

# 建信社会责任混合型证券投资基金

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2023年11月24日

送出日期：2023年11月29日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

基金简称	建信社会责任混合	基金代码	530019
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
基金合同生效日	2012年8月14日	上市交易所及上市日期	-
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	刘克飞	开始担任本基金基金经理的日期	2019年11月28日
		证券从业日期	2012年7月2日
基金经理	李登虎	开始担任本基金基金经理的日期	2023年11月22日
		证券从业日期	2007年9月30日

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

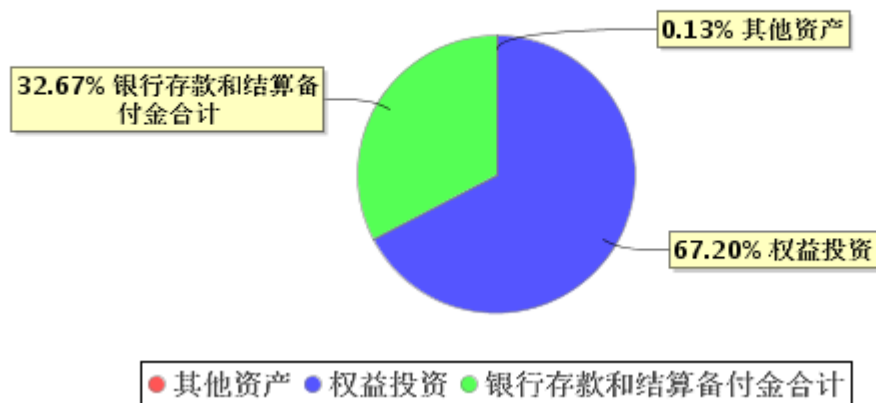
请投资者阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况

投资目标	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。
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、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货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，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或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。 本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%，其中本基金投资于积极履行社会责任的上市公司股票比例不低于股票资产的80%；债券、货币市场工具、银行存款、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证券品种占基金资产的比例为0-40%，其中权证占基金资产净值的0-3%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如果法律法规对上述比例要求有变更的，本基金投资范围将及时做出相应调整，以调整

	变更后的比例为准。
主要投资策略	<p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>大类资产配置策略方面, 本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势, 判断当前所处的经济周期, 进而对未来做出科学预测。在此基础上, 结合对流动性及资金流向的分析, 综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。此外, 本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控, 适时地做出相应的调整。</p> <p>(二) 行业配置策略</p> <p>在定性分析方面, 本基金采用“双向行业筛选法”对投资的行业进行调整, 首先运用“积极筛选法”超配或寻求在持续发展责任、法律责任、内外部道德责任履行等方面具有较好表现的行业; 其次运用“消极筛选法”低配或规避在持续发展责任、法律责任、内外部道德责任履行等方面具有较差表现的行业, 定期动态优化行业配置资产。</p> <p>(三) 个股投资策略</p> <p>个股选择上, 本基金采取“社会责任”和“基本面”双因素选股策略。首先利用“建信社会贡献筛选模型”进行第一轮筛选, 然后由研究员从基本面角度进行第二轮筛选, 经过两轮筛选后, 本基金投资团队再在此基础上进行“自上而下”和“自下而上”的个股选择, 实现股票资产的配置和调整。</p> <p>1、“社会责任”筛选</p> <p>本基金利用“建信社会贡献筛选模型”对上市公司的上述社会责任指标进行量化衡量, 对上市公司的社会贡献程度进行综合评价和动态综合评级, 同时将选择各行业的上市公司中社会责任贡献程度最好的 80% 作为积极履行社会责任的上市公司。</p> <p>2、“基本面”筛选</p> <p>经过第一轮社会责任筛选之后, 公司研究员在此基础上从基本面角度进行第二轮筛选, 本基金采用的基本面筛选方法为四因素模型, 即考虑“治理结构、竞争能力、财务状况以及估值水平”等四个方面的因素。</p> <p>3、市场调研与动态调整</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*75%+中国债券总指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金, 其预期收益及预期风险水平低于股票型基金, 高于债券型基金及货币市场基金, 属于中高收益风险特征的基金。

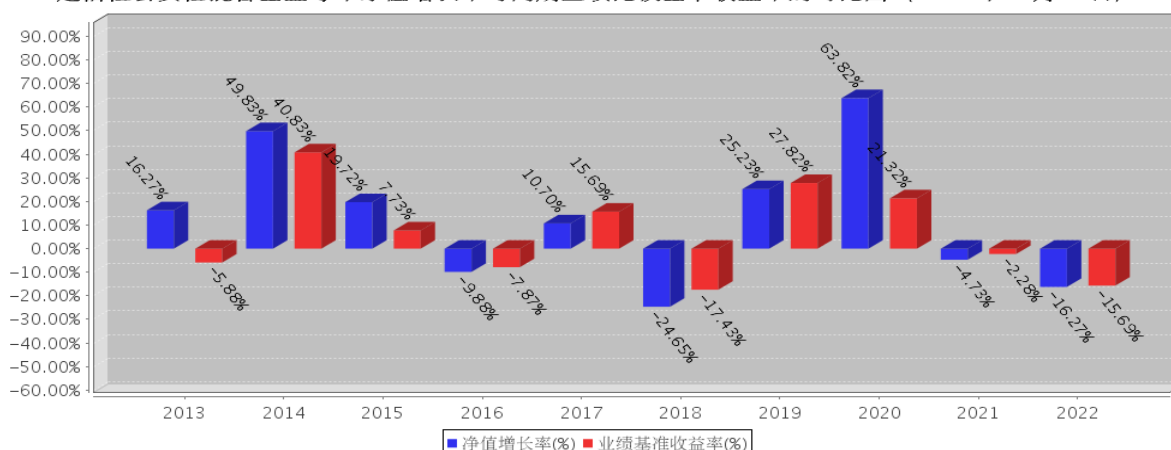
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2023年9月30日)



## (三) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

建信社会责任混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2022年12月31日）



注：基金的过往业绩不代表未来表现。

基金合同生效当年不满完整自然年度的，按实际期限计算净值增长率。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率
申购费 (前收费)	0 万元 ≤ M < 100 万元	1.50%
	100 万元 ≤ M < 500 万元	1.00%
	M ≥ 500 万元	1,000.00 元/笔
赎回费	0 天 ≤ N < 7 天	1.50%
	7 天 ≤ N < 1 年	0.50%
	1 年 ≤ N < 2 年	0.25%
	N ≥ 2 年	0.00%

#### (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	1.20%
托管费	0.20%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费和诉讼费，基金份额持有人大会费用，基金的证券交易费用，基金的银行汇划费用，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。本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

### 四、风险揭示与重要提示

#### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、本基金作为混合型基金，追求高于业绩比较基准的投资回报。但是，通常情况下本基金持有的股票资产占基金资产的比例为60%-95%，因此具有对股票市场的系统性风险。鉴于中国股市目前仍处于发展阶段，具有波动性较大的特征，因而本基金管理人在必要时将通过资产配置，力求降低系统性风险。本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

2、本基金在套期保值过程中有可能出现的风险主要有以下几种。（1）基差风险；（2）流动性风险；（3）不完全套期保值策略风险；（4）模型风险；（5）展期风险。

### 3、流动性风险

本基金的流动性风险主要体现为基金申购、赎回等因素对基金造成的流动性影响。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

## (二) 重要提示

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作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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人官方网站 [www.ccbfund.cn] [客服电话：400-81-95533]

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料