

## 建信社会责任混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要 2016 年第 2 号

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二零一六年九月

### 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2012 年 4 月 9 日证监许可[2012]484 号文核准募集。本基金合同已于 2012 年 8 月 14 日生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准，但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做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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 8 月 13 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

### 一、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

设立日期：2005 年 9 月 19 日

法定代表人：许会斌

联系人：郭雅莉

电话：010-66228888

注册资本：人民币 2 亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下：

股东名称 股权比例

中国建设银行股份有限公司 65%

美国信安金融服务公司 25%

中国华电集团资本控股有限公司 10%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不得以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成，其中3名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总裁等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由6名监事组成，其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

许会斌先生，董事长。2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。自2011年3月至2015年3月出任中国建设银行批发业务总监；自2006年5月至2011年3月任中国建设银行河南省分行行长；自1994年5月至2006年5月历任中国建设银行筹资储备部副主任，零售业务部副总经理，个人银行部副总经理，营业部主要负责人、总经理，个人银行业务部总经理，个人银行业务委员会副主任，个人金融部总经理。许先生是高级经济师，并是国务院特殊津贴获得者，曾荣获中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章等奖项。1983年辽宁财经学院基建财务与信用专业大学本科毕业。

孙志晨先生，董事。现任建信基金管理有限责任公司总裁，兼建信资本管理公司董事长。1985年获东北财经大学经济学学士学位，2006年获长江商学院EMBA。历任中国建设银行筹资部证券处副处长，中国建设银行筹资部、零售业务部证券处处长，中国建设银行个人银行业务部副总经理。

曹伟先生，董事，现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文系硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副总经理、北京分行安华支行副行长、北京分行西四支行副行长、北京分行朝阳支行行长、北京分行个人银行部总经理、中国建设银行个人存款与投资部总经理助理。

张维义先生，董事，现任信安国际北亚副总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院，获经济学学士学位，2012年获得华盛顿大学和复旦大学EMBA工商管理学硕士。历任新加坡公共服务委员会副处长，新加坡电信国际有限公司业务发展总监，信诚基金公司首席运营官和代总经理，英国保诚集团（马来西亚）资产管理公司首席执行官，宏利金融全球副总裁，宏利资产管理公司（台湾）首席执行官和执行董事。

袁时奋先生，董事，现任信安国际有限公司大中华区首席运营官。1981年毕业于美国阿而比学院。历任香港汇丰银行投资银行部副经理，加拿大丰业银行资本市场部高级经理，香港铁路公司库务部助理司库，香港置地集团库务部司库，香港赛马会副集团司库，信安国际有限公司大中华区首席运营官。

殷红军先生，董事，现任中国华电融资租赁有限公司董事长兼总经理。1998年毕业于首都经济贸易大学数量经济学专业，获硕士学位。历任中国电力财务有限公司债券基金部项目经理、华电集团财务有限公司投资咨询部副经理（主持工作）、中国华电集团公司改制重组办公室副处长、体制改革处处长、政策与法律事务部政策研究处处长、中国华电集团资本控股有限公司副总经理。

李全先生，独立董事，现任新华资产管理股份有限公司董事总经理。1985年毕业于中国人民大学财政金融学院，1988年毕业于中国人民银行研究生部。历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员、正大国际财务有限公司总经理助理/资金部总经理，博时基金管理有限公司常务副总经理，新华资产管理股份有限公司

总经理。

王建国先生，独立董事，曾任大新人寿保险有限公司首席行政员，中银保诚退休金信托管理有限公司董事，英国保诚保险有限公司首席行政员，美国国际保险集团亚太区资深副总裁，美国友邦保险（加拿大）有限公司总裁兼首席行政员等。1989年获 Pacific Southern University 工商管理硕士学位。

伏军先生，独立董事，法学博士，现任对外经济贸易大学法学院教授，兼任中国法学会国际经济法学研究会常务理事、副秘书长、中国国际金融法专业委员会副主任。

## 2、监事会成员

王雪玲女士，监事会主席。毕业于清华大学经济管理学院高级工商管理专业，高级经济师。历任中国建设银行山东省分行计划处职员；中国建设银行新疆区分行计划处、信贷处、风险处和人力资源部等副处长、处长、行长助理、副行长；中国建设银行总行机构业务部副总经理。2015年10月起任公司监事会主席。

方蓉敏女士，监事，现任信安国际（亚洲）有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团市场发展区域总监和美国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。方女士1990年获新加坡国立大学法学学士学位，拥有新加坡、英格兰和威尔斯以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士，监事，高级会计师，现任中国华电集团资本控股有限责任公司机构与风险管理部经理。1992年获北京工业大学工业会计专业学士，2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北奥有限公司，中进会计师事务所，中瑞华恒信会计师事务所，中国华电集团财务有限公司计划财务部经理助理、副经理，中国华电集团资本控股（华电财务公司）计划财务部经理，中国华电集团财务有限公司财务部经理，中国华电集团资本控股有限责任公司企业融资部经理。

