

深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金 招募说明书(更新)摘要

2013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:中国民生银行银行股份有限公司
二〇一三年十月

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2011年7月14日证监许可[2011]1092号文核准募集。本基金的基金合同于2011年9月8日正式生效。
基金管理人承诺本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书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。

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,具有与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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

投资有风险,投资者投资本基金前应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对投资本基金的时间、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,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,应全面了解本基金的产品特性,理性判断市场,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、基金管理人在基金实施过程中产生的基金管理风险、本基金特定风险等等。本基金属于股票型基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,目标为获取与市场平均收益,是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。本基金初始募集净值1元,在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始净值,本基金投资者有可能出现亏损。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。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。

本招募说明书所载内容截止日为2013年9月7日,有关财务数据和净值表现截止日为2013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

1.基金管理人基本情况
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:汪光锐
联系人:路彩霞
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:

股权结构	股权比例
中国建设银行股份有限公司	65%
美国信安金融服务有限公司	25%
中国华电集团公司	10%

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实保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大会依法行使权利,不得以任何形式直接或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4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外聘任或解聘高级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、高管等履职情况。
公司日常经营管理由总经理负责。公司根据经营运作需要设置综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场部、专户理财部、市场推广部、人力资源部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部十五个职能部门,以及深圳、成都、上海三个分公司,在上海设立了子公司—建信资本管理有限责任公司。此外,公司还设有投资决策委员会和风险管理委员会。

二、主要人员情况

汪光锐先生,董事长。1982年毕业于东北财经大学,获经济学学士学位。1986年获财政部财政科学研究所财政学硕士学位。1993年获美国Heriot-Watt大学商学院国际银行金融学硕士学位。历任中国建设银行行政办公室副主任、中国建设银行国际业务部处长、中国建设银行行政办公室副主任、中国建设银行国际业务部副总经理,中国建设银行基金托管部总经理,中国建设银行基金托管部总经理兼机构业务部总经理。

孙志晨先生,董事。1985年获东北财经大学学士学位,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,中国建设银行总行总行个人银行业务部副总经理。

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副经理、证券部副经理,北京分行安华支行副行长,北京分行西便门支行行长,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。

刘雁行先生,董事,现任美国普华永道集团亚太—亚洲、1977年获加拿大滑铁卢大学城市设计及环境规划学士学位。历任加拿大安泰保险公司高级培训师、团体保险总监,美国友邦保险亚洲区团体保险部副总监,信安保险有限公司亚洲区行政总裁。

袁时奇先生,董事,现任信安国际(中国)大中华区首席运营官。1981年毕业于美国阿利根西学院。历任香港汇丰银行投资银行部副经理,加拿大丰业银行资本市场部高级经理,香港渣打银行市场部助理经理,香港置地地产运营部副经理,香港赛马会副集团副经理,信安国际(中国)大中华区首席运营官。

殷红军先生,董事,现任中国华电集团资本控股有限公司副总经理。1998年毕业于首都经济贸易大学数量经济学专业,获硕士学位。历任中国电力财务有限公司证券基金部项目经理,华电集团资本控股有限公司投资管理部经理(主持工作),中国华电集团公司改制重组办公室副主任、体制改革处处长、政策与法律事务部政策研究处处长。

顾建超先生,独立董事,现任中国信达资产管理股份有限公司总裁助理。1984年获浙江工业大学管理工程学士学位,1991年获浙江大学经济系宏观经济专业硕士学位,1994年获财政部财研所研究生班金融学硕士学位。历任中国建设银行信托投资公司总稽核兼风险管理部经理,中国建设银行会计部副总经理,香港华建国际集团副总经理。

王建国先生,独立董事,曾任大新人寿险有限公司首席行政官,中银保险退休信托管理有限公司董事,英国保诚保险有限公司首席行政官,美国国际保险集团亚太区资深副总裁,美国友邦保险(加拿大)有限公司总裁兼首席行政官等。1989年获Pacific Southern University工商管理硕士学位。

伏军先生,独立董事,法学博士,现任对外经济贸易大学法学院教授,兼任中国法学会国际经济法研究会常务理事、副教授、中国国际贸易法专业委员会副主任。

2.监事会成员

罗中涛女士,监事会主席。1977年毕业于天津南开大学政治经济学专业。历任国家统计干部、副处长,中国建设银行投资管理部副部长,信贷部副部长,处长,兼任代理行长等。中国建设银行基金托管部副总经理,中国建设银行投资管理部总经理。

