建信中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2019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：中信银行股份有限公司
二〇一九年八月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2013年4月27日证监许可[2013]615号文核准募集。本基金的基金合同于2014年1月27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。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。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人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。

本招募说明书所载内容截止日为2019年7月26日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年6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：孙志晨
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：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

孙志晨先生，董事长，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。2005年9月出任建信基金管理公司总裁，2018年4月起任建信基金管理公司董事长。

张军红先生，董事，现任建信基金管理公司总裁。毕业于国家行政学院行政管理专业，获博士学位。历任中国建设银行总行筹资部储蓄业务处科员、副主任科员、主任科员，总行零售业务部主任科员，总行个人银行业务部个人存款处副经理、高级副经理，总行行长办公室秘书一处高级副经理级秘书、秘书、高级经理，总行投资托管服务部总经理助理、副总经理，总行投资托管业务部副总经理，总行资产托管业务部副总经理。2017年3月出任建信基金管理公司监事会主席，2018年4月起任建信基金管理公司总裁。

曹伟先生，董事，现任中国建设银行总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，总行个人存款与投资部总经理助理、副总经理。

张维义先生，董事，现任信安亚洲区总裁。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，信安北亚地区副总裁、总裁，信安亚洲区总裁。

郑树明先生，董事，现任信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席营运官。1989年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道高级审计经理，新加坡法兴资产管理董事总经理、营运总监、执行长，爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场行销总监，信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席营运官。

华淑蕊女士，董事，现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于吉林大学，获经济学博士学位。历任《长春日报》新闻中心农村工作部记者，湖南卫视《听我非常道》财经节目组运营总监，锦辉控股集团公司副总裁，锦辉精细化工有限公司总经理，吉林省信托有限责任公司业务七部副总经理、理财中心总经理、财富管理总监兼理财中心总经理，吉林省信托有限责任公司副总经理，光大证券财富管理中心总经理（MD），中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。

李全先生，独立董事，现任新华资产管理股份有限公司总裁。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裁。

史亚萍女士，独立董事，现任嘉浩控股有限公司首席运营官。1994年毕业于对外经济贸易大学，获国际金融硕士；1996年毕业于耶鲁大学研究生院，获经济学硕士。先后在标准普尔国际评级公司、英国艾比国民银行、野村证券亚洲、雷曼兄弟亚洲、中国投资有限公司、美国威灵顿资产管理有限公司、中金资本、嘉浩控股有限公司等多家金融机构担任管理职务。

邱靖之先生，独立董事，现任天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)首席合伙人。毕业于湖南大学高级工商管理专业，获EMBA学位，全国会计领军人才，中国注册会计师，注册资产评估师，高级会计师，澳洲注册会计师。1999年10月加入天职国际会计师事务所，现任首席合伙人。

2、监事会成员

马美芹女士，监事会主席，高级经济师，1984年毕业于中央财政金融学院，获学士学位，2009年获长江商学院高级管理人员工商管理硕士。1984年加入中国建设银行，历任中国建设银行总行筹资储蓄部、零售业务部、个人银行部副处长、处长、资深客户经理（技术二级），总行个人金融部副总经理，总行个人存款与投资部副总经理。2018年5月起任建信基金管理公司监事会主席。

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。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。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。

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战略研究部经理。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。曾供职于北京北奥有限公司，中进会计师事务所，中瑞华恒信会计师事务所。2004年加入中国华电集团，历任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计划财务部经理、财务部经理、企业融资部经理、机构与风险管理部经理、机构与战略研究部经理。

安晔先生，职工监事，现任建信基金管理公司信息技术总监。1995年毕业于北京工业大学计算机应用系，获得学士学位。1995年8月加入中国建设银行，历任中国建设银行北京分行信息技术部干部，信息技术管理部北京开发中心项目经理、代处长；2005年8月加入建信基金管理公司，历任基金运营部总经理助理、副总经理，信息技术部执行总经理、总经理，信息技术总监兼金融科技部总经理，信息技术总监。

严冰女士，职工监事，现任建信基金管理公司人力资源部总经理。2003年7月毕业于中国人民大学行政管理专业，获硕士学位。曾任安永华明会计师事务所人力资源部人力资源专员。2005年8月加入建信基金管理公司，历任人力资源部专员、主管、总经理助理、副总经理、总经理。

刘颖女士，职工监事，现任建信基金管理公司审计部总经理。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，英国特许公认会计师公会（ACCA）资深会员。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师，华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006年12月加入建信基金管理公司，历任监察稽核部监察稽核专员、稽核主管、资深稽核员、内控合规部副总经理、内控合规部副总经理兼内控合规部审计部（二级部）总经理、审计部总经理。

