

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	二〇一六年四月 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同意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,投资股指期货基金份额时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、基金管理人因在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特有风险等等。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。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。基金管理人提醒投资者其它基金产品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2016年3月7日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日(财务数据已经审计)。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:许会斌 联系人:郭朔卿 电话:010-66228898 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:	<table border="1"> <tr> <th>股东名称</th><th>股份比例</th></tr> <tr> <td>中国建设银行股份有限公司</td><td>60%</td></tr> <tr> <td>招商证券股份有限公司</td><td>25%</td></tr> <tr> <td>中国工商银行股份有限公司</td><td>15%</td></tr> </table> <p>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。公司章程中明确规定了股东通过股东大会依法行使权利,不得以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理权和基金财产的投资运作。</p> <p>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3名为独立董事。根据公司章程的规定,董事会履行《公司法》及《公司章程》规定的有关重大事项的决策权,对公司基本制度的制定和对总裁等经营管理层人员的监督和奖惩权。</p> <p>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。</p> <p>(二)主要人员情况 1.董事会成员 许会斌先生,董事长。2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。自2011年3月至2015年3月,出任中国建设银行批发业务总监;自2006年6月至2011年3月任中国建设银行河南省分行行长,自1994年6月至2006年6月任中国建设银行河南省分行副行长,零售业务部筹建副主任,零售业务部副经理,营业部主要负责人、总经理,个人银行业务部总经理,个人银行业务委员会副主任,个人金融部总经理。许先生是高级经济师,并赴美国哥伦比亚大学获得,曾荣获中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章等奖项。1983年于财经学院基础财务与信用专业大学本科学历。2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。</p> <p>孙志坚先生,现任建信基金管理有限责任公司总裁,建信资本管理公司董事长1986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证券部证券处副处长,中国建设银行总行零售部、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。 曹伟先生,董事,现任中国建设银行个人存款及投资部副总经理,1990年获北京师范大学文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄部副经理,北京分行安华支行副行长,北京分行西便门支行副行长,北京分行朝外支行行长,北京分行个人银行部总经理,中国建设银行个人存款及投资部总经理助理。</p> <p>张维义先生,董事,现任信安国际北亚副总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院,获经济学学士学位,2012年获得华盛顿大学和莫大商学院MBA工商管理硕士学位。历任新加坡公共服务业委员会副处长,新加坡国际有限公司亚洲业务发展总监,信诚基金公司首席运营和合规总监,美国保诚集团(马来西亚)资产管理有限公司首席执行官,友利金融全球副总裁,友利资产管理公司(台湾)首席执行官和执行董事。 袁时贵先生,董事,现任信安国际美国芝加哥分公司首席运营官。1981年毕业于美国阿拉巴马州。历任香港汇丰银行投资银行副经理,加拿大丰业银行资产管理市场部高级经理,香港铁路公司财务部助理司库,香港置地集团财务部司库,香港赛马会集团司库,信安国际有限公司大中华区首席运营官。 殷红军先生,董事,现任中国华电融资租赁有限公司董事长兼总经理。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债券基金部项目经理,华电集团财务有限公司投资咨询部副经理(主持工作)、中国华电集团公司计划制重组办公室处长、体制改革处处长、政策与法律事务部高级研究处处长、中国华电集团公司控股有限公司副总经理。 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金融学院,1988年毕业于中国人民大学财政金融系。历任中国人民银行中国人民银行研究处主任,任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司经理、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常务副总经理,新华资产管理股份有限公司总经理。</p> <p>王建国先生,独立董事,曾任大新人寿保险(中国)首席执行官,中保康退休信托管理(中国)有限公司董事,美国保诚保险有限公司首席执行官,美国国际保险集团亚太区资深副总裁。方女士1990年获加拿大渥太华大学工商管理硕士学位,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。曾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副主任。</p> <p>2.监事会成员 王雪梅女士,监事会主席。毕业于清华大学经济管理学院高级工商管理专业工商管理专业,高级经济师。历任中国建设银行山东省分行计划处职员;中国建设银行新疆地区分行计划处、信贷处、风险处和人力资源部等处处长、处长、行长助理、副行长;中国建设银行总行机构业务部副总经理。2015年10月起任公司监事会主席。</p> <p>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亚太区首席事务。方女士1990年获加拿大渥太华大学学士学位,拥有新加坡、英格兰和威尔士以及香港地区律师从业资格。 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公司机构与风险管理部经理。1992年获东北财经大学工业企业管理学士学位,2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北联有限公司,中企合众会计师事务所,中理华恒信会计师事务所,中国华电集团财务有限公司计划财务部副经理、副经理,中国华电集团资本控股(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副经理。 