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。曾任美国保诚财险新市场发展区域总监和美国国际集团全球海外及健康险副总裁等职务。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。

唐湘晖女士,监事,现任中国华电集团资本控股有限公司财务与风险管理部副经理。1993年获北京物资学院会计学学士学位,2007年获得清华大学金融学硕士学位。历任中国电力联合大学与经济学院研究中心、电力工业经济调节中心、国家电网公司财务与资产管理部、中国华电集团公司财务与资产管理部,中国华电集团公司审计中心、中国华电集团公司金融管理部副部长,中国华电集团资本控股有限公司(财务公司)监察审计部经理,中国华电集团资本控股有限公司金融管理部经理,中国华电集团资本控股有限公司机构发展与管理部副经理。

顾隽先生,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部总监。1988年获得安徽省委党校政法专业文学学士学位,1990年获得上海复旦大学国际经济法专业学士学位。历任中国日报社记者,穆晋源律师事务所主任,中国建设银行国际业务部副主任,中国信达信托投资有限公司(原名中国建设银行信托投资公司)证券发行部副总经理,宏源证券有限公司投资银行部副总经理,上海永嘉投资管理有限公司执行董事、副总经理。

吴洁女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司风险管理部总监。1992年毕业于南开大学金融系,1995年毕业于中国人民大学金融研究所研究生班。历任中国建设银行国际业务部外汇资金处主任科员,中国建设银行北京总行风险管理部副处长,中国建设银行资金部交易风险管理处综合高级助理(主持工作)。

吴昆玲女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司人力资源部副经理。1996年毕业于中国人民大学信息管理学院,获得学士学位;2001年毕业于北京师范大学经济学院,获得管理学硕士学位。历任中国建设银行总行人力资源部副主任科员,高级经理助理,建信基金管理公司人力资源部副经理助理,副总监、总监。

3.公司高管人员

孙志晨先生,总经理(简历请参见董事会成员)。
何斌先生,副总经理。1992年获东北财经大学计划统计系学士学位。

先后就职于北京市财政局、北京都会会计师事务所、中国证券监督管理委员会基金监管部,历任国泰基金管理公司(任副总经理)、建信基金管理有限责任公司(任督察长)。

王新艳女士,副总经理。特许金融分析师(CFA),中国人民大学研究生部硕士。1998年10月加入长盛基金管理公司,历任研究员、基金经理助理,2002年11月2日至2004年5月22日担任长盛成长价值证券投资基金的基金经理。2004年6月加入景顺长城基金管理公司,历任基金经理、投资副总监、投资总监等职。2005年3月16日至2009年1月16日期间担任景顺长城鼎益股票型证券投资基金(LOF)的基金经理,2007年6月18日至2009年3月16日期间担任景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2009年3月加入本公司,任总经理助理,2010年5月起任副总经理。2009年12月17日至2011年2月1日任建信恒久价值股票型证券投资基金的基金经理;2010年4月27日起任建信核心精选股票型证券投资基金的基金经理;2010年11月16日至2011年12月20日任建信内生动力股票型证券投资基金的基金经理。

4.督察长

路彩霞女士,督察长。1979年毕业于河北大学经济系计划统计专业。历任中国建设银行公司业务部副处长、处长,华夏证券股份有限公司部门副总经理,宝盈基金管理公司首席顾问(公司副总经理级),建信基金管理有限责任公司首席监事。

5.本基金基金经理

梁洪钧先生,博士,特许金融分析师(CFA),投资管理部执行总监。2003年1月获清华大学经济学硕士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任基金工程研究员、规划及展业部产品设计师、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、研究部高级助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部副总监(主持工作)。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金LOF基金经理;2010年5月28日至2012年5月28日任上述社会责任投资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日起任深证基本面60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;2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金基金经理。

6.投资决策委员会成员
孙志晨先生,总经理。
王新艳女士,副总经理。
梁洪钧先生,投资管理部总监。
方志勇先生,投资管理部副总监。
柯晓敏女士,投资管理部副总监。
姚娟女士,研究部首席策略分析师。

