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 便新 滴要

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

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。 基金管理人保证本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

合同取得其余份额 即成为其余份额持有人和其余合同的当事人 其持有其余份额 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 投资有风险,投资者投资本基金价额时应认直阅读本招募说明书,全面认识本

基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对投资基金 的意愿、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,由投资者自行负担

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。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面值,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 不构成对太甚全心结夷亚的保证 其全管理人依昭恪尽职守 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2018年9月7日,有关财务数据和净值表现截

止日为2018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 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

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%。

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

善車組成 甘山2名为独立善車 根据公司音程的规定 善車全層行《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、高管尽职情况。 (二)主要人员情况

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,获博士研究生学位。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, 获经济学学十学位,2012年获得华盛顿大学和复日大学EMBA 丁商管理学硕士, 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,英国保城集团(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

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,现任中国华申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上部副总经理,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 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会融学院。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 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 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。

马美芹女士,监事会主席,高级经济师,1984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年加入建设组行 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

方蓉敏女十, 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、英格兰和威尔斯 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 会计师事条的 由国化由集团财务有限公司计划财务部经理助理 副经理 由国化 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 行草经理 草经理

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 內控合规部审计部(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

3. 公司高管人员 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日起兼任建信资本管理公司董事长。

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。

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

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。

吴曙明先生,督察长(简历请参见公司高级管理人员)。

5、本基金的基金经理

薛珍女十,金融工程及指数投资部总经理助理,博士。2009年5月至2009年12 月在国家电网公司研究院农电配电研究所工作,任项目经理;2010年1月至2013年4 月在路通世纪公司亚洲数据收集部门工作,任高级软件工程师;2013年4月至2015 年8月在中国中投证券公司工作, 历任研究员, 投资经理: 2015年9月加入我公司会 融工程及指数投资部,历任基金经理助理、基金经理,2018年5月起兼任部门总经理 助理。2016年7月4日起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;2017年5月27日至2018年4月25日任建信鑫盛回报灵活配置混合 刑证券投资其全的其全经理,2017年9日13日起任建信量// 事件驱动股票刑证券投 资基金的基金经理;2017年9月28日起任深证基本面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;2017年12月20日起任建信鑫稳回报灵活配 置混合型证券投资基金的基金经理;2017年12月22日起任建信上证50交易型开放 式指数证券投资基金的基金经理,2018年3月5日起任建信智亨添鑫定期开放混合 型证券投资基金的基金经理。

梁洪昀先生:2011年9月8日至2016年7月20日 路龙凯先生:2016年4月11日至2017年9月28日

薛玲女士:2017年9月28日至今。 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

一、基金托管人 一、基金托管人概况

名称:中国民生银行股份有限公司(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 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:其他股份有限公司(上市 注册资本:28,365,585,227元人民币

存续期间:持续经营 电话:010-58560666

中国民生银行是我国首家主要由非公有制企业人股的全国性股份制商业银 行,同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。 多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度,使中国民生银行

有别于国有银行和其他商业银行,而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银 行成立二十年来,业务不断拓展,规模不断扩大,效益逐年递增,并保持了快速健康 的发展势头。 2000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 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8日 中国民生组行通过银行间债券市场成功发行了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。 2009年11月26 日,中国民生银行在香港交易所挂牌上市。 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,提高效益,健康发展"的经营发展方针,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 "三卡"工程、独立评审制度、八大基础管理系统、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 2013年度,民生银行荣获中国投资协会股权和创业投资专业委员会年度中国

优秀股权和创业投资中介机构"最佳资金托管银行"及由21世纪传媒颁发的2013 年PE/VC最佳金融服务托管银行奖。

2013年荣获中国内部审计协会民营企业内部审计优秀企业。 在第八届 "21世纪亚洲金融年会"上,民生银行荣获 "2013·亚洲最佳投资金融服务 银行"大奖。

在"2013第五届卓越竞争力金融机构评选"中,民生银行荣获"2013卓越竞争 品牌建设银行"奖。 在中国社科院发布的《中国企业社会责任蓝皮书(2013)》中、民生银行荣获