吴灵伟女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司人力资源部管理部总经理兼管理培训部总经理。1996年毕业于中国人民大学人力资源管理专业;2001年毕业于北京邮电大学经济系。曾任中国建设银行总行人力资源部主任科员,高级经理助理。2005年9月加入建信基金管理公司,历任人力资源部管理部副总监助理、副总监、总监。 安晓生先生,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司信息技术部总经理。1995年毕业于北京工业大学计算机应用专业,获得学士学位。曾任中国建设银行北京分行科技部经理,中国建设银行信息技术管理部主任科员、项目经理。2005年9月加入建信基金管理公司,历任基金运营部总监助理、副总监、信息技术部副总监、总监。 刘颖女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部副经理。英国特许会计会计师公会(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,任建信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公司监察稽核部。</p> <p>3.公司高管人员 孙志坚先生,总裁(简历请参见董事会成员)。 张维义先生,副总裁。1997年毕业于大连理工大学,获学士学位;2003年毕业于大连理工大学,获硕士学位。曾任中国建设银行辽宁省分行计划处职员;中国建设银行新疆地区分行计划处、信贷处、风险处和人力资源部等处处长、处长、行长助理、副行长;中国建设银行总行机构业务部副总经理。2015年10月起任公司监事会主席。 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公司机构与风险管理部经理。1992年获东北财经大学工业企业管理学士学位,2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北联有限公司,中企合众会计师事务所,中理华恒信会计师事务所,中国华电集团财务有限公司计划财务部副经理、副经理,中国华电集团资本控股(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副经理。 曲寅先生,副总监。1996年毕业于中国人民大学,获学士学位;1999年毕业于中国人民大学,获硕士学位。曾任中国建设银行辽宁省分行信贷处科员,主任科员;中国建设银行总行人力银行业务部主任科员,高级副经理;2005年9月加入建信基金管理公司,历任市场营销部副总监(主持工作)、总监、公司首席市场事务部。2016年1月9日起任建信基金管理副总监(主持工作)。 曲寅先生,副总监。1996年毕业于中国人民大学,获学士学位;1999年毕业于中国人民大学,获硕士学位。曾任中国建设银行总行人力资源部主任科员,主任科员;中国建设银行总行人力银行业务部主任科员,高级副经理;2005年9月加入建信基金管理公司,历任基金运营部总监助理、副总监、信息技术部副总监、总监。 刘颖女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部副经理。英国特许会计会计师公会(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,任建信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公司监察稽核部。</p> <p>4.基金经理 梁洪钧先生,总裁(简历请参见董事会成员)。 张维义先生,副总裁。1997年毕业于大连理工大学,获学士学位;2003年毕业于大连理工大学,获硕士学位。曾任中国建设银行辽宁省分行计划处职员;中国建设银行新疆地区分行计划处、信贷处、风险处和人力资源部等处处长、处长、行长助理、副行长;中国建设银行总行机构业务部副总经理。2015年10月起任公司监事会主席。 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公司机构与风险管理部经理。1992年获东北财经大学工业企业管理学士学位,2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北联有限公司,中企合众会计师事务所,中理华恒信会计师事务所,中国华电集团财务有限公司计划财务部副经理、副经理,中国华电集团资本控股(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副经理。 曲寅先生,副总监。1996年毕业于中国人民大学,获学士学位;1999年毕业于中国人民大学,获硕士学位。曾任中国建设银行辽宁省分行信贷处科员,主任科员;中国建设银行总行人力银行业务部主任科员,高级副经理;2005年9月加入建信基金管理公司,历任市场营销部副总监(主持工作)、总监、公司首席市场事务部。2016年1月9日起任建信基金管理副总监(主持工作)。 曲寅先生,副总监。1996年毕业于中国人民大学,获学士学位;1999年毕业于中国人民大学,获硕士学位。曾任中国建设银行总行人力资源部主任科员,主任科员;中国建设银行总行人力银行业务部主任科员,高级副经理;2005年9月加入建信基金管理公司,历任基金运营部总监助理、副总监、信息技术部副总监、总监。 刘颖女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部副经理。英国特许会计会计师公会(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,任建信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公司监察稽核部。</p> <p>5.基金基金经理 梁洪钧先生,博士,特许金融分析师(CFA),金融工程及指数投资部总经理。2003年1月获清华大学经济学博士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任基金工程研究员、规划发展部产品设计经理、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,历任研究员研究员、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、金融工程及指数投资部总经理。2009年11月6日起任建信沪深300指数证券投资基金基金经理(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的基金经理;2011年9月8日起任建信基本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日起任建信中证100指数增强证券投资基金基金经理;2015年3月25日起任建信双利分级股票基金基金经理;2015年7月31日起任建信中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理;2015年6月9日起任建信中证申万有色金属金属指数分级证券投资基金基金经理;2015年6月9日起任建信基金资产管理公司副总监。</p> <p>6.投资决策委员会成员 孙志坚先生,总裁。 梁洪钧先生,金融工程及指数投资部总经理。 钟敏秋先生,固定收益投资部首席固定收益投资官。 李青,固定收益投资部总经理 姚婉女士,权益投资部副总经理兼研究部首席策略分析师。 顾中汉先生,权益投资部总经理。 许杰先生,权益投资部基金经理。 7.上述人员之间均不存在近亲属关系。</p> <p>二、基金托管人 1.基本情况 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:罗菲菲 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》建立的规范股份制金融企业。多种经济</p>	股东名称	股份比例	中国建设银行股份有限公司	60%	招商证券股份有限公司	25%	中国工商银行股份有限公司	15%
股东名称	股份比例								
中国建设银行股份有限公司	60%								
招商证券股份有限公司	25%								
中国工商银行股份有限公司	15%								

