

建信收益增强债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

建信收益增强债券型证券投资基金
招募说明书（更新）摘要

2017 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\

二〇一七年七月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2009 年 4 月 3 日证监许可[2009]281 号文核准募集。本基金的基金合同于 2009 年 6 月 2 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，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，等等。本基金是债券型基金，风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于较低风险、较低收益的品种。本基金在认购期内按 1.00 元初始面值发售并不改变基金的风险收益特征。投资者按 1.00 元面值购买基金份额以后，有可能面临基金份额净值跌破 1.00 元从而遭受损失的风险。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写，并经中国证监会核准。

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。

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不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的买者自负原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 6 月 1 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 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：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者的利益。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，享受国务院特殊津贴，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，兼建信资本管理有限责任公司董事长。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 PacificSouthernUniversity 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、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（简历参见公司高级管理人员）。

5、本基金基金经理

李菁女士，固定收益投资部总经理，硕士。2002年7月进入中国建设银行股份有限公司基金托管部工作，从事基金托管业务，任主任科员。2005年9月进入建信基金管理有限责任公司，历任债券研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、投资管理部副总监、固定收益投资部总监，2007年11月1日至2012年2月17日任建信货币市场基金基金经理；2009年6月2日起任本基金的基金经理；2011年6月16日起任建信信用增强债券型证券投资基金基金经理；2016年2月4日起任建信安心保本五号混合型证券投资基金；2016年6月8日起任建信安心保本七号证券投资基金基金经理；2016年11月16日起任建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2017年5月25日起任建信瑞福添利混合型证券投资基金基金经理。历任基金经理：钟敬棣先生：2009年6月2日至2011年5月11日；卓利伟先生：2009年6月27日至2011年7月15日；李菁女士：2009年6月2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。

李菁女士，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。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准 (ISAE3402) 认证, 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。2012 年荣获第十届中国财经风云榜最佳资产托管银行称号; 2013 年至 2016 年连续荣获上海清算所授予的托管银行优秀奖和中央国债登记结算有限责任公司授予的优秀托管机构奖称号; 2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的养老金业务最佳发展奖称号。

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，2014年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

（二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近140名，其中具有高级职称的专家30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。

（三）基金托管业务经营情况

截止到2017年3月31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361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。

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）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（3）中国农业银行股份有

限公司注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号办公地址：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 公司网址：
www.abchina.com (4) 中国银行股份有限公司住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号法定代表人：田国立客服电话：95566 网址：www.boc.cn (5) 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.95559.com.cn (6) 招商银行股份有限公司注册地址：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 (7) 中国邮政储蓄银行股份有限公司注册地址：北京市西城区金融大街 3 号办公地址：北京市西城区金融大街 3 号法定代表人：李国华客户服务电话：95580 联系人：陈春林传真：(010) 68858117 公司网址：www.psbc.com (8) 中信银行股份有限公司住所：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座办公地址：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 (9) 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 公司网站：www.cmbc.com.cn (10) 北京银行股份有限公司注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号法定代表人：闫冰竹客户服务电话：95526 公司网站：
www.bankofbeijing.com.cn (11) 光大银行股份有限公司注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦法定代表人：唐双宁客户客服电话：95595 网址：
www.cebbank.com (12) 宁波银行股份有限公司注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号法定代表人：陆华裕客户客服电话：95574 网址：
www.nbcb.com.cn (13) 兴业银行股份有限公司注册地址：福州市湖东路 154 号办公地址：上海市江宁路 168 号法定代表人：高建平客服电话：95561 网址：
www.cib.com.cn (14) 渤海银行股份有限公司注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号办公地址：天津市河东区海河东路 218 号法定代表人：李伏安客服电话：95541 网址：www.cbhb.com.cn (15) 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 (16) 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：王东明客服电话：95558 网址：
www.citics.com (17) 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 (18) 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 3845 层法定代表人：宫少林客户服务热线：95565、4008888111 网址：
www.newone.com.cn (19) 红塔证券有限责任公司住所：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼法定代表人：况雨林客服电话：0871-3577930 网址：
http://www.hongtastock.com/ (20) 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 (21) 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 (22) 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 (23) 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 (24) 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 (25) 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：李福春客户服务电话：0431-96688、0431-85096733 网址：
www.nesc.cn (26) 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 (27) 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 (28) 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 (29) 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 (30) 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 (31) 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 (32) 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 (33) 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 (34) 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：凤良志客户服务热线：400—8888—777 网址：www.gyzq.com.cn (35) 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 (36) 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 (37) 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 (38) 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 (39) 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 (40) 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 (41) 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：4008888588 网址：www.longone.com.cn (42) 民生证券有限责任公司注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16—18 层法定代表人：岳献春客服电话：400—619—8888 网址：www.msyzq.com (43) 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 (44) 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 (45) 九州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 (46) 广州证券有限责任公司注册地址：广州市珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19、20 层法定代表人：刘东客服电话：020—88836999 网址：www.gzs.com.cn (47) 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 (48) 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 (49) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司注册地址: 杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室法定代表人: 陈柏青客户服务电话:4000766123 网址: www.fund123.cn 杭州数米基金销售有限公司(50) 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 (51) 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 (52) 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 (53) 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 (54) 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 (55) 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5层5122室法定代表人: 梁越客户服务电话: 4007868868 网址: www.chtfund.com (56) 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 (57) 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: www.buyforyou.com.cn (58) 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/ (59) 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/ (60) 北京虹点基金销售有限公司注册地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元法定代表人: 胡伟客户服务电话: 400-618-0707 网址: http://www.hongdianfund.com/ (61) 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/ (62) 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/ (63) 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/> (64) 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: TANYIKKUAN 客户服务热线: 400-684-0500 网址:

