

posure

建信社会责任混合型证券投资基金招募说明书 (更新) 摘要

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值
----	------	------	-------	------

1	300454	先导股份	17,800	2,584,560.00	4.99
2	300274	阳光电源	77,405	2,366,270.85	4.57
3	600273	航天信息	34,124	2,208,164.04	4.26
4	002065	东华软件	76,284	2,193,165.00	4.23
5	002477	绝美农牧	114,063	2,190,009.60	4.23
6	601318	中国平安	26,019	2,131,996.86	4.12
7	300124	汇川技术	44,303	2,126,544.00	4.11

8	002573	清新环境	95,878	1,981,798.26	3.83
9	000002	万科A	119,599	1,736,577.48	3.35
10	000024	招商地产	45,000	1,642,950.00	3.17

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

				其中含资产支持证券
--	--	--	--	-----------

序号	债券名称	公允价值(元)	公允价值变动率 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中国铝业			--	--
7	可孚转债		114,794.90	0.22	
8	其他				
9	合计		114,794.90	0.22	

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	110031	航信转债	790	114,794.90	0.22

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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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
无。

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未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 本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	103,442.16
2	应收证券清算款	919,526.27

3	应收股利	-
4	应收利息	1,985.23
5	应收申购款	256,793.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,281,752.73

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	000024	招商地产	1,642,960.00	3.17	重大事件停牌

十二、基金的投资业绩

基金业绩截止日为2015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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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。

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	2015年12月31日	2014年12月31日	2013年12月31日	2012年12月31日	2011年12月31日
2015年1月1日-2015年6月30日	24.36%	2.16%	20.81%	1.70%	3.55%
基金合同生效之日 2012年14月1日- 2015年6月30日	125.10%	1.37%	69.03%	1.13%	56.07%
2015年7月1日-2015年12月31日	24.36%	2.16%	20.81%	1.70%	3.55%

十三、基金的费用概览

(一) 认购费用

本基金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	12%
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

认购本基金时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

(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 15%。

申购金额 (M)	申购费率
M < 100万元	15%
100万元 ≤ M < 500万元	1.0%
M ≥ 500万元	1.00元/笔

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

2、赎回费率

申购金额 (M)	赎回费率
持有期 < 1年	0.5%

持有期≥ 2年	0%
---------	----

赎回费用由赎回人承担,赎回中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. 基金管理人可以根据《暂行办法》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个工作日内至少一家中国证监会指定的基金基金网站上公告。

(四) 申购份额与赎回金额的计算方式

1. 申购份额的计算

申购本基金的首期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

$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$
 $\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$
 $\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$

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：

$\text{净申购金额} = 50000 / (1 + 1.5\%) = 49261.08 \text{元}$
 $\text{申购费用} = 50000 - 49261.08 = 738.92 \text{元}$
 $\text{申购份额} = 49261.08 / 1.05 = 46915.31 \text{份}$

即:投资者投资25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

基金份额持有人在其赎回本基金时缴纳的赎回费,基金份额持有人的赎回净额为赎回金额扣除赎回费用。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;赎回净额按照四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此产生的计算误差计入基金财产。

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

(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。

本基金终止清算时发生在清算、按约定支出等超出基金最高净值10%由清算

(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

本基金的费用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：

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

$$H$$
为每日应计提的托管费
 E 为前一日基金资产净值
 基金托管费每日计提，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、公休假等，支付日期顺延。
 基金管理人及基金托管人可磋商酌情调低基金托管费率，基金托管费，此调整不需召开基金份额持有人大会，但基金管理人必须提前于调整费率实施前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(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)基金销售过程中发生的费用

本基金认购费的销售费率、计算方式、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、赎回费的销售费率水平、计算方式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书的相关规定。不同基金合同转换的转换费,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约定确定并公告。

(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

2. 基金管理人 and 基金托管人处理与基金运作有关的事项发生的费用；
3. 其他根据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”中更新了相关服务机构和注册登记机构的变化信息。

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
二〇一五年九月二十九日

(30) 上海证券有限责任公司
注册地址：上海市西藏中路360号
法定代表人：杨国平
客服电话：021-66262118
网址：www.hysec.com.cn

(31) 浙新证券股份有限公司
注册地址：长沙市芙蓉中路88号航天国际财富中心2层
法定代表人：周晖
客户服务电话：0731-4403390
网址：www.zxjq.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：4008888888
网址：www.donghai.com.cn