成份在中国金融业的涉足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,而为中国金融界、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8日,中国民生银行通过银行间债券市场成功发行158亿元人民币次级债券,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。2006年10月26日,民生银行成功完成股权分置改革,成为中国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;讲求质量,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制等制度创新,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。 2009年6月,民生银行在“2009年中国本土银行网站竞争力评测活动”中获2009年中国本土银行网站“最佳服务品质奖”。 2009年6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年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,民生银行荣获“最佳安全网站”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年亚洲最佳风险管理银行”。 2009年12月9日,在由《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23日,在“超越2009年度金融理财排行榜”评选活动中,中国民生银行一流的银行产品和服务获得了专业网站、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——“中国银行十年改革创新奖”。这一奖项是评委委员会在公司治理、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。 2011年12月,在由中国金融认证中心(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《金融时报》“中国银行业成就奖——最佳贸易金融银行”之后第二次获此殊荣。 2012年11月29日,在第四届“The Asset”杂志举办的2012年度AAA国家奖项评选中荣获“中国最佳银行—新秀奖”。 2013年度,民生银行荣获中国投资协会股权投资专业委员会年度中国优秀股权和创业投资中介机构“最佳基金托管银行”及H21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亚洲最佳投资金融综合服务”大奖。在“2013第五届中国竞争力金融品牌评选”中,民生银行荣获“2013卓越竞争力品牌银行”大奖。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“中国本土上市公司社会责任感指数第一名”、“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年第十六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融“品牌金融奖”。 2014年获中国银行业协会“最佳民生金融奖”、“年度公益慈善优秀项目”。 2014年荣获《亚洲企业治理》“第四届最佳投资者关系公司”大奖和“2014亚洲企业治理典范奖”。 2014年被美国《金融时报》、《福布斯》联合授予“亚洲贸易金融创新服务”称号。 2014年还荣获《亚洲周刊》“中国最佳中小企业金融服务银行”奖,获得《21世纪经济报道》颁发的“最佳资产管理私人银行”奖,获评《经济观察报》“年度卓越私人银行”等。 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资银行”称号。 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选中荣获“年度卓越战略创新银行”和“年度卓越直销银行”两项大奖。	<p>2.主要人员情况 杨格华先生,北京大学硕士、博士,资产托管部副总经理。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部资产托管部,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部高级处、资产托管部总经理助理、副总经理等职务。具有二十多年的金融从业经历,丰富的外资银行工作经验,具有广阔视野和前瞻性的战略眼光。</p> <p>三、相关服务机构 (一)基金的销售机构 1.申银万国证券(简称“一级交易商”) (1)上海申银万国证券有限公司 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:万建华 客服电话:400-8888-666 网址:www.gjia.com (2)中信证券(山东)有限责任公司 住所:青岛市崂山区苗岭路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 (3)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:张佑君 客服电话:95558 网址:www.citics.com (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:10108998 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号国际大厦A座C座 法定代表人:陈有安 客服电话:4008-8888-8888 网址:www.chinastock.com.cn (7)长江证券股份有限公司 住所:武汉市朝晖路8号长江证券大厦 法定代表人:胡运涛 客户服务电话:4008-888-899 网址:www.95579.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:025-84579897 网址:www.htsec.com.cn (9)中泰证券股份有限公司 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:9538 网址:www.wdzq.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:王春峰 客户服务电话:4006519888 网址:www.bhzq.com (11)平安证券股份有限公司 注册地址:深圳市中心路大中华国际交易广场8楼 法定代表人:杨宇翔 客服热线: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:9536 基金管理人:www.guosen.com.cn (13)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口交界处荣隆商务中心A栋18-21层 法定代表人:龙增来 开放式基金咨询电话:4006080008 网址:www.cjis.cn (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:牛冠兴 客户服务电话:0755-82825555 网址:www.axzq.com.cn (15)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368号大成国际大厦2005</p>
---	--