<https://www.ifastps.com.cn> (65) 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 (66) 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 (67) 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 (68) 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 (69) 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/> (70) 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/> 大泰金石基金销售有限公司

(71) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司地址: 北京市朝阳区建国门外大街19号国际大厦A座1504/1505室。 法定代表人: 张冠宇 客户服务热线: 400-819-9868 网址: <http://www.tdyhfund.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: 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：许康玮、陈熹

四、基金的名称

建信收益增强债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型证券投资基金。

六、基金的投资目标

在保持资产流动性的基础上，发挥投研团队在固定收益、股票及金融衍生产品方面的综合研究实力，在有效控制风险的前提下追求基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资范围包括：公司债、国债、金融债、企业债、可转换债券（含可分离式）、中央银行票据、资产支持证券、债券回购、股票、权证以及中国证监会批准的允许基金投资的其他固定收益类金融工具。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。

本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，其中，本基金持有公司债、金融债、企业债、资产支持证券等除国债、中央银行票据以外的固定收益类资产的比例不低于债券资产的 30%，本基金投资于股票（含一级市场新股申购）等权益类品种的比例为基金资产的 0—20%，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

八、基金的投资策略

本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构

建信用类债券投资组合，运用基本面研究择机介入上市公司股票及参与新股申购。综合发挥固定收益、股票及金融衍生产品投资研究团队的力量，重点分析债券发行条款、公司资本结构及盈利增长趋势等因素，构建以公司债券等信用类债券为主体、新股申购及股票二级市场投资为补充的有效匹配投资组合，以实现基金资产的长期稳健增值。所谓信用类债券，是指公司债、金融债、企业债、资产支持证券等除国债、中央银行票据以外的固定收益类金融工具；

（一）资产配置策略

本基金将采取稳健的资产配置策略，严格控制基金净值下行波动的风险。本基金通过宏观策略研究，对相关资产类别（包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等）的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。本基金投资组合将配置各种期限和信用等级的债券类产品并适度参与回购市场的投资；在预期收益高于预期风险的情况下参与一级市场新股申购和增发新股；如果新股的收益率降低，根据风险和收益的配比原则，本基金将参与二级市场的股票买卖。

固定收益类资产中，本基金将主要通过大类资产配置、分类资产配置自上而下进行债券投资管理，以达到提高收益和保持流动性的投资目标。

大类资产配置主要是通过对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断对债券类资产进行选择配置，同时也在银行间市场和交易所债券市场进行选择配置。

分类资产配置主要通过分析债券市场变化、投资人行为、品种间相对价值变化、债券供求关系等进行分类资产配置。可选择配置的品种范围有国债、金融债、企业债、央票、短期融资券等。

（二）债券投资组合策略

本基金在综合分析宏观经济、货币政策的基础上，采用久期管理和信用风险管理相结合的投资策略。

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、信用利差和信用风险管理、回购套利等组合管理手段进行日常管理。

