

深证基本本60交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2014年第2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
本基金经中国证监会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。

3. 本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)期末按市值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	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	2,458,894	20,335,053.38	10.37
2	000051	格力电器	431,588	12,710,266.60	6.48
3	000001	平安银行	936,890	9,285,471.80	4.74
4	000157	中联重科	1,715,500	7,600,063.70	3.88
5	000858	五粮液	411,402	7,376,437.86	3.76
6	000333	美的集团	342,349	6,614,182.68	3.37
7	002024	苏宁云商	809,156	5,701,663.36	2.91
8	000338	潍柴动力	316,516	5,630,819.64	2.87
9	000709	河钢股份	2,903,710	5,400,900.60	2.76
10	000776	广汇股份	588,932	5,379,533.60	2.74

(2)期末按市值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投资明细

4. 本报告期末按品种分类的股票投资组合

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资产

6. 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资产支持证券投资明细

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细

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投资明细

9. 本报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

(3) 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

(1) 报告期内本基金投资前十名证券的发行主体均未被监管部门立案调查和报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

(2) 本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) 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,213.86
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	475.54
6	其他流动资产	-
7	预付款项	-
8	其他资产	-
9	其他	-
	合计	2,599.40

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末未积极投资前五只股票中存在流通受限情况的说明

十一、基金的业绩

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,投资者在进行投资决策前请咨询专业机构仔细阅读基金的风险揭示书。

本报告期末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	份额净值增长率①	业绩比较基准增长率②	份额净值增长率-业绩比较基准增长率③	非业绩比较基准收益率-非业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2011年9月30日—2011年12月31日	-13.38%	1.18%	-17.42%	1.39%	4.04%	-0.21%
2012年1月1日—2012年2月28日	2.43%	1.37%	2.09%	1.38%	0.34%	-0.01%
2012年3月1日—2012年4月30日	-7.94%	1.45%	-8.33%	1.46%	1.99%	-0.01%
2012年5月1日—2012年6月30日	-6.98%	1.14%	-7.87%	1.15%	0.85%	-0.01%
本基金合同生效—2014年6月30日	-24.02%	1.34%	-29.20%	1.37%	5.18%	-0.03%

注:1.本基金业绩比较基准收益率和非基准包括基金成立当日

十二、基金的费用概览

(一)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. 基金合同生效后的信息披露费用;

4. 基金合同生效后的审计费用;

5. 基金上市费及年费;

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;

8. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

9. 基金的交易费用;

10. 按照国家有关规定在基金合同中列支的其他费用。

(二)上述基金费用计提方法、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。计算方法如下:

H=H×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为0.5%

H为每日应计提的基金管理费

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,则顺延至下一个工作日。

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年费率计提。计算方法如下:

H=H×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

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,则顺延至下一个工作日。

3. 基金合同生效后的审计费用可使用费

本基金审计机构由基金管理人聘请,其费用由基金管理人承担。

基金合同生效后的信息披露费用可使用费

基金合同生效后的信息披露费用按基金合同中列支,按前一日基金资产净值及指数许可使用费率每年每日计提,计算方法如下:

H=H×当年天数

其中:H为每日应计提的指数许可使用费,E为前一日基金资产净值;I为指数许可使用费率。

在本基金合同生效后的前四个年度,指数许可使用费率年费分别为万分之四(第一年)、万分之六(第二年)、万分之八(第三年)、万分之十(第四年),从本基金合同生效后的第五个年度起,如果基金资产净值超过十亿元人民币,指数许可使用费率年费为万分之二;如果基金资产净值不足十亿元人民币,则指数许可使用费率年费为万分之二。

每季度指数许可使用费不超过人民币拾万元(15万元),基金合同生效后的指数许可使用费按季度支付,于下一季度首日起10个工作日内由基金管理人向托管人支付。

由于中国证券投资基金业协会要求提高指数使用费的权利,如果指数使用费的计算方法、费率等发生调整,本基金将按照调整后的方法进行计提和支付,并参照《信息披露管理办法》的规定进行信息披露。

4. 上述“一”基金费用的种“中”第4—11项费用,根据有关法律法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金管理人承担支付。

(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资产的损失,以及处理和运作基金资产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,基金合同生效后,从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人可根据业务发展情况调整基金管理费率、基金托管费率,降低基金管理费率和基金托管费率,无需召开基金份额持有人大会。基金管理人必须提前有关规定最迟于新的费率实施前2日在指定媒体上公告。

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”、“主要人员情况”中董事的信息;

2. 更新了“四、基金托管人”的“主要人员情况”及“基金托管业务经营情况”;

3. 更新了“五、相关服务机构”中的相关变动信息,更新了“中融国际保理”;

4. 更新了“六、基金的投资”的投资组合报告的内容,并经基金托管人复核;

5. 更新了“七、基金的风险揭示”中基金管理人风险提示;

上述内容为本招募说明书(更新)摘要,投资者欲查询本更新招募说明书正文,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
二〇一四年十月十七日

