

建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)摘要

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇一七年四月

【重要提示】

建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“基金”或“本基金”）由建信优势动力股票型证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2013年3月1日证监许可[2013]204号文核准的《关于核准建信优势动力股票型证券投资基金有关转型基金运作方式决议的批复》，建信优势动力股票型证券投资基金由封闭式基金转为上市开放式基金（LOF）、调整基金投资比例、修订基金合同，并更名为“建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）”。自2013年3月19日起，由《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》修订而成的《建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。根据2014年8月8日证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定，建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）自2015年7月开始更名为建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）。

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。

基金管理人保证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。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，投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。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，由于本基金可能因为暂时未达到上市条件而不能上市交易所产生的流动性风险，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，等等。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。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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 3 月 18 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 12 月 31 日（财务数据已经审计）。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（以下简称“公司”或“本公司”）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，高级经济师，享国务院特殊津贴，中国建设银行突出贡献奖、河南省五一劳动奖章获得者。1983年毕业于辽宁财经学院基建财务与信用专业，获学士学位。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，2006年5月起任中国建设银行河南省分行行长，2011年3月出任中国建设银行批发业务总监，2015年3月起任建信基金管理有限责任公司董事长。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年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长，中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长，中国建设银行总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，现任信安北亚地区副总裁。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（亚洲）区域副总裁。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营运官。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

张军红先生，监事会主席。毕业于国家行政学院行政管理专业，获博士研究生学位。历任中国建设银行筹资部储蓄业务处科员、副主任科员、主任科员；零售业务部主任科员；个人银行业务部个人存款处副经理、高级副经理；行长办公室秘书一处高级副经理级秘书、秘书、高级经理；投资托管服务部总经理助理、副总经理；投资托管业务部副总经理；资产托管业务部副总经理。2017年3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。曾任英国保诚集团新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战略研究部总经理。

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公司企业融资部经理。严冰女士，职工监事，现任建

信基金管理有限责任公司人力资源部副总经理。2003年7月毕业于中国人民大学行政管理专业，获硕士学位。曾任安永华明会计师事务所人力资源部人力资源专员。2005年8月加入建信基金管理公司，历任人力资源管理专员、主管、部门总经理助理、副总经理。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。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系，获得学士学位。历任中国建设银行北京分行信息技术部，中国建设银行信息技术管理部北京开发中心项目经理、代处长，建信基金管理公司基金运营部总经理助理、副总经理，信息技术部执行总经理、总经理。

3、公司高管人员

孙志晨先生，总裁（简历请参见董事会成员）。曲寅军先生，副总裁，硕士。1999年7月加入中国建设银行总行，历任审计部科员、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、专户投资部总监和首席战略官；2013年8月至2015年7月，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。2015年8月6日起任我公司副总裁，并专任建信资本管理有限责任公司董事、总经理。张威威先生，副总裁，硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行，从事个人零售业务，2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部，从事证券投资基金销售业务，任高级副经理；2005年9月加入建信基金管理公司，一直从事基金销售管理工作，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日起任我公司副总裁。吴曙明先生，副总裁，硕士。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，先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职；2006年3月加入我公司，担任董事会秘书，并兼任综合管理部总经理。2015年8月6日起任我公司督察长，2016年12月23日起任我公司副总裁。吴灵玲女士，副总裁，硕士。1996年7月至1998年9月在福建省东海经贸股份有限公司工作；2001年7月加入中国建设银行总行人力资源部，历任副主任科员、业务经理、高级经理助理；2005年9月加入建信基

金管理公司，历任人力资源部总监助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016年12月23日起任我公司副总裁。

4、督察长

吴曙明先生，督察长（简历请参见公司高级管理人员）。

5、本基金基金经理

姜锋先生，硕士，权益投资部执行投资官。2007年7月毕业于中国人民银行研究生部获金融学硕士学位，同年加入本公司，历任研究员、基金经理、资深基金经理、权益投资部执行投资官。2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理，该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力混合型证券投资基金（LOF），姜锋继续担任该基金基金经理；2014年3月21日起任建信健康民生混合型证券投资基金基金经理；2015年4月22日起任建信环保产业股票基金基金经理。 历任基金经理： 万志勇：2011年7月11日至2015年9月28日； 姜锋：2011年7月11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。

钟敬棣先生，固定收益投资部首席固定收益投资官。

李菁，固定收益投资部总经理

姚锦女士，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

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住 所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2016 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 13 位，较上年上升 4 位；根据 2016 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 153 位，较上年上升 37 位。