1、久期调整

本基金通过宏观经济及政策形势分析，对未来利率走势进行判断，进而确定组合整体久期和调整范围。

2、收益率曲线形变预测

收益率曲线形状的变化将直接影响本基金组合中长、中、短期债券的搭配。本基金将结合收益率曲线变化的预测，适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。

3、信用利差和信用风险管理

信用利差管理策略决定本基金不同类属间的资产配置策略。本基金将结合不同信用等级间债券在不同市场时期利差变化及收益率曲线变化调整公司债、企业债、金融债、政府债之间的配置比例。

本基金还将综合评估不同行业以及单个企业发行的信用类债券在不同经济周期收益率及违约率变化情况，以决定不同行业或企业信用类债券的投资比例。

4、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。比如运用跨市场套利、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。

（三）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、信用风险分析、隐含期权价值评估、流动性分析等方法来评估个券的投资价值。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、利率预期策略下符合久期设定范围的债券；
- 2、具有较高信用等级、较好流动性的债券；
- 3、资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有较大改善的企业发行的债券；
- 4、在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后，市场交易价格被低估的债券；
- 5、在合理估值模型下，预期能获得较高风险—收益补偿且流动性较好的资产支持证券。

（四）可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。对于公司基本面良好、具备良好的成长空间与潜力、转股溢价率和投资溢价率合理并有一定下行保护的可转债，本基金将予以重点关注。

（五）资产支持证券等品种投资策略

包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助采用数量化定价模型，评估其内在价值。

（六）股票投资策略

股票投资采用行业配置与个股精选相结合的投资策略，并通过灵活的仓位控制等手段来避免市场中的系统风险。

1、仓位控制策略

本基金管理人将根据股票市场的 PEG（市盈率与增长比率）、未来宏观经济走势、政府政策、行业发展状况和企业利润增速来判断股市是否被高估或低估以及偏离的程度，并据此进行资产配置。

2、行业配置策略

本基金行业配置采取相对集中的配置策略，从定性分析和定量分析两个角度对行业进行考察。重点投资行业景气周期处于拐点或者行业景气度处于上升阶段的相关产业。

3、个股精选策略

本基金奉行价值与成长相结合的选股原则，即选择具备价值性和成长性的股票进行投资。基金管理人通过绝对估值与相对估值，对股票的内在价值进行判断，并与当前股价进行比较，对股票的价值性作出判断。在价值维度，主要考察股票账面价值与市场价格的比率和预期每股收益与股票市场价格的比率等。在成长维度，主要从未来 12 个月每股收益相对于目前每股收益的预期增长率、公司可持续增长率和主营业务增长率等指标对股票进行考察。

4、止盈止损策略

当宏观经济、产业政策和市场心理等因素导致基金股票资产跌幅超过设定的警戒线时，本基金将逐步减少股票仓位，把损失控制在有限范围内；当基金股票资产盈利超过设定的止盈线时，本基金将逐步降低股票仓位，以锁定收益。

5、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。

（七）权证投资策略

对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：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、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：30%中债企业债总指数+70%中债国债总指数。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，但高于货币市场基金以及不涉及股票二级市场投资的债券型基金。

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2017年4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2017年3月31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 132,561,349.17 13.11

其中：股票 132,561,349.17 13.11

3 固定收益投资 813,862,979.28 80.47

其中：债券 813,862,979.28 80.47

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 47,647,663.93 4.71

7 其他各项资产 17,322,517.73 1.71

8 合计 1,011,394,510.11 100.00

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 25,292,492.07 2.52

B 采矿业 --

C 制造业	61,794,697.10	6.15
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E 建筑业	19,833,604.00	1.98
F 批发和零售业	10,489,500.00	1.04
G 交通运输、仓储和邮政业	8,076,926.00	0.80
H 住宿和餐饮业	--	--
I 信息传输、软件和信息技术服务业	4,123,805.00	0.41
J 金融业	--	--
K 房地产业	--	--
L 租赁和商务服务业	--	--
M 科学研究和技术服务业	2,950,325.00	0.29
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	132,561,349.17	13.20

注：以上行业分类以 2017 年 3 月 31 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	000928	中钢国际	600,000	13,800,000.00	1.37
2	000998	隆平高科	546,500	11,339,875.00	1.13
3	000651	格力电器	350,000	11,095,000.00	1.11
4	601607	上海医药	450,000	10,489,500.00	1.04
5	600566	济川药业	300,000	10,107,000.00	1.01
6	600467	好当家	2,452,441	9,981,434.87	0.99
7	600029	南方航空	1,002,100	8,076,926.00	0.80
8	600688	上海石化	1,005,900	6,437,760.00	0.64
9	000423	东阿阿胶	85,900	5,635,040.00	0.56
10	000333	美的集团	163,617	5,448,446.10	0.54