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

2014年10月17日 星期五
zqsb@stcn.com (0755)83501750

重要提示
本基金经中国证监会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。

3. 本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)期末按市值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	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	2,458,894	20,335,053.38	10.37
2	000051	格力电器	431,588	12,710,266.60	6.48
3	000001	平安银行	936,890	9,285,471.80	4.74
4	000157	中联重科	1,715,500	7,600,063.70	3.88
5	000858	五粮液	411,402	7,376,437.86	3.76
6	000333	美的集团	342,349	6,614,182.68	3.37
7	002024	苏宁云商	809,156	5,701,663.36	2.91
8	000338	潍柴动力	316,516	5,630,819.64	2.87
9	000709	河钢股份	2,903,710	5,400,900.60	2.76
10	000776	广汇股份	588,932	5,379,533.60	2.74

(2)期末按市值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投资明细

4. 本报告期末按品种分类的股票投资组合

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资产

6. 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资产支持证券投资明细

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细

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投资明细

9. 本报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

(3) 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

(1) 报告期内本基金投资前十名证券的发行主体均未被监管部门立案调查和报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

(2) 本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) 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,213.86
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	其他应收款	475.54
6	其他流动资产	-
7	预付款项	-
8	其他资产	-
9	其他	-
	合计	2,599.40

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末未积极投资前五只股票中存在流通受限情况的说明

十一、基金的业绩

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,投资者在进行投资决策前请咨询专业机构仔细阅读基金的风险揭示书。

本报告期末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	份额净值增长率①	业绩比较基准增长率②	份额净值增长率-业绩比较基准增长率③	非业绩比较基准收益率-非业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2011年9月30日—2011年12月31日	-13.38%	1.18%	-17.42%	1.39%	4.04%	-0.21%
2012年1月1日—2012年2月28日	2.43%	1.37%	2.09%	1.38%	0.34%	-0.01%
2012年3月1日—2012年4月30日	-7.94%	1.45%	-8.33%	1.46%	1.99%	-0.01%
2012年5月1日—2012年6月30日	-6.98%	1.14%	-7.87%	1.15%	0.85%	-0.01%
本基金合同生效—2014年6月30日	-24.02%	1.34%	-29.20%	1.37%	5.18%	-0.03%

注:1.本基金业绩比较基准收益率和非基准包括基金成立当日

十二、基金的费用概览

(一)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. 基金合同生效后的信息披露费用;

4. 基金合同生效后的审计费用;

5. 基金上市费及年费;

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;

8. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

9. 基金的交易费用;

10. 按照国家有关规定在基金合同中列支的其他费用。

(二)上述基金费用计提方法、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。计算方法如下:

H=H×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为0.5%

H为每日应计提的基金管理费

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,则顺延至下一个工作日。

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年费率计提。计算方法如下:

H=H×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

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,则顺延至下一个工作日。

3. 基金合同生效后的审计费用可使用费

本基金审计机构由基金管理人聘请,其费用由基金管理人承担。

基金合同生效后的信息披露费用可使用费

基金合同生效后的信息披露费用按基金合同中列支,按前一日基金资产净值及指数许可使用费率每年每日计提,计算方法如下:

H=H×当年天数

其中:H为每日应计提的指数许可使用费,E为前一日基金资产净值;I为指数许可使用费率。

在本基金合同生效后的前四个年度,指数许可使用费率年费分别为万分之四(第一年)、万分之六(第二年)、万分之八(第三年)、万分之十(第四年),从本基金合同生效后的第五个年度起,如果基金资产净值超过十亿元人民币,指数许可使用费率年费为万分之二;如果基金资产净值不足十亿元人民币,则指数许可使用费率年费为万分之二。

每季度指数许可使用费不超过人民币拾万元(15万元),基金合同生效后的指数许可使用费按季度支付,于下一季度首日起10个工作日内由基金管理人向托管人支付。

由于中国证券投资基金业协会要求提高指数使用费的权利,如果指数使用费的计算方法、费率等发生调整,本基金将按照调整后的方法进行计提和支付,并参照《信息披露管理办法》的规定进行信息披露。

4. 上述“一”基金费用的种“中”第4—11项费用,根据有关法律法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金管理人承担支付。

(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资产的损失,以及处理和运作基金资产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,基金合同生效后,从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人可根据业务发展情况调整基金管理费率、基金托管费率,降低基金管理费率和基金托管费率,无需召开基金份额持有人大会。基金管理人必须提前有关规定最迟于新的费率实施前2日在指定媒体上公告。

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”、“主要人员情况”中董事的信息;

2. 更新了“四、基金托管人”的“主要人员情况”及“基金托管业务经营情况”;

3. 更新了“五、相关服务机构”中的相关变动信息,更新了“中融国际保理”;

4. 更新了“六、基金的投资”的投资组合报告的内容,并经基金托管人复核;

5. 更新了“七、基金的风险揭示”中基金管理人风险提示;

上述内容为本招募说明书(更新)摘要,投资者欲查询本更新招募说明书正文,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
二〇一四年十月十七日

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

2014年10月17日 星期五
zqsb@stcn.com (0755)8350175