(33) 申万宏源证券有限公司
办公地址：上海市徐汇区龙漕路989号4层
法定代表人：李梅
客服电话：95528或4008956523
网址：www.swhyc.com

(34) 浙商证券股份有限公司
办公地址：杭州钱江世纪城黄龙世纪广场A6/7
法定代表人：吴强雄
客服电话：0571-9677777
网址：http://www.stocke.com.cn

(35) 天津证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区民治路新华保险大厦16楼
法定代表人：林小明
客服电话：0756-32321188
网址：www.tjzq.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：深圳市福田区红岭中路1010号国信证券大厦
法定代表人：何如
客户服务电话：95566
网址：www.guosen.com.cn

(37) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳罗湖区笋岗街道东504号407发展银行大厦23楼J单元
法定代表人：薛峰
客户服务电话：4006788887
网址：www.zlfund.com, www.jmmw.com

(38) 杭州来基基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市滨江区浦沿街道388号恒生大厦12楼
法定代表人：陈新甫
客户服务电话：4000766123
网址：www.hund123.cn

(39) 上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海虹口区场中路685弄37号4号楼44室
法定代表人：杨文斌
客户服务电话：400-700-9696
网址：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129号1502号楼2层
法定代表人：其实
客户服务电话：4001818188
网址：www.1234567.com.cn

(41) 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：4009000222

(42) 浙江同花顺基金销售有限公司概况
注册地址：浙江省杭州市文二路101号元茂大厦300室
法定代表人：凌顺晖
客户服务电话：400-877-3772
网址：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72号0302
法定代表人：蒋程
客户服务电话：4006188866
网址：www.shengshiview.com

(44) 北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京经济技术开发区安达北路109号院5222室
法定代表人：梁斌
客户服务电话：4009988888
网址：www.chtfund.com

[illegible]

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	300960	完整股份	17,890	2,594,560.00	4.09
2	300274	航天电源	77,406	2,366,270.00	4.57
3	602271	航天信息	34,124	2,208,164.04	4.26
4	002006	东方软件	76,284	2,193,165.00	4.23
5	002477	德美农牧	114,063	2,100,009.00	4.09
6	601218	中国平安	26,019	2,131,906.96	4.13
7	300124	汇川技术	44,303	2,126,544.00	4.11
8	002673	清能环境	66,878	1,981,728.00	3.83
9	000002	万科 A	119,589	1,736,577.48	3.36
10	000024	招商地产	45,000	1,642,166.00	3.17
4.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	债券代码	债券名称	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	
1	国家债券		--	--	
2	央行票据		--	--	
3	金融债券		--	--	
4	资产/质押式金融债		--	--	
4	企业债		--	--	
5	企业短期融资券		--	--	
6	中期票据		--	--	
7	可转债		114,794.90	0.22	
8	其他		--	--	
9	合计		114,794.90	0.22	
5.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	110031	前次转债	790	114,794.90	0.22
6.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资产支持证券投资明细					
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					
8.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					
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					
无。					
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					
本基金本报告期末未投资于国债期货。					
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细					
无。					
10.3 本期国债期货投资评价					
本基金本报告期末未投资于国债期货。					
11. 投资组合构成附注					
11.1 本基金报告期内投资前十名证券的发行主体均未被监管部门立案调查和在本报告期内被					
11.2 本基金报告期末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	项目	名称	金额 (元)		
1	存出保证金		103,442.16		
2	应收证券清算款		919,526.27		
3	应收股利		--		
4	应收利息		1,985.25		
5	应收申购款		256,790.07		
6	其他应收款		--		
7	待摊费用		--		
8	其他		--		
9	合计		1,281,763.73		
11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细					
11.5 报告期末持有的公允价值低于成本的债券明细					
11.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					

