

# 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

**基金管理人:建信基金管理有限责任公司**  
**基金托管人:中国民生银行股份有限公司**  
**二〇一四年十月**

## 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]1062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。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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者了解其基金投资人的权利和义务,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,并对投资本基金的意见、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动导致的投资风险,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、基金管理人及基金托管人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,是股票市场中处于中等风险水平的基金品种。本基金初始募集净值1元。在证券市场波动影响下,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。基金管理人依照其它基金公司的业绩并不构成对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2014年9月7日,有关财务数据和净值表现截止日为2014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:杨文升  
联系人:郭朔  
电话:010-66228888  
注册资本:人民币2亿元  
注册地址:北京市东城区经国经中国证监会证监基金字[2006]158号文批准设立。公司的股权结构如下:

股东名称	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,董事会履行《公司法》规定的有关重大事项的决策权,先后推出了“大集中”对总经理等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、市场投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、客户管理部、海外投部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部等十五个职能部门,以及深圳、成都、北京、上海四个分公司。在上海设立了子公司—建信资产管理有限责任公司。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

### 1.董事会成员

杨文升先生,董事长。现任中国建设银行副行长。1993年毕业于清华大学先进技术专业,获硕士学历。历任中国建设银行吉林省分行副行长、处长、分行行长助理、副行长,中国建设银行大连市分行行长,中国建设银行辽宁省分行行长。2014年6月起任建信基金管理有限责任公司董事长。

孙志晨先生,董事。1985年获东北财经大学经济学学士学位,2006年获长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行营业部证券处副处长,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年获北京师范大学文系硕士学历。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副经理、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。

阮阳伯先生,董事,现任美国信安金融集团总裁—亚洲。1977年获加拿大滑铁卢大学大城市设计与环境规划系学士学位。历任加拿大安泰保险公司高级管理人员,团体保险经理,美国友邦保险公司亚洲区团体保险经理,信安国际有限公司亚洲区行政总裁。

袁时奋先生,董事。现任中国华电集团资本控股公司大中华区首席运营官。1981年毕业于美国阿而比学院。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副司理,香港置地集团市场部司理,香港赛马会副财务总监,信安国际有限公司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专业,获硕士学位。历任中国电力财务有限公司债券基金部项目经理,华电集团财务有限公司投资管理部副经理(主持工作)、中国华电集团公司改制重组办公室副处长、体制改革处处长、政策与法律事务政策研究处处长。

顾建国先生,独立董事。现任中国信达资产管理股份有限公司副总裁。1984年获浙江大学工学管理工程专业学士学位,1991年获浙江大学经济学宏观专业硕士学位,1994年获财政部财研所研究生部财务管理专业博士学位。历任中国建设银行信托投资公司总助助理兼财务部经理,中国建设银行计部副总经理、香港建新国际集团有限公司总经理。

王建国先生,独立董事。曾任中国人寿保险有限公司首席行政官,中银保诚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员等。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、副秘书长、中国国际金融法专业委员会主任。

## 2.监事会成员

张海女士,监事会主席。东北财经大学投资经济管理专业本科毕业,高级经济师。历任中国建设银行辽宁省分行储蓄处处长、营业部经理、抚顺市分行行长、辽宁省分行副行长;中国建设银行新疆地区分行行长;中国建设银行高级研修院副院长。2014年3月起任公司监事会主席。

方晋敏女士,监事。现任信安国际(亚洲)有限公司亚洲区首席律师。曾任美国保诚集团新市场发展总监和美国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。女士1990年获新西兰奥克兰大学法学学士学位,拥有新加坡、英格兰和威尔士以及香港地区律师从业资格。

熊湘晖女士,监事。现任中国华电集团资本控股有限公司政治工作部(纪检监审)主任。1993年获北京师范大学学士学位,2007年获清华大学考硕学位并应用金融硕士。历任中国电力财务与经济发展研究中心,原电力工业部经济调节司,国家电力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,中国华电集团公司结算中心,中国华电集团公司金融管理部副处长、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。

崔峰先生,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年获安徽省委党校政法专业学士学位,1990年获上海复旦大学国际经济法专业法学学士学位。历任中国社评评论员记者,裕晋钢铁股份有限公司内部审计主任,中国信达信托投资有限公司(原名为中国建设银行信托投资公司)证券发行副经理,宏源证券股份有限公司投资银行部副总经理,上海永赢投资管理有限公司执行董事、副经理。

吴浩女士,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年毕业于中国人民银行研究所研究生班。历任中国建设银行国际业务部外汇资金主任科员,中国建设银行资产部交易风险管理处副处长,中国建设银行资产部交易风险管理处、综合处高级副经理(主持工作)。

