

# 建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 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二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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。

本报告中的财务资料经审计，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。

本报告期自 2016 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

基金简称	建信中证 500 指数增强
基金主代码	000478
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 1 月 27 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	274,328,367.01 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。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。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p>
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

### 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	中信银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	吴曙明	方韡
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	fangwei@citicbank.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024

## 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	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
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	2016 年	2015 年	2014 年 1 月 27 日 (基金合同生效日)– 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	36,217,516.51	44,589,650.70	25,548,266.84
本期利润	18,886,419.45	41,731,042.06	28,570,662.25
加权平均基金份额本期利润	0.1208	0.4714	0.2037
本期基金份额净值增长率	1.16%	64.41%	37.10%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	1.0165	0.8526	0.3701
期末基金资产净值	625,515,016.16	217,908,975.34	90,293,440.22
期末基金份额净值	2.2802	2.2541	1.3710

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（不含公允价值变动收益）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、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

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。

## 3.2 基金净值表现

### 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

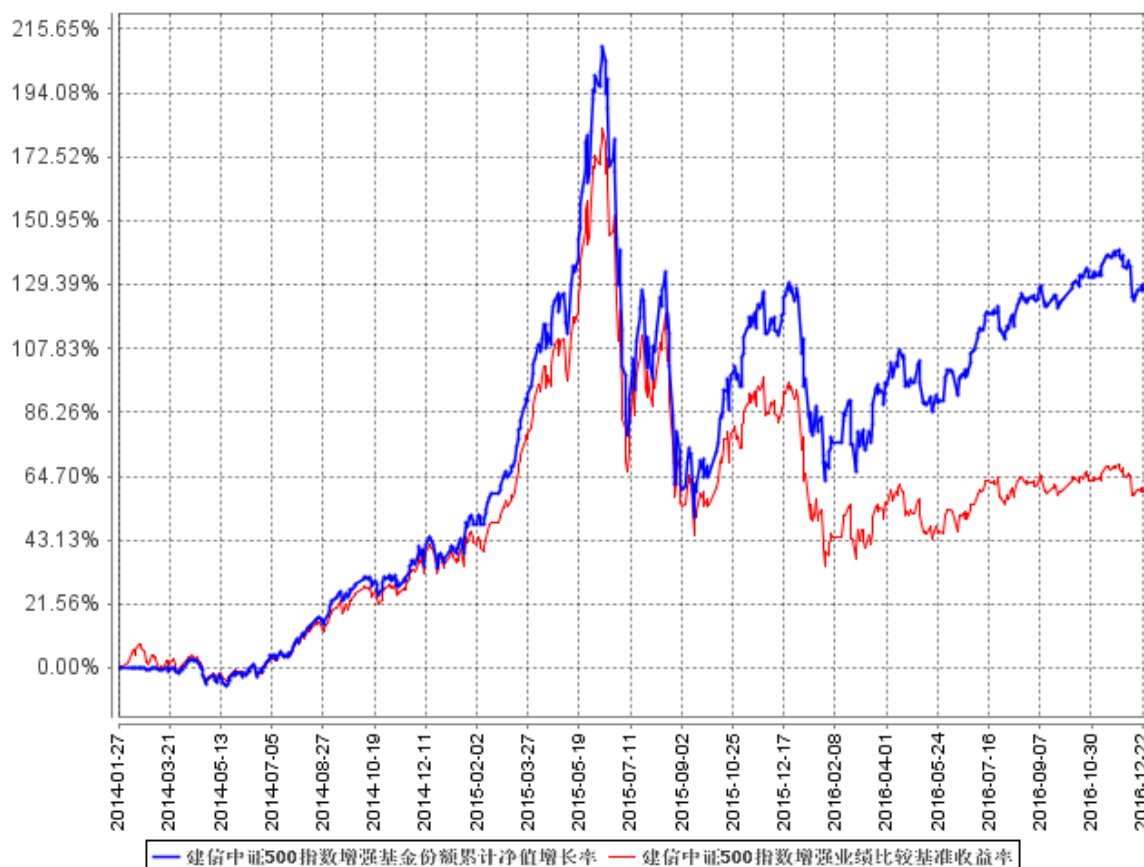
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.57%	0.83%	-0.95%	0.78%	2.52%	0.05%
过去六个月	9.90%	0.88%	2.21%	0.88%	7.69%	0.00%
过去一年	1.16%	1.82%	-16.77%	1.81%	17.93%	0.01%
自基金合同生效起至今	128.02%	2.04%	58.82%	2.00%	69.20%	0.04%

