

# 建信深证 100 指数增强型证券投资基金

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2020 年 12 月 30 日

送出日期：2020 年 12 月 31 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

|         |                 |                |                 |
|---------|-----------------|----------------|-----------------|
| 基金简称    | 建信深证 100 指数增强   | 基金代码           | 530018          |
| 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      |
| 基金合同生效日 | 2012 年 3 月 16 日 | 上市交易所及上市日期     | -               |
| 基金类型    | 股票型             | 交易币种           | 人民币             |
| 运作方式    | 普通开放式           | 开放频率           | 每个开放日           |
| 基金经理    | 梁洪昀             | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2012 年 3 月 16 日 |
|         |                 | 证券从业日期         | 2003 年 2 月 20 日 |

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

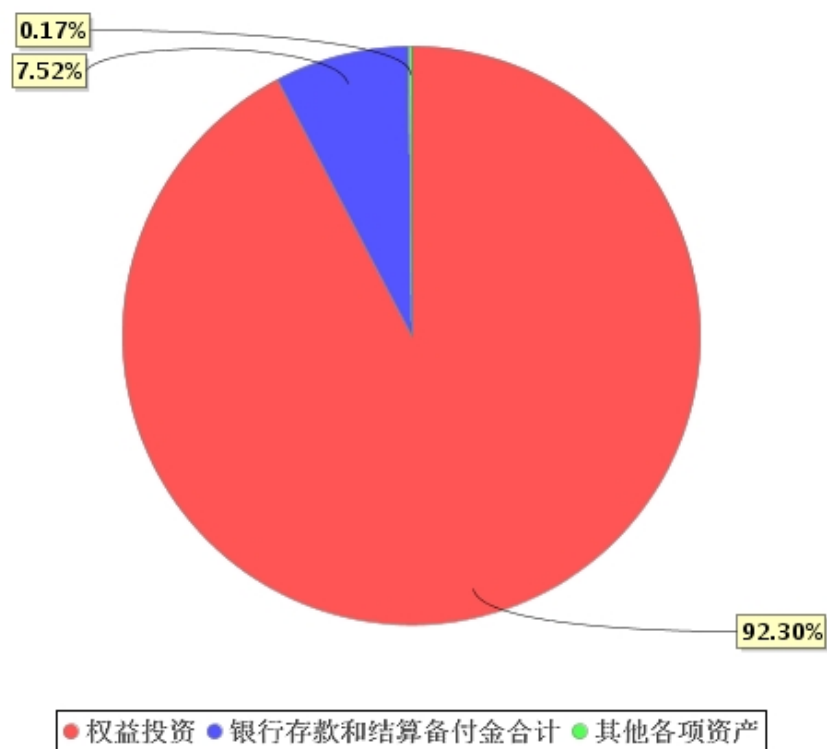
请投资者阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况

|        |  |
|--------|--|
| 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。  |
| 投资范围   | 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%，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。 |
| 主要投资策略 | 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。<br>1、资产配置策略<br>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  |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>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。</p> <p>2、股票投资组合策略</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | 95%×深证 100 价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）  |
| 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。  |

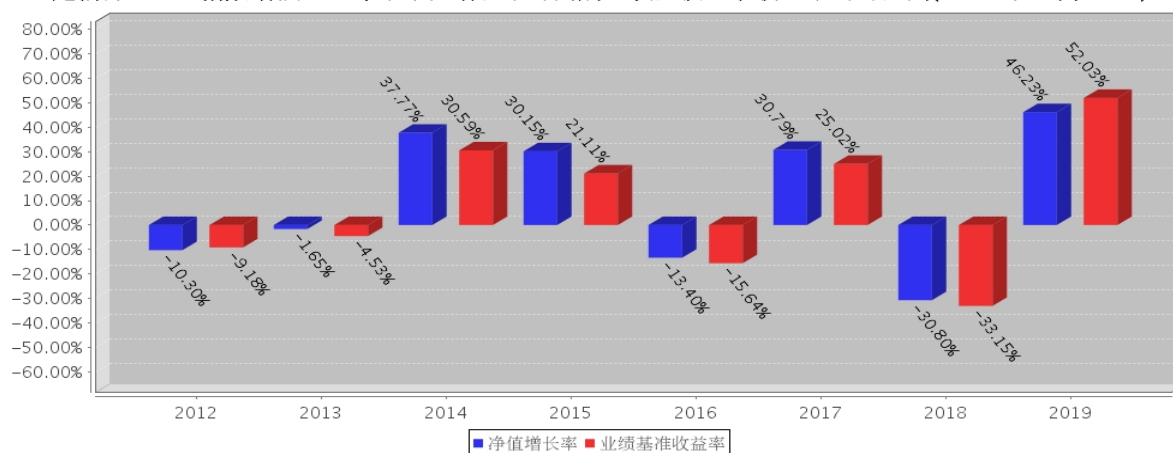
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

### 投资组合资产配置图表(2020年9月30日)



## (三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

建信深证100指数增强基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2019年12月31日)



注:基金的过往业绩不代表未来表现。

基金合同生效当年不满完整自然年度的,按实际期限计算净值增长率。

## 三、投资本基金涉及的费用

## (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取:

| 费用类型         | 份额(S)或金额(M)<br>/持有期限(N) | 收费方式/费率     |
|--------------|-------------------------|-------------|
| 申购费<br>(前收费) | 0万元≤M<100万元             | 1.50%       |
|              | 100万元≤M<500万元           | 1.00%       |
|              | 500万元≤M                 | 1,000.00元/笔 |
| 赎回费          | 0天≤N<7天                 | 1.50%       |
|              | 7天≤N<1年                 | 0.50%       |
|              | 1年≤N<2年                 | 0.25%       |
|              | N≥2年                    | 0.00%       |

## (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

| 费用类别 | 收费方式/年费率  |
|------|---|
| 管理费  | 1.00%   |
| 托管费  | 0.20%   |
| 其他费用 | 基金的证券交易费用,基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用,基金份额持有人大会费用,基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费,基金银行汇划费用,按照国家有关规定可以列入的其他费用。指数许可使用费率0.02%,季度收取下限为人民币5万元。 |

注:本基金交易证券、基金等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

## 四、风险揭示与重要提示

## (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

#### 1、被动跟踪指数的风险

##### (1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

##### (2) 替代投资风险

在某些情况下（包括指数成份股投资受限制、市场流动性不足等）导致本基金无法投资或者获得足够数量的某种或几种股票时，基金管理人将运用替代投资策略，如买入同行业指数成份股、备选成份股或非成份股等，力求降低基金跟踪偏离度，但无法消除由此引起的基金收益率与业绩比较基准之间的偏离及相应的风险。

##### (3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

#### 2、主动增强投资的风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整，如在一定幅度内减少或增强成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。这种基于对基本面的深度研究作出优化调整投资组合的决策，最终结果仍然存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于指数收益率但也有可能低于指数收益率。

## (二) 重要提示

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。

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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人官方网站 [www.ccbfund.cn] [客服电话：400-81-95533]

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料