法定代表人:薛峰
客户服务电话:400-6769887
网址: www.zfund.com, www.jinm.com
(38) 杭州聚宝基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3888号恒生大厦12楼
法定代表人:陈伟奇
客户服务电话:400766123
网址: www.fund123.com
(39) 上海汇付基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路688号3704室4404室
法定代表人:杨文斌
客户服务电话:400-700-0666
网址: www.ehowbuy.com
(40) 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
(41) 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号泛悦大厦10层
法定代表人:王莉
客户服务电话:4009200222
(42) 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楼4楼303室
法定代表人:凌顺平
客户服务电话:400-877-3772
网址: www.5ifund.com
(43) 北京展晟投资管理有限公司
注册地址:北京市朝阳区九渡河锦怀科技园28号03室
法定代表人:蒋煜
客户服务电话:4008188986
网址: www.zhangsheng.com
(44) 北京汇安基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区技术开发区安立北路10号五层1522室
法定代表人:梁越
客户服务电话:400-8898988
网址: www.htfund.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:张磊
客户服务电话:400-820-2819
网址: www.chiafund.com
(46) 北京微众股权投资有限公司
注册地址:北京市石景山区古城大街13号山财财富中心341
法定代表人:熊晔东
客户服务电话:400-819-0965
网址: <http://www.buyifund.com>
(47) 诺正(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区 虹口区300弄9号3724室
法定代表人:王静敏
客户服务电话:400-821-5359
网址: <http://www.northern.com.cn>
(48) 上海金尚资产管理股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪333号14楼08单元
法定代表人:郭霖
客户服务电话:400-990-6818
网址: <http://www.jiafund.com>
(49) 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层27层及28层
法定代表人:丁国东
客户服务电话:400-910-1166
网址: <http://www.cicfund.com>
基金管理人可以根据相关法律法规规定,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:恒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:许云会
联系人:郑玉斌
电话:010-66228888
(三) 出具法律意见书的律师事务所
名称:北京国枫律师事务所
住所:北京市西城区金融大街10号富凯大厦13层12层
负责人:王丽
联系人:徐建军
电话:010-57099999

[illegible]

序号	股票代码	股票名称	流通受限股票的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明				
1	000024	招商地产	1,642,350.00	3.27	无重大事项				
十一、基金的投资									
基金业绩截止日为2015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。									
本报告期末基金份额净值增长率及其与同期比较基准比较其收益率的比较									
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 基准差 ②	业绩比较基 准收益率 ③	业绩比较基 准收益率 基准差 ④	①-④	②-④			
2012年8月14日— 2013年12月31日	3.00%	0.43%	5.66%	0.98%	-1.66%	-0.55%			
2013年1月1日—2013 年12月31日	16.27%	1.28%	-5.88%	1.06%	22.15%	0.23%			
2014年1月1日—2014 年12月31日	49.03%	2.19%	40.83%	0.91%	9.00%	0.28%			
2015年1月1日—2015 年6月30日	24.36%	1.16%	20.81%	1.70%	3.56%	0.46%			
基金合同生效之日— 2015年6月30日	125.10%	1.37%	69.03%	1.13%	56.07%	0.24%			
十三、基金的费用概览									
(一) 认购费用									
本基金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元		1.2%							
100元≤M<500元		0.8%							
M≥500元		1.00%/笔							
本基金认购费计入认购成本,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) 认购的认购费计算									
本基金认购费由申购采用前端收费模式,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与净认购金额,有效认购金额在基金募集期间形成的基金份额归投资者所有,但基金合同生效,则计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为:									
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+认购费用)/基金初始发行面值									
认购份额计算结果按照四舍五入原则,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元		1.5%							
100元≤M<500元		1.0%							
M≥500元		1.00%/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、登记和配售。									
2、赎回费率									
申购金额(M)		赎回费率							
持有期<1天		0.5%							
1天≤持有期<2天		0.25%							
持有期≥2天		0%							
赎回费用由赎回人承担,赎回费率25%归入基金资产,其余部分由基金用于支付赎回费用和相关的费用(注:1天=86,400S)									
3.基金管理人可以根据《基金合同》的相关规定调整费率结构或方式,基金管理人最迟于新的费率或收费方式实施前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) 申购赎回的申购和赎回的计算方式									
1.申购份额的计算									
本基金申购费采用前端收费模式(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									
申购份额=(净申购金额+申购费用)/基金份额净值									