网址:www.hongtastock.com
(17)申万宏源证券有限公司
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
客服电话:95523或4008895523
网址:www.swy.com.cn
(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:95503
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:肖林
客户服务热线: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:杨正中
客户服务电话:0431-96668,0431-85096733
网址:www.nescn.com
(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:张志刚
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:95662
网址:www.xyzq.com.cn
(23)长城证券股份有限公司
住所: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:黄巍华
客服电话:0755-82289698
网址:www.cc168.com.cn

二、二级市场交易代理券商
包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。
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
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:刘金
电话:010-58598939
传真:010-58598907
(三)律师事务所及经办律师
名称:普华永道中会计师事务所(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
执行事务合伙人:李丹
联系人:陈磊
联系电话:021-23238988
经办注册会计师:薛竞、陈露

四、基金名称
深证基本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,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

七、基金的投资方向
本基金主要投资于标的指数的成份股票、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、资产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的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%,但法律法规及基金合同规定的限制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或证券组合对标的指数的成份股票予以替换,这些情况包括但不限于以下情形:(1)法律法规的限制;(2)标的指数的成份股票流动性严重不足;(3)标的指数的成份股票长期停牌;(4)其他合理原因致本基金管理人对于标的指数的跟踪构成严重制约。
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%,年跟踪误差率不超过2%。如因数据编制错误调整或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、确定建仓策略和组合调整。
(2)确定目标组合:根据复制制标的指数成份股及其权重的方法确定目标组合。
(3)确定建仓策略:根据对成份股流动性、行业分布等因素分析,确定合理的建仓策略。
(4)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跟踪实际组合直至达到跟踪目标。
(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定期调整公告,在指数成份股调整生效前,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,若出现成份股票启动临时调整的情形,本基金管理人将密切关注本股票的调整,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其他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、替代基金来代替,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,即用“替代投资组合”应对。采用替代投资组合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
基金管理人每日跟踪基金组合与标的指数的表现偏离度,每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因,现风险控制措施,标的指数成份股调整前的操作以及及成份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“总体复制偏差”、“行业偏差”和“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。行业复制偏差指个股、个股成份股和个股偏差。
本基金通过设定上述指标的最大允许值,对投资组合予以约束,以控制基金相对于比较基准的偏差。
本基金将“总体复制偏差”作为决定是否启动修正程序的监控指标,将“行业偏差”、“个股偏差”指标作为调整指标,以达到控制跟踪偏差的目的。
在具体修正过程中,本基金将采用定量化分析模型,每日计算总体复制偏差指标,计算区间从组合修正日开始计算。如跟踪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,缩减跟踪误差。
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基本的投资。

