深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

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

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市时间：2011 年 10 月 24 日
公告日期：2011 年 10 月 19 日

一、重要声明与提示

《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称"本公告"）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称"本基金"）管理人建信基金管理有限责任公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人中国民生银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2011 年 8 月 3 日《证券时报》及本公司网站（www.ccbfund.cn）上公告的《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》。

二、基金概览

1、基金场内交易简称：深 F60
2、场内交易代码：159916
3、基金申购赎回简称：深 F60
4、申购赎回代码：159916
5、标的指数简称：深证基本面 60 指数
6、标的指数代码：399701
7、2011 年 10 月 17 日基金份额总额：212,066,039 份
8、2011 年 10 月 17 日基金份额净值：1.8730 元
9、本次上市交易份额：212,066,039 份
10、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
11、上市交易日期：2011 年 10 月 24 日
12、基金管理人：建信基金管理有限责任公司
13、基金托管人：中国民生银行股份有限公司
14、申购赎回代理券商：

东方证券、渤海证券、宏源证券、银河证券、国信证券、光大证券、中信证券、国泰君安证券、中投证券、申银万国证券、华泰证券、平安证券、中信万通证券、海通证券、安信证券、长江证券、齐鲁证券、红塔证券

15、本基金开放申购赎回时间：2011 年 10 月 24 日

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会 2011 年 7 月 14 日证监许可［2011］1092 号。

2、基金合同生效日：2011 年 9 月 8 日。

3、基金运作方式：交易型开放式。

4、基金合同期限：不定期。

5、发售日期：2011 年 8 月 8 日至 2011 年 9 月 2 日。其中，网上现金认购的日期为 2011 年 8 月 8 日至 2011 年 9 月 2 日，网下现金认购的日期为 2011 年 8 月 8 日至 2011 年 9 月 2 日，网下股票认购的日期为 2011 年 8 月 29 日至 2011 年 9 月 2 日。

6、发售价格：人民币 1.00 元。

7、发售方式：投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。

8、发售机构：

（1）网下现金发售机构：

建信基金管理有限责任公司

（2）网上现金发售代理机构：

网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司：爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发华福、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、天风证券、天源证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中天证券、中投证券、中信建投、中信金通、中信万通、中信证券、中银证券、中原证券。

（3）网下股票发售代理机构：

国泰君安证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、宏源证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司。

9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

10、募集资金总额及入账情况

本基金于 2011 年 8 月 8 日起公开募集，基金募集工作已于 2011 年 9 月 2 日顺利结束。

经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的募集金额总额为 389,202,212.00 元人民币（含所募集股票市值），有效认购款项在本基金验资确认日之前产生的利息共计 29,824.00 元人民币。募集资金已于 2011 年 9 月 8 日划入本基金在基金托管人中国民生银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为 3,409 户。按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算，募集期募集金额（含所募集股票市值）及利息结转的基金份额共计 389,232,036.00 份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

11、本基金募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《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》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于 2011 年 9 月 8 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（二）基金份额折算

根据《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《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》的有关规定，本基金管理人确定 2011 年 10 月 12 日为本基金的基金份额折算日。折算后的基金份额净值与 2011 年 10 月 12 日标的指数收盘值的二千分之一基本一致。2011 年 10 月 12 日，深证基本面 60 指数收盘值为 3728.224 点，本基金的基金资产净值为 395,318,115.60 元，折算前基金份额总额为 389,232,036 份，折算前基金份额净值为 1.0156 元。

根据《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》中约定的基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.54483643（以四舍五入的方法保留到小数点后 8 位），折算后基金份额总额为 212,066,039 份，折算后基金份额净值为 1.8641 元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司于 2011 年 10 月 13 日进行了变更登记。折算后的基金份额保留到整数位（小数部分舍去，由此产生的误差计入基金财产）。投资者可以自 2011 年 10 月 14 日起在其深圳证券交易所证券账户指定的销售机构查询折算后其持有的基金份额。

本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理，并互相核对。

（三）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上［2011］317 号
2、上市交易日期：2011 年 10 月 24 日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
4、基金场内交易简称：深 F60
5、场内交易代码：159916

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易

6、本次上市交易份额：212,066,039 份

7、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至 2011 年 10 月 17 日，本基金份额持有人户数为 3,409 户，平均每户持有的基金份额为 62,207.70 份。

（二）持有人结构

截至 2011 年 10 月 17 日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为 151,708,521.00 份，占基金总份额的 71.54%；个人投资者持有的基金份额为 60,357,518.00 份，占基金总份额的 28.46%。