刘建伟: 1001-6522/311
 刘建伟: 清华大学, 刘建伟
 (四) 审计委员会: 负责公司的财务事务
 姓名: 曹海清, 上海天大会会计师事务所 (特普信普合伙)
 住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号招商局大厦7楼
 办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号招商局大厦7楼
 审计师: 李丹
 联系人: 陈燕
 联系电话: 021-2222-8888
 传真: 021-2222-8881
 基金注册会计师: 薛竟、陈燕
 四、基金名称
 建信社会责任主题证券投资基金
 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, 追求基金资产的长期增值, 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、基金的投资范围
 本基金投资于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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、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关于股指期货等金融工具的投资比例、杠杆比例、保证金比例以及止损比例等风险控制指标。
 本基金可以参与股指期货交易, 以套期保值为目的, 基金管理人将根据中国证监会的相关规定, 以套期保值为限。
 本基金为混合基金, 基金投资组合比例为: 股票资产占基金资产的70%-95%, 其中, 本基金投资于和股指期货有关的上市公司股票比例不超过基金资产的30%; 债券、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货、股指期货及其他金融工具占基金资产的0-30%; 现金或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, 其权证占基金资产净值的比例不超过3%, 任何交易日末在扣除股指期货合约缴纳的保证金后, 现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值不低于基金资产净值的5%。
 如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种, 本基金投资组合将做相应调整, 以符合调整后的比例。
 八、基金的投资策略
 (一) 股票策略
 1. 宏观策略
 本基金在追求自身长期利益的同时兼顾社会责任, 因此一种长期策略, 可真正意义上实现自身的可持续发展, 并有效避免非理性波动给投资者带来的不利影响。本基金长期价值投资的理念, 坚持社会、环境、公司治理和财务四大社会责任责任的履行, 是投资的基本面, 而自上而下“精选个股、努力发掘优质基金的投资品种”
 (二) 股票策略
 1. 宏观策略
 本基金资产配置策略为: 本基金根据外部宏观的经济指标分析宏观经济发展趋势及影响, 判断当前的经济走势, 进而对未来做出合理的预期。在此基础上, 结合流动性及资金面的分析, 判断债券和权益资产的价值及风险并据此进行资产配置。此外, 本基金将持续进行宏观经济与行业景气度分析, 把握行业景气度变化趋势, 并据此进行资产配置。
 (三) 对宏观经济发展趋势的判断
 本基金将依据各宏观经济指标的变化趋势, 如国内生产总值、产出缺口、通货膨胀率、利率水平、固定资产投资、工业增加值等宏观经济指标, 并据此判断宏观经济运行趋势。
 一般来说, 在经济增长放缓, 投资股票类资产可获得较高的收益; 在经济增长持续, 通货膨胀持续, 投资股票类资产可以系统性获得收益; 在滞胀期, 最佳的资产配置策略是适当降低股票仓位持有现金或债券; 在经济衰退, 投资股票类资产可以取得较高的收益。本基金凭借之力把握宏观经济运行趋势, 把握宏观经济发展趋势, 从而进行资产配置, 从而获得资产配置带来的资产配置收益。
 (四) 对流动性和资金面的分析
 资产价格的波动是受到社会整体流动性状况内在规律决定的, 但是资产价格的短期波动主要受到流动性状况的影响。本基金将依据流动性指标, 如货币供应量、利率水平、M2/M1、M2/M0、M2/M3、M2/M4、M2/M5、M2/M6、M2/M7、M2/M8、M2/M9、M2/M10、M2/M11、M2/M12、M2/M13、M2/M14、M2/M15、M2/M16、M2/M17、M2/M18、M2/M19、M2/M20、M2/M21、M2/M22、M2/M23、M2/M24、M2/M25、M2/M26、M2/M27、M2/M28、M2/M29、M2/M30、M2/M31、M2/M32、M2/M33、M2/M34、M2/M35、M2/M36、M2/M37、M2/M38、M2/M39、M2/M40、M2/M41、M2/M42、M2/M43、M2/M44、M2/M45、M2/M46、M2/M47、M2/M48、M2/M49、M2/M50、M2/M51、M2/M52、M2/M53、M2/M54、M2/M55、M2/M56、M2/M57、M2/M58、M2/M59、M2/M60、M2/M61、M2/M62、M2/M63、M2/M64、M2/M65、M2/M66、M2/M67、M2/M68、M2/M69、M2/M70、M2/M71、M2/M72、M2/M73、M2/M74、M2/M75、M2/M76、M2/M77、M2/M78、M2/M79、M2/M80、M2/M81、M2/M82、M2/M83、M2/M84、M2/M85、M2/M86、M2/M87、M2/M88、M2/M89、M2/M90、M2/M91、M2/M92、M2/M93、M2/M94、M2/M95、M2/M96、M2/M97、M2/M98、M2/M99、M2/M100、M2/M101、M2/M102、M2/M103、M2/M104、M2/M105、M2/M106、M2/M107、M2/M108、M2/M109、M2/M110、M2/M111、M2/M112、M2/M113、M2/M114、M2/M115、M2/M116、M2/M117、M2/M118、M