建信现金添利货币市场基金招募说明书（更新）

2015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:交通银行股份有限公司
二〇一五年十月

【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]535号文注册募集。本基金的基金合同于2014年9月17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注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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, 由于基金份额持有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积极管理风险,本基金的特定风险等。本基金为货币市场基金,其风险和预期收益低于股票基金、混合基金和债券基金。投资有风险,投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,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。

本招募说明书所载内容截止日为2015年9月16日,有关财务数据和净值表现截止日为2015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: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经理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。自2011年3月起至现在,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。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。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营运官。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营运官。

殷红军先生,董事,现任中国华电集团资本控股有限公司副总经理。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。

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

张涛女士,监事会主席。东北财经大学投资经济管理专业本科毕业,高级经济师。历任中国建设银行辽宁省分行储蓄处处长、营业部总经理、抚顺市分行行长、辽宁省分行副行长;中国建设银行新疆区分行行长;中国建设银行高级研修院副院长。2014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公司企业融资部经理。

吴洁女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司风险管理部总经理。1992年毕业于南开大学金融系;1995年毕业于中国人民银行金融研究所研究生部。曾任中国建设银行国际业务部外汇资金处主任科员、中国建设银行资金部交易风险管理处、综合处高级副经理(主持工作)、高级经理。2005年9月加入建信基金管理公司,任风险管理部总监。

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。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。

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

于倩倩女士,硕士。2008年6月加入国泰人寿保险公司,任固定收益研究专员;2009年9月加入金元惠理基金管理公司(原金元比联基金管理公司),任债券研究员;2011年6月加入我公司,历任债券研究员、基金经理助理,2013年8月5日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币市场基金基金经理。

陈建良先生,双学士。2005年7月加入中国建设银行厦门分行,任客户经理;2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部, 任债券交易员;2013年9月加入我公司投资管理部,任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总经理助理,2013年12月10日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币市场基金基金经理。

高珊女士,硕士。2006年7月至2007年6月期间在中信建投证券公司工作,任交易员。2007年6月加入我公司工作,历任初级交易员、交易员,基金经理助理;2012年8月28日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年1月29日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年9月17日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年12月20日起任建信货币市场基金基金经理;2015年8月25日起任建信现金添利货币市场基金基金经理。

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,权益投资部副总经理。

许杰先生,权益投资部基金经理。

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:汤嵩彦
电话:021-95559

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2014年《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19位,跻身全球银行20强;根据《财富》杂志发布的“世界500强公司”排行榜,交通银行位列第217位。2014年荣获《首席财务官》杂志评选的“最佳资产托管奖”。

截至2015年3月31日,交通银行资产总额达到人民币6.63万亿元,实现净利润人民币189.7亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心。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。

刘树军先生,资产托管业务中心总裁。

刘先生2014年4月至今任本行资产托管业务中心总裁,2012年5月至2014年4月任本行资产托管部总经理,2011年10月至2012年5月任本行资产托管部副总经理。2011年10月前历任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书,农行总行信贷部工业信贷处处长,农行总行托管部及养老金中心副总经理,本行内蒙古分行副行长。刘先生为管理学硕士,高级经济师。

(三)基金托管业务经营情况

截止2015年二季度末,交通银行共托管证券投资基金132只。此外,还托管了基金公司特定客户资产管理计划、银行理财产品、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、信托计划、养老保障管理基金、企业年金基金、金库宝资产保管、QFII证券投资资产、ROFII证券投资资产、QDII证券投资资产、QDLP资金、证券公司客户资产管理计划、客户资金等产品。

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)网上交易平台

投资者可以通过本公司网上交易平台办理基金的认购、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

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

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)基金份额登记机构

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:刘焕志
电话:010-52682888
传真:010-52682999
经办律师:刘焕志、孙艳利

(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1233号汇亚大厦1604-1608室
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:021-61238888
传真:021-61238800
经办注册会计师:薛竞 陈熹

四、基金的名称

本基金名称:建信现金添利货币市场基金

五、基金的类型

本基金类型:货币市场基金。

六、基金的投资目标

在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资方向

本基金将投资于以下金融工具:

1、现金;
2、通知存款;
3、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;
4、剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券;
5、期限在一年以内(含一年)的债券回购;
6、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;
7、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金将采取个券选择策略、利率策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。

1、资产配置策略

基金根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断,并结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征,决定基金资产在债券、银行存款等各类资产的配置比例,并适时进行动态调整。