3、公司高管人员

张军红先生，总裁（简历请参见董事会成员）。

曲寅军先生，副总裁，硕士。1999年7月加入中国建设银行总行，历任审计部科员、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、专户投资部总监和首席战略官；2013年8月至2015年7月，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。2015年8月6日至2019年3月13日任我公司副总裁，2015年8月至2017年11月30日专任建信资本管理有限责任公司董事、总经理，2017年11月30日至2018年11月1日兼任建信资本管理公司董事长。2019年3月从我公司离任。

张威威先生，副总裁，硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行，从事个人零售业务，2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部，从事证券基金销售业务，任高级副经理；2005年9月加入建信基金管理公司，一直从事基金销售管理工作，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日起任我公司副总裁。

吴曙明先生，副总裁，硕士。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，先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，历任科员、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，并兼任综合管理部总经理。2015年8月6日起任我公司督察长，2016年12月23日起任我公司副总裁。

吴灵玲女士，副总裁，硕士。1996年7月至1998年9月在福建省东海经贸股份有限公司工作；2001年7月加入中国建设银行总行人力资源部，历任副主任科员、业务经理、高级经理助理；2005年9月加入建信基金管理公司，历任人力资源部总监助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016年12月23日起任我公司副总裁。

马勇先生，副总裁，硕士。1993年8月至1995年8月在江苏省机械研究设计院工作。1998年7月加入中国建设银行总行，历任副主任科员、主任科员、秘书、高级经理级秘书，高端客户部总经理助理，财富管理与私人银行部总经理助理、副总经理，建行黑龙江省分行副行长等职务。2018年8月30日加入建信基金管理有限责任公司，2018年11月13日起任副总裁；2018年11月1日起兼任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事长。

4、督察长

吴曙明先生，督察长（简历请参见公司高级管理人员）。

5、基金经理

叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理，硕士。2008年5月至2011年9月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。2011年9月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理，2012年3月21日至2016年7月20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；2013年3月28日起任建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014年1月27日起任建信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理；2015年8月26日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016年8月9日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017年4月18日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017年5月22日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年1月10日起任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年8月24日起任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年11月22日起任建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。

6、投资决策委员会成员

张军红先生，总裁。
赵乐峰先生，总裁特别助理。
梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。
梁　珉先生，资产配置与量化投资部总经理。
叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理。
张　戈先生，资产配置与量化投资部总经理助理。

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：中信银行股份有限公司（简称“中信银行”）
住所：北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人：李庆萍
成立时间：1987年4月20日
组织形式：股份有限公司
注册资本：489.35亿元人民币
存续期间：持续经营
批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125号
联系人：中信银行资产托管部
联系电话：4006800000
传真：010-85230024
客服电话：95558
网址：bank.ecitic.com

经营范围：保险兼业代理业务（有效期至2020年09月09日）；吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。（企业依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

中信银行（601998.SH，0998.HK）成立于1987年，是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外，为中国经济建设做出了积极贡献。2007年4月，本行实现在上海证券交易所和香港联合交易所A+H股同步上市。

本行以建设最佳综合金融服务企业为发展愿景，充分发挥中信集团金融与实业并举的独特竞争优势，坚持“以客为尊”，秉承“平安中信、合规经营、科技立行、服务实体、市场导向、创造价值”的经营理念，向企业客户和机构客户提供公司银行业务、国际业务、金融市场业务、机构业务、投资银行业务、保理业务、托管业务等综合金融解决方案，向个人客户提供零售银行、信用卡、消费金融、财富管理、私人银行、出国金融、电子银行等多元化金融产品及服务，全方位满足企业、机构及个人客户的综合金融服务需求。

截至2018年末，本行在国内146个大中城市设有1,410家营业网点，同时在境内外下设6家附属公司，包括中信国际金融控股有限公司、信银（香港）投资有限公司、中信金融租赁有限公司、浙江临安中信村镇银行股份有限公司、中信百信银行股份有限公司和阿尔金银行。其中，中信国际金融控股有限公司子公司中信银行（国际）有限公司，在香港、澳门、纽约、洛杉矶、新加坡和中国内地设有38家营业网点。信银（香港）投资有限公司在香港和中国内地设有3家子公司。中信百信银行股份有限公司为本行与百度公司发起设立的国内首家具有独立法人资格的直销银行。阿尔金银行在哈萨克斯坦设有6家营业网点和1个私人银行中心。

30多年来，本行坚持服务实体经济，稳健经营，与时俱进。经过30余年的发展，本行已成为一家总资产规模超6万亿元、员工人数近6万名，具有强大综合实力和品牌竞争力的金融集团。2018年，本行在英国《银行家》杂志“全球银行品牌500强排行榜”中排名第24位；本行一级资本在英国《银行家》杂志“世界1000家银行排名”中排名第27位。

