建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

招募说明书(更新)摘要

2011年1号

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

二〇一一年六月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2009年9月1日证监许可[2009]882号文核准募集。本基金的基金合同于2009年11月5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。本招募说明书经中国证监会核准,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做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。

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,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、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,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,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。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写,并经中国证监会核准。

本招募说明书所载内容截止日为2011年5月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年3月31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:江先周
联系人:路彩营
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,董事会行使《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经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会,由5名监事组成,其中包括2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、高级管理人员尽职情况。

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、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部十五个职能部门以及深圳、成都、北京和上海分公司。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

江先周先生,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经济学硕士学位。1993年获英国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长办公室副处长,中国建设银行国际业务部处长,中国建设银行行长办公室副主任,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年获东北财经大学经济学学士学位,2006年获得长江商学院EMBA学位。历任中国建设银行筹资部证券处副处长,中国建设银行筹资部、零售业务部证券处处长,中国建设银行个人银行业务部副总经理。

马梅琴女士,董事,现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1984年获中央财政金融学院学士学位。历任中国建设银行筹资储蓄部证券处副处长、中国建设银行筹资储蓄部外币储蓄处处长、中国建设银行零售业务部自动服务处处长、中国建设银行个人银行业务部证券业务处处长、中国建设银行个人金融业务部二级个人客户经理兼证券处高级经理、中国建设银行个人金融业务部二级个人客户经理、中国建设银行个人金融业务部副总经理。

俞斌先生,董事,现任中国建设银行财务会计部总经理助理。1992年获南京大学计算数学专业硕士学位。历任中国建设银行江苏分行泰州分行行长助理、副行长。

欧阳伯权先生,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城市设计及环境规划系学士学位。历任加拿大安泰保险公司管理级培训员、团体核保总监,美国友邦保险公司亚洲区团体保险部副总裁,信安国际有限公司亚洲区行政总裁。

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)、中国华电集团公司改制重组办公室副处长、体制改革处处长、政策与法律事务部政策研究处处长。

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总裁助理。1984年获浙江工业大学管理工程学学士学位,1991年获浙江大学经济系宏观经济专业硕士学位,1994年获财政部财科所研究生部财务学博士学位。历任中国建设银行总行信托投资公司总裁助理兼财会部经理,中国建设银行总行会计部副总经理、香港华建国际集团公司总经理。

关启昌先生,独立董事,现任MORRISON & Company Limited总裁。1970年获新加坡大学会计学(荣誉)学士学位。并于1992年修完斯坦福大学行政人员课程。历任Accountant General's Office, Singapore Government 会计师、Turquand Young, Chartered Accountants Hong Kong 核数师、Irish, Young & Outhwaite 核数师、Bechwith Kwan & Company, Chartered Accountants Australia and Hong Kong 合伙人、美林证券总裁、协和集团董事兼总经理、Morrison & Co., LTD总裁。

沈四宝先生,独立董事,现任对外经贸大学法学院院长。1981年获北京大学法律系国际经济法学硕士学位。历任北京大学助教、对外经济贸易大学法学院院长。

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。历任国家统计局干部、副处长,中国建设银行投资调查部副处长,信贷部副处长、处长,委托代理部处长,中国建设银行基金托管部副总经理,中国建设银行投资托管服务部总经理。

谭旭耀先生,监事,现任信安国际公司亚洲区财务分析专员,负责信安亚洲区营运公司财务事务管理、信安亚洲区业务财务分析及预测、项目管理、资本计划、并购活动、策略分析、风险管理、精算事务等。

唐湘晖女士,监事,现任中国华电集团资本控股有限公司金融管理部经理。1994年获北京物资学院经济学学士,2007年获得清华-麦考瑞大学应用金融硕士。历任中电联电力财会与经济发展研究中心职员、原电力工业部经济调节司科员、国家电力公司财务与资产管理部职员、中国华电集团公司结算中心副处长(主持工作)、中国华电集团财务有限公司结算管理部副经理(主持工作)、中国华电集团公司金融管理部副处长(主持工作)、华电扬州发电有限公司副总经理(挂职锻炼)。

