个维度为考察基础，从财务与资信评级两个角度进行评定，在 A 股市场上遴选出 50 家优质上市公司组成其样本股，再对五个维度进行权重优化后编制出的跨市场股票指数。

### 2、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准： $95\% \times$  央视财经 50 指数收益率  $+5\% \times$  银行活期存款利率（税后）。

本基金以央视财经 50 指数为标的指数，但由于相关法规的要求，本基金投

资股票的资产不超过基金资产净值的 95%，且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%，因此，选用“95%×央视财经 50 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）”作为业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

如果指数编制单位变更或停止央视财经 50 指数的编制、发布或授权，或央视财经 50 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致央视财经 50 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，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数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媒体公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，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。

从本基金所分离的两类基金份额来看，建信央视 50A 份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；建信央视 50B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。

## 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 2019 年 10 月 18 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 2019 年 9 月 30 日,本报告中财务资料未经审计。

### 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	960,320,493.40	89.51
	其中:股票	960,320,493.40	89.51
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	90,100,815.76	8.40
8	其他资产	22,498,008.04	2.10
9	合计	1,072,919,317.20	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	-	0.00
B	采矿业	15,629,692.56	1.46
C	制造业	551,019,957.22	51.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	5,474,560.00	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	18,841,946.40	1.76
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,130,207.37	3.38
J	金融业	291,289,226.67	27.29
K	房地产业	31,058,451.20	2.91
L	租赁和商务服务业	-	0.00

M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	5,399,060.59	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	2,437,764.60	0.23
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	957,280,866.61	89.67

## (2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	1,281,249.18	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,758,377.61	0.16
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	3,039,626.79	0.28

## (3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	占基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	853,014	68,821,169.52	6.45
2	600519	贵州茅台	54,601	62,791,150.00	5.88
3	601318	中国平安	636,609	55,410,447.36	5.19
4	002415	海康威视	1,638,493	52,923,323.90	4.96
5	601166	兴业银行	2,945,807	51,639,996.71	4.84
6	600887	伊利股份	1,756,475	50,094,667.00	4.69
7	600036	招商银行	1,350,359	46,924,975.25	4.40
8	600016	民生银行	7,141,140	42,989,662.80	4.03
9	601398	工商银行	7,318,071	40,468,932.63	3.79
10	300136	信维通信	943,498	33,777,228.40	3.16

(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	688088	虹软科技	16,944	697,076.16	0.07
2	688066	航天宏图	15,134	542,251.22	0.05
3	688116	天奈科技	15,113	430,115.98	0.04
4	688011	新光光电	8,807	418,948.99	0.04
5	688015	交控科技	12,549	378,352.35	0.04

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

## 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

无。

## 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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1910	IC1910	30	29,618,400.00	-1,378,966.67	-
公允价值变动总额合计（元）					-1,378,966.67
股指期货投资本期收益（元）					2,294,686.67
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-1,378,966.67

### （2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的，将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃、与标的指数相关性高的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低主要由申购赎回带来的股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，以达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

## 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

无。

### （2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### （3）本期国债期货投资评价

无。

## 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未披露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	4,107,624.44
2	应收证券清算款	17,769,812.38
3	应收股利	-
4	应收利息	37,158.56
5	应收申购款	583,412.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,498,008.04

## (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## (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

无。

## 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	公司名称	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	688088	虹软科技	697,076.16	0.07	非公开发行
2	688066	航天宏图	542,251.22	0.05	非公开发行
3	688116	天奈科技	430,115.98	0.04	非公开发行
4	688011	新光光电	418,948.99	0.04	非公开发行
5	688015	交控科技	378,352.35	0.04	非公开发行

## (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

基金业绩截至日为 2019 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。

## 本报告期净值收益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
自基金合同生效之日—2013年12月31日	-0.62%	1.12%	-1.80%	1.20%	1.18%	-0.08%
2014年1月1日—2014年12月31日	26.05%	1.07%	25.29%	1.08%	0.76%	-0.01%
2015年1月1日—2015年12月31日	17.57%	2.33%	15.19%	2.30%	2.38%	0.03%
2016年1月1日—2016年12月31日	-2.73%	1.38%	-2.23%	1.24%	-0.50%	0.14%
2017年1月1日—2017年12月31日	49.52%	0.77%	42.81%	0.78%	6.71%	-0.01%
2018年1月1日—2018年12月31日	-22.81%	1.38%	-24.67%	1.40%	1.86%	-0.02%
2019年1月1日—2019年9月30日	28.50%	1.32%	25.82%	1.33%	2.68%	-0.01%
自基金合同生效之日—2019年9月30日	112.45%	1.42%	87.55%	1.41%	24.90%	0.01%