吴灵玲女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司人力资源管理部总经理兼综合管理部总经理。

1996年毕业于中国人民大学经济信息管理系；2001年毕业于北京师范大学经济系。曾任中国建设银行总行人力资源部主任科员、高级经理助理。2005年9月加入建信基金管理公司，历任人力资源管理部总监助理、副总监、总监。

安晔先生，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司信息技术部总经理。1995年毕业于北京工业大学计算机应用专业，获得学士学位。曾任中国建设银行北京分行科技部科员、中国建设银行信息技术管理部主任科员、项目经理。2005年9月加入建信基金管理公司，历任基金运营部总监助理、副总监；信息技术部副总监、总监。

刘颖女士，职工监事，现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部副总经理，英国特许公认会计师公会（ACCA）资深会员。1997年毕业于中国人民大学会计系，获学士学位；2010年毕业于香港中文大学，获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师、华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006年12月至今任职于建信基金管理有限责任公司监察稽核部。

## 3、公司高管人员

孙志晨先生，总裁（简历请参见董事会成员）。

张威威先生，副总裁。1997年毕业于大连理工大学，获学士学位；2003年毕业于大连理工大学，获硕士学位。曾任中国建设银行辽宁省分行筹资处科员、主任科员；中国建设银行总行个人银行业务部主任科员、高级副经理；2005年9月加入建信基金管理公司，历任市场营销部副总监（主持工作）、总监、公司首席市场官等职务。2015年8月6日起任建信基金管理副总裁。

曲寅军先生，副总裁。1996年毕业于中国人民大学，获学士学位；1999年毕业于中国人民大学，获硕士学位。曾任中国建设银行总行审计部科员、副主任科员；团委主任科员；重组改制办公室高级副经理；行长办公室高级副经理。2005年9月起就职于建信基金管理公司，历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监和公司首席战略官。2013年8月至今，任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理，并于2015年8月6日起任建信基金管理公司副总裁。

## 4、督察长

吴曙明先生，督察长。1992年毕业于中南工业大学管理系，获学士学位；1999年毕业于财政部财政科学研究所，获经济学硕士学位。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作；1999年7月加入中国建设银行总行，先后在营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，曾任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职。2006年3月加入建信基金管理公司，担任董事会秘书兼综合管理部总监。2015年8月6日起任建信基金管理公司督察长。

#### 5、本基金基金经理

许杰先生，硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析师，2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职，2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理，2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理，2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011年10月加入我公司，2012年3月21日起任建信恒稳价值混合型证券投资基金基金经理；2012年8月14日起任建信社会责任股票型证券投资基金基金经理；2014年9月10日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金经理；2015年2月3日起任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015年5月26日起任建信新经济灵活配置基金的基金经理。

本基金历任基金经理：

姚锦女士：2012年8月14日至2014年3月6日；

许杰先生：2012年8月14日至今。

#### 6、投资决策委员会成员

孙志晨先生，总裁。

梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。

李菁，固定收益投资部总经理

钟敬隼先生，固定收益投资部首席固定收益投资官。

姚锦女士，权益投资部副总经理兼研究部首席策略分析师。

顾中汉先生，权益投资部总经理。

许杰先生，权益投资部副总经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中

国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2016 年 6 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 342 只

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### （1）直销机构

本基金直销机构为本公司设在北京的直销柜台以及网上交易平台。

#### （1）直销柜台

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

法定代表人：许会斌

联系人：郭雅莉

电话：010-66228800

#### （2）网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回、定期投资等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。本公司网址：[www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)。

#### （2）代销机构

##### （1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼(长安兴融中心)

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

(2) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

网址：www.95559.com.cn

(3) 招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

客户服务电话：95555

传真：0755-83195049

网址：www.cmbchina.com

(4) 中国农业银行

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(5) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

传真：010-83914283

客户服务电话：95568

网站：www.cmbc.com.cn

(6) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

客服电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

(7) 中信证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服电话：95558

网址：www.citics.com

(8) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客服电话：10108998

网址：www.ebscn.com

(9) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

客户服务热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

(10) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

客户服务热线：400-910-1166

网址：www.cicc.com.cn

(11) 长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

客服电话：0755-82288968

网址：www.cc168.com.cn

(12) 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

客户服务电话：400-8888-001，(021) 962503

网址：www.htsec.com

(13) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务电话：4008-888-999

公司网址：www.95579.com

(14) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

(15) 中泰证券有限公司

注册地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

客户服务热线：95538

网址：www qlzq.com.cn

(16) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

客户服务电话：0431-96688、0431-85096733

网址：www.nesc.cn

(17) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人：王春峰

客户服务电话：4006515988

网址: [www.bhzq.com](http://www.bhzq.com)

(18) 广发证券股份有限公司

住所: 广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人: 孙树明

客户服务电话: 020-95575

网址: [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(19) 华福证券有限责任公司

注册地址: 福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人: 黄金琳

客服热线: 0591-96326

网址: [www.gfhfzq.com.cn](http://www.gfhfzq.com.cn)