中国企业上市公司社会责任指数第一名"、"中国民营企业社会责任指数第一 在2013年第十届中国最佳企业公民评选中,民生银行荣获"2013年度中国最

佳企业公民大奖" 2013年还获得年度品牌金博奖"品牌贡献奖" 2014年获评中国银行业协会 "最佳民生金融奖"、"年度公益慈善优秀项目

2014年荣获《亚洲企业管治》"第四届最佳投资者关系公司"大奖和"2014亚 洲企业管治典范奖"

2014年被英国《金融时报》、《博鳌观察》联合授予"亚洲贸易金融创新服务 2014年还荣获《亚洲银行家》"中国最佳中小企业贸易金融银行奖",获得《21

已经济报道》颁发的"最佳资产管理私人银行"奖,获评《经济观察》报"年度卓 2015年度,民生银行在《金融理财》举办的2015年度金融理财金貔貅奖评选中

荣获"金牌创新力托管银行奖" 2015年度,民生银行荣获《EUROMONEY》2015年度"中国最佳实物黄金投

2015年度,民生银行连续第四次获评《企业社会责任蓝皮书(2015)》"中国

银行业社会责任发展指数第一名" 2015年度,民生银行在《经济观察报》主办的2014-2015年度中国卓越金融奖

评洗中茔获"在度卓越创新战略创新银行"和"在度卓越直销银行"两项大奖。 2016年度, 民生银行荣获2016胡润中国新全融50强和2016中国最具创新模式

张庆先生,中国民生银行资产托管部总经理,博士研究生,具有基金托管人高 级管理人员任职资格,从事过金融租赁、证券投资、银行管理等工作,具有25年金融

从业经历,不仅有丰富的一线实战经验,还有扎实的总部管理经历。历任中国民生 银行西安分行副行长,中国民生银行沈阳分行筹备组组长、行长、党委书记。 3、基金托管业务经营情况 中国民生银行股份有限公司于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》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好 地发挥后发优势,大力发展托管业务,中国民生银行股份有限公司资产托管部从成 立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则,高 起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工68人,平均年龄36 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文凭。基金业务 人员100%都具有甚全从业资格 中国民生银行坚持以客户需求为导向,秉承"诚信、严谨、高效、务实"的经营

理念、依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台、为 境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至2018年6月30日,中国 民生银行已托管181只证券投资基金。中国民生银行于2007年推出"托付民生•安 享财富"托管业务品牌,塑造产品创新、服务专业、效益优异、流程先进、践行社会责 任的托管行形象,赢得了业界的高度认可和客户的广泛好评,深化了与客户的战略 合作。自2010年至今,中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的"最且潜力托管银 行"、"最佳创新托管银行"、"金牌创新力托管银行" 奖和 "年度金牌托管银行" 奖,荣获《21世纪经济报道》颁发的"最佳金融服务托管银行"奖。

二、基金托管人的内部控制制度 1. 内部风险控制目标

强化内部管理,保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行,保证自觉 合规依法经营,形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系,保障业 务正常运行,维护基金份额持有人及基金托管人的合法权益。 2. 内部风险控制组织结构

中国民生银行股份有限公司基金托管业务内部风险控制组织结构由中国民生 银行股份有限公司审计部、资产托管部内设风险监督中心及资产托管部各业务中 心共同组成。总行审计部对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部 内设独立、专职的风险监督中心、负责拟定托管业务风险控制工作总体思路与计 划,组织、指导、协调、监督各业务中心风险控制工作的实施。各业务中心在各自职 责范围内实施具体的风险控制措施。 3.内部风险控制原则

(1)全面性原则:风险控制必须覆盖资产托管部的所有中心和岗位,渗透各项业 务过程和业务环节;风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位,每位员工对 白己岗位职责范围内的风险负责。 (2)独立性原则:资产托管部设立独立的风险监督中心,该中心保持高度的独立

性和权威性,负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。 (3)相互制约原则:各中心在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机

制,建立不同岗位之间的制衡体系。 (4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客

(5)防火墙原则:托管部自身财务与基金财务严格分开;托管业务日常操作部门

与行政、研发和营销等部门严格分离。 4、内部风险控制制度和措施

(1)制度建设:建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格 的人员行为规范等一系列规章制度。

(2)建立健全的组织管理结构:前后台分离,不同部门,岗位相互牵制。 (3)风险识别与评估:风险监督中心指导业务中心进行风险识别、评估,制定并

(4)相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监 (5)人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理

