

建信收益增强债券型证券投资基金招募说明书 (更新摘要)

2018年第1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

二〇一八年一月

(3) 本期国债期货投资评价
本基金报告期内无国债期货持仓。

10. 投资组合报告注:
(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报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2) 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报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	111,269.32
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,147,900.00
4	应收股利	11,924,072.52
5	应收申购款	225,883.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,261,225.26

(4) 报告期末持有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	113001	广汽转债	24,074,900.00	3.61
2	120005	16国信转债	6,147,900.00	0.92
3	131010	13国信转债	2,191,803.20	0.33
4	132003	16国信转债	2,240,000.00	0.31
5	129001	16国信转债	1,514,270.40	0.23

(5) 报告期末前十名股票公允价值变动明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	公允价值变动说明
1	600881	八一钢铁	5,723,784.00	0.86	重大资产

(6) 投资组合报告附注的其他资产明细

本基金无其他资产。

12. 基金的业绩
本基金自成立以来未发表过业绩,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业绩比较基准收益率的比较

1. 建仓期收益增强债券基金:

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
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9月30日	4.03%	0.14%	-0.42%	0.09%	4.45%	0.05%

基金合同生效之日
2009年6月2日
—2017年9月30日

78.22%

0.31%

36.79%

0.11%

41.43%

0.20%

2. 建仓期收益增强债券基金:

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
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— 2013年12月31日	-0.49%	0.27%	-1.49%	0.12%	1.00%	0.15%
2014年1月1日— 2014年12月31日	23.30%	0.39%	11.16%	0.14%	12.14%	0.25%
2015年1月1日— 2015年12月31日	20.90%	0.47%	9.02%	0.11%	11.88%	0.36%
2016年1月1日— 2016年12月31日	-1.13%	0.22%	2.29%	0.12%	-3.42%	0.10%
2017年1月1日— 2017年9月30日	3.68%	0.14%	-0.2%	0.09%	4.10%	0.06%

基金合同生效之日
2009年6月2日
—2017年9月30日

72.58%

0.31%

36.79%

0.11%

35.90%

0.20%

十三、费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1. 基金管理人的管理费

(1) 基金资产的管理费

(2) 基金托管人的托管费

(3) 基金销售服务费

(4) 基金合同生效后的信息披露费

(5) 基金持有人大会费用

(6) 基金销售机构的销售费用

(7) 基金的投资交易费用

(8) 基金财产审计的审计费用

(9) 基金开户费用

(10) 基金销售机构在基金合同约定的范围内参与基金的市场推广、销售、注册登记等费用

上述基金费用均列入基金财产,在法律法规允许的范围内参与基金的市场推广、销售、注册登记等费用

本基金终止清算时发生费用,按实际支出金额从基金财产总值中扣除。

2. 基金费用的费率、计提方法、支付方式和支付频率

(1) 基金管理人的管理费

本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=0.7%×E

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款指令,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

本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=0.2%×E

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,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,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率为30.4%。

(4) 基金合同生效后的信息披露费

本基金信息披露费按前一日基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下:

H=0.4%×E

H为每日应计提的基金销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

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销售服务费划款指令,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。

(5) 基金持有人大会的费用

本基金持有人大会的费用由基金资产承担。

(6) 基金销售机构的销售费用

投资者申购本基金A类基金份额时,收取申购费用,申购费用随申购金额增加而递减,投资者可以多次申购本基金,申购费率按每次申购申请单计算。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:

申购费率	A类、C类基金份额申购费率
持有期1年	0.1%
1年<持有期<2年	0.5%
持有期>2年	0%

注:1指满30天。

赎回费率由赎回基金份额的基金份额持有人承担,不低于赎回金额的25%应归基金财产,其余用于支付赎回费用和相关的其他手续费。基金管理人可以根据《基金合同》的相关规定调整赎回费率或收费方式,或调整赎回费率,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日内在至少一家中国证监会指定信息披露媒体上公告。

3. 转换续

(1) 基金转换是指本公司日常运作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基金的行为。

(2) 基金转换业务

(3) 基金转换费用

(4) 基金转换的最低基金份额

(5) 基金转换费用

(6) 基金转换费用

(7) 基金转换费用

(8) 基金转换费用

(9) 基金转换费用

(10) 基金转换费用

(11) 基金转换费用

(12) 基金转换费用

(13) 基金转换费用

(14) 基金转换费用

(15) 基金转换费用

(16) 基金转换费用

(17) 基金转换费用

(18) 基金转换费用

(19) 基金转换费用

(20) 基金转换费用

(21) 基金转换费用

(22) 基金转换费用

(23) 基金转换费用

(24) 基金转换费用

(25) 基金转换费用

(26) 基金转换费用

(27) 基金转换费用

(28) 基金转换费用

(29) 基金转换费用

(30) 基金转换费用

(31) 基金转换费用

(32) 基金转换费用

(33) 基金转换费用

(34) 基金转换费用

(35) 基金转换费用

(36) 基金转换费用

(37) 基金转换费用

(38) 基金转换费用

(39) 基金转换费用

(40) 基金转换费用

(41) 基金转换费用

(42) 基金转换费用

(43) 基金转换费用

(44) 基金转换费用

(45) 基金转换费用

(46) 基金转换费用

(47) 基金转换费用

(48) 基金转换费用

(49) 基金转换费用

(50) 基金转换费用

(51) 基金转换费用

(52) 基金转换费用

(53) 基金转换费用

(54) 基金转换费用

(55) 基金转换费用

(56) 基金转换费用

(57) 基金转换费用

(58) 基金转换费用

(59) 基金转换费用

(60) 基金转换费用

(61) 基金转换费用

(62) 基金转换费用

(63) 基金转换费用

(64) 基金转换费用

(65) 基金转换费用

(66) 基金转换费用

(67) 基金转换费用

(68) 基金转换费用

(69) 基金转换费用

(70) 基金转换费用

(71) 基金转换费用

(72) 基金转换费用

(73) 基金转换费用

(74) 基金转换费用

(75) 基金转换费用

(76) 基金转换费用

(77) 基金转换费用

(78) 基金转换费用

(79) 基金转换费用

(80) 基金转换费用

(81) 基金转换费用

(82) 基金转换费用

(83) 基金转换费用

(84) 基金转换费用

(85) 基金转换费用

(86) 基金转换费用

(87) 基金转换费用

(88) 基金转换费用

(89) 基金转换费用

(90) 基金转换费用

(91) 基金转换费用

(92) 基金转换费用

(93) 基金转换费用

(94) 基金转换费用

(95) 基金转换费用

(96) 基金转换费用

(97) 基金转换费用

(98) 基金转换费用

(99) 基金转换费用

(100) 基金转换费用

(101) 基金转换费用

(102) 基金转换费用

(103) 基金转换费用

(104) 基金转换费用

(105) 基金转换费用

(106) 基金转换费用

(107) 基金转换费用

(108) 基金转换费用

(109) 基金转换费用

(110) 基金转换费用

(111) 基金转换费用

(112) 基金转换费用

(113) 基金转换费用

(114) 基金转换费用

(115) 基金转换费用

(