截至 2016 年 12 月 31 日，交通银行资产总额为人民币 84,031.66 亿元。2016 年 1-12 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 672.10 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

牛锡明先生，董事长、执行董事。

牛先生 2013 年 10 月至今任本行董事长、执行董事，2013 年 5 月至 2013 年 10 月任本行董事长、执行董事、行长，2009 年 12 月至 2013 年 5 月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生 1983 年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997 年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999 年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。

彭先生 2013 年 11 月起任本行副董事长、执行董事，2013 年 10 月起任本行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任本行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任本行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任本行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任本行行长助理；1994 年至 2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总

裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至2016年12月31日，交通银行共托管证券投资基金270只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

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。

2、场内代销机构

指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站

(www.szse.cn)。

3、场外代销机构

（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：上海市浦东新区银城中路188号 法定代表人：牛锡明 客服电话：95559 网址：

www.bankcomm.com (3) 中国工商银行股份有限公司 住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号 法定代表人：易会满 客服电话：95588 网址：www.icbc.com.cn (4) 中信银行股份有限公司 办公地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座 法定代表人：李庆萍 客服电话：95558 网址：bank.ecitic.com (5) 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 客户服务电话：95568 网址：www.cmbc.com.cn (6) 深圳众禄金融控股股份有限公司 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, www.jjmmw.com (7) 蚂蚁（杭州）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 (8) 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.ehowbuy.com (9) 上海天天基金销售有限公司 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 (10) 和讯信息科技有限公司 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 网址：www.Licaike.com (11) 浙江同花顺基金销售有限公司 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 (12) 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 (13) 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 (14) 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 (15) 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：www.noah-fund.com/ (16) 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：400-821-9031 网址：www.lufunds.com / (17) 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/ (18) 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：刘鹏宇 客户服务电话：0755-83999913 网址：www.jinqianwo.cn/

(19) 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/> (20) 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> (21) 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 (22) 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 (23) 上海联泰资产管理有限公司 注册地址：中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室 法定代表人：燕斌 客户服务热线：4000-466-788 (24) 中信期货有限公司 地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305、14层 法定代表人：张皓 客服电话：400 9908 826 网址：<http://www.citicsf.com>

(25) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006# 法定代表人：张彦 客户服务热线：400-166-1188 网址：

<http://www.jrj.com.cn/> (26) 大泰金石基金销售有限公司 地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室 法定代表人：袁顾明 客户服务热线：400-928-2266 网址：<https://www.dtfunds.com/> (27) 深圳前海微众银行股份有限公司 地址：深圳市南山区桃园路田厦国际中心A36楼 法定代表人：

顾敏 客户服务热线：400-999-8800 网址：www.webank.com

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) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人：金颖

办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层

电话：(010) 58598839

传真：(010) 58598907

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

电话： 021-31358666

传真： 021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（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：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 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：许康玮、陈熹

四、基金的名称

建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）。

五、基金的类型

混合型证券投资基金。

六、基金的投资目标

采取定量和定性相结合的方法，寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力、而且价值被低估的优势上市公司，通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产来获取超额收益。

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。

本基金为混合型基金，股票投资占基金资产净值的比例为 60%-95%，权证占基金资产净值的比例不超过 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值

的比例不低于 5%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人对经济环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析，作出投资决策，具体包括以下几个方面：

1、资产配置策略

本基金自基金合同生效之日起 6 个月内，使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在此基础上，本基金管理人将综合运用定性分析和定量分析手段，对大类资产进行合理配置。

本基金管理人将以大类资产的预期收益率、风险水平和它们之间的相关性为出发点，对于可能影响资产预期风险、收益率和相关性的因素进行综合分析和动态跟踪，据此制定本基金在股票、债券和货币市场工具等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，并进行定期或不定期的调整，以达到控制风险、增加收益的目的。

本基金进行资产配置时所参考的主要指标包括国内生产总值（GDP）增长率、货币供应量及其变化、利率水平及其预期变化、通货膨胀率、货币与财政政策、汇率政策等。

除基本面因素以外，基金管理人还将关注其他可能影响资产预期收益与风险水平的因素，观察市场信心指标、行业动量指标等，力争捕捉市场由于低效或失衡而产生的投资机会。

通常情况下，基金管理人会定期根据市场变化，以研究结果为依据对当前资产配置进行评估并作必要调整。在特殊情况下，亦可针对市场突发事件等在本基金投资范围及各类资产配置比例限制范围内进行及时调整。