（二）主要人员情况

方合英先生，中信银行执行董事，行长兼财务总监。方先生于2018年9月加入本行董事会。方先生自2014年8月起任本行党委委员，2014年11月起任本行副行长，2017年1月起兼任本行财务总监，2019年2月起任本行党委副书记。方先生现同时担任信银（香港）投资有限公司、中信银行（国际）有限公司及中信国际金融控股有限公司董事。此前，方先生于2013年5月至2015年1月任本行金融市场业务总监，2014年5月至2014年9月兼任本行杭州分行党委书记、行长；2007年3月至2013年5月任本行苏州分行党委书记、行长；2003年9月至2007年3月历任本行杭州分行党委委员、行长助理、副行长；1996年12月至2003年9月在本行杭州分行工作，历任信贷部科长、副总经理，富阳支行行长、党组书记，国际结算部副总经理，零售业务部副总经理、总经理；1996年7月至1996年12月任浙江省发展银行杭州城东办事处副主任；1992年12月至1996年7月在浙江银行学校实验城市信用社信贷部工作，历任信贷员、经理、总经理助理；1991年7月至1992年12月在浙江银行学校任教师。方先生为高级经济师，毕业于北京大学，获高级管理人员工商管理硕士学位，拥有二十余年中国银行业从业经验。

杨毓先生，中信银行副行长，分管托管业务。杨先生自2015年7月起任本行党委委员，2015年12月起任本行副行长。此前，杨先生2011年3月至2015年6月任中国建设银行江苏省分行党委书记、行长；2006年7月至2011年2月任中国建设银行河北省分行党委书记、行长；1982年8月至2006年6月在中国建设银行河南省分行工作，历任计财处副处长、信阳分行副行长、党委委员，计财处处长，郑州市铁道分行党委书记、行长，郑州分行党委书记、行长，河南省分行党委副书记、副行长（主持工作）。杨先生为高级经济师，研究生学历，管理学博士。

杨璋琪先生，中信银行资产托管部副总经理（主持工作），硕士研究生学历。杨先生2018年1月至2019年3月，任本行金融同业部副总经理；2015年5月至2018年1月，任本行长春分行行长；2013年4月至2015年5月，任本行机构业务部总经理助理；1996年7月至2013年4月，就职于本行北京分行（原总行营业部），历任支行行长、投资银行部总经理、贸易金融部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

2004年8月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2019年半年末，中信银行托管140只公开募集证券投资基金，以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，托管总规模达到8.79万亿元人民币。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

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直销柜台以及网上交易平台。

（1）直销柜台
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：孙志晨
联系人：郭雅莉
电话：010-66228800

（2）网上交易平台

投资者可以通过本公司网上交易平台办理基金的认购、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、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：田国立
客服电话：95533
网址：www.ccb.com

（2）中国农业银行股份有限公司
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：周慕冰
客户服务电话：95599
公司网址：www.abchina.com

（3）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：彭纯
客服电话：95559
网址：www.95559.com.cn

（4）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：李庆萍
客服电话：95558
网址：bank.ecitic.com

（5）中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人：李晓鹏
客户服务电话：95595
公司网站：www.cebbank.com

（6）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：洪琦
传真：010-83914283
客户服务电话：95568
公司网站：www.cmbc.com.cn

（7）渤海银行股份有限公司
注册地址：天津市河西区马场道201-205号
办公地址：天津市河东区海河东路218号
法定代表人：李伏安
客服电话：95541
网址：www.cbhb.com.cn

（8）宁波银行股份有限公司
注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人：陆华裕
客户客服电话：95574
网址：www.nbcb.com.cn

（9）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：高国富
客服电话：95528
网址：www.spdb.com.cn

（10）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

（11）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人：马勇
客户服务热线：400-166-1188
网址：http://www.jrj.com.cn/

（12）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
网址：www. Licaike.com

（13）上海挖财基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：冷飞
客户服务热线：021-50810673
网址：http:// www.wacaijijin.com

（14）北京百度百盈基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101
法定代表人：张旭阳
客户服务热线：95055-9
网址：https://www.baiyingfund.com/

（15）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/

（16）深圳众禄基金销售股份有限公司
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

（17）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

（18）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

（19）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
法定代表人：陈柏青
客户服务电话：4000766123
网址：www.fund123.cn

（20）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

（21）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：李兴春
客户服务热线：400-921-7755
网址：www.leadbank.com.cn

（22）嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
法定代表人：赵学军
客户服务热线：400-021-8850
网址：https://www.harvestwm.cn

（23）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人：刘汉青
客户服务热线：95177
网址：http://www.snjijin.com

（24）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：周斌
客户服务电话：4007868868
网址：www.chtfund.com