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:中国民生银行银行股份有限公司(以下简称“中国民生银行”)
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标

成立时间:1996年2月7日
基金托管业务批准文号:证监基金字[2004]101号
组织形式:股份有限公司(上市)
注册资本:28,365,585,227元人民币
存续期间:持续经营
联系人:关晓
电话:010-58560666

中国民生银行于1996年1月12日在北京正式成立,是我国首家主要由非公有制企业入股的全股份制商业银行,同时又是严格按照《公司法》、《商业银行法》建立的规范化的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的诞生和实现规范化的现代企业制度,使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行,而成为国际经济、金融改革先锋。中国民生银行成立十余年来,业务不断拓展,规模不断扩大,效益逐年递增,并保持了良好的资产质量。

2009年12月19日,中国民生银行A股股票600016在上海证券交易所挂牌上市。2003年3月18日,中国民生银行40亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004年11月18日,中国民生银行通过银行间债券市场成功发行58亿元人民币次级债券,成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005年10月26日,民生银行成功完成股权分置改革,成为国内首家完成股权分置改革的商业银行,为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。

中国民生银行自上市以来,按照“团结奋进,开拓创新,培育人才;严格管理,规范行为;敬业守法;讲究质量,提高效率,健康发展”的经营理念,在改革发展与管理等方面进行了有益探索,先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三三”机制、独立审计制度、八大基础管理体系、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新,实现了低风险、快增长、高效益的战略目标,树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

2007年11月,民生银行通过了SAI国际组织颁布的SA8000体系认证(即企业社会责任管理体系),成为中国金融界第一家通过该项认证的商业银行。

2007年11月,民生银行获得2007第一财经金融品牌榜十佳中资银行称号,同时荣获《21世纪经济报道》等机构评选的“最佳贸易融资银行奖”。

2007年12月,民生银行荣获《福布斯》颁发的第三届“亚太地区最大规模上市公司企业50强”奖项。

2008年7月,民生银行荣获“2008年中国最具生命力百强企业”第三名。在《2008中国商业竞争力评价报告》中民生银行综合实力排名第61位,在公司治理和流程银行两个单项评价中位列第一。

2009年6月,民生银行在“2009年本土网上银行竞争力评测活动”中获2009年中国本土网上银行“最佳服务质量奖”。

2009年9月,在大连召开的第二届“中国中小企业融资论坛上,中国民生银行被评为2009中国中小企业金融服务十佳机构”。在“首届中国优秀财经证券网站评选”中,民生银行荣膺“最佳安全性能奖”和“2009年度最佳银行网站”两项大奖。

2009年11月21日,在第四届“21世纪亚洲金融年会”上,民生银行被评为2009“亚洲最佳风险管理银行”。

2009年12月9日,在由《财新周刊》主办的“2009年第二届最受尊敬银行评选暨2009年中国最佳银行理财产品评选”中,民生银行获得了“2009年中国最受尊敬银行”、“最佳服务私人银行”、“2009年最佳零售银行”等多个奖项。

2010年2月3日,在“卓越2009年度金融理财排行榜”评选活动中,中国民生银行“渝信电子银行”产品服务获得了专业理财专家和网友的一致好评,荣获卓越2009年度金融理财排行榜“十佳电子银行奖”。

2010年10月,在经济观察网主办的“2009年度中国最佳银行评选”中,民生银行获得评委委员会——“中国最佳银行十年改革创新奖”。这一奖项是评委委员会在综合公司治理、激励机制、风险管理、产品创新、管理架构、商业模式六个方面表现卓越银行中特别设立的。

2011年12月,在中国银行业协会、CFCA联合举办的40位成员行共同举办的2011中国网上银行年会上,民生银行荣获“2011年中国网上银行最佳网银安全奖”。这是继2009年、2010年荣获“中国网上银行最佳网银安全奖”后,民生银行第三次获此殊荣,是第三方支付安全认证机构对民生银行网上银行安全性的肯定。

2012年6月20日,在“国际经济高峰论坛”上,民生银行金融业务以其2011-2012年度取得的出色业绩和产品创新殊荣荣获“2012年中国卓越贸易金融理财产品”奖项。这也是民生银行继2010年荣获“中国金融”中国银行业成就奖——最佳贸易金融“奖”之后第二次获此殊荣。