翟峰先生,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年获得安徽省安庆师范学院文学学士学位,1990年获得上海复旦大学国际经济法专业法学学士学位。历任中国日报评论部记者,秘鲁首钢铁矿股份有限公司内部审计部副主任,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)证券发行部副总经理,宏源证券股份有限公司投资银行总部副总经理,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年毕业于中国人民银行金融研究所研究生部。历任中国建设银行国际业务部外汇资金处主任科员、中国建设银行资金部交易风险管理处副处长、中国建设银行资金部交易风险管理处、综合处高级副经理(主持工作)。

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、北京京都会计师事务所、中国证券监督管理委员会基金监管部、国泰基金管理公司副总经理、建信基金管理公司督察长。

张延明先生,副总经理。1993年获中国人民大学投资经济系学士学位,1997年获中国人民大学投资经济系硕士学位。先后供职于深圳市建设集团、中国建设银行,历任中国建设银行信贷管理部主任科员、中国建设银行行长办公室主任科员、副处长、处长。2006年11月加入建信基金管理公司,任总经理助理;2008年6月起任建信基金管理公司副总经理。

王新艳女士,副总经理。注册金融分析师(CFA),中国人民银行研究生部硕士。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股票型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,于2005年3月16日至2009年3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,于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日期间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日起任建信内生动力股票基金的基金经理。

4、督察长

路彩营女士,督察长。1979年毕业于河北大学经济系计划统计专业。历任中国建设银行副主任科员、主任科员、副处长、处长,华夏证券部门副总经理,宝盈基金管理公司首席顾问(公司副总经理级),建信基金管理公司监事长。

5、本基金的基金经理

梁洪昀先生,投资管理部副总监。注册金融分析师(CFA)。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,历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、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、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监,自2009年11月5日至今任本基金的基金经理;自2010年5月28日起任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金的基金经理和建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

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。
万志勇先生,研究部执行总监。
梁洪昀先生,投资管理部副总监。
卓利伟先生,投资管理部副总监。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况
名称:中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
批准设立机关及批准设立文号:国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146号)
组织形式:国有独资
存续期间:持续经营
注册资本:人民币334,018,850,026元
联系电话:010-66105799
联系人:赵会军

(二)主要人员情况

截至2011年3月末,中国工商银行资产托管部共有员工130人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年3月,中国工商银行共托管证券投资基金205只,其中封闭式8只,开放式197只。自2003年以来,本行连续七年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的25项最佳托管银行大奖;2010年,本行资产托管部总经理获得《财资》设立的年度中国最佳托管银行家个人大奖。本行是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构
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
法定代表人:江先周
联系人:孙桂东
电话:010-66228800

2、场外代销机构

(1)中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼(长安兴融中心)
法定代表人:郭树清
客服电话:95533
网址:www.ccb.com

(2)中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55 号
法定代表人:姜建清
客服电话:95588
网址:www.icbc.com.cn

(3)中国农业银行
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:项俊波
客户服务电话:95599
公司网址:www.abchina.com

(4)中国银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
客服电话:95566
网址:www.boc.cn

(5)交通银行股份有限公司
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
客服电话:95559
网址:www.95559.com.cn

(6)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
客户服务电话:95555
传真:0755-83195049
网址:www.cmbchina.com

(7)中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
法定代表人:孔丹
客服电话:95558
网址:bank.ecitic.com

(8)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
传真:010-83914283
客户服务电话:95568
公司网站:www.cmbc.com.cn

(9)北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:闫冰竹
联系人:王曦
传真:010-66226045
客户服务电话:95526
公司网站:www.bankofbeijing.com.cn

(10)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:万建华
客服电话:400-8888-666
网址:www.gtja.com

(11)中信证券股份有限公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
法定代表人:王东明
客服电话:95558
网址:www.citics.com

(12)中信万通证券有限责任公司
住所:青岛市市南区东海西路28号
法定代表人:张智河
客服电话:0532-96577
网址:www.zxwt.com.cn

(13)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

(14)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
客户服务热线:95565、4008888111
网址:www.newone.com.cn

(15)中信金通证券有限责任公司
住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯商务楼A座
法定代表人:刘军
客服电话:0571-96598
网址:www.bigsun.com.cn

