

---

**建信双利策略主题分级股票型  
证券投资基金  
招募说明书（更新）摘要  
2017 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：招商银行股份有限公司**

**二〇一七年六月**

---

## 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会 2011 年 3 月 10 日证监许可[2011]355 号文核准募集。本基金合同已于 2011 年 5 月 6 日生效。

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，本基金的特定风险，等等。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》，了解本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。

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并不构成新基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 5 月 5 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 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

成立日期：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：

股东名称	股权比例
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，兼建信资本管理公司董事长。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（亚洲）区域副总裁。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，现任中国华电融资租赁有限公司董事长兼总经理。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、中国华电集团资本控股有限公司副总经理。

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监察稽核部副总经理,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监察稽核部。

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、公司高级管理人员

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，并专任建信资本管理有限责任公司董事、总经理。

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

梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师（CFA），2003年1月获清华大学经济学博士学位。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限

责任公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理；2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2011年9月8日至2016年7月20日任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金基金经理；2015年3月25日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理；2015年7月31日起任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金基金经理；2015年8月6日至2016年10月25日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：

万志勇：2011年5月6日至2012年5月18日；

马志强：2011年8月2日至2015年3月25日；

梁洪昀：2015年3月25日至今。

#### 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）基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

注册资本：252.20 亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

## 2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2017 年 3 月 31 日，本集团总资产 60,006.74 亿元人民币，高级法下资本充足率 14.43%，权重法下资本充足率 12.08%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室 5 个职能处室，现有员工 60 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管

服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”。

## （二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996 年 12 月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理，杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008 年 4 月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

### （三）基金托管业务经营情况

截至2017年3月31日，招商银行股份有限公司累计托管285只开放式基金。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、场外发售机构

##### （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

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](http://www.ccbfund.cn)。

##### （2）场外代销机构

（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：王洪章

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://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](http://www.icbc.com.cn)

（3）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：田国立

客服电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

（4）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：牛锡明

客服电话：95559

网址：[www.95559.com.cn](http://www.95559.com.cn)

（5）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](http://www.cmbchina.com)

（6）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](http://www.abchina.com)

（7）中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：李庆萍

客服电话：95558

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

（8）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：洪崎

客户服务电话：95568

公司网站：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

（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](http://www.bankofbeijing.com.cn)

（10）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](http://www.gtja.com)

（11）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](http://www.citics.com)

（12）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客服电话：10108998

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

（13）招商证券股份有限公司

注册地址：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、4008888111

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

（14）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](http://www.cc168.com.cn)

（15）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](http://www.htsec.com)

（16）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](http://www.95579.com)

（17）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：北京市朝阳区门内大街 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](http://www.csc108.com)

（18）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](http://www.qlzq.com.cn)

（19）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](http://www.nesc.cn)

（20）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.bhzq.com](http://www.bhzq.com)

（21）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](http://www.gf.com.cn)

（22）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](http://www.gfhfzq.com.cn)

（23）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](http://www.cindasc.com)

（24）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：4008888123

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

（25）平安证券有限责任公司

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：4008866338

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

（26）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：4006008008

网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

（27）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](http://www.axzq.com.cn)

（28）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：400-8888-777

网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

（29）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](http://www.chinastock.com.cn)

（30）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：0532-95548

网址：[www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

（31）华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户咨询电话：025-84579897

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

（32）申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路  
358 号大成国家大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李季

客服电话：4008-000-562

网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

（33）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](http://www.962518.com)

（34）财富证券股份有限公司

注册地址：长沙市芙蓉中路 2 段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：周晖

客户服务电话：0731-4403340

网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

（35）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：4008888588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

（36）申万宏源证券有限公司

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523 或 4008895523

网址：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

（37）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：<http://www.stocke.com.cn>

（38）广州证券有限责任公司

注册地址：广州市珠江西路 5 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](http://www.gzs.com.cn)