## 十三、基金的费用概览

## (一) 场外申购与赎回的费用

## 1、场外申购费率

本基金对申购设置级差费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	1.2%
100 万元 ≤ M < 300 万元	0.8%
300 万元 ≤ M < 500 万元	0.4%
M ≥ 500 万元	1000 元/笔

申购费用由投资人承担，在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，

主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

基金管理人对于部分基金份额持有人费用的减免不构成对其他投资者的同等义务。

## 2、场外赎回费率

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。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，赎回费的 25% 归入基金财产，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。

赎回费率随赎回基金份额持有年限的增加而递减。通过场外认购、申购的投资者其份额持有期限以份额实际持有期限为准；从场内转托管至场外的基金份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管转入确认日开始计算。具体费率如下：

持有期限	场外赎回费率
持有期 < 7 日	1.5%
7 日 ≤ 持有期 < 1 年	0.5%
1 年 ≤ 持有期 < 2 年	0.25%
持有期 ≥ 2 年	0%

注：1 年指 365 天

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## （二）场外申购份额与赎回金额的计算

### 1、建信央视 50 份额申购份额的计算

建信央视 50 份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日建信央视 50 份额净值

（注：在适用固定金额计算申购费率时，净申购金额=申购金额-申购费用）

例：某投资人投资 100,000 元申购建信央视 50 份额，假设申购当日建信央视 50 份额净值为 1.0250 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额=100,000/（1+1.2%）=98,814.23 元

申购费用=100,000-98,814.23=1,185.77 元

申购份额=98,814.23/1.025=96,404.13 份

即：投资者投资 100,000 元申购建信央视 50 份额，对应申购费率为 1.2%，假设申购当日建信央视 50 份额净值为 1.0250 元，则可得到 96,404.13 份建信央视 50 份额。

## 2、建信央视 50 份额赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的建信央视 50 份额净值为基准进行计算，计算公式：

赎回总金额=赎回份额 × T 日建信央视 50 份额净值

赎回费用=赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额=赎回总金额 - 赎回费用

例：某投资人赎回 10 万份建信央视 50 份额，份额持有期限 100 天，对应赎回费率为 0.5%，假设赎回当日建信央视 50 份额净值是 1.1480 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额 =100,000×1.148=114,800.00 元

赎回费用 =114,800.00×0.5% = 574.00 元

净赎回金额 =114,800.00-574.00=114,226.00 元

即：投资人赎回本基金 10 万份建信央视 50 份额，份额持有期限 100 天（未满 1 年），假设赎回当日建信央视 50 份额净值是 1.1480 元，则其可得到的净赎回金额为 114,226.00 元。

## 3、建信央视 50 份额净值的计算

建信央视 50 份额的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。

#### 4、申购份额、余额的处理方式

申购的有效份额为净申购金额除以当日的建信央视 50 份额的基金份额净值，有效份额单位为份。场外申购份额按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

#### 5、赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。赎回金额计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

### （三）场内申购与赎回的费用

#### 1、场内申购费率

场内会员单位应按照场外申购费率设定投资人场内申购的申购费用。

申购费用由投资人承担，在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

基金管理人对部分基金持有人费用的减免不构成对其他投资者的同等义务。

#### 2、场内赎回费率

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。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，赎回费的 25% 归入基金财产，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。

持有期限	场内赎回费率
持有期 < 7 日	1.5%
7 日 ≤ 持有期 < 1 年	0.5%
1 年 ≤ 持有期 < 2 年	
持有期 ≥ 2 年	

注：1 年指 365 天

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### 5、场内申购份额与赎回金额的计算

##### (1) 建信央视 50 份额申购份额的计算

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日建信央视 50 份额净值

（注：在适用固定金额计算申购费率时，净申购金额=申购金额-申购费用）

申购份额计算结果保留到整数位，不足 1 份额对应的申购资金返还至投资人资金账户。

例：某投资人通过场内投资 100,000 元申购建信央视 50 份额，对应的申购费率为 1.2%，假设申购当日建信央视 50 份额净值为 1.0250 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额=100,000/（1+1.2%）=98,814.23 元

