建信沪深300指数证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)摘要

2015年2号

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

二零一五年十二月

【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2015年11月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年9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:许会斌
联系人:郭雅莉
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裁等经营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、高级管理人员尽职情况。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

许会斌先生,董事长。自2011年3月起至现在,出任中国建设银行批发业务总监;自2006年5月至2011年3月任中国建设银行河南省分行行长;自1994年5月至2006年5月历任中国建设银行筹资储备部副主任、零售业务部副总经理,个人银行部副总经理,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,并是国务院特殊津贴获得者,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年辽宁财经学院基建财务与信用专业大学本科毕业。2015年3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年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长,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与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副总经理、北京分行安华支行副行长、北京分行西四支行副行长、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。

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复旦大学EMBA工商管理学硕士。历任新加坡公共服务委员会副处长,新加坡电信国际有限公司业务发展总监,信诚基金公司首席运营官和代总经理,英国保诚集团(马来西亚)资产管理公司首席执行官,宏利金融全球副总裁,宏利资产管理公司(台湾)首席执行官和执行董事。

袁时奋先生,董事,现任信安国际有限公司大中华区首席营运官。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,香港铁路公司库务部助理司库,香港置地集团库务部司库,香港赛马会副集团司库,信安国际有限公司大中华区首席营运官。

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。

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年毕业于中国人民银行研究生部。历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员、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副总经理,新华资产管理股份有限公司总经理。

王建国先生,独立董事,曾任大新人寿保险有限公司首席行政员,中银保诚退休金信托管理有限公司董事,英国保诚保险有限公司首席行政员,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学研究会常务理事、副秘书长、中国国际金融法专业委员会副主任。

2、监事会成员

王雪玲女士,监事会主席。毕业于清华大学经济管理学院高级工商管理人员工商管理专业,高级经济师。历任中国建设银行山东省分行计划处职员;中国建设银行新疆区分行计划处、信贷处、风险处和人力部等副处长、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。

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副总裁等职务。1990年获新加坡国立大学法学学士学位,拥有新加坡、英格兰和威尔斯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责任公司机构与风险管理部经理。1992年获北京工业大学工业会计专业学士,2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北奥有限公司,中进会计师事务所,中瑞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经理助理、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经理。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)。

吴灵玲女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司人力资源管理部总经理。1996年毕业于中国人民大学经济信息管理系,获得学士学位;2001年毕业于北京师范大学经济系,获得管理学硕士学位。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管理部总监助理,副总监,总监。

安晔生先,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科员、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。

3、公司管人员

孙志晨先生,总裁(简历请参见董事会成员)。

张威威先生,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筹资处科员、主任科员;中国建设银行总行个人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、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任建信基金管理副总裁。

曲寅军先生,副总裁。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审计部科员、副主任科员;团委主任科员;重组改制办公室高级副经理;行长办公室高级副经理。2005年9月起就职于建信基金管理公司,历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监和公司首席战略官。2013年8月至今,任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理,并于2015年8月6日起任建信基金管理公司副总裁。

4、督察长

吴曙明先生,督察长。1992年毕业于中南工业大学管理系,获学士学位;1999年毕业于财政部财政科学研究所,获经济学硕士学位。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作;1999年7月加入中国建设银行总行,先后在营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务,曾任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职。2006年3月加入建信基金管理公司,担任董事会秘书兼综合管理部总监。2015年8月6日起任建信基金管理公司督察长。

5、本基金的基金经理

梁洪昀先生,金融工程及量化投资投资管理部总监。特许金融分析师(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、投资管理部执行总监、投资管理部总监,2009年11月5日至今任本基金的基金经理;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;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和建信深证基本面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;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发起式证券投资基金基金经理;2015年8月6日起任建信中证申万有色金属指数分级发起式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,总裁。

梁洪昀先生,金融工程及指数投资部总经理。

钟敏棣先生,固定收益投资部首席固定收益投资官。

李菁,固定收益投资部总经理

姚锦女士,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,权益投资部副总经理。

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。

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
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
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-66105799
联系人:洪渊

(二)主要人员情况

截至2015年9月末,中国工商银行资产托管部共有员工205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2015年9月,中国工商银行共托管证券投资基金496只。自2003年以来,本行连续十一年获得香港《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49项最佳托管银行大奖;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

本基金直销机构为本公司设在北京的直销柜台以及网上交易平台。

(1)直销柜台

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:许会斌
联系人:郭雅莉
电话:010-66228800

(2)网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回、定期投资等业务,具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址:www.ccbfund.cn。

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:王洪章
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:刘士余
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:田国立
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:牛锡明
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:李建红
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:常振明
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:洪崎
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
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
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
地址: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

(12)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:薛峰
客服电话:10108998
网址:www.ebscn.com

(13)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

(14)中金公司
地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27、28层
法定代表人:丁学东
客服电话:010-65051166
网址:http://www.cicc. com.cn

(15)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

(16)海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98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

(17)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

(18)中信建投证券股份有限公司
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:王常青
客户服务电话:400-8888-108
公司网址:www.csc108.com

(19)中泰证券有限公司
注册地址:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
客户服务热线:95538
网址: www.qlzq.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:矫正中
客户服务电话:0431-96688、0431-85096733
网址:www.nesc.cn

(21)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: 4006515988
网址:www.bhzq.com