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税前）}$ 。

中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场中小市值公司的整体情况。

### 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变动的比较

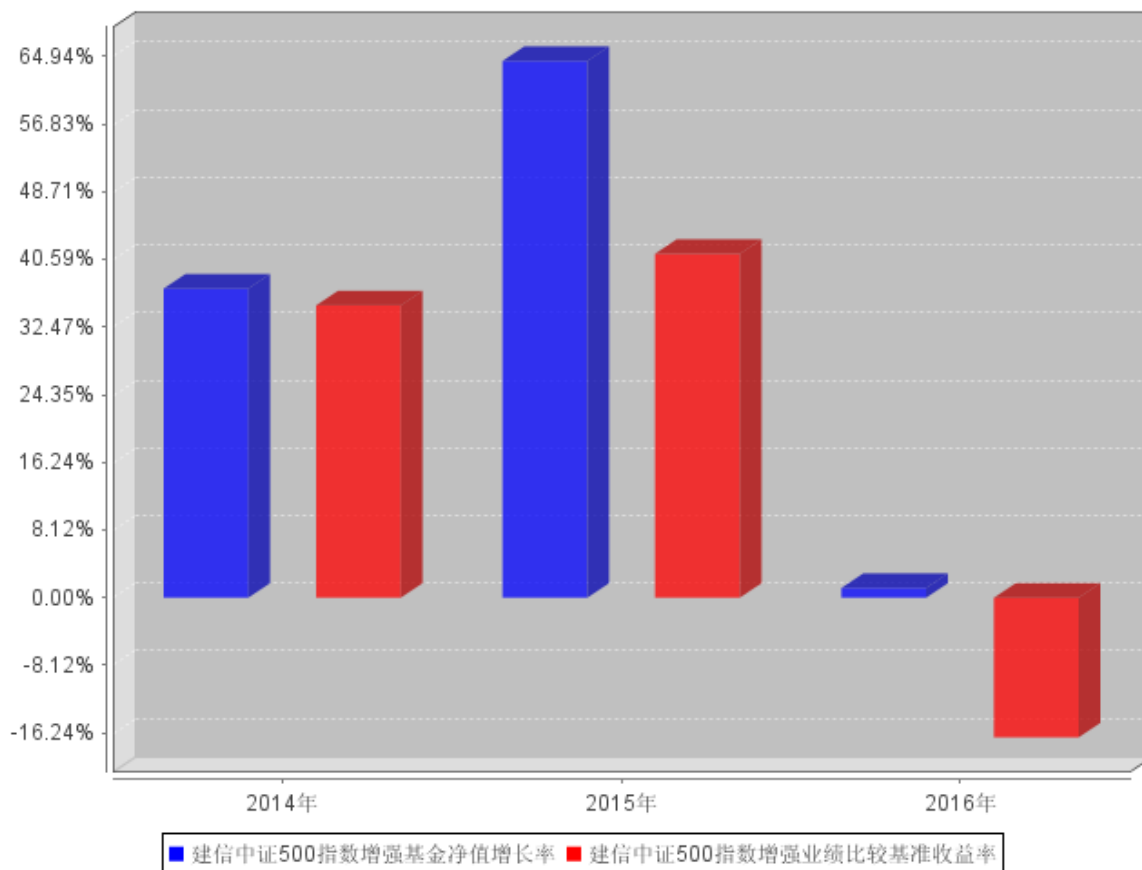
建信中证500指数增强基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信中证500指数增强自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