(20) 信达证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

法定代表人: 张志刚

客服热线: 400-800-8899

网址: [www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(21) 兴业证券股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 268

法定代表人: 兰荣

客户服务电话: 4008888123

网址: [www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(22) 平安证券有限责任公司

注册地址: 深圳市金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人: 杨宇翔

客服热线: 4008866338

网址: [stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(23) 中国中投证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层  
01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址: 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人: 龙增来

开放式基金咨询电话: 4006008008

网址: [www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

(24) 安信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

办公地址: 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 20 层

法定代表人: 牛冠兴

客户服务电话: 0755-82825555

网址: [www.axzq.com.cn](http://www.axzq.com.cn)

(25) 国元证券股份有限公司

注册地址: 合肥市寿春路 179 号

法定代表人: 蔡咏

客户服务热线: 400-8888-777

网址: [www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

(26) 中国银河证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 陈有安

客户服务电话: 4008-888-8888

网址: [www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(27) 中信证券(山东)有限责任公司

住所: 青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层(1507-1510 室)

法定代表人: 杨宝林

客服电话: 0532-96577

网址: [www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

(28) 华泰证券股份有限公司

地址: 江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人: 吴万善

客户咨询电话: 025-84579897

网址: [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(29) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址: 新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国家大厦 20 楼 2005 室

法定代表人: 李季

客服电话: 4008-000-562

网址: [www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(30) 上海证券有限责任公司

注册地址: 上海市西藏中路 336 号

法定代表人: 郁忠民

客服电话: 021-962518

网址: [www.962518.com](http://www.962518.com)

(31) 财富证券股份有限公司

注册地址: 长沙市芙蓉中路 2 段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人: 周晖

客户服务电话: 0731-4403340

网址: [www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

(32) 东海证券有限责任公司

注册地址: 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

法定代表人: 朱科敏

客服热线: 400888588

网址: [www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(33) 申万宏源证券有限公司

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人: 李梅

客服电话: 95523 或 4008895523

网址: [www.sywg.com](http://www.sywg.com)

(34) 浙商证券股份有限公司

办公地址: 杭州杭大路 1 号黄龙世纪广场 A6/7

法定代表人：吴承根

客服电话：0571-967777

网址：<http://www.stocke.com.cn>

(35) 天源证券经纪有限公司

注册地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 18 楼

法定代表人：林小明

客服电话：0755-33331188

网址：[www.tyzq.com.cn](http://www.tyzq.com.cn)

(36) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(37) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006788887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn), [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(38) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000766123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(39) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

网址：[www.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

(40) 上海天天基金销售有限公司概况

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客户服务电话：4001818188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(41) 和讯信息科技有限公司概况

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：4009200022

(42) 浙江同花顺基金销售有限公司概况

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

客户服务电话：400-877-3772

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(43) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

客户服务电话：4008188866

网址：[www.shengshiview.com](http://www.shengshiview.com)

(44) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

法定代表人：梁越

客户服务电话：4007868868

网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(45) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室

法定代表人：张晶

客户服务电话：400-820-2819

网址：[www.chinapnr.com](http://www.chinapnr.com)

(46) 北京微动利投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341

法定代表人：梁洪军

客户服务电话：400-819-6665

网址：<http://www.buyforyou.com.cn>

(47) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

网址：<http://www.noah-fund.com/>

(48) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

客户服务电话：400-866-6618

网址：<https://www.lufax.com/>

(49) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

客户服务热线：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn/>

(50) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人：董浩

客户服务电话：400-068-1176

网址：[www.jimufund.com/](http://www.jimufund.com/)

(51) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾路 1 号 A 栋 201 室

法定代表人：齐小贺

客户服务电话：0755-83999913

网址：[www.jinqianwo.cn/](http://www.jinqianwo.cn/)

(52) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：TAN YIK KUAN

客户服务热线：400-684-0500

网址：[https:// www.ifastps.com.cn](https://www.ifastps.com.cn)

(53) 北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

客户服务热线：010-56282140

网址：[www.fundzoe.cn](http://www.fundzoe.cn)

(54) 天津国美基金销售有限公司

地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层

法定代表人：丁东华

客户服务热线：400-111-0889

网址：[www.gomefund.com](http://www.gomefund.com)

(55) 上海利得基金销售有限公司

地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

客户服务热线：400-033-7933

网址：[www.leadbank.com.cn](http://www.leadbank.com.cn)

(56) 上海万得投资顾问有限公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

法定代表人：王廷富

客户服务热线：400-821-0203

网址：[www.windmoney.com.cn](http://www.windmoney.com.cn)

基金管理人可以根据相关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

## (二) 登记机构

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：许会斌

联系人：郑文广

电话：010-66228888

## (三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：北京德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层

负责人：王丽

联系人：徐建军

电话：010-66575888

传真：010-65232181

经办律师：徐建军、刘焕志

## (四) 审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：陈熹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：薛竞、陈熹

#### 四、基金的名称

建信社会责任混合型证券投资基金。

#### 五、基金的类型

混合型证券投资基金。

#### 六、基金的投资目标

在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

#### 七、基金的投资方向

本基金的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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需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。

