

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(A 类份额)

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 | 建信深证基本面 60ETF 联接 | 基金代码 | 530015 |
| 下属基金简称 | 建信深证基本面 60ETF 联接 A | 下属基金代码 | 530015 |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 | 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2011 年 9 月 8 日 | 上市交易所及上市日期 | - |
| 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 | 薛玲 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2017 年 9 月 28 日 |
| | | 证券从业日期 | 2013 年 4 月 22 日 |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

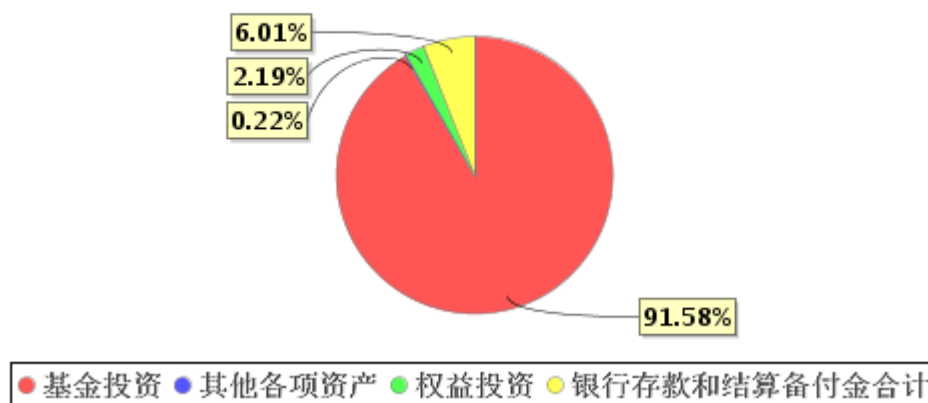
请投资者阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金将绝大部分基金资产投资于目标 ETF，密切跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资范围 | 本基金以目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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；同时，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）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），该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。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 | 本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖目标 ETF 或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金管理人将对投资组合进行适当调整，以降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金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%。如因标的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。 |

| | |
|--------|--|
| | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股，采取自上而下的资产配置策略，先保留现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，然后主要通过一级市场将剩余的大部分资产投资于目标 ETF 并使该投资比例不低于基金资产净值的 90%。同时，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（首次发行或增发等）及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。</p> <p>2、基金组合的构建方法</p> <p>本基金可通过成份股实物形式在一级市场申购及赎回目标 ETF 份额；本基金可在二级市场上买卖目标 ETF 份额，本基金在二级市场上买卖目标 ETF 份额仅出于基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，而不以套利为目的。</p> |
| 业绩比较基准 | 深证基本面 60 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为深证基本面 60ETF 的联接基金，风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时，本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险—收益的品种。 |

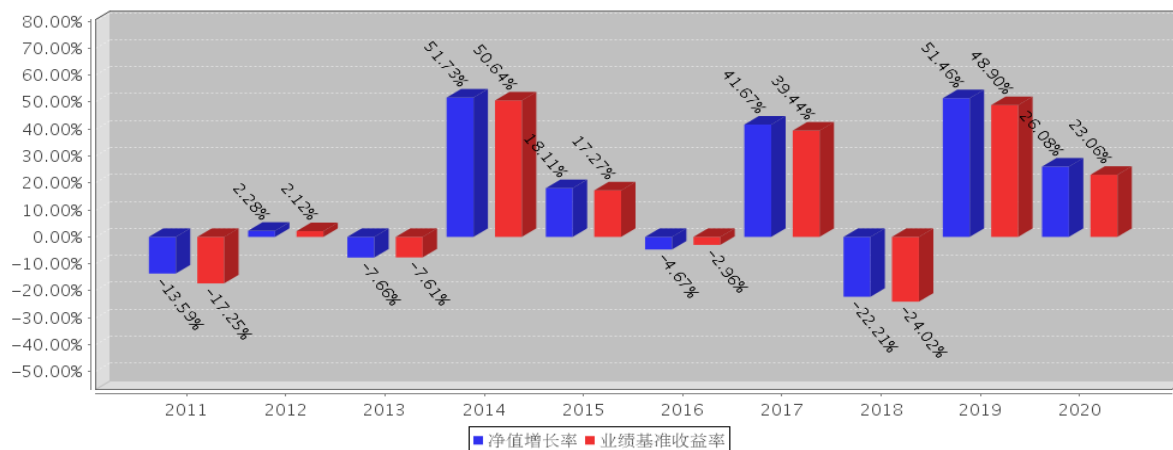
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

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

建信深证基本面60ETF联接A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) /持有期限(N) | 收费方式/费率 |
|--------------|-------------------------|--------------|
| 申购费 (前收费) | 0 万元 \leq M<100 万元 | 1.50% |
| | 100 万元 \leq M<500 万元 | 0.70% |
| | M \geq 500 万元 | 1,000.00 元/笔 |
| 赎回费 | 0 天 \leq N<7 天 | 1.50% |
| | 7 天 \leq N<1 年 | 0.50% |
| | 1 年 \leq N<2 年 | 0.30% |
| | N \geq 2 年 | 0.00% |

(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 | 按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取 0)的 0.50%年费率计提 |
| 托管费 | 按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取 0)的 0.10%年费率计提 |
| 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和律师费,持有人大会费用,证券交易费用,银行汇划费用,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。本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。 |

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、目标 ETF 的风险

本基金为 ETF 联接基金,主要投资对象是目标 ETF,因此目标 ETF 面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险。

2、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

目标 ETF 回报与标的指数回报的偏离,投资成本、各种费用及税收导致本基金收益率落后于标的指数收益率,投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为目标 ETF 份额和成份股、或在面临投资者赎回时无法以赎回价格将目标 ETF 份额和成份股及时地转化为现金,基金管理人对于指数基金的管理能力,例如跟踪标的指数的水平、技术手段、买入卖出证券的时机选择等,都会对本基金的收益产生影响,从而影响本基金相对于对标的指数的偏离程度。

3、本基金为目标 ETF 的联接基金,但不能保证本基金的表现与目标 ETF 的表现完全一致,产生差异的原因包括以下几个方面:

(1) 本基金赎回采用现金方式，为支付现金赎回款，相比目标 ETF，本基金需要保留更多的现金资产；

(2) 本基金申购采用现金方式，在利用到账的申购资金投资目标 ETF 过程中，市场波动等原因会造成本基金与目标 ETF 表现的差异；

(3) 本基金为应对现金申购赎回而进行的证券交易需支付一定的手续费，此等费用将影响本基金相对于目标 ETF 的表现。

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