（25）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王伟刚
客户服务热线：010-56282140
网址：www.hcjijin.com

（26）北京晟视天下基金销售有限公司
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

（27）北京唐鼎耀华基金销售有限公司
地址：北京市朝阳区建国门外大街19号国际大厦A座1504/1505室。
法定代表人：张冠宇
客户服务热线：400-819-9868
网址： http://www.tdyhfund.com/

（28）天津国美基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层
法定代表人：丁东华
客户服务电话：400-111-0889
网址：www.gomefund.com

（29）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人： 李昭琛
客户服务热线：010-62675369
网址：https://trade.xincai.com/web/promote

（30）上海万得基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人： 王廷富
客户服务电话：400-821-0203
网址：www.windmoney.com.cn

（31）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：张晶
客户服务电话：400-820-2819
网址：www.chinapnr.com

（32）北京微动利基金销售有限公司
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：季长军
客户服务电话：400-819-6665
网址：www.buyforyou.com.cn

（33）北京虹点基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人：郑毓栋
客户服务电话：400-618-0707
网址：http://www.hongdianfund.com/

（34）深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
法定代表人：刘鹏宇
客户服务电话：0755-83999913
网址：http://www.fujiwealth.cn/

（35）上海陆金所基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人：王之光
客户服务电话：400-821-9031
网址： www.lufunds.com /

（36）大泰金石基金销售有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
法定代表人：姚杨
客户服务电话：400-928-2266
网址：https://www.dtfunds.com/

（37）珠海盈米基金销售有限公司
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
客户服务电话：020-89629066
网址：http://www.yingmi.cn/

（38）奕丰金融基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
法定代表人：TEO WEE HOWE
客户服务热线：400-684-0500
网址：https:// www.ifastps.com.cn

（39）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
客户服务热线：4000-618-518
网址：https://danjuanapp.com/

（40）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
法定代表人：毛淮平
客户服务热线：400-817-5666
网址：https://www.amcfortune.com

（41）深圳前海微众银行股份有限公司
注册地址：深圳市南山区桃园路田厦国际中心A36楼
法定代表人：顾敏
客户服务热线：400-999-8800
网址：www.webank.com

（42）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
客户服务热线：4008888123
网址：www.xyzq.com.cn

（43）中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人： 丁学东
客户服务热线：400-910-1166
网址：www.cicc.com.cn

（44）北京植信基金销售有限公司
法定代表人：于龙
地址：北京朝阳区四惠盛世龙源国食苑10号楼
客户服务电话： 4006-802-123
网址：www.zhixin-inv.com

（45）平安证券股份有限公司
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：何之江
客服热线：4008866338
网址：stock.pingan.com

（46）上海长量基金销售投资顾问有限公司
地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
电话：400-820-2899
网址：http://www.erichfund.com/websiteII/html/index.html

（47）中信期货有限公司
地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层
法定代表人：张皓
客服电话：400 9908 826
网址：http://www.citicsf.com

（48）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：曹宏
客服电话：0755-82288968
网址：www.cc168.com.cn

（49）华泰证券股份有限公司
地址：南京市江东中路228号
法定代表人：周易
网址：www.htsc.com.cn

（50）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：张佑君
客服电话：95558
网址：www.citics.com

（51）华融证券股份有限公司
法定代表人：祝献忠
地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦11至18层
客服电话：95390
网址：http://www.hrsec.com.cn/main/index/index.shtml?0

（52）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：霍达
客户服务电话：95565、4008888111
网址：www.newone.com.cn

（53）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：陈共炎
客户服务电话：4008-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn

（54）中信（山东）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：姜晓林
客服电话：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

（55）中泰证券有限公司
注册地址：山东省济南市经十路128号
法定代表人：李玮
电话：0531-82093699
客户服务热线：95538
网址： www.qlzq.com.cn

（56）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

（57）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.sywg.com

（58）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：李琦
客服电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

（59）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：胡伏云
客服电话：020-88836999
网址：www.gzs.com.cn

（60）东方证券股份有限公司
地址：上海市中山南路318号东方国际金融广场21-29层
法定代表人：潘鑫军
客服电话：95503
网址：http://www.dfzq.com.cn/dfzq/index.jsp

（61）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

（62）江海证券有限公司
地址：哈尔滨市香坊区赣水路 5 6 号
法定代表人：赵洪波
客户服务电话：400-666-2288
网址：http://www.jhzq.com.cn/

（63）东北证券股份有限公司
地址：长春市生态大街6666号
法定代表人：李福春
客户服务电话：95360
网址：www.nesc.cn

（64）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：王常青
客户服务电话：400-8888-108
公司网址：www.csc108.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。