本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中本基金投资于积极履行社会责任的上市公司股票比例不低于股票资产的 80%；债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 0-40%，其中权证占基金资产净值的 0-3%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如果法律法规对上述比例要求有变更的，本基金投资范围将及时做出相应调整，以调整变更后的比例为准。

#### 八、基金的投资策略

##### （一）投资理念

上市公司在谋求自身利益的同时兼顾社会责任是一种共赢战略，可真正意义上实现自身的可持续发展，并给投资者带来长期稳健的收益。本基金在长期价值投资理念的基础上，坚持社会责任投资，重点考察企业社会责任的履行，立足企业基本面，“自下而上”精选个股，努力实现本基金的投资目标。

##### （二）投资策略

##### 1、大类资产配置策略

大类资产配置策略方面，本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。

##### （1）对宏观经济发展变动趋势的判断

宏观研究员根据各项重要的经济指标，如国内生产总值、产出缺口、通货膨胀率、利率水平、货币信贷数据等因素判断当前宏观经济所处的周期，并根据具体情况推荐适合投资的资产类别。一般来说，在经济复苏阶段，投资股票类资产可以获得较高的收益；在经济过热阶段，适当降低股票投资比例可以降低系统性风险；在滞涨阶段，最佳的资产配置策略应当是降低股票仓位持有现金；在经济萧条阶段，债券类资产是优先选择

的投资品种。本基金凭借实力雄厚的宏观经济研究团队，对宏观经济发展变动趋势做出判断，从而指导基金投资的大类资产配置策略。

#### (2) 对流动性和资金流向的分析

资产价格的长期变化是由社会发展和经济变动的内在规律决定的，但是资产价格的短期变化受流动性和资金流向的影响。这一点在股票市场上体现得尤其明显。此外，通过对宏观经济运行规律的深入研究以及对估值的客观分析能判断大类资产价格变动趋势，却无法得知资产价格变动的节奏，但资金流向分析可以弥补这一缺点。基于以上判断，本基金将对流动性和资金的流向进行监控，充分利用目前可得的信息，着重从货币供应量、银行信贷、储蓄存款余额、股市成交量和成交额、银行回购利率走势等方面进行判断。

#### (3) 对股市及债市估值及风险分析

本基金采用相对估值法和绝对估值法相结合的方法衡量股市的估值水平及风险。其中，相对估值法主要是通过将A股当前估值水平与历史估值水平，以及与同一时期H股和国际股市的估值水平进行比较，再结合对A股合理溢价波动区间的分析，判断当前A股市场估值水平是否合理；绝对估值法则主要采用FED模型、DCF模型和DDM模型计算A股市场的合理估值水平，并与当前市场估值进行比较，从而判断市场的估值风险。

本基金从以下几方面分析债券市场估值和风险：一方面，通过对利率走势、利率期限结构等因素的分析，预测债券的投资收益和风险；另一方面，对宏观经济、行业前景以及公司财务进行严谨的分析，考察其对企业信用利差的影响，从而进行信用类债券的估值和风险分析。

具体来说，本基金的资产配置具体流程如下：

- ① 根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期；
- ② 进行流动性及资金流向的分析，确定中、短期的市场变化方向；
- ③ 计算股票市场、债券市场估值水平及风险分析，评价不同市场的估值优势；
- ④ 对不同调整方案的风险、收益进行模拟，确定最终资产配置方案。

### 2、行业配置策略

#### (1) 行业的筛选

在定性分析方面，本基金采用“双向行业筛选法”对投资的行业进行调整，首先运用“积极筛选法”超配或寻求在持续发展责任、法律责任、内外部道德责任履行等方面具有较好表现的行业；其次运用“消极筛选法”低配或规避在持续发展责任、法律责任、内外部道德责任履行等方面具有较差表现的行业，定期动态优化行业配置资产。

#### (2) 行业的配置

本基金从定性分析和定量分析两个角度对行业进行考察，并据此进行股票投资的行业配置。

在定性分析方面，以宏观经济运行和经济景气周期监测为基础，利用经济周期、行业的市场容量和增长空间、行业发展政策、行业结构变化趋势、行业自身景气周期等多个指标把握不同行业的景气度变化情况和业绩增长趋势，动态调整行业资产配置权重，积极把握行业景气变化中的投资机会。本基金重点关注如下几类行业：国家经济政策重点扶持的行业、受益于当前经济运行周期的行业、长期增长前景看好的行业、行业景气度高或处于拐点的行业。

定量分析指标主要包括：行业相对估值水平、行业相对利润增长率、行业PEG等。本基金重点关注相对估值水平合理、利润增长率高、PEG较低的行业。

### 3、个股投资策略

个股选择上，本基金采取“社会责任”和“基本面”双因素选股策略。首先利用“建信社会贡献筛选模型”进行第一轮筛选，然后由研究员从基本面角度进行第二轮筛选，经过两轮筛选后，本基金投资团队再在此基础上进行“自上而下”和“自下而上”的个股选择，实现股票资产的配置和调整。