本基金基金合同于 2014 年 1 月 27 日生效，成立当年基金收益率以实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

自基金合同生效以来，本基金未实施利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注

册资本的 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、量化衍生品及海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北两个营销中心，并在上海设立了子公司--建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、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、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产

业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信瑞盛添利混合型证券投资基金、建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒丰纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金共 82 只开放式基金，管理的公募基金资产规模共计为 3770.62 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶乐天	金融工程及指数投资部总经理助理、本基金的基金经理	2014 年 1 月 27 日	-	8	硕士。曾就职于中国国际金融有限公司，先后担任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资；2011 年 9 月加入我公司，担任基金经理助理。2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 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；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任中证 500 指数增强基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强



					型证券投资基金基金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）管理的不同投资组合（包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下：

当时间窗为 1 日时，配了 19338 对投资组合，有 4101 对投资组合未通过 T 检验，其中

1329 对投资组合的正溢价率占优频率小于 55%，其它 2772 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中，其中 1807 对平均溢价率低于 2%，其它 965 对平均溢价率超过 2%的投资组合中，其中 920 对贡献率均未超过 5%，另外 45 对溢价金额占组合净资产比例很小，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为 3 日时，配了 20730 对投资组合，有 4694 对投资组合未通过 T 检验，但其中 822 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 3872 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中，其中 3601 对平均溢价率低于 5%，其它 271 对平均溢价率超过 5%的投资组合中，有 235 对贡献率未超过 5%，另外 36 对溢价金额占组合净资产比例很小，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为 5 日时，配了 21350 对投资组合，有 5960 对投资组合未通过 T 检验，但其中 1162 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 4798 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合，其中 4709 对平均溢价率低于 10%，其它 89 对平均溢价率超过 10%的投资组合中，有 80 对贡献率均未超过 5%，另外 9 对溢价金额占组合净资产比例很小，同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 2 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期间，本基金管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型进行指数增强和风险管理，坚持量化增强策略，并获得了较为显著且稳定的超额收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 1.16%，波动率 1.82%，业绩比较基准收益率-16.77%，波动率 1.81%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回首 2016 年，在年初“熔断”式的大幅下跌行情后，指数逐步企稳，波动率逐步下降，投资者情绪有所缓和。四季度特朗普当选又一次给市场带来了较大的冲击，债券收益率大幅上行，股市波动率有所放大。展望 2017 年，全球市场逐步趋于稳定，对汇率的担忧也有所降低，但上

市公司赢利预计仍没有大的起色，仍需紧密关注上市公司 2016 年年报数据。指数预计仍维持一个上有顶下有底的区间震荡行情，精选个股非常关键。

本基金管理人将坚持量化分析研究，进一步改进指数增强策略，努力克服市场的波动，持续获取稳健的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总裁、督察长、投资总经理、研究总经理、风险管理总经理、运营总经理及监察稽核总经理组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）。

自 2015 年 3 月 26 日起，公司按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值

核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值价格，对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)进行估值。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2016 年度基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司在建信中证 500 指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2016 年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了后附的建信中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“建信中证 500 指数增强基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债

表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了普华永道中天审字(2017)第 21872 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:建信中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款		77,375,263.29	28,587,056.44
结算备付金		6,825,891.54	2,388,844.00
存出保证金		10,876,466.84	4,518,357.45
交易性金融资产		531,065,789.16	178,642,255.39
其中:股票投资		531,065,789.16	178,642,255.39
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	5,807,621.08
应收利息		19,795.52	7,279.17
应收股利		-	-
应收申购款		3,020,760.65	337,341.05
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		629,183,967.00	220,288,754.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		335.27	-