（二）登记机构
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
法定代表人：孙志晨
联系人：郑文广
电话：010-66228888

（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：刘焕志
电话：010－52682888
传真：010－52682999
经办律师：徐建军、刘焕志

（四）审计基金资产的会计师事务所
普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室
办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
电话：021-2323 8888
执行事务合伙人：李丹
经办注册会计师：许康玮、沈兆杰
联系人：沈兆杰

四、基金的名称

建信中证500指数增强型证券投资基金。

五、基金的类型

股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为不低于90%，其中投资于中证500成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货以套期保值为目的，股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金采用指数增强型投资策略，以中证500指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、资产配置策略

本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制与目标指数的跟踪误差的前提下，力争获得与所承担的市场风险相匹配的超额收益。

2、股票投资组合策略

本基金将参考标的指数成份股在指数中的比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。

（1）指数增强策略

1）成份股权重优化增强策略。本基金在严格控制跟踪误差、跟踪偏离度的前提下，进行宏微观经济研究，综合运用GARP策略、建信多因子选股模型等量化投资技术，深入分析成份股的估值水平、公司业绩增长情况、资产盈利水平和财务状况及股票市场交易情况等，在考虑交易成本、流动性、投资比例限制等因素并结合基金管理人对市场研判后，将适度超配价值被低估的正超额收益预期的成份股以及低配或剔除价值被高估的负超额收益预期的成份股。

2）非成份股优选增强策略。本基金将依托公司投研团队的研究成果，综合采用数量化投资技术和深入调查研究相结合的研究方法，自下而上精选部分成份股以外的股票作为增强股票库，力争在最佳时机选择增强股票库中估值合理、基本面优良且具有持续成长潜力的股票进行适度的优化配置，以获取超额收益。

A.行业精选

各行业之间的预期收益、风险及其相关性是制定行业配置决策时的根本因素，本基金通过对各行业竞争结构、行业成长空间、行业周期性及景气程度、行业主要产品或服务的供需情况、上市公司代表性、行业整体相对估值水平等因素或指标的综合评估，精选行业景气周期处于拐点或者行业景气度处于上升阶段的相关产业，在行业内部进行个股选择。

B.个股精选

a.价值分析

价值分析包括公司的品质分析及估值水平分析。健康的品质是公司未来持续成长的良好基础，也可以提高公司的抗风险能力，因此本基金对上市公司的价值分析首先将分析公司的品质，着重对公司进行财务分析，考察每股收益率（EPS）、净资产收益率（ROE）、市盈率（PE）、市净率（PB）、市销率（PS）等指标，另外将根据上市公司所处行业景气度及其在行业中的竞争地位等多方面的因素进行综合评估，挖掘上市公司的投资价值。

b.成长性分析

对于成长性分析，本基金将重点关注企业的持续增长潜力，对公司内部因素进行深刻理解和分析，挖掘上市公司保持高成长性和业绩增长的驱动因素（如公司治理结构、商业盈利模式、核心竞争力等），深入分析这些驱动因素是否具有可持续性，从而优选出竞争力优良、成长潜力高于平均水平的上市公司。本基金选取的成长性指标主要包括：销售收入增长率、每股收益增长率、净利润增长率、主营业务增长率、PEG等。

3）其他增强策略。本基金将及时把握其他盈利机会，提升投资组合的有效性。

（2）组合调整策略

1）定期调整

本基金将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整，达到有效控制跟踪偏离度和跟踪误差的目的。

2）不定期调整

A.与指数相关的调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配、各类限售股获得流通权等原因而需要进行成份股权重调整时，本基金将参考标的指数最新权重比例，进行相应调整。

B.限制性调整

根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，当基金投资组合中按标的指数权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时，本基金将对其进行实时的被动性卖出调整，并相应地对其他资产或个股进行微调，以保证基金合法规范运行。

C.根据申购和赎回情况调整

本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，制定交易策略以应对基金的申购赎回，从而有效跟踪标的指数。

D.其他调整

根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对该部分股票投资组合进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。

（3）跟踪误差、跟踪偏离度控制策略

本基金为指数增强型基金，将通过适度的主动投资获取超越标的指数的超额收益，同时也将因承担相应的主动风险而导致较大的跟踪误差。

因此，本基金将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，实现有效控制跟踪误差。

3、债券投资策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下管理策略：

（1）久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

（2）收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

（3）债券类属配置策略

根据国债、金融债、公司债、可转债、资产支持证券等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被相对高估的类属债券，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对公司债、可转债、资产支持证券等新品种的投资，主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和管理，获取适当的超额收益。