#### (1) “社会责任”筛选

本基金首先利用“建信社会贡献筛选模型”对上市公司进行“社会责任”的筛选。本基金认为企业社会责任

是指企业在创造利润、对股东利益负责的同时，还要承担对员工、对环境和社会的责任。而企业社会责任的履行其实就是指企业对股东、员工、国家、社会等利益相关者做出的贡献。因此本基金建立了“建信社会贡献筛选模型”对企业的社会责任进行量化衡量。

“建信社会贡献筛选模型”通过一系列的社会责任指标综合衡量上市公司为社会相关方创造的价值以及对社会造成的成本，进而综合衡量上市公司的社会责任贡献程度。社会责任指标包括但不限于：利用净利润来衡量公司为股东创造的价值、利用除增值税以外的消费税、营业税、所得税、资源税、城建税等支付的税收来衡量公司为国家创造的价值、利用支付给职工的工资、福利及社保基金总额等来衡量公司为员工所创造的价值、利用借款利息来衡量公司为银行等债权人创造的价值、利用企业对外捐赠等来衡量公司为其他利益相关者创造的价值、利用上市公司因废水、废气、固体废物等排放造成的环境成本减去公司环保项目等支出来衡量公司因环境污染等因素对社会造成的社会成本。

本基金利用“建信社会贡献筛选模型”对上市公司的上述社会责任指标进行量化衡量，对上市公司的社会贡献程度进行综合评价和动态综合评级，同时将选择各行业的上市公司中社会责任贡献程度最好的80%作为积极履行社会责任的上市公司。

#### (2) “基本面”筛选

经过第一轮社会责任筛选之后，公司研究员在此基础上从基本面角度进行第二轮筛选，本基金采用的基本面筛选方法为四因素模型，即考虑“治理结构、竞争能力、财务状况以及估值水平”等四个方面的因素。

治理结构分析主要考察公司是否已建立起完善的法人治理结构，公司的经营活动是否高效、有序等；

公司竞争能力分析主要考察公司的管理者素质、市场营销能力、技术创新能力、专有技术、特许权、品牌、重要客户等方面；

财务状况分析主要考察公司的财务安全性指标，反映行业特性的主要财务指标、公司股权和债权融资能力与成本分析、公司再投资收益率分析等；

最后是估值水平分析，如果公司具有竞争能力、财务状况良好，但是股价已经被严重高估，股票将丧失吸引力。因此本基金将对股票进行估值分析，本基金管理人将关注PE、PB、PS等指标。对于这些指标，除了静态分析以外，本基金管理人还将根据对公司的深入研究及盈利预测，进行动态分析。

综上所述，本基金将重点关注公司治理结构完善、竞争能力强、财务状况良好、估值合理甚至低估的公司，来实现对投资组合的合理构建。

#### (3) 市场调研与动态调整

本基金将重视市场调研，获取第一手信息，以提高投资的准确性，尽可能规避基本面风险。公司研究员或本基金投资团队将对重点公司进行实地调研，在调研基础上形成投资决策。

本基金投资团队在通过上述“自上而下”和“自下而上”相结合的方式同时进行个股选择的同时，将根据宏观经济、政策以及公司基本面的变化，对个股投资比例进行动态调整，以此来持续优化投资组合，提高投资收益。

### 4、 新股申购策略

本基金将研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司的社会责任履行情况和基本面因素，根据股票市场整体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，从而制定相应的新股申购策略。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定继续持有或者卖出。

### 5、 债券投资策略

在债券组合的构造和调整上，本基金综合运用久期管理、期限配置策略、类属配置管理、套利策略等组合管理手段进行日常管理。

#### (1) 久期管理策略

本基金建立了债券分析框架和量化模型，预测利率变化趋势，确定投资组合的目标平均久期，实现久期管理。

本基金将债券市场视为金融市场整体的一个有机部分，通过“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策以及债券市场资金供求等因素的分析，主动判断利率和收益率曲线可能移动的方向和方式，并据此确定收益资产组合的平均久期。当预测利率和收益率水平上升时，建立较短平均久期或缩短现有收益资产组合的平均久期；当预测利率和收益率水平下降时，建立较长平均久期或增加现有收益资产组合的平均久期。

本基金建立的分析框架包括宏观经济指标和货币金融指标，分析金融市场中各种关联因素的变化，从而判断债券市场趋势。宏观经济指标有GDP、CPI/PPI、固定资产投资、进出口贸易；货币金融指标包括货币供应量M1/2、新增贷款、新增存款、超额准备金率。

#### （2）期限配置策略

本基金资产组合中长、中、短期债券主要根据收益率曲线形状的变化进行合理配置。具体来说，本基金在确定收益资产组合平均久期的基础上，将结合收益率曲线变化的预测，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。

#### （3）类属配置策略

本基金资产在不同类属债券资产间的配置策略主要依靠信用利差管理和信用风险管理来实现。在信用利差管理策略方面，本基金一方面分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，另一方面将分析信用债市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响，最后综合各种因素，分析信用利差曲线整体及各类型信用债信用利差走势，确定各类债券的投资比例。