2012年11月29日,民生银行在“The Asset”杂志举办的2012年度AAA国际信用评级评选中获得“中国最佳银行-新秀奖”。

2.主要人员情况

杨春萍女士,北京大学本科,硕士,资产托管部副经理(主持工作)。曾就职于中国投资银行总行,意大利联合信贷银行北京代表处,中国民生银行金融市场和资产托管部。历任中国建设银行总行业务经理,意大利联合信贷银行北京代表处代表,中国民生银行金融市场处处长,资产托管部总经理助理、副总经理、副经理(主持工作)等职务。具有近二十年的金融从业工作经历,丰富的外资银行工作经验,具有广阔的眼界和前瞻性的战略眼光。

3.基金托管业务经营情况
中国民生银行托管了公司于2004年7月9日获得基金托管资格,成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥托管优势,大力发展托管业务,中国民生银行设立了有限资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金份额持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则,高起点建设托管系统,完善制度,组织人员,资产托管部目前共有员工152人,平均年龄33岁,100%员工拥有大学本科以上学历,80%以上员工具有硕士以上学历。基金业务人员100%都具有基金从业资格。截止到2013年9月30日,本行共托管基金25只,分别为九只精品优选混合型证券投资基金、融通易支付货币市场证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、天治天得利货币市场基金、东方金债货币市场基金、长信增利动态策略证券投资基金、华富领先企业混合型证券投资基金、景顺长城深证100指数分级证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中证500指数证券投资基金、工银瑞信添利债券型证券投资基金、建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金、建信保本混合型证券投资基金、浙商银行添利混合型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、工银瑞信睿智深证100指数分级证券投资基金、农银汇理行业轮动股票型证券投资基金、建信月盈安心财富债券型证券投资基金、中银中国股票型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、德邦货币货币市场基金和中银互利分级债券型证券投资基金,托管基金资产净值达553.82亿元。

三、相关服务机构

(一)基金发售代理机构

1.申银万国证券股份有限公司(简称“一级交易商”)
2.国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市世纪广场135号

法定代表人:万建华
客服电话:400-8888-666
网址:www.gjia.com

Q中信证券股份有限公司
住所:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
客服电话:95558
网址:www.citics.com

Q中汇万通证券有限责任公司
住所:青岛市崂山区曲阜路29号澳柯玛大厦15层(507-1510室)
法定代表人:杨宝林
客服电话:0532-96577
网址:www.zxwz.com

Q光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
客服电话:10108998
网址:www.ebscn.com

6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:王宇光
客服电话:4008-888-888
网址:www.htsec.com

Q永江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路88号汉口证券大厦
法定代表人:胡跃立
客服电话:4008-888-999
公司网址:www.95579.com

6华泰证券股份有限公司
住所:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客户咨询电话:025-84579897
网址:www.htsec.com

Q齐鲁证券有限公司
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
客户服务热线:95538
网址:www.qlzq.com

10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1015室
法定代表人:杜庆华
客服电话:4006515988
网址:www.bhzq.com

Q1平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市金田路中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇平
客服热线:4008866338
网址:stock.pingan.com

Q2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号国信信托大厦
法定代表人:何如
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

Q3中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳福田区益田路与福中路交界荣超商务中心A栋18-21层
法定代表人:龙增来
开放式基金咨询电话:4006008008
网址:www.citics.com

Q4安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界贸易中心C20层
法定代表人:牛冠兴
客户服务电话:0755-82822555
网址:www.axzq.com.cn

Q5诚源证券股份有限公司
注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文三路233号
办公地址:新疆自治区太平桥大街19号
法定代表人:海成
客服电话:4008-000-562
网址:www.cyzq.com.cn

Q6红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:刘雨晨
客服电话:0871-3577888
网址:www.hongtasecurities.com

Q7招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福华一路111号
法定代表人:陈明华
客服电话:95523/4008895223
网址:www.swsc.com

Q8东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2楼22-29层
法定代表人:潘鑫军
客服电话:95503
网址:www.dfzq.com.cn

Q9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:肖时庆
客服电话:95565/4008888111
网址:www.newone.com.cn

Q0北京证券有限责任公司
注册地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:栾智正
客户服务电话:0431-96688、0431-85096733
网址:www.bjzq.com.cn

Q11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:高冠江
客服电话:400-800-8899
网址:www.cindasc.com