2、股票投资策略

股票投资策略可以分为行业配置和个股选择两个层面。

（1）行业配置

基金管理人对宏观经济形势与政策、行业景气程度、拟投资上市公司代表性等方面进行研究，以此为基础，以投资业绩比较基准中各个行业的权重为参照，进行行业配置决策。

各行业之间的预期收益、风险及其相关性仍然是制定行业配置决策时的根本因素，因而基金管理人的研究将围绕着对它们产生重大影响的因素或指标展开，主要包括各行业竞争结构、行业成长空间、行业周期性及景气程度、行业主要产品或服

务的供需情况、拟投资上市公司代表性、行业整体估值水平等等。

通过对上述因素或指标的综合评估，基金管理人定期确定各行业的配置水平，并据此对股票投资组合的行业配置进行调整。如果发生重大事件，基金管理人亦可在本基金投资范围内对行业配置进行及时调整。

（2）股票选择

本基金管理人通过对宏观经济、行业、子行业、上市公司的详细分析来选择具备良好内生性成长或外延式扩张动力、而且价值被低估的优势上市公司。

内生性成长动力方面重点关注上市公司的产品或服务的供需情况、竞争结构以及公司的管理和治理水平等因素，所依据的指标主要是上市公司的净资产收益率（ROE）。

外延式扩张动力方面主要考虑上市公司整体上市、大股东资产注入的可能性以及公司的并购价值和整合前景等，将重点关注上市公司和关联方的优质资产状况和扩张战略等因素，所依据的指标主要是上市公司每股收益（EPS）的预期增长幅度。

在具备良好内生性成长或外延式扩张动力的备选股票构成的股票池基础上，本基金管理人将通过绝对估值与相对估值，结合上市公司的成长性对其股票的内在价值进行判断并与当前股价进行比较，对股票的投资价值做出判断。所依据的指标包括上市公司未来预期利润水平、预期市盈率水平等。

本基金奉行“成长与价值相结合”的选股原则，即选择具有良好内生性成长或外延式扩张动力、而且价值被低估的优势上市公司进行投资。同时，投资业绩比较基准中的股票将是本基金重点关注的对象。

3、债券投资策略

本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。

（1）债券投资组合策略

本基金在综合分析宏观经济和货币政策的基础上，采用久期控制下的主动性投资策略，并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。

在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线形变预测、信用利差管理、回购套利等组合管理手段进行日常管理。

（2）个券选择策略

在个券选择上，本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等级分析、流动性评估等方法来评估个券的风险收益。

具有以下一项或多项特征的债券，将是本基金重点关注的对象：

- ①有较高信用等级的债券；
- ②在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，到期收益率较高的债券；
- ③有良好流动性的债券；
- ④风险水平合理、有较好下行保护的债券。

4、权证投资策略

本基金将通过对权证标的股票基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，综合运用杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等策略获取权证投资收益。

5、资产支持证券投资策略

本基金将仔细研究资产支持证券池中资产的情况以及发行主体的资信，认真分析相关证券的结构，综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等级分析、流动性评估等方法来评估资产支持证券的风险收益。重点关注具有以下一项或多项特征的产品：

- (1) 有较高信用等级；
- (2) 在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，收益率较高；
- (3) 风险水平合理、有较好下行保护。

(二) 投资决策体制和流程

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

如果指数编制单位停止编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，本基金管理人有权对此基准进行调整并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年1月17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12月31日，本报告所列财务数据已经审计。

(一) 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 349,795,066.66 63.89

其中：股票 349,795,066.66 63.89

2 基金投资 --

3 固定收益投资 --

其中：债券 --

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7 银行存款和结算备付金合计 179,677,085.31 32.82

8 其他资产 17,980,922.14 3.28

9 合计 547,453,074.11 100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 9,495,633.00 1.76

B 采矿业 --

C 制造业 290,278,968.54 53.87

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 --

F 批发和零售业 33,855,000.00 6.28

G 交通运输、仓储和邮政业 5,326,049.12 0.99

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 --
 J 金融业 --
 K 房地产业 --
 L 租赁和商务服务业 10,839,416.00 2.01
 M 科学研究和技术服务业 --
 N 水利、环境和公共设施管理业 --
 O 居民服务、修理和其他服务业 --
 P 教育 --
 Q 卫生和社会工作 --
 R 文化、体育和娱乐业 --
 S 综合 --
 合计 349,795,066.66 64.91