同时本基金将根据经济运行周期，分析公司债券、企业债券等信用债发行人所处行业发展状况、行业景气度、市场地位，并结合发行人的财务状况、债务水平、管理能力等因素，评价债券发行人的信用风险、债券的信用级别，对各类信用债券的信用风险进行有效地管理。

#### （4）套利策略

在市场低效或无效状况下，本基金将根据市场实际情况，积极运用各类套利以及优化策略对收益资产投资组合进行管理与调整，捕捉交易机会，以获取超额收益。

##### A、回购套利

本基金将适时运用多种回购交易套利策略以增强静态组合的收益率，比如运用回购与现券的套利、不同回购期限之间的套利进行相对低风险套利操作等，从而获得杠杆放大收益。

##### B、跨市场套利

本基金将利用同一只债券类投资工具在不同市场（主要是银行间市场与交易所市场）的交易价格差进行套利，从而提高收益资产组合的投资收益。

## 6、股指期货投资策略

本基金将通过对所投资股票头寸的流动性、风险程度等因素的评估，确定是否需要进行套期保值。

本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，即减小现货资产的价格波动风险，从而使套期保值组合的风险最小。本基金将采取以下步骤开展组合资产的套期保值。

#### （1）确定套期保值目标现货组合、期限以及交易方向

套期保值的目标现货组合是指需要进行套期保值的股票资产，这部分资产可以是基金持有或者将要持有的所有股票资产，也可以是部分股票资产。本基金将通过对国内外宏观经济运行趋势、财政以及货币政策、市场资金供需状况、股票市场估值水平、固定收益类资产收益水平等因素进行分析，结合对股票头寸的流动性、风险程度等因素的测评，以确定需要进行套期保值的股票组合和套期保值期限。

根据期货合约的交易方向不同，套期保值分为两类：买入套期保值、卖出套期保值。买入套期保值（又称多头套期保值）是在期货市场买入期货合约，用期货市场多头对冲现货市场上行风险，主要用于降低基金建仓期股票价格大幅上涨的风险；卖出套期保值（又称空头套期保值）是在期货市场中卖出期货合约，用期货市场空头对冲现货市场的下行风险，以规避基金运作期间股票价格下跌的风险。本基金将根据实际需要确定交易方向。

#### （2）选择股指期货合约开仓种类

在期货合约选择方面，本基金将遵循品种相同或相近以及月份相同或相近的原则。如果市场上存在以不同指数为标的的股票指数期货，则将选择与目标现货组合相关性较强的指数为标的的股票指数期货进行套期保值。本基金将综合权衡所承担的基差风险、合约的流动性以及展期成本等因素，确定最有利的合约或者合约组合进行开仓。

#### （3）根据最优套期保值比例确定期货头寸

本基金将通过最优套期保值比例来确定期货头寸，以目标资产组合与期货标的指数之间的  $\beta$  系数作为最优套期保值比例。

#### （4）初始套期保值组合的构建及调整

计算得到最优的套期保值比例后，本基金将其转换为具体的期货合约数，计算得到合约数量后，本基金根据选择股指期货合约开仓种类构建套期保值组合。

#### （5）合约的展期

当标的指数期货存在两种及两种以上近月合约时，本基金将利用各类近期合约的择机转换策略从而获取最大的套保收益，原则上本基金将以价差的波动程度作为合约转换的主要依据。

一般情况下，本基金将根据价差的变化在各类近期合约的转换过程中完成合约的展期，但当价差稳定时，本基金将持有现有的合约组合到期，交割结算完成后重新计算最优套期保值比例、选择开仓合约种类，从而重新构造股指期货合约组合对现货投资组合继续进行套期保值。

#### （6）动态调整

本基金将基于现货组合市值、股票组合  $\beta$  值的变动情况，动态确定套期保值过程中的最优套期保值比例，并适时对组合中的期货头寸进行调整。

因此本基金将根据目标资产  $\beta$  值的稳定性和调整成本，设定一定的阈值，当套期保值比例变化率超过该阈值时，调整期货合约数，以达到较好的套期保值效果。

### 7、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

### 8、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## （三）投资管理体制及流程

### 1、投资管理体制

本基金管理人建立了包括投资决策委员会、投资管理部、研究部、交易部等部门的完整投资管理体系。

投资决策委员会是负责基金资产运作的最高决策机构，根据基金合同、法律法规以及公司有关规章制度，确定公司所管理基金的投资决策程序、权限设置和投资原则；确定基金的总体投资方案；负责基金资产的风险控制，审批重大投资事项；监督并考核基金经理。投资管理部及基金经理根据投资决策委员会的决策，构建投资组合、并负责组织实施、跟踪和调整，以实现基金的投资目标。研究部提供相关的投资策略建议和证券选择建议，并负责构建和维护股票池。交易部根据基金经理的交易指令，进行基金资产的日常交易，对交易情况及时反馈。