(6)应急预案:制定完备的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾备中 心,保证业务不中断。 5、资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控 等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1)坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中 间业务,中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运 作,一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环 境的变化和托管业务的快速发展,新问题新情况不断出现,中国民生银行股份有限

公司资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置,视风险防范和 (2)实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参

与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面,有效。中国民生银行股份有限公司资 产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务中心和业务岗位,每 立员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3)建立分工明确,相互牵制的风险控制组织结构, 托管部通过建立纵向双人 制,横向多中心制的内部组织结构,形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。 (4)以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部

十分重视内部控制制度的建设,已经建立了一整套内部风险控制制度,包括业务管 理办法,内部控制制度,员工行为规范,岗位职责及减括所有后台运作环节的操作 手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。 (5)制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要,制度落

实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部

设置专职风险监督中心,依照有关法律规章,定期对业务的运行进行稽核检查。总 行审计部也不定期对资产托管部进行稽核检查。 (6)将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中,技术控制风险比制度 控制风险更加可靠,可将人为不确定因素隆至最低。托管业务系统需求不仅从业务

方面而且从风险控制方面都要经过多方论证,托管业务技术系统具有较强的自动 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定,对基金的投 资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管 理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赐

回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收 到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金打 管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管 人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通 知基金管理人限期纠正。

1、申购赎回代理券商(简称"一级交易商"

(1) 国泰君安证券股份有限公司 地址:上海市浦东新区商城路618号

法定代表人:杨德红 客服电话:400-8888-666

(2) 光大证券股份有限公司

住所:上海市静安区新闸路1508号

客服电话:10108998 网址:www.ebscn.com

客户服务热线:95565、4008888111

地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

客服电话:0755-82288968

地址:上海市淮海中路98号

网址:www.htsec.com

客户服务电话:4008-888-999

地址:北京市朝阳门内大街188号 法定代表人: 王常青

网址:www.csc108.com (8) 中泰证券股份有限公司

地址:山东省济南市经七路86号 法定代表人: 李玮

网址:www.glzg.com.cn

客户咨询电话:025-84579897

(10) 东北证券股份有限公司

客户服务电话:0431-96688、0431-85096733

网址:www.bhzq.com

法定代表人:张志刚

地址:广东省深圳市福田区金田路4306号荣超大厦18楼

网址:stock.pingan.com (14) 中信建投证券有限责任公司

网址:www.csc108.com (15) 安信证券股份有限公司

法定代表人: 王连志

住所:北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座

(17) 中信证券股份有限公司 地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人:张佑君 客服电话:95558

客服电话:4008-000-562

(19) 东海证券股份有限公司 地址:常州市延陵西路23号投资广场18层

客服热线:95531 网址:www.longone.com.cn (20) 兴业证券股份有限公司

客户服务电话: 4008888123

(21) 国信证券股份有限公司 地址:深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦

网址:www.guosen.com.cn

包括具有经纪业务资格及深圳证券交易所会员资格的所有证券公司。

名称:中国证券登记结算有限责任公司

电话:010-58598839

住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层

二,相关服务机构 (一)基金份额发售机构

法定代表人:周健男

法定代表人:霍达

(4) 长城证券有限责任公司

(5) 海通证券股份有限公司

客户服务电话:400-8888-001,(021)962503

法定代表人: 尤习贵

(7) 中信建投证券有限责任公司

客户服务电话:400-8888-108

客户服务电话:95538

(9) 华泰证券股份有限公司

地址:长春市自由大路1138号

(11) 渤海证券股份有限公司

法定代表人, 王春峰 客户服务电话:4006515988

(12) 信达证券股份有限公司 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

(13) 亚安证券股份有限公司

客户服务电话:4008866338

地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心20层

客户服务电话:0755 - 82825555 网址:www.axzq.com.cn (16) 中国银河证券股份有限公司

客户服务电话:4008-888-8888 网址:www.chinastock.com.cn

网址:www.citics.com

(18) 申万宏源西部证券有限公司 注册地址: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

法定代表人:赵俊

注册地址:福州市湖东路268 法定代表人:杨华辉

客户服务电话:95536

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 传真:010-58598907

负责人:王丽 电话:010-66575888

(四)会计师事务所及经办注册会计师

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 资明细

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

深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金

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

六、基金的投资目标 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,实现与标的指数表现

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、一级市场新发股票(包 括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、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)。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。