（39）红塔证券有限责任公司

住所：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

客服电话：0871-3577930

网址：<http://www.hongtastock.com/>

（40）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：深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

（41）中金公司

地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27、28 层

法定代表人：丁学东

客服电话：010-65051166

网址：<http://www.cicc.com.cn>

（42）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 9908 826

网址：<http://www.citicsf.com>

（43）深圳众禄金融控股股份有限公司

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：4006788887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)，[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

（44）杭州数米基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000766123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（45）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](http://www.ehowbuy.com)

（46）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](http://www.1234567.com.cn)

（47）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：4009200022

网址：[www.Licaike.com](http://www.Licaike.com)

（48）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](http://www.5ifund.com)

（49）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：4008188866

网址：[www.shengshiview.com](http://www.shengshiview.com)

（50）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：4007868868

网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

（51）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：张晶

客户服务电话：400-820-2819

网址：[www.chinapnr.com](http://www.chinapnr.com)

（52）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/](http://www.noah-fund.com/)

（53）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 /](http://www.lufunds.com/)

（54）北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人：董浩

客户服务电话：400-068-1176

网址：[www.jimufund.com/](http://www.jimufund.com/)

（55）深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾路 1 号 A 栋 201 室

法定代表人：齐小贺

客户服务电话：0755-83999913

网址：[www.jinqianwo.cn/](http://www.jinqianwo.cn/)

（56）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：<http://www.yingmi.cn/>

（57）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：TAN YIK KUAN

客户服务热线：400-684-0500

网址：[https:// www.ifastps.com.cn](https://www.ifastps.com.cn)

(58) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：燕斌

客户服务热线：4000-466-788

(59) 深圳前海微众银行股份有限公司

地址：深圳市南山区桃园路田厦国际中心 A36 楼

法定代表人：顾敏

客户服务热线：400-999-8800

网址：[www.webank.com](http://www.webank.com)

(60) 北京汇成基金销售有限公司

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.fundzoe.cn](http://www.fundzoe.cn)

(61) 上海利得基金销售有限公司

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：沈继伟

客户服务热线：400-033-7933

网址：[www.leadbank.com.cn](http://www.leadbank.com.cn)

(62) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

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：<http://www.jrj.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。

## 2、场内发售机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

### （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：金颖

办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

联系电话：0755-25938095

传真：0755-25987538

联系人：任瑞新

### （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：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：陈熹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：许康玮、陈熹

## 四、基金的名称

本基金名称：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

## 五、基金的类型

本基金类型：股票型证券投资基金

## 六、基金的投资目标

本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，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

本基金的投资范围为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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规和监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金为股票型基金，基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0-3%；固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

## 八、基金的投资策略

### 1、大类资产配置策略

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，本基金将以此为出发点，对于可能影响资产预期收益率、风险水平和相关性的因素进行综合分析和动态

跟踪，据此制定基金在股票、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调整，以达到控制风险、增加收益的目的。

此外，基金管理人还将关注其他可能影响资产预期收益率与风险水平的因素，观察市场信心指标、行业动量指标等，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，亦可针对市场突发事件等进行及时调整。本基金资产配置具体调整流程如下：

- （1）计算股票市场估值水平；
- （2）分析宏观经济运行特征，预测未来经济增长率、行业、公司的盈利增长率，分析债券预期收益率；
- （3）综合比较股票市场估值、债券收益率以及未来公司盈利增长，确定资产组合配置；
- （4）根据资产组合调整规模、市场股票资金供需状况，将对不同调整方案的风险、收益进行模拟，确定最终资产配置方案。