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

1	国家债券	89,709,150.00	8.93
2	央行票据	--	
3	金融债券	206,170,000.00	20.53
	其中：政策性金融债	166,386,000.00	16.57
4	企业债券	93,710,391.80	9.33
5	企业短期融资券	110,047,000.00	10.96
6	中期票据	226,244,000.00	22.53
7	可转债（可交换债）	38,477,437.48	3.83
8	同业存单	--	
9	其他	49,505,000.00	4.93
10	合计	813,862,979.28	81.06

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

序号 债券代码 债券名称 数量（张） 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

1	011760033	17 徐工 SCP002	800,000	79,984,000.00	7.97
2	160208	16 国开 08	800,000	78,288,000.00	7.80
3	101553005	15 金发科技 MTN001	500,000	51,785,000.00	5.16
4	101554011	15 淄博城运 MTN001	500,000	51,405,000.00	5.12
5	019539	16 国债 11	500,000	49,970,000.00	4.98

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。

10、投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	248,959.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,983,667.94
5	应收申购款	5,089,889.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,322,517.73

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113009	广汽转债	20,343,589.00	2.03
2	132005	15 国资 EB	5,352,468.00	0.53
3	128009	歌尔转债	5,173,600.00	0.52
4	113010	江南转债	2,270,615.20	0.23
5	132003	15 清控 EB	2,117,800.00	0.21
6	110035	白云转债	1,082,030.60	0.11

7 128011 汽模转债 297,694.60 0.03
 8 128013 洪涛转债 182,652.80 0.02

(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 2017 年 3 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

1、建信收益增强债券 A 基金：

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
----	-------	----------	-----------	--------------

基金合同生效之日	2009 年 6 月 2 日	2009 年 12 月 31 日	3.40%	0.28%	-0.69%	0.06%
			4.09%	0.22%		

	2010 年 1 月 1 日	2010 年 12 月 31 日	9.67%	0.28%	2.57%	0.12%	7.10%	0.16%
--	----------------	------------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

	2011 年 1 月 1 日	2011 年 12 月 31 日	-4.14%	0.30%	6.08%	0.13%	-10.22%	0.17%
--	----------------	------------------	--------	-------	-------	-------	---------	-------

	2012 年 1 月 1 日	2012 年 12 月 31 日	5.69%	0.22%	4.11%	0.08%	1.58%	0.14%
--	----------------	------------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

	2013 年 1 月 1 日	—2013 年 12 月 31 日	-0.10%	0.28%	-1.49%	0.12%	1.39%	0.16%
--	----------------	-------------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

	2014 年 1 月 1 日	2014 年 12 月 31 日	23.86%					
--	----------------	------------------	--------	--	--	--	--	--

0.39%

11.16%

0.14%

12.70%

0.25%

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

21.38%

0.47%

9.02%

0.11%

12.36%

0.36%

2016年1月1日 2016年12月31日

-0.71%

0.22%

2.29%

0.12%

-3.00%

0.10%

2017年1月1日-2017年3月31日 1.23% 0.14% -0.35% 0.09% 1.58% 0.05%

基金合同生效之日 2009年6月2日 2017年3月31日 73.43% 0.31% 36.90%

0.12% 36.53% 0.19%

2、建信收益增强债券C基金：

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

基金合同生效之日 2009年6月2日 2009年12月31日 3.20% 0.27% -0.69%

0.06% 3.89% 0.21%

2010年1月1日 2010年12月31日 9.21% 0.29% 2.57% 0.12% 6.64% 0.17%

2011年1月1日 2011年12月31日 -4.53% 0.30% 6.08% 0.13% -10.61%

0.17%

2012年1月1日 2012年12月31日 5.48% 0.22% 4.11% 0.08% 1.37% 0.14%

2013年1月1日至2013年12月31日 -0.49% 0.27% -1.49% 0.12% 1.00% 0.15%

2014年1月1日至2014年12月31日 23.30% 0.39% 11.16% 0.14% 12.14%

0.25%

2015年1月1日至2015年12月31日

20.90%

0.47%

9.02%

0.11%

11.88%

0.36%

2016年1月1日至2016年12月31日 -1.13%

0.22%

2.29%

0.12%

-3.42%

0.10%

2017年1月1日至2017年3月31日 1.14% 0.15% -0.35% 0.09% 1.49% 0.06%

基金合同生效之日 2009年6月2日至2017年3月31日 68.35% 0.31% 36.90%

0.12% 31.45% 0.19%

十三、费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1、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) 从C类基金份额基金的财产中计提的销售服务费；
- (4) 基金合同生效后的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (7) 基金的证券交易费用；
- (8) 基金财产划拨支付的银行费用；

