

建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(C 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 6 月 21 日

送出日期：2024 年 6 月 28 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 | 建信沪深 300 红利 ETF 发起式联接 | 基金代码 | 012712 |
| 下属基金简称 | 建信沪深 300 红利 ETF 发起式联接 C | 下属基金交易代码 | 012713 |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 | 基金托管人 | 中信证券股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 9 月 8 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 | 郭志腾 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023 年 12 月 7 日 |
| | | 证券从业日期 | 2017 年 7 月 10 日 |
| 其他 | 基金合同生效满三年后的对应日，若本基金资产净值低于 2 亿元人民币，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。 若目标 ETF 触发终止运作的情形，或目标 ETF 因退市变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金，则本基金将自动终止。 连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，本基金将自动进行基金财产清算并终止。 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

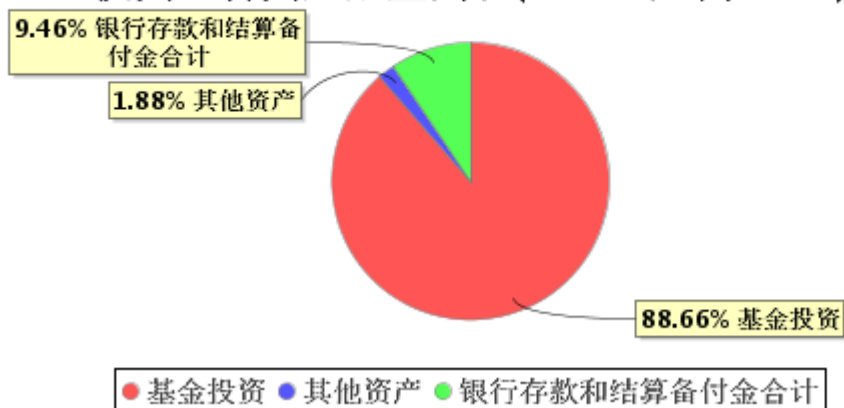
请投资者阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股票、国内依法发行上市的非成份股（包括主板、中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会注册或核准上市的股票）、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）、债券回购、货币市场工具、衍生工具（股指期货、股票期权）、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）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）。 本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。本基金成立以后还可以按照法 |

| | |
|---------------|---|
| | <p>律法规和监管部门的有关规定进行融资。</p> <p>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。</p> <p>本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，对现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。股指期货、股票期权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。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。</p> <p>为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于目标 ETF，在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 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。本基金投资目标 ETF 的两种方式如下：</p> <p>（1）申购和赎回：目标 ETF 开放申购赎回后，以组合证券进行申购赎回或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其他方式申赎目标 ETF；</p> <p>（2）二级市场方式：目标 ETF 上市交易后，在二级市场进行目标 ETF 的交易。本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。</p> <p>当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。</p> <p>本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标 ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取完全复制策略，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 红利指数收益率×95%+银行活期存款税后收益率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数所表征的市场组合相似的风险收益特征，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |

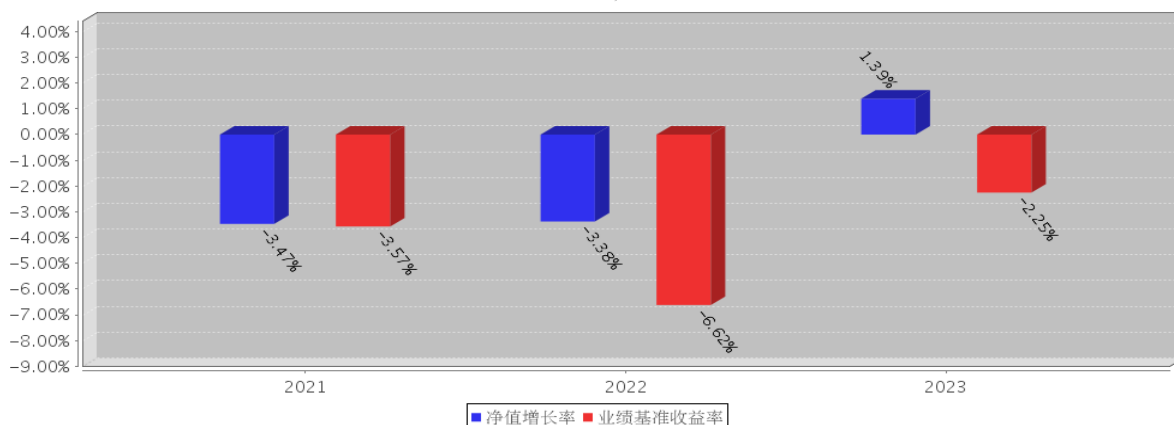
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2024年3月31日)



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

建信沪深300红利ETF发起式联接C 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 (2023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) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|------|-----------------------------|---------|
| 赎回费 | 0 天 ≤ N < 7 天 | 1.5% |
| | N ≥ 7 天 | 0% |

注：本基金 C 类份额不收取认购费、申购费。

(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/年费率或金额 | 收取方 |
|------|--------------------------|------------|
| 管理费 | 按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金 | 基金管理人和销售机构 |

| | | |
|--------------|--|--------|
| | 份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 0.50%年费率计提 | |
| 托管费 | 按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 0.10%的年费率计提 | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 0.3% | 销售机构 |
| 审计费用 | 40,000.00 元 | 会计师事务所 |
| 其他费用 | 本基金其他费用详见本基金合同或招募说明书费用章节。 | 相关服务机构 |

注：1、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。

2、审计费用、信息披露费、指数许可使用费（若有）为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

建信沪深 300 红利 ETF 发起式联接 C

| |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 1.09% |

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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、目标 ETF 的风险

本基金属于 ETF 联接基金，主要投资于目标 ETF，因此目标 ETF 面临的风险（例如目标 ETF 的管理风险、操作风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险和技术风险等风险）可能直接或间接成为本基金的风险。

在本基金目标 ETF 未能符合基金备案条件时，本基金将不能设立，面临募集失败的风险。

本基金为目标 ETF 的联接基金，但不能保证本基金的表现与目标 ETF 的表现完全一致，产生差异的原因包括：投资对象和投资范围的不同，投资管理方式的不同，如在指数化投资过程中，不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不同，基金规模、投资成本、各种费用与税收的不同，现金比例及现金管理方式的不同，本基金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，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不得低于基金资产净值的 5%，而目标 ETF 则没有这项规定。

2、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

标的指数调整成份股或变更编制方法，标的指数成份股发生送配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，成份股派发现金红利、成份股增发、送配等所获收益，成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本，基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等费用的存在，都会对本基金的收益产生影响，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，受到最低买入股数的限制，缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指

数跟踪成本较大，指数发布机构指数编制错误等，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

3、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，或者编制机构退出市场，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。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

(二) 重要提示

-中国证监会对本基金募集的注册，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