（三）截至 2011 年 10 月 17 日，前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	证券账户号	持有基金份额	占场内基金份额的比例
1	红塔证券股份有限公司	0899013695	19,070,863	8.99%
2	广发证券－工行－广发金管家新型高成长集合资产管理计划	0899055547	10,897,636	5.14%
3	国都－华夏－国都安心投资集合资产管理计划	0899055675	8,173,568	3.85%
4	财富证券有限责任公司	0899040740	8,171,796	3.85%
5	中国银河证券股份有限公司	0899054806	6,541,200	3.08%
6	海通证券股份有限公司	0899035652	5,456,868	2.57%
7	中国石化财务有限责任公司	0800008778	5,449,045	2.57%
8	东方证券股份有限公司	0899017317	5,448,818	2.57%
9	光大证券股份有限公司	0899029696	5,448,818	2.57%
10	渤海证券股份有限公司	0899031006	5,448,818	2.57%
11	中航－浦发－中航金航 2 号集合资产管理计划	0899055452	5,448,818	2.57%
合计			85,556,248	40.33%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、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
批准设立机关和批准设立文号：中国证监会证监基金字［2005］158 号文
法定代表人：江先周
总经理：孙志晨
联系人：孙桂东
咨询电话：010-66228888
法人营业执照文号：企合国副字第 001136
注册资本：人民币 2 亿元
存续期间：持续经营
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

2、股权结构：

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%

3、组织机构

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分公司、成都分公司、北京分公司和上海分公司。此外，公司还设有投资决策委员会和风险管理委员会。

4、人员情况

截至 2011 年 10 月 17 日，公司共有员工 164 人，所有人员在最近三年内均没有受到有关管理部门处罚的记录。

5、信息披露负责人

路彩营

6、基金管理业务情况简介

截至 2011 年 9 月 30 日，基金管理人管理的基金为建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、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、全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信保本混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金和建信新兴市场优选股票型证券投资基金、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共 18 只开放式基金和建信优势动力股票型证券投资基金 1 只封闭式基金，管理的基金总资产规模为 394.27 亿元。

7、本基金基金经理

梁洪昀先生，CFA，证券从业经历 7 年，现任建信基金管理有限责任公司投资管理部副总监。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。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 日起任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2010 年 5 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。

（二）基金托管人

1、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：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：22,262,277,489 元人民币
存续期间：持续经营
电话：010-58560666
联系人：关悦

2、主要人员情况

陈凌：女，高级会计师。资产托管部总经理。曾任职于中国有色金属工业总公司财务部，中国有色财务公司，招商银行北京分行，中国民生银行股份有限公司总行营业部、北京管理部、西安分行、总行年金筹备组；历任中国有色财务公司处长，中国民生银行股份有限公司总行营业部副主任、北京管理部副总经理、西安分行行长、总行年金筹备组组长等职务。具有丰富的大型企业集团、非银行金融机构及商业银行的从业工作经历和管理工作经验。

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 43 人，平均年龄 35 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。截止到 2011 年 6 月 30 日，本行共托管基金 10 只，分别为天治品质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和光大保德信信用添益债券型证券投资基金。托管基金资产净值为 337.78 亿元。

（三）验资机构

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：021-61238888
传真：021-61238800
经办注册会计师：薛竞　陈宇

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金 2011 年 10 月 17 日资产负债表如下：

资　产	2011年 10 月 17 日	负债和所有者权益	2011年 10 月 17 日
	余额		余额
资　产：		负债：	
银行存款	7,922,316.28	短期借款	－
结算备付金	－	交易性金融负债	－
存出保证金	500,000.00	衍生金融负债	－
交易性金融资产	389,607,642.25	卖出回购金融资产款	－
其中：　股票投资	389,607,642.25	应付证券清算款	－
债券投资	－	应付赎回款	－
资产支持证券投资	－	应付管理人报酬	91,118.01
基金投资	－	应付托管费	18,223.59
衍生金融资产	－	应付销售服务费	－
买入返售金融资产	－	应付交易费用	313,616.39
应收证券清算款	－	应付税费	－
应收利息	169,233.46	应付利息	－
应收股利	－	应付利润	－
应收申购款	－	其他负债	581,373.31
其他资产	－	负债合计	1,004,331.30
		所有者权益：	397,194,860.69
		实收基金	389,232,036.00
		未分配利润	7,962,824.69
		所有者权益合计	397,194,860.69
资产合计：	398,199,191.99	负债与持有人权益总计：	398,199,191.99

