

# 建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2021 年 9 月 15 日

送出日期：2021 年 9 月 30 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    | 建信沪深 300 指数（LOF）  | 基金代码           | 165309                   |
| 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             |
| 基金合同生效日 | 2009 年 11 月 5 日   | 上市交易所及上市日期     | 深圳证券交易所 2009 年 11 月 30 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    | 梁洪昀               | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2009 年 11 月 5 日          |
|         |                   | 证券从业日期         | 2003 年 2 月 20 日          |
| 其他      | 场内简称：沪深 300LOF 建信 |                |                          |

### 二、基金投资与净值表现

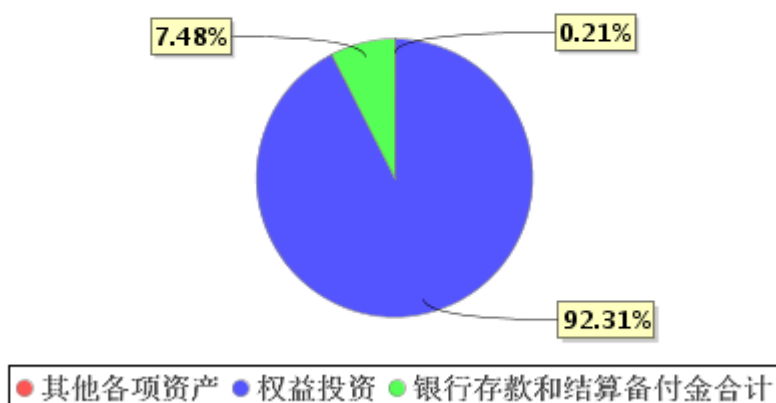
#### （一）投资目标与投资策略

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   | 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。                                                                                                                                                                                        |
| 投资范围   | 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。<br>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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。<br>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（如股票指数期货等），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。<br>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%。                                                                                                   |
| 业绩比较基准 | $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款利率}$                                                                                                                                                                           |
| 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。                                                                                                                                                                        |

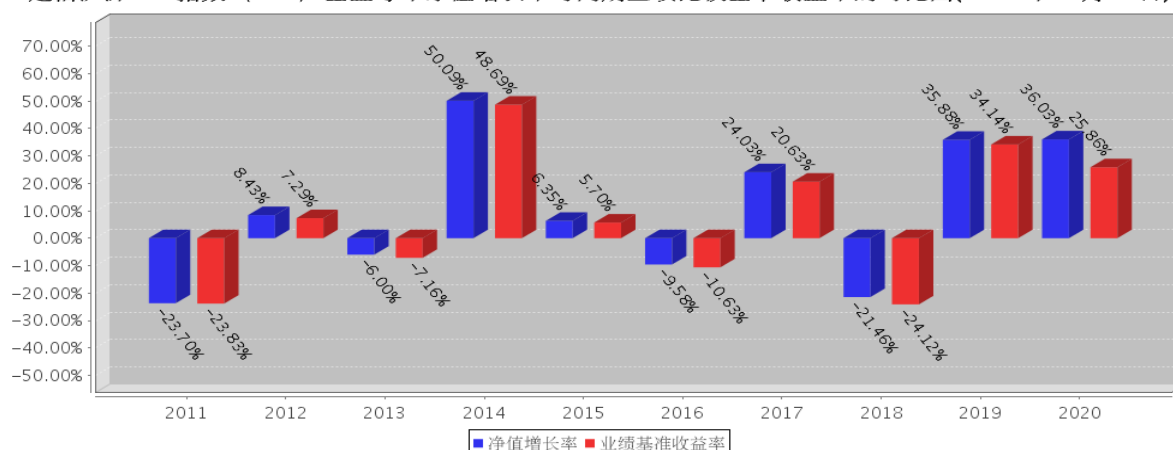
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2021年6月30日)



## (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

建信沪深300指数 (LOF) 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2020年12月31日)



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)<br>/持有期限 (N) | 收费方式/费率      | 备注      |
|--------------|-----------------------------|--------------|---------|
| 申购费<br>(前收费) | 0 万元 ≤ M < 100 万元           | 1.20%        | 场内、场外份额 |
|              | 100 万元 ≤ M < 500 万元         | 0.80%        | 场内、场外份额 |
|              | 500 万元 ≤ M < 1000 万元        | 0.40%        | 场内、场外份额 |
|              | M ≥ 1000 万元                 | 1,000.00 元/笔 | 场内、场外份额 |
| 赎回费          | 0 天 ≤ N < 7 天               | 1.50%        | 场内份额    |
|              | N ≥ 7 天                     | 0.50%        | 场内份额    |
|              | 0 天 ≤ N < 7 天               | 1.50%        | 场外份额    |
|              | 7 天 ≤ N < 1 年               | 0.50%        | 场外份额    |

|  |                  |       |      |
|--|------------------|-------|------|
|  | 1 年 $\leq$ N<2 年 | 0.25% | 场外份额 |
|  | N $\geq$ 2 年     | 0.00% | 场外份额 |

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  | 0.75%                                                                                                             |
| 托管费  | 0.15%                                                                                                             |
| 其他费用 | 基金上市费用,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和律师费,基金份额持有人大会费用,基金的证券交易费用,银行汇划费用,按照法律、法规规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。 |

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、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

#### 2、替代投资风险

在某些情况下(包括指数成份股投资受限制、市场流动性不足等)导致本基金无法投资或者获得足够数量的某种或几种股票时,基金管理人将运用替代投资策略,如买入同行业指数成份股、备选成份股或非成份股等,力求降低基金跟踪偏离度,但无法消除由此引起的基金收益率与业绩比较基准之间的偏离及相应的风险。

#### 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离:

(1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法,使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差;

(2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化,使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差;

(3) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差;

(4) 由于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的存在,使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差;

(5) 在本基金指数化投资过程中,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,都会对本基金的收益产生影响,从而影响本基金对标的指数的跟踪程度;

(6) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制,基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同;因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大;因基金申购与赎回带来的现金变动;因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。

4、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