2、个券选择策略

在个券选择上,基金将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值,发掘出具备相对价值的个券。

3、利率策略

通过全面研究GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量,分析宏观经济运行的可能情景,并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上,预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

4、利用短期市场机会的灵活策略

由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期内市场失衡;新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的动因,研究其中的规律,据此调整组合配置,改进操作方法,积极利用市场机会获得超额收益。

未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税前)。

十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金, 基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月27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2015年6月30日,本报告中的财务资料未经审计。

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	固定收益投资	18,720,799,397.65	28.83
	其中:债券	18,720,799,397.65	28.83
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	308,000,782.00	0.47
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	45,360,335,862.56	69.85
4	其他资产	546,703,830.32	0.84
5	合计	64,935,839,872.53	100.00

2. 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	9.69	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	4,661,895,284.55	7.74
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金本报告期内基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

3. 基金投资组合平均剩余期限

(1)投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	67

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

(2) 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	26.23	7.74
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	27.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	9.99	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	28.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	14.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		106.89	7.74

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	摊余成本(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	5,342,707,271.06	8.87
	其中:政策性金融债	3,293,017,166.45	5.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	13,247,858,509.77	21.99
6	中期票据	130,233,616.82	0.22
7	其他	-	-
8	合计	18,720,799,397.65	31.08
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券		

5. 报告期末按摊余成本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	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100236	10国开36	7,000,000	701,947,216.39	1.17
2	140443	14农发43	6,000,000	600,704,822.37	1.00
3	011560001	15东航SCP001	3,600,000	360,434,169.55	0.60
4	011537005	15中建材SCP005	3,500,000	349,983,004.53	0.58
5	011510004	15中电投SCP004	3,500,000	349,895,359.26	0.58
6	140357	14进出57	3,300,000	330,563,299.04	0.55
7	041563008	15首钢CP002	3,000,000	300,000,127.99	0.50
8	071503006	15中信CP006	3,000,000	299,964,500.66	0.50
9	071502005	15国泰君安CP005	3,000,000	299,954,203.63	0.50
10	011599184	15武钢SCP001	2,900,000	290,293,035.05	0.48

6. “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1811%
报告期内偏离度的最低值	0.0235%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1167%

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。

8. 投资组合报告附注

(1)本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

(2)本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

(3) 基金投资的前十名债券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

(4)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	546,703,830.32
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	546,703,830.32

十二、基金的业绩

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。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—2014年12月31日	1.1809%	0.0008%	0.3921%	0.0000%	0.7888%	0.0008%
2015年1月1日-2015年6月30日	2.1695%	0.0016%	0.6695%	0.0000%	1.5000%	0.0016%
自基金合同生效起—2015年6月30日	3.3760%	0.0014%	1.0615%	0.0000%	2.3145%	0.0014%

十三、基金的费用概览

(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、销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金的开户费用、账户维护费用。
10、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。

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.30 %÷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前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0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.05%÷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前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。

3.基金销售服务费

本基金的年销售服务费率为 0.15%,销售服务费的计算方法具体如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数
H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费
E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金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基金销售服务费划付指令, 经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份额登记机构,由基金份额登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第4-10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

本基金不收取申购费用与赎回费用。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整相关费率或收费方式,并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(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;

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“三、基金管理人”的“基金管理人概况”,更新了董事、监事的变动信息;

2、更新了“四、基金托管人”的基本情况及相关业务经营情况;

3、更新了“五、相关服务机构”的“代销机构”的相关信息;

4、增加了“九、基金的投资”中的基金投资组合报告;

5、更新了“十、基金的业绩”;

6、“二十二、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。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要,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
二〇一五年十月二十九日

关于建信安心保本二号混合型证券投资基金募集期认购申请确认比例的公告

经中国证监会证监许可[2015]2064号文注册,建信安心保本二号混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2015年9月23日至2015年10月30日公开募集。由于投资者认购踊跃,截至2015年10月27日,本基金的有效认购申请总金额达到5,482,898,749.34元,超过《建信安心保本二号混合型证券投资基金基金份额发售公告》(以下简称 “发售公告”)中规定的募集规模上限50亿元,其中2015年10月27日有效认购申请金额为856,069,190.17元。