### 2、投资流程

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理体制，具体的投资管理流程包括研究分析、投资决策、交易执行和投资回顾。

#### （1）研究分析

研究部及投资管理部广泛地参考和利用公司内、外部的研究成果，走访拟投资公司或其他机构，进行深入细

致的调查研究，了解国家宏观经济政策及行业发展状况，挖掘有投资价值的拟投资上市公司，同时，建立相关研究模型。研究部撰写宏观策略报告、行业策略报告和拟投资上市公司投资价值分析报告，作为投资决策依据之一。

研究部和投资管理部定期或不定期举行投资研究联席会议，讨论宏观经济、行业、拟投资上市公司及相关问题，作为投资决策的重要依据之一。

#### (2) 投资决策

投资决策委员会根据基金合同、相关法律法规以及公司有关规章制度确定基金的投资原则以及基金的资产配置比例范围，审批总体投资方案以及重大投资事项。

基金经理根据投资决策委员会确定的投资对象、投资结构、持仓比例范围等总体投资方案，并结合研究人员提供的投资建议、自己的研究与分析判断、以及基金申购赎回情况和市场整体情况，构建并优化投资组合。

对于超出权限范围的投资，按照公司权限审批流程，提交主管投资领导或投资决策委员会审议。

#### (3) 交易执行

交易部接受基金经理下达的交易指令。交易部接到指令后，首先应对指令予以审核，然后再具体执行。基金经理下达的交易指令不明确、不规范或者不合规的，交易部可以暂不执行指令，并及时通知基金经理或相关人员。

交易部应根据市场情况随时向基金经理通报交易指令的执行情况及对该项交易的判断和建议，以便基金经理及时调整交易策略。

#### (4) 投资回顾

绩效评估小组定期对基金绩效进行评估。基金经理定期向投资决策委员会回顾前期投资运作情况，并提出下期的操作思路，作为投资决策委员会决策的参考。

### 九、基金的业绩比较基准

#### 本基金投资业绩比较基准

$75\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 25\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

如果今后法律法规发生变化，或指数编制单位停止编制该指数、更改指数名称，或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

#### 选择比较基准的理由

本基金为混合型证券投资基金，股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，故本基金采取 75%作为复合业绩比较基准中衡量股票投资部分业绩表现的权重，相应将 25%作为衡量债券投资部分业绩表现的权重。

沪深 300 指数是由中证指数公司编制的，从上海和深圳股票市场中选取的 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。该指数样本覆盖了沪深市场七成左右的流通市值和超过四分之三的总市值，具有良好的市场代表性、能够反映 A 股市场整体走势的指数。沪深 300 指数中的很多成份股本身即为业绩优良的蓝筹品种，以其为标的的指数期货也已经推出，从而会为本基金带来新的投资机会和风险管理手段。因此，基金管理人选择沪深 300 指数作为本基金股票部分的比较基准。

中国债券总指数的发布主体是中央国债登记结算有限责任公司。中央国债登记结算公司是全国债券市场内提供国债、金融债券、企业债券和其他固定收益证券的登记、托管、交易结算等服务的国有独资金融机构，是财政部唯一授权主持建立、运营全国国债托管系统的机构，是中国人民银行指定的全国银行间债券市场债券登记、托管、结算机构和商业银行柜台记账式国债交易的一级托管人。同时中国债券总指数是目前国内涵盖范围最广的债券指数之一，具有良好的市场代表性。

由此可见，上述两个指数的发布主体在证券市场上具有较高的市场代表性、权威性和中立性，适合作为本基金的业绩比较基准。

### 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于

中高收益/风险特征的基金。

#### 十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2016年6月30日，本报告所列财务数据未经审计。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 29,389,051.37 78.36

其中：股票 29,389,051.37 78.36

2 固定收益投资

其中：债券

资产支持证券 --

3 贵金属投资 --

4 金融衍生品投资 --

5 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

6 银行存款和结算备付金合计 7,971,473.55 21.26

7 其他各项资产 142,686.91 0.38

8 合计 37,503,211.83 100.00

##### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业 729,781.00 1.99

B 采矿业 --

C 制造业 20,451,462.27 55.76

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 2,335,756.13 6.37

F 批发和零售业 47,750.00 0.13

G 交通运输、仓储和邮政业 689,222.50 1.88

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 1,699,471.06 4.63

J 金融业 --

K 房地产业 --

L 租赁和商务服务业 1,508,063.22 4.11

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 1,222,359.19 3.33

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 705,186.00 1.92

R 文化、体育和娱乐业 --

S 综合 --

合计 29,389,051.37 80.13

注：以上行业分类以 2016 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	000568	泸州老窖	81,300	2,414,610.00	6.58
2	600298	安琪酵母	104,900	1,871,416.00	5.10
3	300068	南都电源	74,951	1,638,428.86	4.47
4	300242	明家联合	43,674	1,508,063.22	4.11
5	300408	三环集团	79,300	1,424,228.00	3.88
6	002099	海翔药业	147,900	1,408,008.00	3.84
7	300197	铁汉生态	81,200	1,125,432.00	3.07
8	600519	贵州茅台	3,819	1,114,842.48	3.04
9	600068	葛洲坝	179,100	1,042,362.00	2.84
10	600855	航天长峰	30,449	953,053.70	2.60