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

八、基金的投资策略 本基金主要采取完全复制策略,跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份

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 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股票加以 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

基金管理人对标的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:力争使得本基金日均跟踪偏 离度的绝对值不超过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避免

股流动性严重不足;(3)标的指数的成份股票长期停牌;(4)其他合理原因导致本

跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 (一)股票资产日常投资组合管理 基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步:确定目标组合、确定建仓策略

(1)确定目标组合:根据复制标的指数成份股及其权重的方法确定目标组合。 (2)确定建仓策略:根据对成份股流动性、公司行为等因素的分析,确定合理 的建仓策略。 (3)组合调整:根据复制法确定目标组合之后,在合理时间内采用适当的手段

(2)将基金持有的证券组合构成与标的指数进行比较,制定目标组合构成及

(1)根据标的指数构成及权重,结合基金当前持有的证券组合及其比例,制作 下一交易日基金的申购赎回清单并公告。

(3)实施交易策略,以实现基金最优组合结构。 3、标的指数成份股票定期调整 根据标的指数的编制规则及调整公告,在指数成份股调整生效前,分析并确定

权重,确定合理的交易策略

组合调整策略,及时进行投资组合的优化调整,减少流动性冲击,尽量减少标的指 数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。 4、成份股公司信息的日常跟踪与分析 跟踪标的指数成份股公司信息(如:股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌

理人将密切关注样本股票的调整,并及时制定相应的投资组合调整策略。 6、申购赎回情况的跟踪与分析 跟踪本基金申购和赎回信息,结合基金的现金头寸管理,分析其对组合的影

在标的指数成份股票调整周期内,若出现成份股票临时调整的情形,本基金管

化,以利于本基金投资目标的实现。 8、跟踪偏离度的监控与管理 基金经理每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度。每月末、季度末定期分 析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因、现

对。采用替代投资策略的原则是使得本基金投资组合对标的指数的跟踪误差最小

偏差"、"个股偏差"指标作为调整指标,以达到控制跟踪偏差的目的。 在具体的修正过程中,本基金将采用定量化分析模型,每日计算总体累积偏差 指标,计算区间从组合修正日开始累积。如该指标超过允许的最大值,则基金管理

本基金投资权证必须是出于追求基金充分投资,减少交易成本,降低跟踪误差

本基金的业绩比较基准为:本基金标的指数。 十、基金的风险收益特征 本基金属于股票基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合

基金。本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特

九、基金的业绩比较标准

征,属于证券投资基金中较高风险,较高预期收益的品种。 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

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。

股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

1、合计项不含可退替代款的估值增值。 2、以上行业分类以2018年6月30日的中国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

以上行业分类以2018年6月30日的中国证监会行业分类标准为依据

1、报告期末按券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序的前五名债券明细

(2)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抗

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明细

(1)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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

8、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权证明细

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投资股指期货 (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

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

(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

11、投资组合报告附注

本基金报告期内未投资于国债期货。 (3)本期国债期货投资评价 木基全报告期内未投资于国债期货

(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 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)其他资产的构成

(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。

② 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

基金业绩截止日为2018年6月30日。

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 ① 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

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

注:2011年业绩比较基准收益率和标准差包括基金成立日当日 十三、基金的费用概览 (一)基金费用的种类

5、基金上市费及年费;

2. 基金托管人的托管费

顺延。

2、基金托管人的托管费; 3. 基金合同生效后的标的指数许可使用费: 4、基金合同生效后的信息披露费用:

6、基金收益分配中发生的费用 7、基金份额持有人大会费用;

10、基金财产拨划支付的银行费用:

(三)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 在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如 H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为0.5%

H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.1% H为每日应计提的基金托管费 E为前一日基金资产净值

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如

本基金作为指数基金,需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议 的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。 基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支,按前一日基金资产净