应付赎回款		968,123.03	1,247,775.41
应付管理人报酬		504,635.87	180,277.16
应付托管费		100,927.18	36,055.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,688,524.02	608,185.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		406,405.47	307,485.36
负债合计		3,668,950.84	2,379,779.24
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		274,328,367.01	96,671,968.72
未分配利润		351,186,649.15	121,237,006.62
所有者权益合计		625,515,016.16	217,908,975.34
负债和所有者权益总计		629,183,967.00	220,288,754.58

报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.2802 元，基金份额总额 274,328,367.01 份。

## 7.2 利润表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		27,566,605.00	47,160,289.92
1.利息收入		343,527.79	168,184.13
其中：存款利息收入		343,527.79	166,293.31
债券利息收入		-	1,890.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		44,059,515.03	49,018,597.46
其中：股票投资收益		42,166,373.44	44,657,195.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-6,131.80
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		579,200.00	3,348,240.00
股利收益		1,313,941.59	1,019,293.92
3.公允价值变动收益（损失以		-17,331,097.06	-2,858,608.64

“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入 (损失以“-”号填列)		494,659.24	832,116.97
<b>减：二、费用</b>		<b>8,680,185.55</b>	<b>5,429,247.86</b>
1. 管理人报酬		3,305,456.60	1,813,432.62
2. 托管费		661,091.28	362,686.49
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		4,133,047.45	2,671,870.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		580,590.22	581,257.96
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>18,886,419.45</b>	<b>41,731,042.06</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>18,886,419.45</b>	<b>41,731,042.06</b>

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	96,671,968.72	121,237,006.62	217,908,975.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	18,886,419.45	18,886,419.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	177,656,398.29	211,063,223.08	388,719,621.37
其中：1. 基金申购款	368,640,205.83	427,480,390.70	796,120,596.53
2. 基金赎回款	-190,983,807.54	-216,417,167.62	-407,400,975.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少)	-	-	-

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	274,328,367.01	351,186,649.15	625,515,016.16
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	65,861,621.20	24,431,819.02	90,293,440.22
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	41,731,042.06	41,731,042.06
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号 填列)	30,810,347.52	55,074,145.54	85,884,493.06
其中：1. 基金申购款	350,195,176.00	408,086,858.81	758,282,034.81
2. 基金赎回款	-319,384,828.48	-353,012,713.27	-672,397,541.75
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动(净值减少 以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	96,671,968.72	121,237,006.62	217,908,975.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

          孙志晨  赵乐峰  丁颖            
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

建信中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第 615 号《关于核准建信中证 500 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 308,106,805.84 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 039 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2014 年 1 月 27 日正式生效,



基金合同生效日的基金份额总额为 308,165,342.91 份基金份额，其中认购资金利息折合 58,537.07 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，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、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为不低于 90%，其中投资于中证 500 成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为 95%X 中证 500 指数收益率+5%X 商业银行活期存款利率（税前）。

#### **7.4.2 本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2017 年 3 月 27 日批准报出。会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### **7.4.5 会计差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税

收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司(“建信基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

### 7.4.8.1 关联方报酬

#### 7.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,305,456.60	1,813,432.62
其中：支付销售机构的客户维护费	1,116,627.10	587,902.45

1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1%/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产里列支的费用项目。

#### 7.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	661,091.28	362,686.49

支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.2%/当年天数。

#### 7.4.8.1.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

### 7.4.8.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金管理人未投资本基金。

#### 7.4.8.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期内未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.8.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中信银行	77,375,263.29	272,171.83	28,587,056.44

本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.6 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

。

### 7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新发未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新发未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新发未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603228	景旺	2016年	2017	新发未上市	23.16	23.16	2,597	60,146.52	60,146.52	-

	电子	12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	上市						
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新发未 上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新发未 上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新发未 上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	新发未 上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新发未 上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新发未 上市	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 3 日	新发未 上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新发未 上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新发未 上市	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-
300588	熙菱信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新发未 上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌日	停牌	期末	复牌日	复牌	数量（股）	期末	期末估值总	备注
----	----	-----	----	----	-----	----	-------	----	-------	----

