建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2021 年 8 月 17 日

送出日期：2021 年 8 月 18 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	建信港股通恒生中国企业 ETF	**基金代码**	513680	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	**基金托管人**	兴业银行股份有限公司	
基金合同生效日	2018 年 12 月 13 日	**上市交易所及上市日期**	上海证券交易所	2019 年 1 月 21 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	龚佳佳	**开始担任本基金基金经理的日期**	2019 年 2 月 22 日	
		证券从业日期	2012 年 7 月 9 日	
基金经理	吕鑫	**开始担任本基金基金经理的日期**	2021 年 08 月 11 日	
		证券从业日期	2016 年 07 月 11 日	
基金经理	薛锐	**开始担任本基金基金经理的日期**	2021 年 08 月 13 日	
		证券从业日期	2016 年 06 月 13 日	
其他	场内简称：建信 H 股 一级市场申赎代码：513681；二级市场交易代码：513680			

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

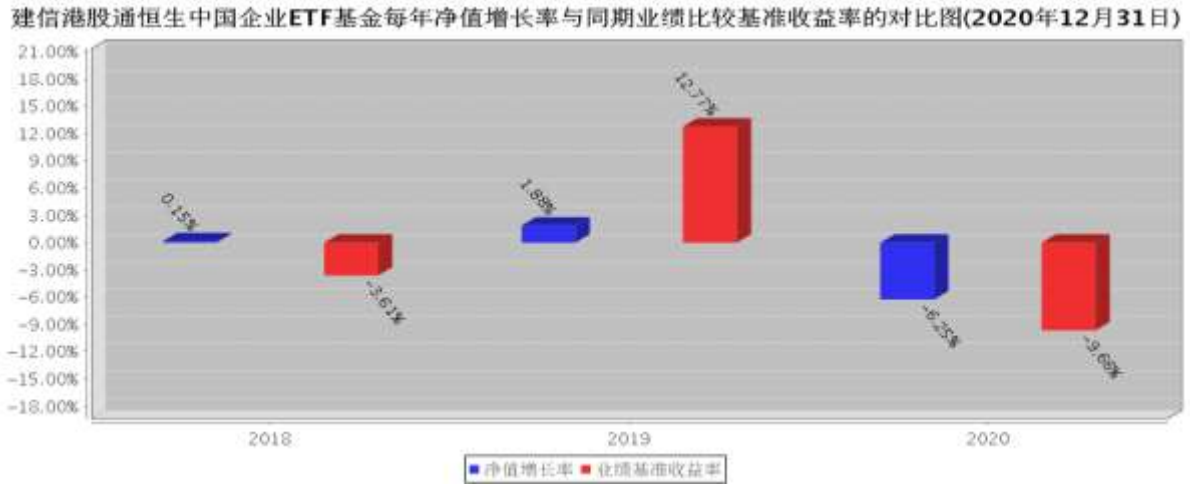
请投资者阅读《招募说明书》第十一部分了解详细情况

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现基金的投资目标，本基金可投资于债券、货币市场工具、资产支持证券、银行存款、权证、股指期货、债券回购、同业存单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）。 基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。 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。

主要投资策略	本基金主要采用指数复制策略及替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金主要采用指数复制策略，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。对于出现特殊情况（比如流动性不足、成份股不在港股通标的范围内、因法律法规原因个别成份股被限制投资等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可通过投资非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金固定收益类证券和货币市场工具的投资组合。本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股。 由于本基金申购赎回采取现金替代的方式，考虑到申购赎回资金流动冲击以及资金划转等操作问题，本基金将会保留一定的现金头寸用于满足赎回及证券交收要求。现金头寸的增加将导致跟踪误差的扩大，因此基金管理人将通过投资以标的指数为基础资产的衍生产品以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	经估值汇率调整的恒生中国企业指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪恒生中国企业指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金主要投资香港联合交易所上市的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

(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



注:基金的过往业绩不代表未来表现。
基金合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

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：

费用类型	份额（S）或金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
申购费（前收费）	-	0	投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过0.5%的标准收取佣金
赎回费	-	0	投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过0.5%的标准收取佣金

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	0.50%
托管费	0.10%
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、诉讼费和仲裁费，持有人大会费用，证券/期货的开户、交易、清算、结算登记等实际发生的其他相关费用，银行汇划费用、账户开户及维护费用，上市费及年费，基金收益分配中发生的费用，因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用，基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、及预

	扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）（简称“税收”），及基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等，代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用，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0.04%/年，若一个季度累计计提指数使用费金额小于指数使用许可协议规定的费用下限，则基金于季度末最后一日补提指数使用费至指数使用许可协议规定的费用下限

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、指数下跌风险

本基金采取指数化投资策略，被动跟踪标的指数。标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

2、跟踪偏离风险

标的指数调整成份股或变更编制方法，标的指数成份股发生送配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，成份股派发现金红利、成份股增发、送配等所获收益，成份股停牌、摘牌或流动性差等，基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等费用的存在，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，受到最低买入股数的限制，缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大，基金申购与赎回带来的现金变动，指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

另外，本基金通过港股通投资标的指数的成分券，对于标的指数成分券中不属于港股通范围的股票，本基金无法投资，将会以投资非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，可能会带来跟踪偏离的风险。

3、汇率风险

本基金以人民币募集和计价，跟踪香港市场股票指数。港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险。人民币对港币的汇率的波动也可能加大基金净值的波动，从而对基金业绩产生影响。

此外，由于基金运作中的汇率取自汇率发布机构，如果汇率发布机构出现汇率发布时间延迟或是汇率数据错误等情况，可能会对基金运作或者投资人的决策产生不利影响。

4、流动性风险

本基金最小申购赎回单位设置较高，中小投资人只能在二级市场上按交易价格卖出基金份额。由于本基金为跟踪香港市场股票指数的 ETF，基金份额的清算交收和境内普通 ETF 存在一定差异，目前 T 日申购的基金份额在 T+1 日才可以卖出或赎回，存在基金份额不能及时变现的风险。

5、本基金可能遇到的风险还包括指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险等。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，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