在本基金基金合同生效后的前四个年度,指数许可使用费年费率分别为万分 之四(第一年度),万分之六(第二年度),万分之八(第三年度),万分之十(第四 年度)。从本基金基金合同生效后的第五个年度起,如果基金资产净值超过或等于 人民币40亿元,指数许可使用费年费率为万分之十;如果基金资产净值不足人民币

其中:H 为每日应计提的指数许可使用费;E 为前一日的基金资产净值;I 为

的计算方法、费率等发生调整、本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用 费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。 4、上述(一)"基金费用的种类"中第4-11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。

由于中证指数有限公司保留变更或提高指数使用费的权利。如果指数使用费

财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金 募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中 支付,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。 五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基

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""主要人员情况"中监事的信息; 2、更新了"第四部分:基金托管人"的"主要人员情况"及"基金托管业务经营

基金管理人必须依照有关规定最迟干新的费率实施目前2日在指定媒体上刊登公

4、更新了"第十一部分:基金的投资"的投资组合报告的内容,并经基金托管 人复核;

传真:010-65232181

地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层 法定代表人:丁益 网址:www.cc168.com.cn

(6) 长江证券股份有限公司 地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦 公司网址:www.95579.cd

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

地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

客户服务电话:400-800-8899

地址:北京市朝阳门内大街188号 法定代表人:王常青 客户服务电话:400-8888-108

成国家大厦20楼2005室 网址:www.hvsec.com

网址:www.xyzq.com.cn

3、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。 (二)登记结算机构

(三)律师事务所及经办律师 名称:北京德恒律师事务所

2、投资组合日常管理

等),以及成份股公司其他重大信息,分析这些信息对指数的影响,并根据这些信息 确定基金的申购赎回清单以及基金的每日交易策略。

> 响,制定交易策略以应对基金的申购赎回。 7、替代投资 对个别成份股,若其存在投资受限、严重的流动性困难、财务风险较大、面临重 大不利的司法诉讼或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时, 本基金 可以不投资该成份股,而用备选股、甚至现金来代替,或者选择与其行业相近、定价 特征类似或者收益率相关性较高的其他股票来代替,即采用"替代投资策略"应

并优化跟踪偏离度管理方案。 本基金选择"总体累积偏差"、"行业偏差"及"个股偏差"作为评估指标,评估 投资组合与标的指数的跟踪误差、行业构成比例偏差、个股比例偏差和个股构成差 异。本基金通过设定上述指标的最大允许值,对投资行为予以约束,以控制基金相 对于比较基准的偏差

金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作以及成份股未来可能发生的变化等,

人将通过控制行业偏差、个股偏差等指标,调整组合品种,缩减跟踪偏差。 一) 权证投资策略 本基金可根据法律法规规定,并基于谨慎原则运用权证对基金投资组合进行 管理,以提高投资效率,管理基金投资组合风险水平,以更好地实现本基金的投资

的目的,不得用于投机交易目的,或用作杆杆工具放大基金的投资。

本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日,本报告所列财务数据未经审

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

金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会,

3、更新了"第五部分:相关服务机构"中的相关变动信息,更新了"申购赎回代 理券商":

文,可登陆基金管理人网站www.ccbfund.cn。 建信基金管理有限责任公司

1、基金管理人的管理费;

8、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费; 11、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照合理价格确

H为每日应计提的基金管理费 E为前一日基金资产净值 基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人于次月首日起3个工作日内向 基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16 基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日,支付日期

> 基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人于次月首日起3个工作日内向 基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作 日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期

3、基金合同生效后的指数许可使用费

H=E×I÷当年天粉

指数许可使用费年费率。 40亿元,则指数许可使用费年费率为万分之十二 每季度指数许可使用费下限为人民币壹拾伍万元(15 万元)。基金合同生效 后的指数许可使用费按季支付,于下一季度首日起10个工作日内从基金财产中-

值及指数许可使用费年费率每日计提,逐日累计。计算方法如下:

(四)不列入基金费用的项目 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

5、更新了"第十二部分:基金的业绩",并经基金托管人复核; 上述内容仅为本招募说明书(更新)摘要,投资人欲查询本更新招募说明书正