吴灵娟女士,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经济信息管理系,获学士学位,2001年毕业于北京师范大学经济学,获得管理学学士学位。历任中国建设银行总行人力资源部主任科员,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、北京政法会计师事务所、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),硕士。1998年10月加入长城基金管理公司,历任研究员、基金经理助理,2002年11月2日至2004年6月22日担任长城价值股票型证券投资基金的基金经理。2004年6月加入鹏华长城基金管理公司,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3月16日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日任鹏华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日至2013年12月20日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,宝盈基金管理有限公司首席副(公司副总经理级),建信基金管理有限责任公司监事长。

## 5.基金基金经理

梁洪涛先生,博士,特许金融分析师(CFA),投资管理部总监。2003年1月获清华大学工学博士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计、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、研究部总监助理、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)、总监。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。  
梁洪涛先生,投资管理部总监。  
马志勇先生,投资管理部副总监。  
钟敏女士,投资管理部副总监。  
姚剑秋先生,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。

## 八、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  
法定代表人:洪崎  
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  
电话:010-58560666  
联系人:赵天杰  
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,同时又是一家严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范化的股份制金融企业。多种经济成份的入股,在改革探索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。

2008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交易所正式挂牌交易。2004年11月8日,中国民生银行通过银行间债券市场成功发行7582亿元人民币次级债券,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、“三工”制度、独立评审制度、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,民生银行获得2007第一财经金融品牌价值榜十佳银行称号,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”。

2007年12月,民生银行荣获《福布斯》颁发的第三届“亚太地区大规模上市企业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中国商业银行竞争力评价报告》中民生银行核心竞争力排名第6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年中国本土银行间竞争力评价活动”中获2009年中国本土银行网站“最佳服务质量奖”。

2009年9月,在大连召开的第二届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“第十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年度最佳风险管理银行”。

2009年12月9日,在《理财周报》主办的“2009年第二届最受尊敬银行评选暨2009年第三届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,中国民生银行一流的电子银行产品和服务获得了专业评测公司、网友和专家的一致好评,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,在经济观察报主办的“2009年度中国最佳银行评选”中,民生银行获得评委委员会“中国银行业十年改革创新奖”。这一奖项评选委员会为表彰在公司治理、激励机制、风险管理、产品创新、管理架构、商业模式六个方面创新表现卓越的银行而特别设立的。

2011年12月,由中华全国银行间同业公会(CFCA)联合近40家成员行共同举办的2011中国电子银行年会上,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,是第三方权威安全认证机构对民生银行网上银行安全性的再度肯定。

2012年6月20日,在国际经济高峰论坛上,民生银行贸易金融业务以其2011-2012年度的出色业绩和产品创新最终荣获“2012年中国卓越贸易金融银行”奖项。这也是民生银行继2010年荣获英国《金融时报》“中国银行成就奖——最佳贸易金融银行奖”之后第三次获此殊荣。

2012年11月29日,民生银行在《The Asset》杂志举办的2012年度AAA国家奖项评选中获得“中国最佳银行-新秀奖”。

2013年度,民生银行荣获中国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评优优秀企业。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卓越竞争力品牌建设银行”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名”、“中国银行业社会责任指数第一名”。

在2013年第十一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”。

## 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)。曾就职于中国建设银行总行,意大利联合信贷银行北京代表处,中国民生银行金融市场部和资产部。历任中国建设银行总行业务经理,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部处长、资产托管部总经理助理、副经理、副经理(主持工作)等职务。具有近三十年的金融从业经历,丰富的外资银行工作经验,具有广阔的视野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76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文凭。基金业务人员100%都具有基金从业资格。

截止至2014年6月30日,本行共托管基金29只,分别为天治品质优选混合型证券投资基金、融通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、东方金账簿货币市场基金、长信增利动态策略证券投资基金、华商领先企业混合型证券投资基金、银华深证100指数分级证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、工银瑞信添颐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、建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国投瑞银瑞福保本混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、工银瑞信沪深300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、建信月盈安心理财富证券投资基金、中银美丽中国股票型证券投资基金、建信消费精选混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫绩优稳健增利18个月定期开放债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、德邦德利货币市场基金、光大保德信分级债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、中银中高等级债券型证券投资基金、汇添富全债宝货币市场基金和金国通信用金通货币市场证券投资基金。托管基金资产净值5563.97亿元。