申购手续费=100,000-98,814.23=1,185.77 元

申购份额=98,814.23/1.0250=96,404.13 份

因场内申购份额保留至整数份，故投资人申购所得份额为 96,404 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为：

实际净申购金额=96,404×1.0250=98,814.10 元

退款金额=100,000-98,814.10-1,185.77=0.13 元

即：投资人投资 100,000 元从场内申购建信央视 50 份额，假设申购当日建信央视 50 份额净值为 1.0250 元，则其可得到建信央视 50 份额 96,404 份，退款 0.13 元。

## （2）建信央视 50 份额赎回金额的计算

赎回总金额=赎回份额 × 赎回当日建信央视 50 份额净值

赎回费用=赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额=赎回总金额 - 赎回费用

赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资人从场内赎回 10 万份建信央视 50 份额，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日建信央视 50 份额净值是 1.1480 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=100,000×1.1480=114,800.00 元

赎回费用=114,800.00×0.5% = 574.00 元

净赎回金额=114,800.00-574.00=114,226.00 元

即：投资人从深圳证券交易所场内赎回 10 万份建信央视 50 份额，假设赎回当日建信央视 50 份额净值是 1.1480 元，则其可得到的净赎回金额为 114,226.00 元。

6、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 7、场内申购与赎回的注册登记

建信央视 50 份额场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

8、办理建信央视 50 份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行。

## （四）场内申购份额与赎回金额的计算

### 1、建信央视 50 份额申购份额的计算

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日建信央视 50 份额净值

（注：在适用固定金额计算申购费率时，净申购金额=申购金额-申购费用）

申购份额计算结果保留到整数位，不足 1 份额对应的申购资金返还至投资人资金账户。

例：某投资人通过场内投资 100,000 元申购建信央视 50 份额，对应的申购费率为 1.2%，假设申购当日建信央视 50 份额净值为 1.0250 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23 \text{ 元}$$

$$\text{申购手续费} = 100,000 - 98,814.23 = 1,185.77 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,814.23 / 1.0250 = 96,404.13 \text{ 份}$$

因场内申购份额保留至整数份，故投资人申购所得份额为 96,404 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 96,404 \times 1.0250 = 98,814.10 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 100,000 - 98,814.10 - 1,185.77 = 0.13 \text{ 元}$$

即：投资人投资 100,000 元从场内申购建信央视 50 份额，假设申购当日建信央视 50 份额净值为 1.0250 元，则其可得到建信央视 50 份额 96,404 份，退款 0.13 元。

## 2、建信央视 50 份额赎回金额的计算

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日建信央视 50 份额净值}$$

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

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

赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资人从场内赎回 10 万份建信央视 50 份额，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日建信央视 50 份额净值是 1.1480 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 100,000 \times 1.1480 = 114,800.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 114,800.00 \times 0.5\% = 574.00 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 114,800.00 - 574.00 = 114,226.00 \text{ 元}$$

即：投资人从深圳证券交易所场内赎回 10 万份建信央视 50 份额，假设赎回当日建信央视 50 份额净值是 1.1480 元，则其可得到的净赎回金额为 114,226.00 元。

## （五）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、基金的指数使用许可费；
- 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、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金上市费和年费；
- 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

。

#### （六）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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0 \% \div \text{当年天数}$$

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，于次月前 5 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

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22 \% \div \text{当年天数}$$

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，于次月前 5 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。

##### 3、基金的指数使用许可费

基金的指数使用许可费自合同生效之日算起，收取标准和方法为：

$$H=E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

H=每日应付的指数使用许可费；E=前一日基金资产净值

基金合同生效之日所在季度，指数使用许可费按实际计提金额收取。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。

指数使用许可费每日计算，逐日累计，根据基金管理人出具的付款指令按季支付。

4、上述“一、基金费用的种类中第 4—10 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。

#### （七）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；
- 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。

#### （八）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、更新了全文涉及《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》条款变更的相关内容；
- 2、更新了“第三部分：基金管理人”的“主要人员情况”；
- 3、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；
- 4、更新了“第五部分：相关服务机构”的“代销机构”的相关信息及“审

计基金资产的会计师事务所”；

5、更新了“第十三部分：基金的投资”中的基金投资组合报告；

6、更新了“第十四部分：基金的业绩”；

7、更新了“第二十七部分：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。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，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](http://www.ccbfund.cn)。

建信基金管理有限责任公司

二〇一九年十二月