建信积极配置混合型证券投资基金

（原建信保本混合型证券投资基金转型）

【2014】年度报告摘要

基金管理人：建信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2015年3月31日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之一以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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及其更新。

本报告中的财务报表经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	建信保本混合
基金主代码	530012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月18日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	674,768,540.34份
基金合同存续期（若有）	不定期

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	建信积极配置混合
基金主代码	530012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月23日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	253,867,958.52份
基金合同存续期（若有）	不定期

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理，在为适用保本条款的每份基金份额提供人民币1.00元的保本保证的基础上，寻求组合资产的稳定增长和保本期期满收益的最大化。
投资策略	本基金采用定比例组合保险策略（Constant-Proportion Portfolio Insurance，CPPI），通过良好的资产配置、组合管理和风险控制，来实现保本和增值的目标。
业绩比较基准（若有）	三年期银行定期存款收益率（税前）
风险收益特征（若有）	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险品种。

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	根据宏观经济周期和市场环境的变化，本基金目上而下积极，动态地配置大类资产，同时通过合理的证券选择，力争获得高于投资业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整大类资产配置比例，同时将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，运用自下而上的个股、个券投资策略，在大类资产配置和证券选择两个层面上实现投资组合的双重优化。
业绩比较基准（若有）	本基金业绩比较基准：35%×沪深300指数+45%×中国债券总指数。
风险收益特征（若有）	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩霞	蔡松云
	联系电话	010-66228888	（010)66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	（010)66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年1月1日－2014年1月22日	2014年1月23日－2014年12月31日	2013年	2012年
本期已实现收益	4,799,639.69	27,366,273.35	59,091,975.17	76,379,353.24
本期利润	2,955,702.16	88,037,455.79	47,226,838.69	114,505,499.50
加权平均基金份额本期利润	0.0024	0.2669	0.0299	0.0519
本期基金份额净值增长率	0.19%	35.56%	2.79%	5.06%
3.1.2 期末期数据和指标	2014年1月22日	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0690	0.1230	0.0667	0.0312
期末基金资产净值	721,326,896.47	344,537,915.45	1,421,560,349.56	1,895,690,329.95
期末基金份额净值	1.0691	1.397	1.067	1.038

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入扣除公允价值变动收益、扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
2.期末可供分配利润按期末可供分配的实现期末分配利润的实现原则计算，期末可供分配利润的金额为期末实现利润减去已分配利润；如期末未分配利润的实现原则为负数，期末可供分配利润的金额为期末未分配利润；（实现原则分配顺序：1）
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
4.本报告期内为建信保本混合型证券投资基金于2011年1月18日成立，2014年1月23日变更为“建信积极配置混合型证券投资基金”。

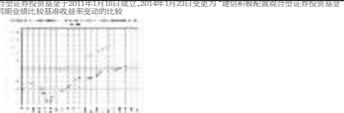
3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 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

3.1.1 期间数据和指标	份额净值增长率①①	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
自基金合同生效起至2014年1月22日	6.90%	0.09%	14.91%	0.01%	-8.01%

注：本基金转型前为建信保本混合型证券投资基金，建信保本混合型证券投资基金于2011年1月18日成立，2014年1月23日变更为“建信积极配置混合型证券投资基金”。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金转型前为建信保本混合型证券投资基金，建信保本混合型证券投资基金于2011年1月18日成立，2014年1月23日变更为“建信积极配置混合型证券投资基金”。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金转型前为建信保本混合型证券投资基金，建信保本混合型证券投资基金于2011年1月18日成立，2014年1月23日变更为“建信积极配置混合型证券投资基金”。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 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
过去三个月	24.27%	1.30%	24.33%	0.91%	-0.06%	0.39%
过去六个月	36.93%	1.03%	34.16%	0.73%	2.77%	0.30%
自基金合同生效起至今	35.56%	0.78%	34.83%	0.67%	0.73%	0.11%

注：1.本基金由建信保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期日变更而来。本基金基金合同于2014年1月23日生效，截止报告期末基金成立未满一年。
2.本报告期内，建信积极配置混合型证券投资基金，建信公司旗下产品投资于沪深300指数及中证指数公司编制的，从上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易的300只A股作为样本编制而成的成份股指数，该指数样本覆盖了沪深市场七成左右的流通市值和超过四分之三的总市值，是具有良好的市场代表性、能够反映A股市场整体走势的指数，沪深300指数中的股东或份额本金因为业绩比较基准收益率高于沪深300指数中证5年期A-AA级企业债券指数，沪深300指数中的股东或份额本金因为基金管理人选择沪深300指数作为本基金投资部分的比较基准，中国债券总指数的发布主体是中央国债登记结算公司是全国银券市场内规模领先、品种齐全、流动性好、信息披露及时、具有权威性的综合性指数，其中，国债指数是中国债券总指数的重要组成部分，国债指数是中国债