2/M119、M2/M120、M2/M121、M2/M122、M2/M123、M2/M124、M2/M125、M2/M126、M2/M127、M2/M128、M2/M129、M2/M130、M2/M131、M2/M132、M2/M133、M2/M134、M2/M135、M2/M136、M2/M137、M2/M138、M2/M139、M2/M140、M2/M141、M2/M142、M2/M143、M2/M144、M2/M145、M2/M146、M2/M147、M2/M148、M2/M149、M2/M150、M2/M151、M2/M152、M2/M153、M2/M154、M2/M155、M2/M156、M2/M157、M2/M158、M2/M159、M2/M160、M2/M161、M2/M162、M2/M163、M2/M164、M2/M165、M2/M166、M2/M167、M2/M168、M2/M169、M2/M170、M2/M171、M2/M172、M2/M173、M2/M174、M2/M175、M2/M176、M2/M177、M2/M178、M2/M179、M2/M180、M2/M181、M2/M182、M2/M183、M2/M184、M2/M185、M2/M186、M2/M187、M2/M188、M2/M189、M2/M190、M2/M191、M2/M192、M2/M193、M2/M194、M2/M195、M2/M196、M2/M197、M2/M198、M2/M199、M2/M200、M2/M201、M2/M202、M2/M203、M2/M204、M2/M205、M2/M206、M2/M207、M2/M208、M2/M209、M2/M210、M2/M211、M2/M212、M2/M213、M2/M214、M2/M215、M2/M216、M2/M217、M2/M218、M2/M219、M2/M220、M2/M221、M2/M222、M2/M223、M2/M224、M2/M225、M2/M226、M2/M227、M2/M228、M2/M229、M2/M230、M2/M231、M2/M232、M2/M233、M2/M234、M2/M235、M2/M236、M2/M237、M2/M238、M2/M239、M2/M240、M2/M241、M2/M242、M2/M243、M2/M244、M2/M245、M2/M246、M2/M247、M2/M248、M2/M249、M2/M250、M2/M251、M2/M252、M2/M253、M2/M254、M2/M255、M2/M256、M2/M257、M2/M258、M2/M259、M2/M260、M2/M261、M2/M262、M2/M263、M2/M264、M2/M265、M2/M266、M2/M267、M2/M268、M2/M269、M2/M270、M2/M271、M2/M272、M2/M273、M2/M274、M2/M275、M2/M276、M2/M277、M2/M278、M2/M279、M2/M280、M2/M281、M2/M282、M2/M283、M2/M284、M2/M285、M2/M286、M2/M287、M2/M288、M2/M289、M2/M290、M2/M291、M2/M292、M2/M293、M2/M294、M2/M295、M2/M296、M2/M297、M2/M298、M2/M299、M2/M300、M2/M301、M2/M302、M2/M303、M2/M304、M2/M305、M2/M306、M2/M307、M2/M308、M2/M309、M2/M310、M2/M311、M2/M312、M2/M313、M2/M314、M2/M315、M2/M316、M2/M317、M2/M318、M2/M319、M2/M320、M2/M321、M2/M322、M2/M323、M2/M324、M2/M325、M2/M326、M2/M327、M2/M328、M2/M329、M2/M330、M2/M331、M2/M332、M2/M333、M2/M334、M2/M335、M2/M336、M2/M337、M2/M338、M2/M339、M2/M340、M2/M341、M2/M342、M2/M343、M2/M344、M2/M345、M2/M346、M2/M347、M2/M348、M2/M349、M2/M350、M2/M351、M2/M352、M2/M353、M2/M354、M2/M355、M2/M356、M2/M357、M2/M358、M2/M359、M2/M360、M2/M361、M2/M362、M2/M363、M2/M364、M2/M365、M2/M366、M2/M367、M2/M368、M2/M369、M2/M370、M2/M371、M2/M372、M2/M373、M2/M374、M2/M375、M2/M376、M2/M377、M2/M378、M2/M379、M2/M380、M2/M381、M2/M382、M2/M383、M2/M384、M2/M385、M2/M386、M2/M387、M2/M388、M2/M389、M2/M390、M2/M391、M2/M392、M2/M393、M2/M394、M2/M395、M2/M396、M2/M397、M2/M398、M2/M399、M2/M400、M2/M401、M2/M402、M2/M403、M2/M404、M2/M405、M2/M406、M2/M407、M2/M408、M2/M409、M2/M410、M2/M411、M2/M412、M2/M413、M2/M414、M2/M415、M2/M416、M2/M417、M2/M418、M2/M419、M2/M420、M2/M421、M2/M422、M2/M423、M2/M424、M2/M425、M2/M426、M2/M427、M2/M428、M2/M429、M2/M430、M2/M431、M2/M432、M2/M433、M2/M434、M2/M435、M2/M436、M2/M437、M2/M438、M2/M439、M2/M440、M2/M441、M2/M442、M2/M443、M2/M444、M2/M445、M2/M446、M2/M447、M2/M448、M2/M449、M2/M450、M2/M451、M2/M452、M2/M453、M2/M454、M2/M455、M2/M456、