根据发售公告的有关规定, 本基金对2015年10月27日之前的有效认购申请均全部确认,对2015年10月27日的有效认购申请采用“比例确认”的方式给予部分确认。

经计算, 本基金2015年10月27日的认购申请确认比例为43.591154%。

2015年10月27日认购申请确认比例和确认金额的计算公式如下:

认购申请确认比例=(50亿元-截至前一日全部有效认购总金额)/当日有效认购总金额。

认购申请确认金额=当日提交的有效认购申请金额×认购申请确认比例。

当发生部分确认时,认购费率按照投资者认购申请确认金额所对应的费率计算,且认购申请确认金额不受认购最低限额的限制。最终认购申请确认金额以本基金的基金份额登记机构计算并确认的结果为准。未确认部分的认购款项将由各销售机构退还给投资者。

投资者可访问本公司网站(www.ccbfund.cn)或拨打本公司客户服务热线400-81-95533(免长途通话费)、010-66228000咨询相关情况。

特此公告。

建信基金管理有限责任公司
2015年10月29日

建信双息红利债券型证券投资基金调整大额申购（转换转入）限额的公告

公告送出日期:2015年10月29日

1.公告基本信息

基金名称	建信双息红利债券型证券投资基金	
基金简称	建信双息红利债券	
基金主代码	530017	
基金管理人名称	建信基金管理有限责任公司	
公告依据	《建信双息红利债券型证券投资基金基金合同》《建信双息红利债券型证券投资基金招募说明书》	
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停大额申购起始日	2015年11月2日
	暂停大额转换转入起始日	2015年11月2日
	限制申购金额(单位:元)	10,000,000
	限制转换转入金额(单位:元)	10,000,000
	暂停大额申购(转换转入)的原因说明	保护基金份额持有人利益 保持基金的平稳运行
下属分级基金的基金简称	建信双息红利A	建信双息红利C
下属分级基金的交易代码	530017	531017
该分级基金是否暂停大额申购(转换转入)	是	是
下属分级基金的限制申购金额(单位:元)	10,000,000	10,000,000
下属分级基金的限制转换转入金额(单位:元)	10,000,000	10,000,000

2.其他需要提示的事项

(1)建信双息红利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)目前大额申购(转换转入)限额为2000万元人民币。为了保持基金的平稳运作,保护基金份额持有人利益,本公司决定自2015年11月2日起将本基金的大额申购(转换转入)限额由2000万元调整为1000万元。

(2)本基金暂停大额申购(转换转入)业务期间,除大额申购(转换转入)外其他业务仍照常办理。

(3)在暂停大额申购(转换转入)业务期间,单日单个基金账户累计申购(含转换转入)本基金(A类或C类)的金额不应超过1000万元(可以达到1000万)。如单日单个基金账户累计申购(含转换转入)本基金(A类或C类)的金额超过1000万元,本基金将有权确认相关业务失败。

(4)本基金恢复大额申购(转换转入)业务的具体时间将另行公告。

(5) 投资者办理具体业务时应遵照本公司及代销机构的相关要求和规定。

(6) 投资者如有疑问, 请拨打本基金管理人客户服务热线:400-81-95533 (免长途通话费)、010-66228000, 或登录网站www.ccbfund.cn获取相关信息。

风险提示:

基金管理人承诺依照诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的“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,由投资者自行负担。

投资者投资本基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件,了解拟投资基金的风险收益特征,并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配。

特此公告。

建信基金管理有限责任公司
2015年10月29日

建信稳定增利债券型证券投资基金调整大额申购（转换转入）限额的公告

公告送出日期:2015年10月29日

1.公告基本信息

基金名称	建信稳定增利债券型证券投资基金	
基金简称	建信稳定增利债券	
基金主代码	530008	
基金管理人名称	建信基金管理有限责任公司	
公告依据	《建信稳定增利债券型证券投资基金基金合同》《建信稳定增利债券型证券投资基金招募说明书》	
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停大额申购起始日	2015年11月2日
	暂停大额转换转入起始日	2015年11月2日
	限制申购金额(单位:元)	3,000,000
	限制转换转入金额(单位:元)	3,000,000
	暂停大额申购(转换转入)的原因说明	保护基金份额持有人利益 保持基金的平稳运行
下属分级基金的基金简称	建信稳定增利A	建信稳定增利C
下属分级基金的交易代码	531008	530008
该分级基金是否暂停大额申购(转换转入)	是	是
下属分级基金的限制申购金额(单位:元)	3,000,000	3,000,000
下属分级基金的限制转换转入金额(单位:元