代码	名称	期	原因	估值单 价	期	开盘单 价		成本总额	额	
002151	北斗星 通	2016 年 11 月 16 日	重大资 产重组	31.90	2017 年 1 月 12 日	31.00	119,550	3,802,639.48	3,813,645.00	-
002491	通鼎互 联	2016 年 12 月 22 日	重大资 产重组	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	192,830	3,105,498.94	2,996,578.20	-
600161	天坛生 物	2016 年 12 月 6 日	重大资 产重组	39.40	2017 年 3 月 24 日	43.34	74,431	2,949,596.72	2,932,581.40	-
600171	上海贝 岭	2016 年 12 月 14 日	重大资 产重组	14.05	2017 年 2 月 16 日	14.90	111,200	1,694,873.17	1,562,360.00	-
600537	亿晶光 电	2016 年 12 月 27 日	重大资 产重组	7.43	2017 年 1 月 13 日	8.17	189,400	1,371,428.00	1,407,242.00	-
600687	刚泰控 股	2016 年 7 月 25 日	重大资 产重组	16.42	2017 年 1 月 18 日	16.38	84,800	1,358,835.00	1,392,416.00	-
002226	江南化 工	2016 年 11 月 14 日	重大资 产重组	8.61	2017 年 3 月 1 日	9.20	107,200	918,301.00	922,992.00	-
600645	中源协 和	2016 年 12 月 13 日	重大资 产重组	26.80	-	-	32,500	978,333.00	871,000.00	-
601168	西部矿 业	2016 年 12 月 19 日	重大资 产重组	7.83	-	-	105,500	833,826.35	826,065.00	-
000547	航天发 展	2016 年 4 月 19 日	重大资 产重组	15.36	2017 年 1 月 3 日	16.90	51,112	888,184.86	785,080.32	-
002440	闰土股 份	2016 年 10 月 24 日	重大资 产重组	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	47,400	727,106.00	774,516.00	-
000887	中鼎股 份	2016 年 11 月 18 日	重大资 产重组	25.94	2017 年 2 月 15 日	23.99	29,200	679,622.41	757,448.00	-

002745	木林森	2016 年 7 月 18 日	重大资 产重组	36.49	-	-	18,400	569,132.96	671,416.00	-
300420	五洋科 技	2016 年 12 月 13 日	重大资 产重组	24.98	2017 年 3 月 23 日	27.48	21,400	511,091.57	534,572.00	-
600151	航天机 电	2016 年 11 月 11 日	重大资 产重组	10.97	-	-	37,700	427,743.00	413,569.00	-
002071	长城影 视	2016 年 6 月 16 日	重大资 产重组	13.64	2017 年 1 月 3 日	15.00	28,800	435,593.09	392,832.00	-
300535	达威股 份	2016 年 12 月 12 日	重大资 产重组	90.29	-	-	3,100	332,620.00	279,899.00	-
002400	省广股 份	2016 年 11 月 28 日	重大资 产重组	13.79	-	-	15,770	219,089.76	217,468.30	-
300100	双林股 份	2016 年 11 月 7 日	重大资 产重组	34.00	2017 年 1 月 25 日	30.60	5,500	190,180.00	187,000.00	-
000829	天音控 股	2016 年 9 月 29 日	重大资 产重组	11.28	-	-	16,100	183,388.00	181,608.00	-
000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	重大资 产重组	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	7,500	138,687.00	141,150.00	-
600552	凯盛科 技	2016 年 9 月 8 日	重大资 产重组	18.43	2017 年 2 月 13 日	17.51	6,300	112,537.00	116,109.00	-
002464	金利科 技	2016 年 12 月 28 日	重大资 产重组	78.20	2017 年 1 月 5 日	78.82	100	6,334.55	7,820.00	-
600673	东阳光 科	2016 年 11 月 15 日	重大资 产重组	7.29	-	-	700	4,516.51	5,103.00	-

