

建信安心保本三号混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

§1 重要提示及目录

1.1 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。本半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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 4 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 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..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 15 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 40 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 40 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 43 |
| 7.6 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..... | 43 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 44 |
| 7.8 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..... | 44 |
| 7.9 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..... | 44 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 45 |
| §8 基金份额持有人信息 | 46 |

| | |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 46 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 46 |
| 8.3 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..... | 46 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 47 |
| §10 重大事件揭示..... | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 47 |
| 10.2 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..... | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 47 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 48 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 48 |
| 10.8 其他重大事件..... | 50 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 51 |
| §12 备查文件目录..... | 52 |
| 12.1 备查文件目录..... | 52 |
| 12.2 存放地点..... | 52 |
| 12.3 查阅方式..... | 52 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 建信安心保本三号混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 建信安心保本三号混合 |
| 基金主代码 | 002281 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 1 月 4 日 |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,166,712,038.47 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，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金的资产包括风险资产和安全资产，本基金投资策略分为两个层次：一层为基金在风险资产和安全资产两大类资产上的配置策略；另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 2 年期银行定期存款收益率（税前）。 |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金产品，属于证券投资基金中的中低风险品种。 |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 吴曙明 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 010-66228888 | 95559 |
| | 电子邮箱 | xinzipilu@ccbfund.cn | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-81-95533 010-66228000 | 95559 |
| 传真 | | 010-66228001 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 | 上海市浦东新区银城中路 188 号 |

| | | |
|-------|-----------------------------------|----------------------|
| | 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 | 上海市浦东新区银城中路 188 号 |
| 邮政编码 | 100033 | 200120 |
| 法定代表人 | 许会斌 | 牛锡明 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ccbfund.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 建信基金管理有限责任公司 | 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层 |
| 基金保证人 | 重庆三峡担保集团股份有限公司 | 重庆市渝北区青枫北路 12 号 3 幢 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 85,632,063.94 |
| 本期利润 | 75,108,946.34 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0169 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.66% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.69% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 98,770,811.50 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0237 |
| 期末基金资产净值 | 4,265,482,849.97 |
| 期末基金份额净值 | 1.024 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 2.40% |

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（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

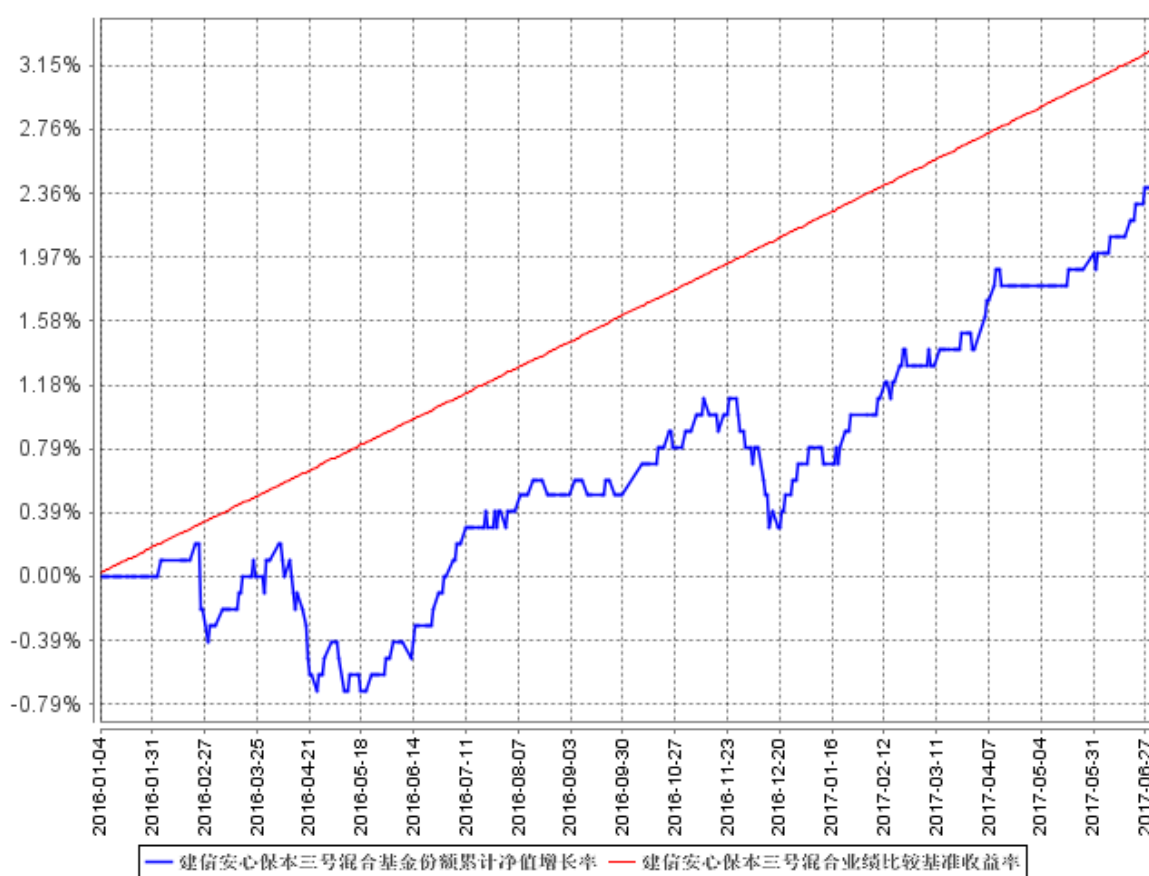
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 0.39% | 0.05% | 0.18% | 0.00% | 0.21% | 0.05% |
| 过去三个月 | 0.99% | 0.05% | 0.53% | 0.01% | 0.46% | 0.04% |

