建信积极配置混合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：中国工商银行股份有限公司
二〇一八年三月

【重要提示】

根据《建信保本混合型证券投资基金基金合同》，建信积极配置混合型证券投资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后变更而来。

建信保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可［2010]1808号文核准，自2010年12月20日至2011年1月14日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为39,139 户，募集资金及其产生的利息共计3,125,506,923.65元，折合基金份额3,125,506,923.65 份。建信基金管理有限责任公司向中国证监会办理完毕基金备案手续后，于2011年1月18日获书面确认，建信保本混合型证券投资基金基金合同自该日起正式生效。

2014年1月17日，建信保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期。根据《建信保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，于到期操作期间后变更为“建信积极配置混合型证券投资基金”。

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，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等。

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。

投资有风险。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。

本招募说明书所载内容截止日为2018年1月22日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年12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人的利益。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。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，信安北亚地区副总裁。

郑树明先生，董事，现任信安国际（亚洲）有限公司北亚地区首席营运官。1989年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道高级审计经理，新加坡法兴资产管理董事总经理、营运总监、执行长，爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场行销总监。

华淑蕊女士，董事，现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于吉林大学，获经济学博士学位。历任《长春日报》新闻中心农村工作部记者，湖南卫视《听我非常道》财经节目组运营总监，锦辉控股集团公司副总裁、锦辉精细化工有限公司总经理，吉林省信托有限责任公司业务七部副总经理、理财中心总经理、财富管理总监兼理财中心总经理、副总经理，光大证券财富管理中心总经理（MD）。

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。

方尊敏女士，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内控合规部副总经理兼内控合规部审计部（二级部）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内控合规部。

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总监兼信息技术部总经理。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、高级管理人员

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，2015年8月至2017年11月30日专任建信资本管理有限责任公司董事、总经理，2017年11月30日起兼任建信资本管理公司董事长。

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（简历请参见公司高级管理人员）。

5、本基金基金经理

姚锦女士，权益投资部总经理，博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师，2004年5月至2011年5月任天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职，2009年3月17日至2011年3月3日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理；2009年12月17日至2011年5月5日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理。历任建信基金管理公司研究部首席策略分析师、权益投资部副总经理兼研究部首席策略分析师、权益投资部总经理。2012年2月17日起任建信优选成长混合型证券投资基金的基金经理；2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任股票型证券投资基金的基金经理；2014年1月20日起任建信保本混合型证券投资基金的基金经理，该基金于1月23日起转型为建信积极配置混合型证券投资基金，姚锦继续担任该基金的基金经理；2017年6月9日起任建信核心精选混合型证券投资基金的基金经理；2018年1月24日起任建信龙头企业股票型证券投资基金的基金经理。

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。

钟敏棣先生，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）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：易会满
注册资本：人民币35,640,625.71万元
联系电话：010-66105799
联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至2017年末，中国工商银行资产托管部共有员工230人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2017年末，中国工商银行共托管证券投资基金815只。自2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的54项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

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：田国立
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：陈四清
客服电话：95566
网址：www.boc.cn

（5）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

（6）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：胡怀邦
客服电话：95559
网址：www.95559.com.cn

（7）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

（8）中国邮政储蓄银行有限责任公司
注册地址：北京市西城区宣武门西大街131号
办公地址：北京市西城区宣武门西大街131号
法定代表人：陶礼明
客户服务电话：11185
联系人：陈春林
传真：010-66415194
网址：www.cpsrb.com

（9）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

（10）中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人：唐双宁
客户服务电话：95595
公司网站：www.cebbank.com

（11）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：洪琦
传真：010-83914283
客户服务电话：95568
公司网站：www.cmbc.com.cn

（12）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

（13）深圳众禄基金销售股份有限公司
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：400-678-8887
网址：www.zlfund.cn，www.jjmmw.com

（14）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：400-076-6123
网址：www.fund123.cn

（15）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

（16）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：400-181-8188
网址：www.1234567.com.cn

（17）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：400-920-0022
网址：www.Licaike.com

（18）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

（19）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：400-818-8866
网址：www.shengshiview.com

（20）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号五层5122室
法定代表人：梁越
客户服务电话：400-786-8868
网址：www.chtfund.com