本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 508,415,785.94 元，属于第二层次的余额为 22,650,003.22 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 162,691,110.87 元，第二层次 15,951,144.52 元，无第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月



31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	531,065,789.16	84.41
	其中：股票	531,065,789.16	84.41
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	84,201,154.83	13.38
7	其他各项资产	13,917,023.01	2.21
8	合计	629,183,967.00	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,125,626.00	0.66
B	采矿业	13,487,774.77	2.16
C	制造业	233,414,077.40	37.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,878,536.31	0.78

E	建筑业	17,802,269.62	2.85
F	批发和零售业	29,075,746.53	4.65
G	交通运输、仓储和邮政业	8,032,153.48	1.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,172,729.46	4.82
J	金融业	5,019,425.18	0.80
K	房地产业	45,913,767.06	7.34
L	租赁和商务服务业	4,766,189.30	0.76
M	科学研究和技术服务业	2,790,684.61	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	2,908,475.48	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,766,526.24	0.60
S	综合	10,107,097.08	1.62
	合计	416,261,078.52	66.55

以上行业分类以 2016 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	831,095.98	0.13
B	采矿业	-	-
C	制造业	87,333,659.13	13.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,707,667.66	0.75
E	建筑业	1,407,905.23	0.23
F	批发和零售业	11,286,356.12	1.80
G	交通运输、仓储和邮政业	634,068.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,431,634.76	0.87
J	金融业	1,031,781.60	0.16

K	房地产业	1,719,280.16	0.27
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	28,430.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	392,832.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	114,804,710.64	18.35

以上行业分类以 2016 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 8.3 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

#### 8.3.1 期末指数投资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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002221	东华能源	456,690	5,658,389.10	0.90
2	002001	新和成	286,728	5,619,868.80	0.90
3	002410	广联达	375,000	5,475,000.00	0.88
4	002375	亚厦股份	494,600	5,232,868.00	0.84
5	601929	吉视传媒	1,236,600	5,181,354.00	0.83
6	600736	苏州高新	565,906	5,110,131.18	0.82
7	600291	西水股份	261,701	5,019,425.18	0.80
8	600298	安琪酵母	275,925	4,916,983.50	0.79
9	600600	青岛啤酒	166,891	4,913,271.04	0.79
10	600022	山东钢铁	1,938,900	4,847,250.00	0.77

注：投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于[www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)网站的年度报告正文。

### 8.3.2 期末积极投资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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	337,000	4,266,420.00	0.68
2	600186	莲花健康	821,524	4,222,633.36	0.68
3	002080	中材科技	220,545	3,863,948.40	0.62
4	002151	北斗星通	119,550	3,813,645.00	0.61
5	002441	众业达	270,300	3,616,614.00	0.58
6	600986	科达股份	225,169	3,431,575.56	0.55
7	002172	澳洋科技	328,500	3,360,555.00	0.54
8	000815	美利云	138,240	2,840,832.00	0.45
9	600429	三元股份	330,851	2,597,180.35	0.42
10	000593	大通燃气	228,429	2,576,679.12	0.41

注：投资者欲了解本报告期末基金积极投资的所有股票明细，应阅读登载于[www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600022	山东钢铁	7,716,626.00	3.54
2	600743	华远地产	7,582,390.94	3.48
3	002428	云南锗业	7,218,012.95	3.31
4	601012	隆基股份	7,188,179.79	3.30
5	002221	东华能源	7,143,522.42	3.28
6	000861	海印股份	7,132,424.00	3.27
7	000667	美好置业	7,011,284.00	3.22
8	002001	新和成	6,693,854.57	3.07
9	000973	佛塑科技	6,446,608.00	2.96
10	600433	冠豪高新	6,264,407.83	2.87
11	300156	神雾环保	6,167,293.61	2.83
12	000062	深圳华强	6,136,534.22	2.82