（4）个券精选策略

个券精选策略指基于对信用质量、期限和流动性等因素的考察，重点关注具有以下特征的债券：较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善、期权价值被低估，或者属于创新品种而价值尚未被市场充分发现。通过深入研究，发掘出这些具有较高当期收益率或者较高升值潜力的债券，可为投资者创造超额投资回报。

4、股指期货投资策略

本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。本基金将采取以下步骤开展组合资产的套期保值。

（1）确定套期保值目标现货组合、期限以及交易方向

套期保值的目标现货组合是指需要进行套期保值的股票资产，这部分资产可以是基金持有或者将要持有的所有股票资产，也可以是部分股票资产。本基金将通过对国内外宏观经济运行趋势、财政以及货币政策、市场资金供需状况、股票市场估值水平、固定收益类资产收益水平等因素进行分析，结合对股票头寸的流动性、风险程度等因素的测评，以确定需要进行套期保值的股票组合和套期保值期限。

根据期货合约的交易方向不同，套期保值分为两类：买入套期保值、卖出套期保值。买入套期保值（又称多头套期保值）是在期货市场买入期货合约，用期货市场多头对冲现货市场上行风险，主要用于降低基金建仓期股票价格大幅上涨的风险；卖出套期保值（又称空头套期保值）是在期货市场中卖出期货合约，用期货市场空头对冲现货市场的下行风险，以规避基金运作期间股票价格下跌的风险。本基金将根据实际需要确定交易方向。

（2）选择股指期货合约开仓种类

在期货合约选择方面，本基金将遵循品种相同或相近以及月份相同或相近的原则。如果市场上存在以不同指数为标的的股票指数期货，则将选择与目标现货组合相关性较强的指数为标的的股票指数期货进行套期保值。本基金将综合权衡所承担的基差风险、合约的流动性以及展期成本等因素，确定最有利的合约或者合约组合进行开仓。

（3）根据最优套期保值比例确定期货头寸

本基金将通过最优套期保值比例来确定期货头寸，以当前投资组合和目标投资组合的差与期货标的指数之间的β系数作为最优套期保值比例。

（4）初始套期保值组合的构建及调整

计算得到最优的套期保值比例后，本基金将其转换为具体的期货合约数，计算得到合约数量后，本基金根据选择的股指期货合约开仓种类构建套期保值组合。

（5）合约的展期

当标的指数期货存在两种及两种以上近月合约时，本基金将利用各类近期合约的择机转换策略从而获取一定的套保收益，原则上本基金将以基差的大小程度作为合约转换的主要依据。

（6）动态调整

本基金将基于现货组合市值、股票组合β值的变动情况，动态确定套期保值过程中的最优套期保值比例，并适时对组合中的期货头寸进行调整。

因此本基金将根据目标资产β值的稳定性和调整成本，设定一定的阀值，当套期保值比例变化率超过该阀值时，调整期货合约数，以达到较好的套期保值效果。

5、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

6、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

7、其他金融衍生产品的投资策略

本基金将根据公募基金的特点和要求，结合该类金融衍生产品的特征，在进行充分风险控制和遵守法律法规的前提下，制定合适的投资策略，以控制并降低投资组合风险，提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

二、投资决策依据和程序投资决策体制和流程

1、投资决策依据

（1）国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定。

（2）宏观经济发展环境、证券市场走势。

2、投资管理程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理体制。

（1）研究分析

研究部依托公司研究平台，整合外部信息及外部研究力量的研究成果进行指数跟踪、成份股公司及非成份股公司行为等信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策

投资决策委员会根据法律法规、基金合同、研究报告以及基金监控指标和调整指标等，召开投资决策会议，确定基金投资组合是否需要进行调整以更好地跟踪标的指数，审批总体投资方案及重大投资事项。

基金经理根据标的指数，结合研究报告，构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下，基金经理将根据投资决策委员会确定的投资组合调整方案采取适当的方法调整组合，以降低交易成本、控制投资风险，同时适当进行增强投资。对于超出权限范围的投资，基金经理按照公司权限审批流程，提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

（3）交易执行

交易部接收到基金经理下达的交易指令后，首先应对指令予以审核，然后具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或者不合规的，交易部可以暂不执行指令，并及时通知基金经理或相关人员。

交易部应根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况及对该项交易的判断和建议，以便基金经理及时调整交易策略。

（4）投资回顾

风险管理部定期对基金的绩效进行评估，并对基金的跟踪误差、跟踪偏离度、信息比率、流动性风险等进行评估。同时，评估信息将以绩效评估报告的形式及时反馈至投资决策委员会、监察稽核部、投资管理部等相关部门，为制定和调整投资策略、评估风险水平提供依据。

九、基金的业绩比较基准

95%×中证500指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税前）。

中证500指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体情况。

如果指数编制单位变更或停止中证500指数的编制、发布或授权，或中证500指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致中证500指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票指数增强型基金，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，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月15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2019年6月30日，本报告中的财务资料未经审计。