行、卖出。基金管理人应当在交易前不确定、不构成或不合规的交易可以选择不执行并，并及时通知基金管理人和相关当事人。

交易指令的传递和执行应当遵循公平原则以利于实现投资回报的宗旨，并应确保各利益主体的合法权益，以便使基金份额持有人得到及时、合理的交易服务。

(三) 投资组合限制

本基金的投资组合将严格按照基金合同进行，基金经理定期向投资决策委员会汇报前期运作情况，并提出下期的投资策略，作为投资决策委员会决策的参考。

九、基金的投资业绩基准

本基金业绩比较基准为：
 $70\% \times \text{沪深300指数收益率} + 25\% \times \text{中国债券综合指数收益率}$

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制机构停止编制该指数、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，并经基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在不损害基金份额持有人利益的前提下变更业绩比较基准并及时公告。

业绩比较基准的理由

本基金为混合型股票型证券投资基金，股票资产占基金资产的比例为60%-95%，故本基金采取75%沪深300指数与25%中国债券综合指数的加权比例，相应25%作为衡量基金整体资产配置是否合理的主要标准。

沪深300指数是反映中国证券市场上市公司编制的，从上海和深圳证券交易所中选取的300只A股作为样本编制成的成份证券指数，该指数代表了沪深两市七亿股左右的市场市值和总市值四分之三的总体特征，具有良好的市场代表性，能够较好地反映沪深证券市场整体运行情况。沪深300指数中的许多成份股是本国经济运行的龙头品种等，以其作为市场的择时指标也已经得出，从而为本基金基本带来长期的收益和风险管理优势，因此，基金管理人选择沪深300指数作为本基金业绩比较基准。

中国债券综合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银行间同业拆借中心、金融债发行、企业债等其他固定收益品种的登记、托管、交易清算等业务的唯一合法运营机构，是政府债券一级托管主体，运营全国国债托管系统的机构，也是中国人民银行授权的全国银行间债券市场自律组织之一，托管、清算和利率互换业务有符合证监会规定的一级托管人，同时中国债券综合指数是目前国内覆盖范围最广的债券类指数之一，具有较好的市场代表性。

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，适合合作为基金业绩的比较基准。

十、基金的风险分析及特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于股票型基金，高于债券型基金及货币型基金，属于中高收益及高风险特征的基金。

十一、基金的投资目标和策略

本基金的投资目标和策略旨在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，并且保证基金所披露的信息真实、准确、完整；同时，通过充分揭示投资风险，切实维护投资者合法权益。本基金经理人承诺依照《证券投资基金法》及其他相关法律法规的规定，于2015年8月27日撰写了本报告中的财务信息、净值表现和投资信息披露等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所披露数据截至至2015年6月30日，本报告所列财务报表数据未经审计。

一、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	46,892,760.90	81.57
2	其中：股票	46,892,760.90	81.57
3	固定收益投资	114,794.90	0.20
4	其中：债券	114,794.90	0.20
5	贵金属投资	-	-
6	衍生金融资产	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和其他货币资金合计	9,891,814.20	16.00
9	其他资产	1,281,762.23	2.23
10	合计	57,489,131.69	100.00