## 三、相关服务机构

### (一)基金份额发售机构

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  
住所:上海市浦东新区商城路618号  
办公地址:上海市延平路135号  
法定代表人:王东明  
客服电话:400-8888-666  
网址:www.gtja.com  
(2)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  
(3)中信万通证券有限责任公司  
住所:青岛市市南区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)  
法定代表人:杨宝林  
客服电话:0532-96577  
网址:www.zxwt.com.cn  
(4)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:薛峰  
客服电话:1010898  
网址:www.ebscn.com  
(5)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:王开国  
客户服务电话:400-8888-001,(021)962503  
网址:www.htsec.com  
(6)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:陈有安  
客户服务电话:4008-888-8888  
网址:www.chinastock.com.cn  
(7)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:胡润涛  
客户服务电话:4008-888-999  
公司网址:www.95578.com  
(8)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:吴万善  
客户咨询电话:025-84679897  
网址:www.htsec.com  
(9)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  
客户服务电话:95538  
网址:www.qizq.com.cn  
(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101室  
法定代表人:杜庆春  
客户服务电话:4006515888  
网址:www.bhzq.com  
(11)平安证券有限责任公司  
注册地址:深圳市金田路4018号国际交易广场办公楼  
法定代表人:杨宇翔  
客服电话:400866338  
网址:stock.pingan.com  
(12)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  
(13)中国中投证券有限责任公司  
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋18-21层  
法定代表人:龙增来  
开放式基金咨询电话:4006090808  
网址:www.citics.com  
(14)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号新世界商务中心20层  
法定代表人:吕锐  
客户服务电话:0755-82825555  
网址:www.axzq.com.cn  
(15)宏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艺路233号  
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号  
法定代表人:冯戎  
客服电话:4008-000-562  
网址:www.hysc.com  
(16)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:况雨  
客服电话:0871-3577888  
网址:www.hongtastock.com  
(17)申银万国证券股份有限公司  
注册地址:上海市常熟路171号  
法定代表人:丁国荣  
客服电话:95523或4008895523  
网址:www.sywq.com  
(18)东方证券股份有限公司  
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22-29层  
法定代表人:潘鑫军  
客服电话:0563  
网址:www.dfzq.com.cn  
(19)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:宫少林  
客户服务电话:95565,4008888111  
网址:www.newone.com.cn  
(20)东北证券股份有限公司  
注册地址:长春市自由大路1138号  
法定代表人:郑永中  
客户服务电话:0431-96688,0431-85069733  
网址:www.nesc.cn  
(21)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  
客服热线:400-800-8899  
网址:www.cindasc.com  
(22)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  
客户服务电话:95562  
网址:www.xyzq.com.cn  
(23)长城证券股份有限公司  
住所:深圳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:黄辉华  
客服电话:0755-82288968  
网址:www.cc168.com.cn  
(2)二级市场交易代理券商  
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。

## 4.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)登记注册机构

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  
电话:010-58598397  
传真:010-58598907  
(三)律师事务所及经办律师  
名称:北京德恒律师事务所  
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层  
负责人:王丽  
联系人:徐建军  
电话:010-66575888  
传真:010-65232181  
经办律师:徐建军、刘洪志  
(四)会计师事务所及经办注册会计师  
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
法定代表人:杨建信  
联系人:陈熹  
联系电话:021-23238888  
传真:021-23238900  
经办注册会计师:薛岚、陈燕  
4.基金名称  
深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金  
五、基金的类型  
股票型基金  
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,实现与标的指数的长期一致的投资收益。

## 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。

## 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作为替代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基金管理人对该指数的跟踪构成严重制约等。

在正常情况下一,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跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

## 1.股票资产日常投资组合管理

### (1)投资组合的建立

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、确定建仓策略和调整组合。

#### 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调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

#### (2)投资组合日常管理

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。

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权重,确定合理的交易策略。

#### (3)实施交易策略,以实现基金最优投资组合。

(4)标的指数的成份股票定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告,在指数成份股票生效前,分析并确定组合调整策略,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变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

#### (4)成份股公司信息日常跟踪与分析

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。

#### (5)标的指数的成份股票临时调整

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,本基金管理人将密切关注本分析的调整,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、面临重大不利司法诉讼或有充分合理的理由认为其被市场操纵等情形时,本基金可选择不投资该成份股,而用备选股、甚至现金来代替,或者选择与其行业相近、投资特征类似或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的表现偏离度。每月末、季度末对组合分析基金的实际情况与标的指数的表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因,现因基金持仓结构、标的指数成份调整前后的操作以及成份股未来可能发生的变化等,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误差。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,以控制基金相对于目标指数的跟踪误差。

本基金将“总体累积偏差”作为决定是否启动修正程序的控制指标,将“行业偏差”、“个股偏差”指标作为调整指标,以达到跟踪跟踪偏差的目的。

在具体的修正过程中,本基金将采用量化分析模型,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。

## 2.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,以提高投资组合效率,管理基金投资组合风险水平,以更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资权证必须出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的,不得用于投机交易目的,或用于杠杆交易放大基金的投资。

## 九、基金的业绩比较标准

本基金标的指数为:深证基本面60指数。

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征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

</