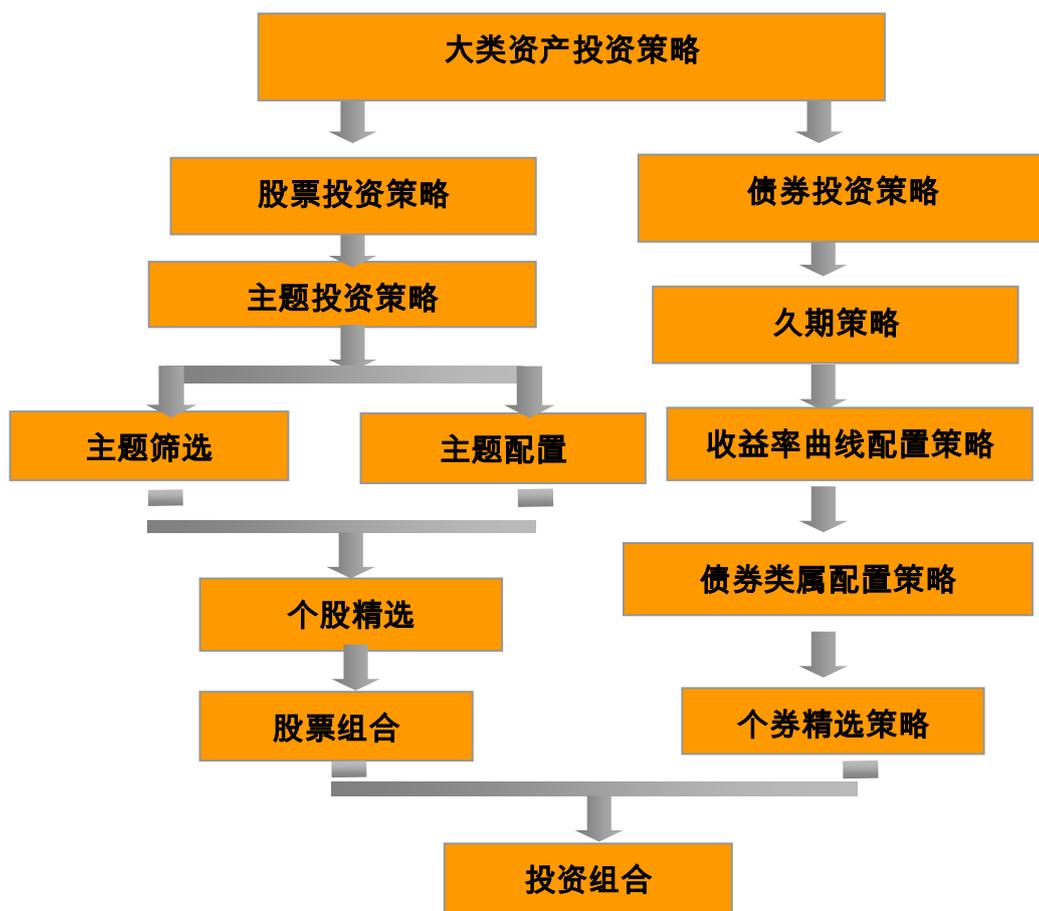


图 1 大类资产投资策略

## 2、股票投资组合策略

### (1) 主题筛选策略

本基金将通过自上而下的方式，从社会、文化、科技、国内外宏观经济、国家政策、资本市场发展情况等多个角度出发，在深入研究的基础上，通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题（详见图 2）。

按照主题产生的大类原因，本基金将主要关注以下五类主题：政策促进类主题、模式转化类主题、科技进步类主题、投资工具增加类主题、事件类主题，通过对投资主题的细分，可以帮助本基金更好地把握主题的发展规律，并且有利于本基金对于同类主题投资机会的对比分析。