(22)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:孙树明
客户服务电话:020-95575
网址:www.gf.com.cn

(23)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

(24)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

(25)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268
法定代表人:兰荣
客户服务电话: 4008888123
网址:www.xyzq.com.cn

(26)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

(27)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栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
开放式基金咨询电话:4006008008
网址: www.china-invs.cn

(28)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

(29)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:蔡咏
客户服务热线:400-8888-777
网址:www.gyzq.com.cn

(30)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

(31)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
法定代表人:杨宝林
客服电话:0532-95548
网址:www.citicssd.com

(32)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

(33)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358号大成国家大厦20楼2005室
法定代表人:许建平
客服电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com

(34)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

(35)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

(36)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

(37)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

(38)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.swyg.com

(39)浙商证券股份有限公司
办公地址:杭州杭大路1号黄龙世纪广场A6/7
法定代表人:吴承根
客服电话:0571-967777
网址:http://www.stocke.com.cn

(40)天源证券经纪有限公司
注册地址:深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼
法定代表人:林小明
客服电话:0755-33331188
网址:www.tyzq.com.cn

(41)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20层
法定代表人:邱三发
客服电话:020-88836999
网址:www.gzs.com.cn

(42)红塔证券有限责任公司概况
住所: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:0871-3577930
网址:http://www.hongtastock.com/

(43)深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人:薛峰
客户服务电话: 4006788887
网址:www.zlfund.cn、www.jjmmw.com

(44)杭州数米基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
客户服务电话: 4000766123
网址:www.fund123.cn

(45)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人:杨文斌
客户服务电话: 400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com

(46)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
客户服务电话: 4001818188
网址:www.1234567.com.cn

(47)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
客户服务电话: 4009200022

(48)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
法定代表人:凌顺平
客户服务电话:400-877-3772
网址:www.5ifund.com

(49)北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
法定代表人:蒋煜
客户服务电话:4008188866
网址:www.shengshiview.com

(50)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
法定代表人:梁越
客户服务电话:4007868868
网址:www.chtfund.com

(51)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
法定代表人:张皞
客户服务电话:400-820-2819
网址:www.chinapnr.com

(52)北京微动利投资管理有限公司
注册地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人: 梁洪军
客户服务电话:400-819-6665
网址: www.buyforyou.com.cn

(53)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
法定代表人:汪静波
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com/

(54)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
客户服务热线:020-89629066
网址:http://www.yingmi.cn/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、刘焕志

(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(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:陈熹
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
经办注册会计师:薛竞、陈熹

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2015年10月23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。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日,本报告中的财务资料未经审计。

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	429,099,639.07	93.43
	其中:股票	429,099,639.07	93.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	114,867.00	0.03
	其中:债券	114,867.00	0.03
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	29,229,367.36	6.36
7	其他各项资产	852,041.67	0.19
8	合 计	459,295,915.10	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	1,802.30	0.00
B	采矿业	1,441,766.92	0.32
C	制造业	6,448,575.13	1.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	393,957.73	0.09
E	建筑业	167,605.00	0.04
F	批发和零售业	259,877.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	724,437.50	0.16
H	住宿和餐饮业	522,909.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	694,351.00	0.15
J	金融业	-	-
K	房地产业	557,698.92	0.12
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	46,424.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	69,290.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	223,790.38	0.05
S	综合	146,454.00	0.03
	合 计	11,698,938.88	2.57

注:以上行业分类以2015年9月30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	1,001,810.36	0.22
B	采矿业	17,193,700.78	3.78
C	制造业	136,588,919.80	30.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,422,033.32	3.61
E	建筑业	18,533,257.30	4.07
F	批发和零售业	9,187,638.04	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	16,135,706.31	3.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,968,227.69	4.82
J	金融业	143,804,951.97	31.58
K	房地产业	21,447,458.75	4.71
L	租赁和商务服务业	4,208,738.40	0.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,334,295.91	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	547,576.04	0.12
R	文化、体育和娱乐业	5,933,641.27	1.30
S	综合	1,092,744.25	0.24
	合 计	417,400,700.19	91.66

注:以上行业分类以2015年9月30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	601318	中国平安	541,632	16,173,131.52	3.55
2	600036	招商银行	832,383	14,791,445.91	3.25
3	600016	民生银行	1,567,548	13,245,780.60	2.91
4	600000	浦发银行	528,703	8,792,330.89	1.93
5	601166	兴业银行	594,402	8,654,493.12	1.90
6	601988	中国银行	1,811,671	6,739,416.12	1.48
7	601288	农业银行	2,082,899	6,311,183.97	1.39
8	601766	中国中车	481,176	6,240,852.72	1.37
9	601328	交通银行	1,022,220	6,215,097.60	1.36
10	000002	万 科A	486,578	6,194,137.94	1.36

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五名股票投资明细

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	002437	誉衡药业	31,635	766,199.70	0.17
2	600259	广晟有色	17,200	583,080.00	0.13
3	002128	露天煤业	60,794	527,691.92	0.12
4	600754	锦江股份	18,100	522,909.00	0.11
5	002324	普利特	26,900	514,059.00	0.11

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	-	-
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	中期票据	-	-
7	可转债	114,867.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	114,867.00	0.03

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	110031	航信转债	900	114,867.00	0.03

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

11.8 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。

11.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

11.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

11.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

11.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

11.10.1 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。