（21）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：张扈
客户服务电话：400-820-2819
网址：www.chinapnr.com

（22）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

（23）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

（24）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

（25）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：www.hongdianfund.com

（26）深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
法定代表人：刘鹏宇
客户服务电话：0755-83999913
网址：www.jinqianwo.cn

（27）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：www.yingmi.cn

（28）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：TEO WEE HOWE
客户服务热线：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn

（29）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：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.hcjijin.com

（30）天津国美基金销售有限公司
注册地址：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

（31）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：李兴春
客户服务热线：400-921-7755
网址：www.leadbank.com.cn

（32）上海万得基金销售有限公司
注册地址：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

（33）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：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：www.jrj.com.cn

（34）大泰金石基金销售有限公司
注册地址：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：袁颖明
客户服务热线：400-928-2266
网址：www.dtfunds.com

（35）北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址：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：www.tdyhfund.com

（36）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
客户服务热线：4000-618518400-817-5666010-
网址：danjuanapp.com

（37）嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
法定代表人：赵学军
客户服务热线：400-021-8850
网址：www.harvestwm.cn

（38）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
法定代表人：李一梅
客户服务热线：400-817-5666
网址：www.amcfortune.com

（38）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

（39）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：张佑君
客服电话：95558
网址：www.citics.com

（40）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
法定代表人：杨宝林
客服电话：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

（41）光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
客服电话：10108998
网址：www.ebscn.com

（42）招商证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
客户服务热线：95565、400-888-8111
网址：www.newone.com.cn

（43）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

（44）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

（45）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

（46）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

（47）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

（48）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

（49）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：400-888-8123
网址：www.xyzq.com.cn

（50）华泰证券股份有限公司
地址：南京市江东中路228号
法定代表人：周易
客户咨询电话：0755-82492193
网址：www.htsc.com.cn

（51）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

（52）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：蔡咏
客户服务热线：400-888-8777
网址：www.gyzq.com.cn

（53）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

（54）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：400-600-8008
网址：www.china-invs.cn

（55）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

（56）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.ewww.com.cn

（57）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

（58）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

（59）平安证券股份有限公司
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：400-886-6338
网址：stock.pingan.com

（60）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

（61）红塔证券股份有限公司
注册地址：云南省昆明市北京路155号附1号
办公地点：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦7-11楼
法定代表人：况雨林
客服电话：0871-3577930
网址：www.hongtazq.com

（62）九州天源证券有限公司
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

（63）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：www.stocke.com.cn

（64）广州证券有限责任公司
注册地址：广州市珠江西路6号广州国际金融中心主塔19、20层
法定代表人：邱三发
客服电话：020-88836999
网址：www.gzs.com.cn

（65）申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
客户服务电话：400-800-0562，400-889-5523
网址：www.swhysc.com

（66）中信期货有限公司
地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层
法定代表人：张皓
客服电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com

（67）华融证券股份有限公司
法定代表人：祝献忠
地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦11至18层
客服电话：95390
网址：www.hrsec.com.cn

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）法律登记机构

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：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01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
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：沈光杰
经办注册会计师：许康玮、陈熹

四、基金的名称

建信积极配置混合型证券投资基金。

五、基金的类型

混合型证券投资基金。

六、基金的投资目标

根据宏观经济周期和市场环境的变化，本基金自上而下积极、动态地配置大类资产，同时通过合理的证券选择，力争取得高于投资业绩比较基准的回报。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、权证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合中股票、权证等权益类资产占基金资产的30%-80%，其中，

本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的20%-70%，其中，基金保留的现金以及投资于到期日在一年期以内的政府债券的比例合计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本基金投资其他品种，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

（一）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。

1、大类资产配置策略

本基金将采用“自上而下”的多因素分析决策支持系统，结合定性分析和定量分析实现大类资产的积极、动态配置。

根据现代投资组合理论，资产配置决策应该基于对大类资产的预期收益率、风险水平及其相关性的判断而制定。据此，本基金管理人将对于可能影响资产预期风险、收益率和相关性的因素进行综合分析和动态跟踪，制定本基金在股票、债券和货币市场工具等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，并进行定期或不定期的调整，以达到控制风险、增加收益的目的。