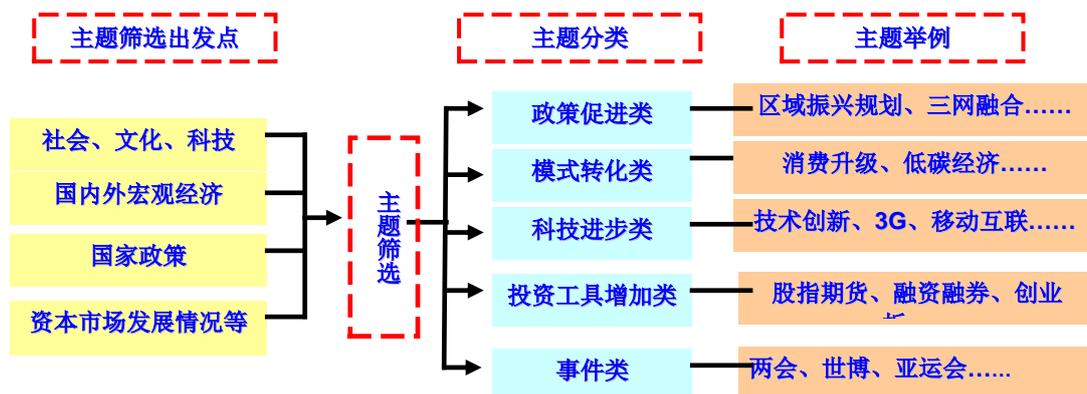


图2 主题筛选策略

## （2） 主题配置策略

在主题筛选的基础上，本基金将综合考虑主题产生原因、主题景气程度、主题投资可行性、主题估值水平等因素，确定每个主题的配置权重范围，从而进行主题配置（详见图3）。

分析主题产生的原因以及原因的可持续性决定主题配置的首要因素。在主题产生的初期，本基金将对其产生的原因进行分析，同时通过分析促进主题发展的各项原因的可持续性、对产生原因相同或者相似的主题进行对比分析，选择出发展前景良好、具有投资价值的主题。

主题的景气程度分析主要包括投资者对主题的关注程度分析、主题的发展阶段分析等方面，随着市场对主题关注程度的变化以及主题发展阶段的变化，本基金将对主题的配置比例进行调整。