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,100,000.00	4.23
B	制造业	24,472,104.99	47.26
C	D 电子、电力、热力、燃气及生产和供应业	2,794,138.25	5.40
D	E 建筑业	1,281,762.23	2.49
E	F 批发和零售业	-	-
G	H 交通运输、仓储和邮政业	-	-
I	J 住宿和餐饮业	-	-
K	L 信息传输、软件和信息技术服务业	5,406,060.28	10.44
M	N 金融业	4,537,425.14	8.76
O	P 房地产业	4,900,067.24	9.64
N	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,981,798.26	3.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	R 卫生和社会工作	-	-
R	S 文化、体育和娱乐业	521,157.00	1.01
S	T 综合	-	-
合计		46,892,760.90	90.54

例如，某投资者投资5万元申购本基金基金份额，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%)=49387.10元
申购费用=50000-49387.10=612.90元
申购份额=49387.10/1.05=47035.33份

注：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，则其申购份额为49351.21份基金份额。

(三)赎回的计算

基金份额持有人可在赎回本基金时缴回赎回费。基金份额持有人的赎回净额为赎回总额扣除赎回费用，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

赎回费用以人民币为单位，计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回净额按四舍五入方法计算，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

例如：某投资者赎回1万份基金份额，赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值为1.1456元，则其可得赎回金额为：

赎回总金额=10000×1.1456=11456元
赎回费用=11456×0.5%=57.28元
净赎回金额=11456-57.28=11398.72元

注：投资者赎回某类基金10000份基金份额，假设赎回当日该基金份额净值为1.1456元，则可得到净赎回金额为11398.72元。

3. 基金收益的分配原则

T日基金份额净值-T日基金份额净值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，计算结果保留小数点后四位，小数点第五位四舍五入。

（一）基金收益分配方式为现金分红和红利再投资，并在T+1日内公告，特殊情况经中国证监会同意，可以适当延长支付期限；

（二）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）基金合同生效日至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事务所、律师事务所和审计费；
（5）基金份额持有人大会费；
（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。

本基金运作过程中发生的上述费用，如系必须支出，则由基金管理人承担并记入基金财产中。

（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

本基金的管理费按照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：
 $H = E \times 1.5\%$ ，H为当日应计提的管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提，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基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前首个工作日由基金管理人从基金财产中一次性支付给基金管理人。遇法定节假日、公休等，可顺延至下一个工作日。

（2）基金托管人的托管费

本基金托管费按照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：
 $H = E \times 0.25\%$ ，H为当日应计提的托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提，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基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前首个工作日由基金管理人从基金财产中一次性支付，遇法定节假日、公休等，可顺延至下一个工作日。

（七）基金销售服务费

本基金的销售服务费按照前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。基金销售服务费，必须根据实际支付给基金份额持有人的人头数进行分摊，且不得低于每个基金份额持有人至少一笔不低于人民币最低基金份额认购及公开发售的金额。前述上述费率经基金份额持有人大会决议通过。

本基金的第(九)条第(八)项用，根据国家有关法规和协议相应规定，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）基金销售和购买的费用

1、本基金的申购费用和赎回费用
（1）申购费用
本基金采用前端收费方式，申购费率随申购金额的不同而不同。本基金的申购费用于支付注册登记费及其他必要的手续费，申购费率及申购费用适用标准请参见本招募说明书的相关规定。
本基金申购费用采取补差的方式，即首次、追加申购费用均按照本招募说明书约定的相关费率，不再重复收取补差的费用，补差规则按照中国证券投资基金业协会相关法律法规及中国证券登记结算公司的相关规定执行并公告。

（2）赎回费用
①不列入基金费用的项目
A、基金管理人和基金托管人因履行或未完全履行合同义务导致的使用或支出基金财产的损失；
B、基金管理人在基金合同生效后与基金份额持有人发生的事项导致的费用；
C、基金合同生效后所支付的税费使用，包括但不限于诉讼费、会计费和律师费、信息披露费等费用；
D、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和不得列入基金费用的事项。
（2）收取
本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按照国家税收法律、法规执行。
②对于对称性将更明确的说明
A、更新了“二级市场”的“主要市场情况”中的信息。
B、新增了“二级市场”的说明并增加基金行情相关情况。
C、在“五、相关服务机构”中更新了现代机构名称和注册地址变更的信息。
4. 修订了“九、基金的投资”，更新了基金投资组合报告，并补充了基金托管人。
5. 更新了“十、基金的风险揭示”，增加了基金投资风险、基金估值风险、基金流动性风险。
6. 更新了“十二、其他应披露事项”，添补了期间涉及本基金和基金管理人相关临时公告。

建信基金管理有限责任公司
二〇一五年一月二十日