(9) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

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。

2、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

基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(3) 销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。

本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \times \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中划出，由注

册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。

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、销售服务费，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。

本条第（一）款第 4 至第 9 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。

（二）基金销售时发生的费用

1、申购费

投资者在申购本基金 A 类基金份额时，收取申购费用，申购费率随申购金额增加而递减；投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金 C 类基金份额不收取申购费。

本基金的申购费率如下表所示：

费用种类 A 类基金份额 C 类基金份额

申购费 $M < 100$ 万元 0.8%

0%

$100 \text{ 万元} \leq M < 500 \text{ 万元}$ 0.5%

$500 \text{ 万元} \leq M < 1000 \text{ 万元}$ 0.3%

$M \geq 1000 \text{ 万元}$ 1000 元/笔

注：M 为申购金额

本基金的申购费用应在投资者申购 A 类基金份额时收取，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 A 类、C 类基金份额赎回费率

持有期 < 1 年 0.1%

$1 \text{ 年} \leq \text{持有期} < 2 \text{ 年}$ 0.05%

持有期 ≥ 2 年 0%

注：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 2 个工作日在至少一家中国证监会指定的媒体公告。

3、基金转换

(1) 基金转换是指本公司旗下的开放式基金持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为本公司管理的其他开放式基金的份额。

(2) 基金转换业务规则

1) 本公司旗下基金办理日常转换的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所交易日（本公司公告暂停申购或转换时除外）。

由于各基金销售机构系统及业务安排等原因，开放日的具体交易时间可能有所不同，投资者应参照各基金销售机构的具体规定。

2) 基金转换只能在同一销售机构进行。

3) 转入的基金份额持有期自该部分基金份额登记于注册登记系统之日起开始计算。转入的基金在赎回或转出时，按照自基金转入确认日起至该部分基金份额赎回或转出确认日止的持有时段所适用的赎回费率档次计算其所应支付的赎回费。基金转换后可赎回的时间为 T+2 日。

4) 基金转换，以申请当日基金份额净值为基础计算。投资者采用份额转换的原则提交申请。基金转换遵循先进先出的原则。

5) 投资者办理基金转换业务时，转出的基金必须处于可赎回状态，转入的基金必须处于可申购状态，已冻结的基金份额不得申请基金转换。

6) 单笔转换基金份额不得低于 1000 份。

(3) 基金转换费用

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和转出基金的赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担，如转出基金有赎回费用的，收取该基金赎回费的 25% 归入基金财产。

基金转换费用的具体计算公式如下：

转出金额=转出基金份额转出基金当日基金份额净值

(2) 转入金额:

1) 如果转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率,

转入金额 = 转出金额 (1 - 转出基金赎回费率) / (1 + 转入基金申购费率 - 转出基金申购费率)

2) 如果转出基金的申购费率 \geq 转入基金的申购费率,

转入金额 = 转出金额 (1 - 转出基金赎回费率)

(3) 转换费用 = 转出金额 - 转入金额

(4) 转入份额 = 转入金额 / 转入基金当日基金份额净值

本基金自 2009 年 7 月 3 日开始办理基金转换业务。

4、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公告。

(三) 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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

- 1、更新了第四部分:基金托管人中的基金托管业务经营情况。
- 2、更新了第五部分:相关服务机构中代销机构的变动信息。
- 3、更新了第九部分: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。
- 4、更新了第十部分:基金的业绩,并经基金托管人复核。
- 5、更新了第二十二部分:其他应披露事项,添加了自上次本基金招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

上述内容仅为本招募说明书(更新)摘要,投资人欲查询本更新招募说明书正文,可登陆基金管理人网站 www.ccbfund.cn。

建信基金管理有限责任公司

二〇一七年七月十二日