(16)长城证券有限责任公司
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:黄耀华
客服电话:0755-82288968
网址:www.cc168.com.cn

(17)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

(18)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:顾伟国
客户服务电话:4008-888-8888
网址:www.chinastock.com.cn

(19)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:胡运钊
客户服务电话:4008-888-999
公司网址:www.95579.com

(20)华泰联合证券有限责任公司
住所:深圳市福田区深南大道4011 号香港中旅大厦25 、24楼
法定代表人:马昭明
客户服务电话:95513
公司网址:www.lhzq.com

(21)中信建投证券有限责任公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:张佑君
客户服务电话:400-8888-108
公司网址:www.csc108.com

(22)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.htsc.com.cn

(23)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
客户服务热线:95538
网址: www.qlzq.com.cn

(24)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市人民大街138-1号
法定代表人:矫正中
客户服务电话:0431-96688、0431-85096733
网址:www.nesc.cn

(25)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:张志军
客户服务电话: 4006515988
网址:www.bhzq.com

(26)广发证券股份有限公司
住所:广州市天河北路183号大都会广场43楼
法定代表人:王志伟
客户服务电话:020-95575
网址:www.gf.com.cn

(27)广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人:黄金琳
客服热线:0591-96326
网址:www.gfhfzq.com.cn

(28)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

(29)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: 4008888123
网址:www.xyzq.com.cn

(30)财富证券股份有限公司
注册地址:长沙市芙蓉中路2段80号顺天国际财富中心26层
法定代表人:周晖
客户服务电话:0731-4403340
网址:www.cfzq.com

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

(32)东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼
法定代表人:朱科敏
客服热线:4008888588
网址:www.longone.com.cn

(33)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:况雨林
客服电话:0871-3577888
网址:www.hongtastock.com

(34)中国建银投资证券有限责任公司
注册地址:深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层
法定代表人:杨小阳
开放式基金咨询电话:4006008008
网址: www.cjis.cn

(35)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

(36)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建设路2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.hysec.com

(37)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:郁忠民
客服电话:021-962518
网址:www.962518.com

(38)国元证券股份有限公司
注册地址:合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
客户服务热线:400-8888-777
网址:www.gyzq.com.cn

(39)民生证券有限责任公司概况
注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
法定代表人:岳献春
客服电话:400-619-8888
网址:www.mszq.com

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。

3、场内发售机构

本基金场内交易机构是指深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位,具体名单详见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。

(二)注册登记机构
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
联系电话:0755-25938095
传真:0755-25987538
联系人:任瑞新

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:北京市德恒律师事务所
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、李晓明

(四)审计基金资产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系人:陈宇
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
经办会计师:许康玮、陈宇

四、基金的名称

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

五、基金的类型

股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深300指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%,投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。

八、基金的投资策略

本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

本基金对标的指数的跟踪目标:力争使得日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。

1、资产配置策略

本基金跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的90%;投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的资产不低于基金资产净值的5%。

如因标的指数成份股调整、股票停牌限制、股票流动性不足、基金申购或赎回等各种基金管理人之外的因素,致使基金无法依指数权重购买某成份股时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整。

2、股票投资组合策略

(1)投资组合的构建

本基金股票资产投资以沪深300指数为标的指数,原则上采用完全复制的方法,首先按照标的指数中的行业权重为基准权重,确定行业配置比例;再进一步根据各行业中的个股基准权重,确定行业内的个股配置比例。

(2)投资组合的调整

本基金为指数型基金,基金所构建的指数化投资组合原则上将根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、成份股公司行为信息、新股增发因素等变化,对基金投资组合进行实时调整,以实现基金净值增长率与基准指数收益率之间的跟踪误差最小化。

(3)替代投资策略

因特殊情况(如成份股投资受限制、市场流动性不足等)导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他适当方法(如买入其他成份股或备选成份股、非成份股等)进行替代。

(4)跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

指数基金跟踪误差的来源包括:对受限成份股的替代投资、成份股调整时的交易策略以及基金每日现金流入或流出的建仓或变现策略、成份股股息的再投资策略等。基金管理人将通过对上述因素的有效管理,追求跟踪误差最小化。