13	600736	苏州高新	6,112,482.88	2.81
14	600496	精工钢构	6,076,011.00	2.79
15	002410	广联达	6,074,525.00	2.79
16	002466	天齐锂业	5,990,530.80	2.75
17	002128	露天煤业	5,918,552.00	2.72
18	000877	天山股份	5,916,905.00	2.72
19	600729	重庆百货	5,901,819.27	2.71
20	600586	金晶科技	5,873,213.10	2.70
21	002093	国脉科技	5,838,968.00	2.68
22	002375	亚厦股份	5,683,637.00	2.61
23	002118	紫鑫药业	5,667,998.06	2.60
24	600503	华丽家族	5,629,871.64	2.58
25	002308	威创股份	5,571,153.07	2.56
26	601929	吉视传媒	5,516,422.00	2.53
27	002663	普邦股份	5,498,520.61	2.52
28	600284	浦东建设	5,337,693.15	2.45
29	000631	顺发恒业	5,312,949.79	2.44
30	600073	上海梅林	5,295,016.00	2.43
31	600409	三友化工	5,239,951.64	2.40
32	600600	青岛啤酒	5,185,958.93	2.38
33	002624	完美世界	5,183,989.51	2.38
34	600291	西水股份	5,183,797.12	2.38
35	002217	合力泰	5,174,105.17	2.37
36	002384	东山精密	5,160,308.30	2.37
37	600161	天坛生物	5,110,454.72	2.35
38	600216	浙江医药	5,058,311.00	2.32
39	002080	中材科技	5,029,572.84	2.31
40	000541	佛山照明	5,015,656.84	2.30
41	000627	天茂集团	4,986,243.42	2.29
42	600757	长江传媒	4,926,615.00	2.26
43	002244	滨江集团	4,923,178.00	2.26
44	300297	蓝盾股份	4,920,213.00	2.26
45	600240	华业资本	4,919,593.62	2.26
46	300043	星辉娱乐	4,908,119.09	2.25
47	600175	美都能源	4,901,794.00	2.25
48	600458	时代新材	4,853,937.36	2.23

49	300274	阳光电源	4,841,054.89	2.22
50	601777	力帆股份	4,830,351.97	2.22
51	600456	宝钛股份	4,818,627.98	2.21
52	600143	金发科技	4,812,118.09	2.21
53	600298	安琪酵母	4,747,528.32	2.18
54	002309	中利科技	4,711,005.88	2.16
55	600507	方大特钢	4,699,411.46	2.16
56	600487	亨通光电	4,697,511.56	2.16
57	600812	华北制药	4,693,022.05	2.15
58	601226	华电重工	4,624,881.27	2.12
59	002269	美邦服饰	4,590,840.00	2.11
60	600894	广日股份	4,581,543.51	2.10
61	002051	中工国际	4,578,918.14	2.10
62	002176	江特电机	4,559,908.00	2.09
63	600335	国机汽车	4,523,947.44	2.08
64	000030	富奥股份	4,489,757.80	2.06
65	002581	未名医药	4,477,884.09	2.05
66	600064	南京高科	4,463,976.00	2.05
67	600637	东方明珠	4,461,484.79	2.05
68	000815	美利云	4,446,817.94	2.04
69	002477	雏鹰农牧	4,410,062.52	2.02
70	002151	北斗星通	4,387,862.48	2.01

上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000062	深圳华强	7,396,651.63	3.39
2	600284	浦东建设	7,069,021.40	3.24
3	002217	合力泰	6,185,197.19	2.84
4	600143	金发科技	5,677,879.20	2.61
5	600320	振华重工	5,602,780.11	2.57
6	000627	天茂集团	5,456,460.27	2.50
7	600478	科力远	5,311,538.98	2.44
8	000667	美好置业	5,184,784.00	2.38
9	600507	方大特钢	5,097,251.24	2.34