主题投资可行性主要考察主题市场容量、流动性、覆盖率等因素，本基金选用流通市值占比、总市值和日均成交金额等作为主题市场投资可行性的参考指标。

主题市场估值是指主题覆盖个股的估值指标均值，本基金将选用市盈率、市净率和市销率等作为市场估值的参考指标。

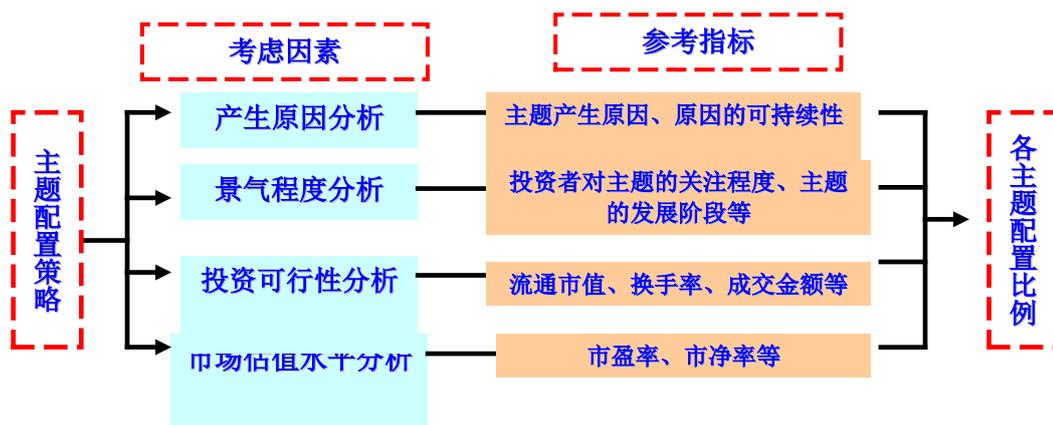


图3 主题配置策略

### （3） 个股投资策略

在前述主题筛选和主题配置的基础上，本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合（详见图4）。

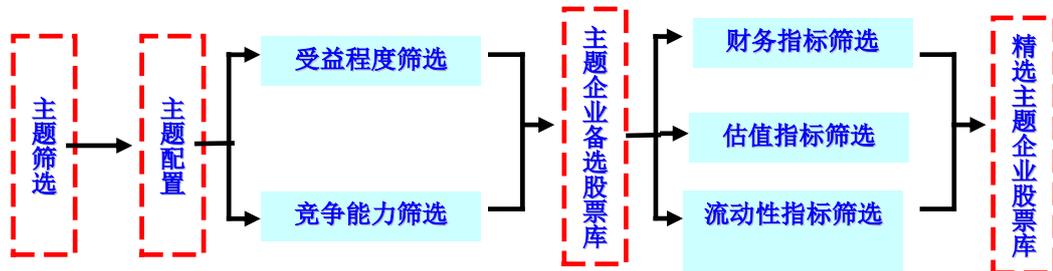


图4 个股投资策略

具体分以下两个层次进行股票挑选：

#### A、 备选主题企业股票库投资策略

在确立投资主题及投资主题配置比例之后，本基金将选择受益于投资主题并且具有良好竞争能力的股票进入备选库，具体来说本基金对上市公司受益程度以及竞争能力考核的指标主要有：

##### I、 受益程度筛选

主要包括公司盈利模式、公司业绩受主题驱动的程度以及持续性、类似公司受主题驱动程度的比较、公司业绩弹性等。

## II、竞争能力筛选

主要包括包括公司治理结构、管理者素质、市场营销能力、技术创新能力、是否具有垄断性资源、是否具有行业壁垒、是否有专有技术、特许权、品牌知名度、是否是行业垄断或寡头垄断者等。

### B、精选主题企业股票库投资策略

在主题企业备选股票库的基础上，本基金将通过三类指标的筛选最终确定精选主题企业股票库：

#### I、财务指标筛选

主要包括偿债能力分析指标、营运能力分析指标、盈利能力分析指标、发展能力分析指标四个方面。

#### II、估值指标筛选

主要包括 PE、PB、EV/EBITDA、PS 等指标。

#### III、流动性指标

主要包括流通市值、总市值、日均成交金额、换手率等指标。

## 3、债券投资策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略：

### （1）久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

### （2）收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

### （3）债券类属配置策略

根据国债、金融债、公司债、可转债、资产支持证券等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被

相对高估的类属债券，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对公司债、可转债、资产支持证券等新品种的投资，主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和管理的，获取超额收益。

#### （4）个券精选策略

个券精选策略指基于对信用质量、期限和流动性等因素的考察，重点关注具有以下特征的债券：较高到期收益率、较高当期收入、预期信用质量将改善、期权价值被低估，或者属于创新品种而价值尚未被市场充分发现的个券。通过深入研究，发掘这些具有较高当期收益率或者较高升值潜力的债券，可为投资者创造超额投资回报。

#### 4、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

### 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率}$ 。

如果基金所跟踪的目标指数被中证指数有限公司停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更基金的业绩比较基准，并在变更前提前 2 个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

### 十、基金的风险收益特征

本基金属于采用高仓位操作的股票型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。

从本基金所分离的两类基金份额来看，建信稳健份额将表现出低风

险、收益稳定的明显特征，其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额；建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征，其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。

## 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年4月19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。

本报告中财务资料未经审计。本报告期截至2017年3月31日止。

### 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	权益投资	150,873,411.28	87.83
	其中：股票	150,873,411.28	87.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	216,999.05	0.13
	其中：债券	216,999.05	0.13
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,661,153.27	12.03
8	其他资产	36,710.57	0.02
9	合计	171,788,274.17	100.00

### 1、报告期末按行业分类的股票投资组合

#### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值
----	------	---------	---------