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资于国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

### 11.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	56,000.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,452.09
5	应收申购款	85,233.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	142,686.91

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1	300242	明家联合	1,508,063.22	4.11	重大事项
---	--------	------	--------------	------	------

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2016年6月30日。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①—③

②—④

2012年8月14日—2012年12月

31日 3.90%

0.43%

5.56%

0.98%

-1.66%

-0.55%

2013年1月1日—2013年12月31日 16.27% 1.28% -5.88% 1.05% 22.15% 0.23%

2014年1月1日—2014年12月31日 49.83% 1.19% 40.83% 0.91% 9.00% 0.28%

2015年1月1日—2015年12月31日 19.72% 2.65% 7.73% 1.86% 11.99% 0.79%

2016年1月1日—2016年6月30日 -12.55% 2.19% -11.20% 1.38% -1.35% 0.81%

基金合同生效之日2012年8月14日—2016年6月30日 89.50% 1.79%

33.86%

1.31%

55.64% 0.48%

### 十三、基金的费用概览

#### (一) 认购费用

本基金的认购费率随认购金额的增加而递减，具体费率结构如下表所示：

认购金额（M） 认购费率

M<100 万元 1.2%

100 万元≤M<500 万元 0.8%

M≥500 万元 1000 元/笔

本基金认购费由认购人承担，可用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

#### (二) 认购份数的计算

认购本基金的认购费用采用前端收费模式，即在认购基金时缴纳认购费。投资者的认购金额包括认购费用和净认购金额。有效认购款项在基金募集期间形成的利息归投资者所有，如基金合同生效，则折算为基金份额计入投资者的账户，具体份额以登记机构的记录为准，投资者的总认购份额的计算方式如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金份额初始发售面值

认购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

#### (三) 申购费率与赎回费率

##### 1、申购费率

本基金对申购设置级差费率，申购费率随申购金额的增加而递减，最高申购费率不超过 1.5%：

申购金额（M） 申购费率

M < 100 万元 1.5%

100 万元 ≤ M < 500 万元 1.0%

M ≥ 500 万元 1000 元/笔

申购费用由申购人承担，不列入基金资产，申购费用用于本基金的市场推广、登记和销售。

##### 2、赎回费率

持有期限（Y） 赎回费率

持有期 < 1 年 0.5%

1 年 ≤ 持有期 < 2 年 0.25%

持有期 ≥ 2 年 0%

赎回费用由赎回人承担，赎回费中 25% 归入基金资产，其余部分作为本基金用于支付登记费和其他必要的手续费。（注：1 年指 365 天）

3、基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体及基金管理人网站公告。

#### (四) 申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额的计算

申购本基金的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份数 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者投资 5 万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.05 元，则可得到的申购份  
额为：

净申购金额=50000/（1+1.5%）=49261.08 元

申购费用=50000-49261.08=738.92 元

申购份额=49261.08/1.05=46915.31 份

即：投资者投资 5 万元申购本基金的基金份额，假设申购当日基金份额净值为 1.05 元，则其可得到  
46915.31 份基金份额。

## 2、赎回净额的计算

基金份额持有人在赎回本基金时缴纳赎回费，基金份额持有人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

赎回总金额=赎回份额赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回净额结果按照四舍五  
入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资者赎回本基金 10000 份基金份额，赎回适用费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，  
则其可得净赎回金额为：

赎回总金额=10000×1.148=11480 元

赎回费用=11480×0.5%=57.40 元

净赎回金额=11480-57.40=11422.60 元

即：投资者赎回本基金 10000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额  
为 11422.60 元。

## 3、基金份额净值计算

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/T 日发行在外的基金份额总数。基金份额净值单位为人民币元，计算  
结果保留到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延  
迟计算或公告。

### （五）基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- （4）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金的证券交易费用；
- （7）基金的银行汇划费用；
- （8）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。

### （六）基金费用的费率、计提方法、计提标准和支付方式

#### （1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指

令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### (2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费率、基金托管费率，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但基金管理人必须最迟于新的费率实施前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

本条第1款第(3)至第(8)项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### (七) 基金销售时发生的费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书的相关规定。本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书的相关规定。不同基金间转换的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定确定并公告。

#### (八) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### (九) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

- 1、更新了“三、基金管理人”的“主要人员情况”中监事的信息。
- 2、更新了“四、基金托管人”的基金托管业务经营情况信息。
- 3、在“五、相关服务机构”中更新了相关代销机构和注册登记机构的变动信息。
- 4、更新了“九、基金的投资”，更新了基金投资组合报告，并经基金托管人复核。
- 5、更新了“十、基金的业绩”，并经基金托管人复核。
- 6、更新了“二十二、其他应披露事项”，添加了期间涉及本基金和基金管理人的相关临时公告。

建信基金管理有限责任公司

二〇一六年十月一日