九、基金的业绩比较标准
本基金业绩的指标为:深证基本60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,具有与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。

十一、基金的投资组合报告
基金管理人及基金托管人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。
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2016年3月25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。本报告期内基金投资组合报告如下:
1.报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	90,181,426.14	90.07
2	债权投资	90,181,426.14	90.07
3	其他资产	-	-
4	其他负债	-	-
5	资产减值准备	-	-
6	公允价值变动资产	-	-
7	公允价值变动负债	-	-
8	其他资产	-	-
9	其他负债	-	-
10	其他资产	-	-
11	其他负债	-	-
12	其他资产	-	-
13	其他负债	-	-
14	其他资产	-	-
15	其他负债	-	-
16	其他资产	-	-
17	其他负债	-	-
18	其他资产	-	-
19	其他负债	-	-
20	其他资产	-	-
21	其他负债	-	-
22	其他资产	-	-
23	其他负债	-	-
24	其他资产	-	-
25	其他负债	-	-
26	其他资产	-	-
27	其他负债	-	-
28	其他资产	-	-
29	其他负债	-	-
30	其他资产	-	-
31	其他负债	-	-
32	其他资产	-	-
33	其他负债	-	-
34	其他资产	-	-
35	其他负债	-	-
36	其他资产	-	-
37	其他负债	-	-
38	其他资产	-	-
39	其他负债	-	-
40	其他资产	-	-
41	其他负债	-	-
42	其他资产	-	-
43	其他负债	-	-
44	其他资产	-	-
45	其他负债	-	-
46	其他资产	-	-
47	其他负债	-	-
48	其他资产	-	-
49	其他负债	-	-
50	其他资产	-	-
51	其他负债	-	-
52	其他资产	-	-
53	其他负债	-	-
54	其他资产	-	-
55	其他负债	-	-
56	其他资产	-	-
57	其他负债	-	-
58	其他资产	-	-
59	其他负债	-	-
60	其他资产	-	-
61	其他负债	-	-
62	其他资产	-	-
63	其他负债	-	-
64	其他资产	-	-
65	其他负债	-	-
66	其他资产	-	-
67	其他负债	-	-
68	其他资产	-	-
69	其他负债	-	-
70	其他资产	-	-
71	其他负债	-	-
72	其他资产	-	-
73	其他负债	-	-
74	其他资产	-	-
75	其他负债	-	-
76	其他资产	-	-
77	其他负债	-	-
78	其他资产	-	-
79	其他负债	-	-
80	其他资产	-	-
81	其他负债	-	-
82	其他资产	-	-
83	其他负债	-	-
84	其他资产	-	-
85	其他负债	-	-
86	其他资产	-	-
87	其他负债	-	-
88	其他资产	-	-
89	其他负债	-	-
90	其他资产	-	-
91	其他负债	-	-
92	其他资产	-	-
93	其他负债	-	-
94	其他资产	-	-
95	其他负债	-	-
96	其他资产	-	-
97	其他负债	-	-
98	其他资产	-	-
99	其他负债	-	-
100	其他资产	-	-
101	其他负债	-	-
102	其他资产	-	-
103	其他负债	-	-
104	其他资产	-	-
105	其他负债	-	-
106	其他资产	-	-
107	其他负债	-	-
108	其他资产	-	-
109	其他负债	-	-
110	其他资产	-	-
111	其他负债	-	-
112	其他资产	-	-
113	其他负债	-	-
114	其他资产	-	-
115	其他负债	-	-
116	其他资产	-	-
117	其他负债	-	-
118	其他资产	-	-
119	其他负债	-	-
120	其他资产	-	-

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。
2.报告期末按行业分类的股票投资组合
(1)报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票投资。
(2)报告期末按行业分类的股票投资组合