			比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,710,924.86	1.67
B	采矿业	8,317,872.00	5.14
C	制造业	52,433,131.16	32.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,398,613.47	3.95
E	建筑业	8,344,118.80	5.15
F	批发和零售业	115,425.52	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	4,917,440.06	3.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	768,202.00	0.47
J	金融业	50,508,975.48	31.20
K	房地产业	9,626,002.93	5.95
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	282,436.20	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,816,240.00	1.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,697,150.80	1.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,936,878.00	1.81
S	综合	-	-
	合计	150,873,411.28	93.20

注：以上行业分类以2017年3月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

### (2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

### 3、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	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	601318	中国平安	265,856	9,839,330.56	6.08
2	601328	交通银行	1,212,900	7,556,367.00	4.67

3	600900	长江电力	462,261	6,134,203.47	3.79
4	000001	平安银行	587,800	5,390,126.00	3.33
5	601166	兴业银行	313,900	5,088,319.00	3.14
6	601988	中国银行	1,232,300	4,559,510.00	2.82
7	000783	长江证券	443,600	4,342,844.00	2.68
8	002142	宁波银行	232,214	4,277,381.88	2.64
9	000776	广发证券	233,300	3,987,097.00	2.46
10	601668	中国建筑	382,800	3,521,760.00	2.18

#### 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	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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	216,999.05	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	216,999.05	0.13

#### 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	113011	光大转债	2,170	216,999.05	0.13

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8、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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

(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

(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。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

(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

(1) 本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，广发证券股份有限公司（000776）于2016年11月28日发布公告称11月26日收到中国证监会行政处罚决定书：2015年1月16日，中国证监会公开通报 2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司因存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题，且涉及客户数量较多，受到责令限期改正的行政监管措施。2015年8月24日，收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（鄂证调查字2015023号）。因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立案调查。2015年9月12日，因在接入恒生HOMES系统期间未采取有效措施严格审查客户身份的真实性，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，因此受到中国证监会责令整改，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款等处罚。

(2) 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	26,828.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,192.52
5	应收申购款	6,689.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,710.57

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

## 十二、基金的业绩

基金业绩截至日为 2017 年 3 月 31 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。

本报告期净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差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
2011年5月6日—2011年12月31日	-15.50%	0.92%	-23.81%	1.24%	8.31%	-0.32%

2012年1月1日— 2012年12月31日	11.14%	1.23%	7.29%	1.22%	3.85%	0.01%
2013年1月1日— 2013年12月31日	13.01%	1.38%	-7.16%	1.32%	20.17%	0.06%
2014年1月1日至 2014年12月31日	23.80%	1.13%	48.69%	1.15%	-24.89 %	-0.02%
2015年1月1日— 2015年12月31日	22.06%	2.55%	5.70%	2.36%	16.36%	0.19%
2016年1月1日至 2016年12月31日	-7.99%	1.44%	-10.63%	1.33%	2.64%	0.11%
2017年1月1日— 2017年3月31日	5.56%	0.52%	4.19%	0.49%	1.37%	0.03%
自基金合同生效 之日起至2017年3 月31日	55.75%	1.53%	11.06%	1.48%	44.69%	0.05%

### 十三、基金的费用与税收

#### （一）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、基金上市费用；
- 4、基金财产划拨支付的银行费用；
- 5、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

#### （三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。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 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。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

在通常情况下，基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。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托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## （四）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

**（五）**基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 个工作日前在指定媒体上刊登公告。

## **（六）基金税收**

本基金运作过程中的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规履行。

## **十四、对招募说明书更新部分的说明**

- 1、更新了“第三部分：基金管理人”的“基金管理人概况”，更新了董事的信息。
- 2、更新了“第四部分：基金托管人”的基本情况及相关业务经营情况。
- 3、更新了“第五部分：相关服务机构”的“代销机构”等相关信息。
- 4、更新了“第十二部分：基金的投资”中的基金投资组合报告。
- 5、更新了“第十三部分：基金的业绩”。
- 6、更新了“第二十六部分：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](http://www.ccbfund.cn)。

建信基金管理有限责任公司

二〇一七年六月七日