Q12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:兰荣
客服电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn

Q13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:肖时庆
客服电话:95565/4008888111
网址:www.newone.com.cn

Q14安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界贸易中心C20层
法定代表人:牛冠兴
客户服务电话:0755-82822555
网址:www.axzq.com.cn

Q15诚源证券股份有限公司
注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文三路233号
办公地址:新疆自治区太平桥大街19号
法定代表人:海成
客服电话:4008-000-562
网址:www.cyzq.com.cn

Q16红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:刘雨晨
客服电话:0871-3577888
网址:www.hongtasecurities.com

Q17招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福华一路111号
法定代表人:陈明华
客服电话:95523/4008895223
网址:www.swsc.com

Q18东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2楼22-29层
法定代表人:潘鑫军
客服电话:95503
网址:www.dfzq.com.cn

Q19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:肖时庆
客服电话:95565/4008888111
网址:www.newone.com.cn

Q20北京证券有限责任公司
注册地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:栾智正
客户服务电话:0431-96688、0431-85096733
网址:www.bjzq.com.cn

Q21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:高冠江
客服电话:400-800-8899
网址:www.cindasc.com

Q22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:兰荣
客服电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn

Q23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:肖时庆
客服电话:95565/4008888111
网址:www.newone.com.cn

Q24安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界贸易中心C20层
法定代表人:牛冠兴
客户服务电话:0755-82822555
网址:www.axzq.com.cn

Q25诚源证券股份有限公司
注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文三路233号
办公地址:新疆自治区太平桥大街19号
法定代表人:海成
客服电话:4008-000-562
网址:www.cyzq.com.cn

Q26红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:刘雨晨
客服电话:0871-3577888
网址:www.hongtasecurities.com

Q27招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福华一路111号
法定代表人:陈明华
客服电话:95523/4008895223
网址:www.swsc.com

Q28东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2楼22-29层
法定代表人:潘鑫军
客服电话:95503
网址:www.dfzq.com.cn

Q29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:肖时庆
客服电话:95565/4008888111
网址:www.newone.com.cn

Q30北京证券有限责任公司
注册地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:栾智正
客户服务电话:0431-96688、0431-85096733
网址:www.bjzq.com.cn

Q31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:高冠江
客服电话:400-800-8899
网址:www.cindasc.com

Q32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:兰荣
客服电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn

Q33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:肖时庆
客服电话:95565/4008888111
网址:www.newone.com.cn

Q34安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界贸易中心C20层
法定代表人:牛冠兴
客户服务电话:0755-82822555
网址:www.axzq.com.cn

Q35诚源证券股份有限公司
注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文三路233号
办公地址:新疆自治区太平桥大街19号
法定代表人:海成
客服电话:4008-000-562
网址:www.cyzq.com.cn

Q36红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:刘雨晨
客服电话:0871-3577888
网址:www.hongtasecurities.com

Q37招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福华一路111号
法定代表人:陈明华
客服电话:95523/4008895223
网址:www.swsc.com

Q38东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2楼22-29层
法定代表人:潘鑫军
客服电话:95503
网址:www.dfzq.com.cn

Q39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:肖时庆
客服电话:95565/4008888111
网址:www.newone.com.cn

七、基金的投资方向
本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票,一级市场新股发行及中国证监会上允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的有关规定)。其中,基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%,但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

八、基金的投资策略
本基金采取完全复制策略,跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股票的构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票及其权重的变动进行相应调整。基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%。

本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产投资组合,但在特殊情况下,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的成份加以替换,这些情况包括但不限于以下情形:1)法律法规的限制;2)标的指数成份流动性严重不足;3)标的指数的成份股票长期停牌;4)其他合理原因导致本基金管理人对标指数的跟踪构成严重制约等。

在正常情况下,本基金对标的指数的跟踪目标是:力争使本基金日跟踪误差的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。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跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。

九、基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。

十、基金资产净值增长率与业绩比较基准差异较小的说明
本基金管理人认为,本基金业绩比较基准的选取,是综合考虑了本基金的投资方向、投资策略、资产配置、业绩比较基准、风险收益特征等因素后确定的,旨在为投资者提供合理的业绩比较基准,并不代表对基金未来表现的承诺,也不构成对基金业绩表现的保证。