本基金每日跟踪基金组合与指数表现的偏离度,每月末定期分析基金组合与标的指数表现的累积偏离度、跟踪误差变化情况及其原因,并优化跟踪偏离度管理方案。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。

十、基金的风险收益特征

本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年4月20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。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自2011年1月1日起至3月31日止。

11.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,973,628,009.49	94.27
	其中:股票	3,973,628,009.49	94.27
2	固定收益投资	100,840,945.60	2.39
	其中:债券	100,840,945.60	2.39
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	132,510,566.59	3.14
6	其他资产	8,357,390.34	0.20
7	合 计	4,215,336,912.02	100.00

11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采掘业	–	–
C	制造业	–	–
C0	食品、饮料	–	–
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	–	–
C5	电子	–	–
C6	金属、非金属	–	–
C7	机械、设备、仪表	–	–
C8	医药、生物制品	–	–
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	–	–
H	批发和零售贸易	–	–
I	金融、保险业	3,709,957.60	0.09
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	–	–
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合 计	3,709,957.60	0.09

注:以上行业分类以2011年3月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

11.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	13,512,139.05	0.32
B	采掘业	484,442,731.01	11.55
C	制造业	1,432,095,431.10	34.14
C0	食品、饮料	220,481,564.66	5.26
C1	纺织、服装、皮毛	15,626,920.32	0.37
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	100,320,292.75	2.39
C5	电子	29,843,989.36	0.71
C6	金属、非金属	361,540,668.92	8.62
C7	机械、设备、仪表	527,337,614.72	12.57
C8	医药、生物制品	164,632,040.17	3.93
C99	其他制造业	12,312,340.20	0.29
D	电力、煤气及水的生产和供应业	96,783,269.97	2.31
E	建筑业	118,760,158.17	2.83
F	交通运输、仓储业	176,893,135.02	4.22
G	信息技术业	130,066,318.58	3.10
H	批发和零售贸易	111,530,572.65	2.66
I	金融、保险业	1,063,733,190.36	25.36
J	房地产业	210,577,280.95	5.02
K	社会服务业	37,108,625.05	0.88
L	传播与文化产业	5,519,504.60	0.13
M	综合类	88,895,695.38	2.12
	合 计	3,969,918,051.89	94.65

注:以上行业分类以2011年3月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

11.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

11.3.1报告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资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	9,014,699	127,017,108.91	3.03
2	601318	中国平安	2,321,660	114,829,303.60	2.74
3	601328	交通银行	16,777,929	95,466,416.01	2.28
4	600016	民生银行	15,651,674	87,492,857.66	2.09
5	601166	兴业银行	2,906,653	83,450,007.63	1.99
6	600000	浦发银行	5,965,657	81,252,248.34	1.94
7	600030	中信证券	4,824,187	67,393,892.39	1.61
8	601088	中国神华	2,285,434	66,483,275.06	1.59
9	000002	万 科A	6,707,759	58,290,425.71	1.39
10	601601	中国太保	2,178,128	48,180,191.36	1.15

11.3.2报告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十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600816	安信信托	272,791	3,709,957.60	0.09

注:该只股票原为指数投资持有,2010年7月1日沪深300指数调整时被列为非成份股,2011年1月第一个交易日调整时仍被列为非成份股。

11.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	100,110,000.00	2.39
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	730,945.60	0.02
7	其他	–	–
	合 计	100,840,945.60	2.40

11.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801044	08央行票据44	1,000,000	100,110,000.00	2.39
2	110016	川投转债	6,160	730,945.60	0.02

11.6 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投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

11.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

11.8 投资组合报告附注

11.8.1 本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

11.8.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

11.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,063,778.03
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	511,060.13
4	应收利息	4,381,599.36
5	应收申购款	2,400,952.82
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合 计	8,357,390.34

11.8.4 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。

11.8.5 报告期末指数投资前十名、积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

11.8.5.1 报告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不存在流通受限情况。

11.8.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600816	安信信托	3,709,957.60	0.09	重要事项未公告

注:该只股票原为指数投资持有,2010年7月1日沪深300指数调整时被列为非成份股,2011年1月第一个交易日调整时仍被列为非成份股。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2011年3月31日。