注：以上行业分类以 2016 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

2、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

(三) 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	002640	跨境通	1,850,000	33,855,000.00	6.28
2	600146	商赢环球	732,500	24,795,125.00	4.60
3	300285	国瓷材料	578,067	22,608,200.37	4.20
4	002322	理工环科	934,202	22,290,059.72	4.14
5	300436	广生堂	367,600	19,865,104.00	3.69
6	002050	三花智控	1,786,564	19,723,666.56	3.66
7	000651	格力电器	764,200	18,814,604.00	3.49
8	000925	众合科技	696,313	17,108,410.41	3.17
9	000858	五粮液	457,301	15,767,738.48	2.93
10	601678	滨化股份	1,724,400	12,570,876.00	2.33

(四) 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。

(五) 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。

(六) 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。

(七) 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。

(八) 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

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。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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。

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。

(十一) 投资组合报告附注

(1) 该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。

(2) 基金投资的前十名股票未超出该基金的基金合同规定的投资范围。

(3) 其他各项资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 457,914.91

2 应收证券清算款 17,433,379.52

3 应收股利 -

4 应收利息 88,788.43

5 应收申购款 839.28

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 17,980,922.14

(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可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 12 月 31 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 份额净值增长率① 份额净值增长率标准差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

自基金合同生效起-2013 年 12 月 31 日 0.75% 1.00% -5.64% 1.02% 6.39% -0.02%

2014 年 1 月 1 日-2014 年 12 月 31 日 34.86% 1.02% 40.83% 0.91% -5.97%

0.11%

2015 年 1 月 1 日-2015 年 12 月 31 日 18.68%

2.07%

7.73%

1.86%

10.95%

0.21%

2016 年 1 月 1 日-2016 年 12 月 31 日 -8.76% 1.50% -7.87% 1.05% -0.89% 0.45%

自基金合同生效起-2016 年 12 月 31 日 47.11% 1.49% 31.90% 1.28% 15.21%

0.21%

十三、基金的费用概览

(一) 申购费与赎回费

1、申购费

本基金对申购设置级差费率，场内申购和场外申购执行统一收费标准。申购费率随申购金额的增加而递减，最高申购费率不超过 1.50%。

投资人可以多次申购基金，申购费用按每日累计申购金额确定申购费率，以每笔

申购申请单独计算费用。销售机构另有规定的，从其规定。

申购金额(M) 申购费率

M<100 万元 1.50%

100 万元≤M<500 万元 1.0%

M≥500 万元 1000 元/笔

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费

本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，具体赎回费率如下表所示：

持有期限(Y) 场外赎回费率 场内赎回费率

Y<1 年 0.50% 0.50%

1 年≤Y<2 年 0.25% 0.50%

Y≥2 年 0% 0.50%

注：Y 为基金份额持有期限；1 年指 365 天。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

基金管理人可以按照基金合同的相关规定调整申购费率或收费方式，或者调低赎回费率，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体公告。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(二) 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)，投资人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：某投资人投资 5 万元申购本基金，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：

$$\text{净申购金额} = 50000 / (1 + 1.50\%) = 49261.08 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50000 - 49261.08 = 738.92 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49261.08 / 1.05 = 46915.31 \text{ 份}$$

即：投资人投资 5 万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.05 元，则其可得到 46915.31 份本基金基金份额。

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：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

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：某投资人通过场外赎回本基金 50000 份基金份额，赎回适用费率为 0.25%，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：

$$\text{赎回总金额} = 50000 \times 1.148 = 57400 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 57400 \times 0.25\% = 143.5 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 57400 - 143.5 = 57256.5 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 50000 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 57256.5 元。

3、基金份额净值计算

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。

（三）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、基金上市费用；

- 4、基金的证券交易费用；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（四）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理费

本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

基金管理人的管理费逐日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核确认后于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、本章第（三）节中第 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。

（五）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

（六）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在指定媒体上刊登公告。

（七）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

（八）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

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”中董事和监事的信息。
- 2、更新了“四、基金托管人”的主要人员情况及相关业务经营情况。
- 3、在“五、相关服务机构”中，更新了代销机构的变动信息。
- 4、更新了“十、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“十一、基金的业绩”，并经基金托管人复核。
- 6、更新了“二十三、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

二〇一七年四月二十九日