除上述基本面因素以外，基金管理人还将关注其他可能影响资产预期收益与风险水平的因素，观察市场信心指标等，力争捕捉市场由于低效或失衡而产生的投资机会。

通常情况下，基金管理人会以季度为周期，定期根据市场变化，以研究结果为依据对当前资产配置进行评估并作必要调整。在特殊情况下，例如市场发生重大突发事件，或预期将产生剧烈波动时，基金管理人也将对资产配置进行及时调整。通过大类资产配置，本基金实现在整体投资组合层面的第一重优化。

具体调整流程如下：

（1）从国内生产总值、通货膨胀率、利率水平、货币信贷数据等因素判断当前宏观经济所处的周期，结合利率和货币政策等相关因素，对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测；

（2）从货币供应量、银行信贷、储蓄存款余额、股市成交状况、银行回购利率走势等方面对市场流动性和资金流向进行分析；

（3）对股市估值及风险进行分析。本基金主要采用相对估值法和绝对估值法相结合的方法衡量股市的估值水平及风险。A、相对估值法主要是通过将A股估值水平和历史估值水平、同一时期H股和国际股市的估值水平进行比较，再结合对A股合理溢价波动区间的分析，判断当前A股市场估值水平是否合理；B、绝对估值法则主要采用FED模型、DCF模型和DDM模型计算市场合理估值水平，与当前市场估值进行比较，判断市场的估值风险。

（4）对债市估值及风险进行分析。本基金主要通过对利率走势、利率期限结构、通货膨胀率、货币信贷数据等因素的分析，预测债券的投资收益和风险；同时结合宏观经济、行业前景对公司财务进行分析，从而考察其对企业信用利差的影响，进行信用类债券的估值和风险分析。

（5）确定大类资产配置比例，并根据资产组合调整规模、市场股票资金供需状况，对不同调整方案的风险、收益进行模拟，从而确定最终大类资产配置方案。

2、股票投资策略

本基金坚持“自下而上”的个股选择策略，致力于选择具有竞争力比较优势、未来成长空间大、持续经营能力强的上市公司，同时结合财务数据定量分析和多种价值评估方法进行多角度投资价值分析。

运用“自下而上”的个股精选策略构建股票投资组合，可能导致行业配置过度集中的风险。为此，本基金将运用行业偏离度等指标，对行业配置风险进行控制。

（1）定性选取具备竞争力优势的上市公司

首先通过麦克尔·波特优势竞争企业要素理论对上市公司进行定性的评判，主要选取具备一项或多项企业竞争优势要素的上市公司作为重点投资对象（如下表所示）。

资源优势	拥有稀缺、垄断的自然资源或市场资源
技术优势	自有知识产权；技术壁垒较高；技术领先
规模优势	国内、外市场份额较大的行业龙头，具有规模生产成本优势
品牌优势	拥有世界品牌；中国驰名商标；行业知名度高
市场优势	国内、外市场份额较大的行业龙头；提供独特细分市场产品，子行业垄断或寡头垄断者；受非关税壁垒政策保护的行业
管理优势	已经真正执行现代企业制度
国际优势	具有劳动力成本比较优势；出口特有资源禀赋的优势行业；对外开放较早、关税壁垒较低的行业
股东优势	控股股东或实际控制人实力雄厚，对上市公司的经营发展有较大潜在或现实支持力度

（2）财务数据定量分析

对按上述步骤定性筛选出来的股票，进一步进行财务数据的定量分析。本基金将采用价值因子与成长因子综合评估的的方式选取兼顾成长和价值的上市公司。其中，价值因子与成长因子包含如下指标

价值因子	成长因子
净资产与市值比率（B/P）	ROE（1-红利支付率）
每股盈利/每股市价（E/P）	过去2年主营业务收入复合增长率
年现金流/市值（C/P）	过去2年每股收益复合增长率
销售收入/市值（S/P）	

（3）股票选择

通过价值因子和成长因子评估，运用综合打分方法，精选个股作为本基金的投资对象。

3、债券投资策略

本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。

（1）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。

A、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。

B、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。

C、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债券类属间的配置策略。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金融债、公司债、政府债之间的配置比例。

本基金还将综合评估不同行业的公司债或短期融资券在不同经济周期收益率及违约率变化情况，以决定不同行业公司债或短期融资券的投资比例。

D、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。