

**信诚中证建设工程指数型证券投资基金（LOF）  
基金产品资料概要更新**

编制日期：2021年02月19日

送出日期：2021年03月19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	信诚建设工程（LOF）	基金主代码	165525
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2016年07月27日	基金类型	股票型
上市交易所	深圳证券交易所	上市日期	2016年12月09日
运作方式	开放式	开放频率	每个开放日
交易币种	CNY		
基金经理简介	姓名	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期
	黄稚	2018年07月25日	2011年07月15日
其他条目	其他条目名称	其他条目内容	
	1	本基金场内简称：建设工程	
	2	信诚中证建设工程指数型证券投资基金（LOF）由信诚中证建设工程指数分级证券投资基金转型而来，上述基金转型于2016年7月27日正式实施，自基金转型实施之日起，《信诚中证建设工程指数分级证券投资基金基金合同》失效且《信诚中证建设工程指数型证券投资基金（LOF）基金合同》同时生效，信诚中证建设工程指数分级证券投资基金正式变更为信诚中证建设工程指数型证券投资基金（LOF）。	

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金进行数量化指数投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，实现对中证建设工程指数的有效跟踪，为投资者提供一个有效的投资工具。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证建设工程指数的成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、债券、债券回购、中期票据、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于中证建设工程指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；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%的现金或到期日在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。</p> <p>如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。</p>
主要投资策略	本基金原则上采用完全复制法跟踪指数，即原则上按照标的指数中成份股（含存托凭证）组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益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0.35%，年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证建设工程指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高预期风险、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。

## (二) 投资组合资产配置图表



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



### 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：

申购前端金额费	M<500000.00	1.00%	场内, 场外
	500000.00<=M<1000000.00	0.60%	场内, 场外
	1000000.00<=M	1000.00 元/笔	场内, 场外
赎回费	N<7 天	1.50%	场外

	N<7 天	1.50%	场内
	7 天<=N<365 天	0.50%	场外
	365 天<=N<730 天	0.25%	场外
	7 天<=N	0.50%	场内
	730 天<=N	0.00%	场外

**申购费：**M：申购金额；单位：元

## （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%
其它费用	信息披露费用、会计师费、律师费等

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、市场风险
- 2、管理风险
- 3、估值风险
- 4、流动性风险评估及流动性风险管理工具
- 5、指数投资的特有风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，标的指数为中证建设工程指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险：

#### （1）系统性风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，基金资产主要投资于中证建设工程指数的成份股及其备选成份股，因此中证建设工程指数的市场表现将影响到基金业绩的表现，当中证建设工程指数出现收益变动、波动提高时，本基金的收益可能会受到影响。

#### （2）指数复制风险

本基金原则上采用完全复制法来跟踪中证建设工程指数，能否有效地复制指数并将跟踪误差控制在可接受范围内，对本基金的收益将产生影响。当复制方法由于市场条件受到限制或者替代股的选择存在错误时，本基金的收益可能会受到影响。

#### （3）标的指数回报与行业平均回报偏离风险

标的指数的样本空间为中证建设工程指数成份股及备选成份股，其并不能完全代表整个建设工程行业，标的指数的回报率与建设工程行业股票的整体回报率可能存在偏离。

#### （4）标的指数变更风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

### 6、本基金标的指数特有风险

#### （1）指数可投资市值较小的风险

本基金标的指数为中证建设工程指数，基金份额持有人可能面临该标的指数可投资市值较小的风险。当标的指数可投资市值较小，且投资人大规模申购或赎回本基金时，本基金可能难以及时建仓或减仓，且本基金建仓或减仓可能对成份股价格产生较大影响，进而影响本基金后续建仓或减仓的交易成本。

(2) 基金净值受个股价格波动影响较大的风险

持有人面临基金净值受权重较大的个股价格波动影响较大的风险。

(3) 个股流动性受限的风险

当权重较大的个股或多个个股出现暂停交易、涨停或跌停、停牌或发生其他重大事件等导致无法投资的特殊情形时，将有可能导致本基金无法及时建仓或减仓，并可能进一步影响基金的投资、申购与赎回等运作；基金跟踪误差也可能放大。

(4) 基金暂停申购导致二级市场价格大幅波动的风险

当本基金暂停申购、暂停赎回、或同时暂停申购和赎回，且基金份额不同时暂停二级市场交易时，持有人可能面临基金份额二级市场价格大幅波动的风险。

7、投资流通受限证券的风险

本基金可按照基金合同的约定投资流通受限证券。由于投资流通受限证券在锁定期内无法变现，处于锁定期内的证券可能因为市场调整的影响而出现价格波动的风险。

8、存托凭证投资风险

本基金投资范围包括存托凭证，除与其他投资于内地市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

9、其他风险

**(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网站 [www.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.com.cn)，客服电话 400-666-0066

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

**六、其他情况说明**

无