八、基金投资组合

截止到 2011 年 10 月 17 日，本基金的投资组合如下：

（一）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	389,607,642.25	97.84
	其中：股票	389,607,642.25	97.84
2	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	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	7,922,316.28	1.99
6	其他各项资产	669,233.46	0.17
7	合计	398,199,191.99	100.00

（二）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	19,647,245.95	4.95
C	制造业	228,983,293.43	57.65
C0	食品、饮料	32,532,012.42	8.19
C1	纺织、服装、皮毛	－	－
C2	木材、家具	－	－
C3	造纸、印刷	5,880,890.16	1.48
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,351,269.60	1.60
C5	电子	8,777,588.00	2.21
C6	金属、非金属	103,507,914.78	26.06
C7	机械、设备、仪表	69,438,291.47	17.48
C8	医药、生物制品	2,495,327.00	0.63
C99	其他制造业	－	－
D	电力、煤气及水的生产和供应业	5,483,205.40	1.38
E	建筑业	－	－
F	交通运输、仓储业	11,331,601.46	2.85
G	信息技术业	16,459,853.94	4.14
H	批发和零售贸易	12,387,962.84	3.12
I	金融、保险业	41,842,855.44	10.53
J	房地产业	47,733,742.56	12.02
K	社会服务业	5,737,881.23	1.44
L	传播与文化产业	－	－
M	综合类	－	－
	合计	389,607,642.25	98.09

（三）按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	000002	万　科 A	4,736,025	34,762,423.50	8.75
2	000709	河北钢铁	5,518,514	21,356,649.18	5.38
3	000825	太钢不锈	3,944,900	17,909,846.00	4.51
4	000898	鞍钢股份	3,258,873	17,565,325.47	4.42
5	000001	深发展 A	874,461	14,463,584.94	3.64
6	000651	格力电器	684,600	13,692,000.00	3.45
7	002024	苏宁电器	1,142,801	12,387,962.84	3.12
8	000527	美的电器	702,201	10,540,037.01	2.65
9	000063	中兴通讯	553,458	9,646,772.94	2.43
10	000858	五 粮 液	258,122	9,537,607.90	2.40

（四）按券种分类的债券投资组合

本基金 2011 年 10 月 17 日未持有债券。

（五）按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金 2011 年 10 月 17 日未持有债券。

（六）投资组合报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或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中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	169,233.46
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	669,233.46

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金 2011 年 10 月 17 日未持有可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

以 2011 年 10 月 12 日为基金份额折算日，本基金进行了基金份额折算，具体内容详见第三章的"（二）基金份额折算"。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人违反《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；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，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、 基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

（一）中国证监会核准本基金募集的文件
（二）《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
（三）《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
（四）《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》
（五）法律意见书
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

建信基金管理有限责任公司
二〇一一年十月十九日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人的权利与义务

（一）基金份额持有人

投资者自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

（二）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1、自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
2、依照合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3、根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
4、根据法律法规和基金合同的规定制定基金收益分配方案；
5、依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
6、在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；
7、根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；
8、在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回申请；
9、自行担任基金登记结算机构或选择、更换登记结算机构，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；
10、选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
11、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
12、依法召集基金份额持有人大会；
13、以基金管理人名义代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
14、选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
15、根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资；
16、法律法规、基金合同以及依据基金合同制定的其它法律文件规定的其他权利。

（三）基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

1、依法募集基金，办理或者委托经由中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记结算事宜；
2、办理基金备案手续；
3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金财产分别管理，分别记账，进行证券投资；
6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
7、依法接受基金托管人的监督；
8、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价；
9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格以及申购、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；
10、按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额交付投资者申购之基金份额或赎回之对价；
11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
12、编制季度、半年度和年度基金报告；
13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
15、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
18、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
23、建立并保存基金份额持有人名册；
24、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
25、执行生效的基金份额持有人大会的决定；
26、不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动；
27、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
28、法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。（四）基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1、依照基金合同的约定获得基金托管费；
2、监督基金管理人对本基金的投资运作；
3、自本基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同、托管协议的规定保管基金财产；
4、在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
5、根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；
6、依法提议召开或召集基金份额持有人大会；
7、按规定取得基金份额持有人名册；
8、法律法规规定的其他权利。