10	002269	美邦服饰	5,069,691.00	2.33
11	002466	天齐锂业	5,047,445.27	2.32
12	601777	力帆股份	4,999,517.16	2.29
13	300182	捷成股份	4,811,384.58	2.21
14	000030	富奥股份	4,670,555.82	2.14
15	600651	飞乐音响	4,634,782.99	2.13
16	300244	迪安诊断	4,579,277.60	2.10
17	600260	凯乐科技	4,558,240.00	2.09
18	002384	东山精密	4,536,921.00	2.08
19	601226	华电重工	4,535,404.10	2.08
20	600637	东方明珠	4,533,402.12	2.08
21	300115	长盈精密	4,454,796.69	2.04
22	000830	鲁西化工	4,415,190.00	2.03

上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,580,817,324.14
卖出股票收入（成交）总额	1,252,278,796.99

上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不含相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1701	IC1701	35	43,520,400.00	543,880.00	-
IC1703	IC1703	6	7,296,480.00	17,200.00	-
公允价值变动总额合计（元）					561,080.00
股指期货投资本期收益（元）					579,200.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					969,200.00

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未投资于国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元



序号	名称	金额
1	存出保证金	10,876,466.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,795.52
5	应收申购款	3,020,760.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,917,023.01

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002151	北斗星通	3,813,645.00	0.61	重大资产重组

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
55,517	4,941.34	37,622,595.74	13.71%	236,705,771.27	86.29%

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,183,077.88	0.43%

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2014年1月27日）基金份额总额	308,165,342.91
本报告期期初基金份额总额	96,671,968.72
本报告期基金总申购份额	368,640,205.83
减:本报告期基金总赎回份额	190,983,807.54
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	274,328,367.01

总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

我公司于2016年11月22日第四届董事会第五次会议决定调整高管职务名称，曲寅军任首席投资官（副总裁）、张威威任首席市场官（副总裁）。2016年12月23日公司第四届董事会第十二次临时会议决定吴曙明任首席风险官（副总裁）、吴灵玲任首席财务官（副总裁），已按有关规定报中国基金业协会和北京证监局备案，并于12月27日对外公告。

本报告期内，经中信银行股份有限公司董事会会议审议通过以下事项：任命李庆萍女士为

本行董事长，任命孙德顺先生为本行行长，以上任职资格于 2016 年 7 月 20 日获中国银监会批复核准。

2016 年 8 月 6 日，中信银行股份有限公司发布变更法定代表人的公告：“中信银行股份有限公司（“本行”）收到北京市工商行政管理局重新核发的《营业执照》，本行已完成法定代表人变更的工商登记手续，自 2016 年 8 月 1 日起，本行法定代表人由常振明先生变更为李庆萍女士。”

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为人民币 60,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中投证券	1	690,085,280.18	24.41%	628,909.37	24.10%	-
东北证券	1	653,488,165.26	23.11%	608,600.02	23.32%	-
宏信证券	1	417,241,956.18	14.76%	388,584.67	14.89%	-
光大证券	2	186,050,590.38	6.58%	172,089.14	6.60%	-

方正证券	1	169,719,452.96	6.00%	158,061.37	6.06%	-
民生证券	1	158,461,512.63	5.60%	147,583.75	5.66%	-
国金证券	1	153,617,024.27	5.43%	139,997.01	5.37%	-
中信建投	1	118,419,668.23	4.19%	107,915.74	4.14%	-
信达证券	2	89,611,454.33	3.17%	81,679.59	3.13%	-
东兴证券	1	67,954,866.23	2.40%	63,286.45	2.43%	-
渤海证券	1	47,793,392.66	1.69%	43,554.33	1.67%	-
华创证券	1	40,956,740.63	1.45%	38,142.91	1.46%	-
国泰证券	1	33,888,387.54	1.20%	30,890.29	1.18%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个股、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

（4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本期新增方正证券、华创证券、国金证券、东北证券、宏信证券、国泰君安证券各一个交易单元，未剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本报告期内，本基金租用的证券公司交易单元未进行其他证券投资。

建信基金管理有限责任公司  
2017年3月29日