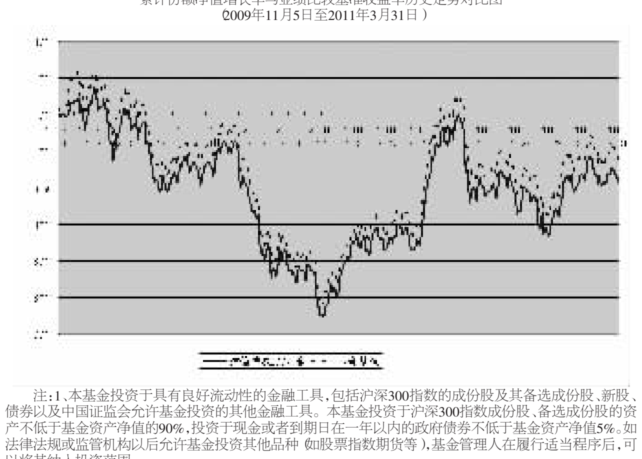
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效之日2009年11月5日至2009年12月31日	1.00%	1.25%	3.38%	1.60%	-2.38%	-0.35%
2010年1月1日至2010年12月31日	-12.28%	1.51%	-11.78%	1.50%	-0.50%	0.01%
2011年1月1日至2011年3月31日	2.60%	1.29%	2.91%	1.29%	-0.31%	0.00%
自基金合同生效之日2009年11月5日至2011年3月31日	-9.10%	1.44%	-6.14%	1.48%	-2.96%	-0.04%

2、自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年11月5日至2011年3月31日)



注:1、本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深300指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%,投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种(如股票指数期货等),基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

2、本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类
(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)基金上市费用;
(4)基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
(5)基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
(6)基金份额持有人大会费用;
(7)基金的证券交易费用;
(8)银行汇划费用;
(9)按照法律、法规规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、基金费用的费率、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0.75%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.75%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起2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,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.15%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费率、基金托管费率,此项调整不需要召开基金份额持有人大会,但基金管理人必须最迟于新的费率实施前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

本条第1款第(3)至第(9)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。

(二)基金销售时发生的费用

1、申购费

本基金对申购设置级差费率,场内申购和场外申购执行统一收费标准。申购费率随申购金额的增加而递减,最高申购费率不超过1.2%:

申购金额(M)	申购费率
M<100万元	1.2%
100万元≤M<500万元	0.8%
500万元≤M<1000万元	0.4%
M≥1000万元	1000元/笔

申购费用由申购人承担,不列入基金资产,申购费用用于本基金的市场推广、注册登记和销售。

2、赎回费

场外赎回费率按照持有期限设置级差费率,最小赎回费率为零;场内赎回费率为固定的0.5%。

持有期限(Y)	场外赎回费率	场内赎回费率
持有期<1 年	0.5%	0.5%
1 年≤持有期<2 年	0.25%	
持有期≥2 年	0%	

赎回费用由赎回人承担,赎回费中25%归入基金资产,其余部分作为本基金用于支付注册登记费和其他必要的手续费。(注:1年指365天)

3、基金管理人可以根据相关法律、法规以及本基金基金合同的规定决定开办本基金和基金管理人管理的、且由同一登记结算机构办理登记结算的其他基金之间的转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体事项可以由基金管理人届时另行规定且公告,并提前告知基金托管人与其他相关机构。

4、基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:
1、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财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

十四、对招募说明书更新部分的说明

1、更新了"三、基金管理人"的"主要人员情况"信息;
2、更新了"四、基金托管人"的"主要人员情况"、"基金托管业务经营情况"、"基金托管人的职责"的相关信息。
3、更新了"五、相关服务机构"中代销机构及会计师事务所的变动信息;
4、更新了"十一、基金的投资"中"基金的投资组合报告"的相关内容,该部分内容均按有关规定编制,并经基金托管人复核;
5、更新了"十二、基金的业绩",该部分内容均按有关规定编制,并经基金托管人复核;
6、更新了"二十四、其他应披露事项",添加了自上次本基金招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

上述内容仅为本招募说明书(更新)摘要,投资人欲查询本招募说明书(更新)正文,可登录基金管理人网站www.ccbfund.cn。

建信基金管理有限责任公司
二〇一一年六月二日