（五）基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

1、以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
2、设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
7、保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
8、对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
9、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年；
10、按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
11、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
12、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值；
13、按照规定监督基金管理人的投资运作；
14、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15、依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和交付赎回对价；
16、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
17、因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
18、按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
19、根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；
20、参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
21、面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；
22、执行生效的基金份额持有人大会的决定；
23、不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动；
24、法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

（六）基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

1、分享基金财产收益；
2、参与分配清算后的剩余基金财产；
3、依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
4、按照规定要求召开基金份额持有人大会；
5、出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
6、查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7、监督基金管理人的投资运作；
8、对基金管理人、基金托管人、代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9、法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

（七）基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1、遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2、交付基金认购、申购对价及缴纳法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；
3、在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4、不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
5、执行生效的基金份额持有人大会决议；
6、遵守基金管理人、基金托管人及基金销售机构和登记结算机构的相关交易及业务规则；
7、返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、代销机构以及其他基金份额持有人处获得的不当得利；
8、法律法规和基金合同规定的其他义务。

（八）基金合同当事各方的权利义务以基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

二、基金份额持有人大会

（一）本基金的基金份额持有人大会由本基金基金份额持有人或本基金联接基金基金份额持有人共同组成，上述两类持有人可以委托他人参会并表决。

本基金基金份额持有人所持有的每一份基金份额为一参会份额。

本基金联接基金基金份额持有人凭所持有的联接基金基金份额，经折算后可以参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会并表决。

每一参会份额享有一票投票权。

联接基金基金份额持有人持有的联接基金基金份额数折算为参会份额数的方法：基金份额持有人大会权益登记日当日，联接基金所持有的本基金基金份额占联接基金资产的比例乘以该持有人所持有的联接基金份额数（计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位）。

（二）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；
（2）更换基金管理人；
（3）更换基金托管人；
（4）转换基金运作方式；
（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
（6）变更基金类别；
（7）本基金与其他基金的合并；
（8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
（9）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
（10）变更基金份额持有人大会程序；
（11）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
（12）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
（13）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（下转 D15 版）

深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告

公告送出日期：2011 年 10 月 19 日

1. 公告基本信息

基金名称	深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	深证基本面 60ETF
场内简称	深 F60
基金代码	159916
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2011年 9 月 8 日
基金管理人名称	建信基金管理有限责任公司
基金托管人名称	中国民生银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	中国证券登记结算有限责任公司
公告依据	《深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《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》等
申购起始日	2011年 10 月 24 日
赎回起始日	2011年 10 月 24 日

注：重要提示

（1）本基金为交易型开放式指数基金，基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

（2）投资者应及时通过本基金销售网点查询认购结果。

2. 日常申购、赎回业务的办理时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所的交易日，开放时间为上午 9:30-11:30 和下午 1:00-3:00。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

3. 日常申购业务

（1）申购份额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购单位的整数倍。本基金最小申购单位为 50 万份，基金管理人有权对其进行调整，并在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（2）申购费率

投资者在申购基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

4. 日常赎回业务

（1）赎回份额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小赎回单位的整数倍。本基金最小赎回单位为 50 万份，基金管理人有权对其进行调整，并在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（2）赎回费率

投资者在赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

5. 基金销售机构

（1）场内代销机构

东方证券、渤海证券、宏源证券、银河证券、国信证券、光大证券、中信证券、国泰君安证券、中投证券、申银万国证券、华泰证券、平安证券、中信万通证券、海通证券、安信证券、长江证券、齐鲁证券、红塔证券。

（2）基金份额净值公告的披露安排

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

（3）其他需要提示的事项

1）申购与赎回的程序

①申购与赎回申请的提出

投资者须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的开放时间提出申购、赎回的申请。

投资者申购本基金时，须根据申购、赎回清单备足相应数量的股票和现金。投资者提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金。

②申购与赎回申请的确认

基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

2）申购和赎回的清算交收与登记

投资者 T 日申购、赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在 T+1 日办理现金替代等的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施日的 3 个工作日前在中国证监会指定的信息披露媒体公告。

3）其他与申购赎回相关的事项

①申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

②申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

申购、赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购、赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。申购、赎回清单的内容与格式见本基金招募说明书。

③T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。

4）本基金管理人可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商，敬请投资者留意相关公告。

5）本公告仅对深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购和赎回业务的有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请详细阅读刊登在 2011 年 8 月 3 日《证券时报》上的《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》，投资者亦可通过本公司网站或相关代销机构查阅相关资料。

6）有关本基金上市交易事宜本公司将另行公告。

特此公告。

建信基金管理有限责任公司
二〇一一年十月十九日