

建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金(A 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2020 年 8 月 28 日

送出日期：2020 年 8 月 31 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	建信央视财经 50 指数	基金代码	165312
下属基金简称	建信央视财经 50 指数 A	下属基金代码	150123
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	基金托管人	交通银行股份有限公司
基金合同生效日	2013 年 3 月 28 日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2013 年 5 月 20 日
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	叶乐天	开始担任本基金基金经理的日期	2013 年 3 月 28 日
		证券从业日期	2008 年 5 月 12 日
其他	场内简称：建信 50A		

注：本基金为分级基金子份额，只上市交易，不接受申购与赎回。

二、基金投资与净值表现

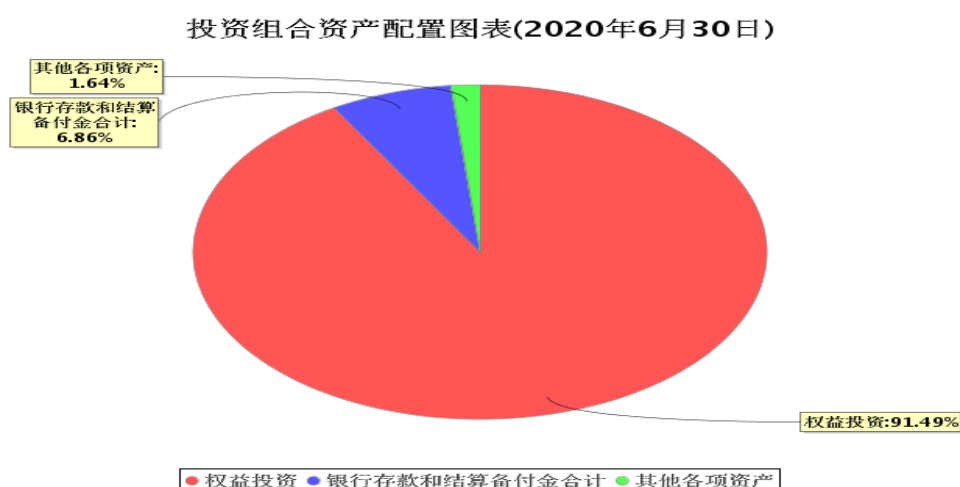
(一) 投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》第十三部分了解详细情况

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，实现对央视财经 50 指数的有效跟踪。
投资范围	本基金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（包括央视财经 50 指数成份股、备选成份股、一级市场初次发行或增发的新股）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等）、货币市场工具、股指期货、权证以及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。 本基金投资于股票的资产不低于基金资产净值的 85%，其中投资于央视财经 50 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；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。 如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

主要投资策略	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，并原则上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%。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，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	95%×央视 50 价格指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	建信央视 50A 份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图无。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

注：场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	1.00%
托管费	0.22%
其他费用	基金合同生效后与基金相关的信息披露费用，基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费，基金份额持有人大会费用，基金的证券交易费用，基金的银行汇划费用，基金上市费和年费，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。指数许可使用费率 0.05%，季度收取下限为人民币 5 万元。

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、杠杆机制风险

本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，建信央视 50A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；建信央视 50B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

由于建信央视 50B 份额内含杠杆机制的设计，建信央视 50B 份额参考净值的变动幅度将大于建信央视 50 份额净值和建信央视 50A 份额参考净值的变动幅度，即建信央视 50B 份额参考净值变动的波动性要高于其他两类份额。

2、折/溢价交易风险

建信央视 50A 份额与建信央视 50B 份额上市交易后，由于受到市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额参考净值可能出现偏离并出现折/溢价风险。尽管份额配对转换套利机制的设计已将建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额的折/溢价风险降至较低水平，但是该制度不能完全规避该风险的存在。

3、风险收益特征变化风险

由于基金份额折算的设计，在建信央视 50 份额净值大于或等于 2.0000 元后，本基金将进行份额不定期份额折算。原建信央视 50B 份额持有人将会获得一定比例的建信央视 50 份额，因此原建信央视 50B 份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于基金份额折算的设计，在建信央视 50B 份额参考净值小于或等于 0.2500 元后，本基金将进行份额不定期份额折算。原建信央视 50A 份额持有人将会获得一定比例的建信央视 50 份额，因此，原建信央视 50A 份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于对建信央视 50A 基金份额在会计年度初，把约定收益折算为场内建信央视 50 份额的设计，使原建信央视 50A 份额持有人将会获得一定比例的建信央视 50 份额，因此，原建信央视 50A 份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

4、份额折算风险

(1) 在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失

场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为 1 份），整数位以后部分采取截位法，余额计入基金财产。因此，在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

(2) 份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险

新增份额可能面临无法赎回的风险是指在场内购买建信央视 50A 份额或建信央视 50B 份额的一部分投资者可能面临的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证券监督管理委员会颁发的基金代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以允许投资者赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金代销资格的证券公司购买建信央视 50A 份额或建信央视 50B 份额，在其参与份额折算后，则折算新增的建信央视 50 份额并不能被赎回。此风险需要引起投资者注意，投资者可以选择在份额折算前将建信央视 50A 份额或建信央视 50B 份额卖出，或者将新增的建信央视 50 份额通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

5、份额配对转换业务中存在的风险

基金合同生效后，在建信央视 50 份额、建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额的存续期内，基金管理人将根据基金合同的约定办理建信央视财经 50 份额与建信央视 50A 份额、建信央视 50B 份额之间份额配对转换。一方面，份额配对转换业务的办理可能改变建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额的市场供求关系，从而可能影响其交易价格；另一方面，份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形，投资者的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

(二) 重要提示

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作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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人官方网站 [www.ccbfund.cn] [客服电话：400-81-95533]

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料