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	5,304,389,978.89	88.29
	其中：股票	5,304,389,978.89	88.29
2	基金投资	–	0.00
3	固定收益投资	10,117.00	0.00
	其中：债券	10,117.00	0.00
	资产支持证券	–	0.00
4	贵金属投资	–	0.00
5	金融衍生品投资	–	0.00
6	买入返售金融资产	–	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	669,359,036.56	11.14
8	其他资产	34,103,750.03	0.57
9	合计	6,007,862,882.48	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末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	39,049,279.32	0.66
B	采矿业	204,927,072.45	3.44
C	制造业	2,131,827,306.74	35.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	153,734,736.96	2.58
E	建筑业	61,151,820.34	1.03
F	批发和零售业	186,797,167.60	3.14
G	交通运输、仓储和邮政业	142,275,870.65	2.39
H	住宿和餐饮业	18,247,768.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	423,113,057.45	7.11
J	金融业	239,738,924.20	4.03
K	房地产业	193,509,612.05	3.25
L	租赁和商务服务业	72,549,122.42	1.22
M	科学研究和技术服务业	1,912,755.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	21,850,374.00	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	–	0.00
P	教育	14,126,247.80	0.24
Q	卫生和社会工作	3,065,214.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	121,363,860.48	2.04
S	综合	63,977,638.29	1.08
	合计	4,093,217,827.75	68.78

注：以上行业分类以2019年6月30日的证监会行业分类标准为依据。

（2）报告期末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	1,187,901.00	0.02
B	采矿业	13,918,563.25	0.23
C	制造业	744,050,434.59	12.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,979,603.00	0.32
E	建筑业	4,408,420.00	0.07
F	批发和零售业	35,310,056.80	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	73,190,946.89	1.23
H	住宿和餐饮业	6,831,594.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	86,963,274.02	1.46
J	金融业	84,778,518.49	1.42
K	房地产业	49,550,745.86	0.83
L	租赁和商务服务业	24,834,157.41	0.42
M	科学研究和技术服务业	19,765,203.01	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	2,064,840.10	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	–	0.00
P	教育	–	0.00
Q	卫生和社会工作	15,812,540.10	0.27
R	文化、体育和娱乐业	27,174,672.62	0.46
S	综合	2,350,680.00	0.04
	合计	1,211,172,151.14	20.35

注：以上行业分类以2019年6月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

（3）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

（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	000027	深圳能源	10,130,226	62,807,401.20	1.06
2	000623	吉林敖东	3,736,623	61,243,250.97	1.03
3	300088	长信科技	10,185,978	51,541,048.68	0.87
4	000999	华润三九	1,628,442	47,778,488.28	0.80
5	002797	第一创业	7,236,800	45,881,312.00	0.77
6	000156	华数传媒	3,926,429	43,229,983.29	0.73
7	000997	新大陆	2,544,302	42,973,260.78	0.72
8	601717	郑煤机	6,661,987	38,039,945.77	0.64
9	002299	圣农发展	1,492,776	37,797,088.32	0.64
10	002500	山西证券	4,651,040	37,673,424.00	0.63

（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	000596	古井贡酒	305,531	36,208,478.81	0.61
2	601166	兴业银行	1,815,779	33,210,597.91	0.56
3	600012	皖通高速	4,709,526	29,811,299.58	0.50
4	000895	双汇发展	1,043,100	25,962,759.00	0.44
5	000059	华锦股份	4,052,400	25,935,360.00	0.44

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	10,117.00	0.00
	其中：政策性金融债	10,117.00	0.00
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	10,117.00	0.00

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	108604	国开1805	100	10,117.00	0.00

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

无。

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贵金属投资明细

无。

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

无。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1907	IC1907	165	161,911,200.00	3,609,902.74	–
公允价值变动总额合计(元)					3,609,902.74
股指期货投资本期收益(元)					-26,255,671.88
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-10,077,146.45

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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

无。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

（3）本期国债期货投资评价

无。

11、投资组合报告附注

（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。

（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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	22,463,715.88
2	应收证券清算款	335,642.91
3	应收股利	–
4	应收利息	176,649.62
5	应收申购款	11,127,741.62
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	34,103,750.03

（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可转换债券。

（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

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

无。

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

无。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2019年6月30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。

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

1、中证500A

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
基金合同生效之日—2014年12月31日	37.10%	1.01%	35.08%	1.16%	2.02%	-0.15%
2015年1月1日—2015年12月31日	64.41%	2.84%	41.26%	2.68%	23.15%	0.16%
2016年1月1日–2016年12月31日	1.16%	1.82%	-16.77%	1.81%	17.93%	0.01%
2017年1月1日–2017年12月31日	3.21%	0.89%	-0.13%	0.88%	3.34%	0.01%
2018年1月1日–2018年12月31日	-31.39%	1.46%	-31.85%	1.43%	0.46%	0.03%
2019年1月1日–2019年6月30日	20.42%	1.62%	17.87%	1.70%	2.55%	-0.08%
基金合同生效之日—2019年6月30日	94.44%	1.74%	27.42%	1.71%	67.02%	0.03%

2、中证500C

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
基金合同生效之日—2018年12月31日	-32.24%	1.49%	-30.77%	1.46%	-1.47%	0.03%
2019年1月1日–2019年6月30日	20.09%	1.62%	17.87%	1.70%	2.22%	-0.08%
基金合同生效之日—2019年6月30日	-18.63%	1.55%	-18.39%	1.56%	-0.24%	-0.01%

十三、基金的费用概览

（一）申购费与赎回费

1、申购费率

（1）A类基金份额申购费用

投资人在申购本基金A类基金份额时，收取申购费用；投资人可以多次申购本基金，申购费用按每日累计申购金额确定申购费率，以每笔申购申请单独计算费用。

本基金A类基金份额的申购费率如下表所示：

申购金额(M)	申购费率
M<100万元	1.5%
100万元≤M<500万元	1.0%
M≥500万元	每笔1,000元

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）C类基金份额申购费

本基金C类基金份额申购费率为0。

2、赎回费率

（1）A类基金份额赎回费

本基金A类基金份额的具体赎回费率如下表所示：

持有期限(Y)	赎回费率
持有期<7日	1.5%
7日≤持有期<1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

注：1年指365天。

赎回费用由赎回人承担，对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对持有期长于7日的基金份额所收取的赎回费，赎回费的25%归入基金财产，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。

（2）C类基金份额赎回费

本基金C类基金份额的赎回费率如下：

持有期限(Y)	赎回费率
Y〈 7 日	1.5%
7 日 ≤ Y〈 30 日	0.5%
Y ≥ 30日	0

赎回费用全额进入基金财产。

3、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的2日前在至少一家中国证监会指定的媒体及基金管理人网站公告。

（二）申购份数与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

申购本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

净申购金额 =申购金额/（1＋申购费率）
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份数=净申购金额/申购当日基金份额净值

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者投资5万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为1.05元，则可得到的申购份额为：

净申购金额=50000/（1+1.5%）=49261.08元
申购费用=50000-49261.08=738.92元
申购份额=49261.08/1.05=46915.31份

即：投资者投资5万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为1.05元，则其可得到46915.31份基金份额。

2、赎回净额的计算

基金份额持有人在赎回本基金时缴纳赎回费，基金份额持有人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额×赎回费率
净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回净额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者赎回本基金10000份基金份额，赎回适用费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值为1.148元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额＝10000×1.148＝11480元
赎回费用＝11480×0.5%＝57.40元
净赎回金额＝11480－57.40＝11422.60元

即：投资者赎回本基金10000份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为1.148元，则可得到的净赎回金额为11422.60元。

3、基金份额净值计算

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日发行在外的基金份额总数。基金份额净值单位为人民币元，计算结果保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（三）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》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、基金的指数许可使用基点费；
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（四）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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1%÷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款指令，基金托管人复核后于次月前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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷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款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.5% 。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.5% ÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为前一日C类基金份额基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人依据与基金管理人约定的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

4、基金的指数许可使用基点费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数许可使用基点费。指数许可使用基点费在通常情况下按前一日的基金资产净值的0.016%的年费率计提。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，根据基金管理人出具的付款指令按季支付。

计算方法如下：

H=E×0.016%÷当年天数
H 为每日应付的指数许可使用基点费
E 为前一日基金资产净值

指数许可使用基点费的收取下限为每季度人民币5万元。

由于中证指数有限公司保留变更或提高指数许可使用基点费的权利，如果指数许可使用基点费的计算方法、费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用基点费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒体进行公告。

上述“一、基金费用的种类中第4—8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。

（五）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；
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。

（六）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

1、更新了“第三部分：基金管理人”的“基金管理人概况”和“主要人员情况”中监事的信息。
2、更新了“第四部分：基金托管人”的基本情况及相关业务经营情况。
3、在“第五部分：相关服务机构”中，更新了基金份额登记机构的信息。
4、更新了“第九部分：基金的投资”，更新了基金投资组合报告，并经基金托管人复核。
5、更新了“第十部分：基金的业绩”，并经基金托管人复核。
6、更新了“第二十二部分：其他应披露事项”，添加了期间涉及本基金和基金管理人的相关临时公告。

建信基金管理有限责任公司
二〇一九年八月