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去六个月 | 1.69% | 0.05% | 1.06% | 0.01% | 0.63% | 0.04% |
| 过去一年 | 2.40% | 0.06% | 2.15% | 0.01% | 0.25% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.40% | 0.06% | 3.24% | 0.01% | -0.84% | 0.05% |

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

建信安心保本三号混合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，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§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、海外投资部、资产配置及量化投资部、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、风险管理部和内控合规部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心，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 2017 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、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、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、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、

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、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财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、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、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、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金，共计 87 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 3,439.09 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 | | |
| 朱虹 | 固定收益投资部副总 | 2016年1月4日 | - | 10 | 硕士。2007年加入长城人寿保险股份有限公司，任债券投资助理。 |

| | | | | |
|--|-------------|--|--|---|
| | 经理、本基金的基金经理 | | | 2009 年 4 月加入天弘基金管理有限公司，任基金经理、固定收益投资总监助理。2012 年 1 月，加入万家基金管理有限公司，任基金经理、固定收益总监。2014 年 8 月加入我公司，历任投资管理部副总监、固定收益投资部副总经理，2015 年 10 月 29 日任建信安心保本二号混合型证券投资基金基金经理，2016 年 1 月 4 日起任建信安心保本三号混合型证券投资基金基金经理，2016 年 6 月 3 日起任建信双债增强债券型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月 17 日起任建信恒远一年定期开放债券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 公平交易制度的执行情况

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 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 1 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

2017 年上半年，主要经济指标延续一季度特征。其中，三四线地产加速去化、企业盈利、财政税收等情况基本符合预期。地产、基建（政府）、制造业在开年以来显示出较强的风险抵御能力，整体没有观测到较大的债务敞口。由于供给侧改革、房地产去化、基建加速等带来的企业利润水平的上升，银行坏账率有所好转，拨备计提对于利润的拖累有所下降。总体看来，维持 2017 年中国经济系统性风险概率较低判断。

二季度相较一季度的重大变化是金融去杠杆显性化，并同时股票、债券两个市场造成冲击。2016 年一季度开始，同业存单规模崛起，代表银行在同业方面的杠杆再起。这一现象在 2016 年经济总体预期较弱，供给侧改革攻坚的环境中，具有一定的正面意义。大规模同业套利放大了央行货币政策宽松的实际效果，使银行间流动性水平较高，降低了企业直接融资成本。在 2016 年底，由于基本面预期及实际情况逆转，该套利行为的收益水平逐渐转负，高昂的同业负债价格压迫银行结束套利头寸，客观上也缩减了央行对流动性的支持。但由于一季度非金融部门的流动性水平较高，尤其是房地产、地方政府、企业都处于流动性正反馈阶段，因此流动性压力不大。随着时间的推进，金融套利结束的规模持续上升，使得同业负债再次显示较强的刚性，表现为量微跌、价急升、期限缩短等特征。

因此在 4 月下旬，伴随同业存单的规模缩减，银行间流动性急剧紧张，对债券的长期乐观预期有一定打压。在股票和其他类权益市场，也表现出负面反馈。

上半年债券市场的获利以票息为主，杠杆价值为负。全债指数表现较差为-2.48%，本基金由

于久期较短，获得了全部票息收益。

本基金在 4 月下旬减持了所有股票资产，并在货币市场利率较高时，增持较大比例的货币市场工具配置。

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 1.69%，波动率 0.05%，业绩比较基准收益率 1.06%，波动率 0.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年需重点关注价格水平的预期差。虽然市场普遍预测 PPI 与 CPI 水平较低，但输入性通胀压力与价格绝对水平高启将对货币政策稳健中性构成压力。输入性通胀水平主要是原油价格的控制者仍是美国和中东国家。当前弱美元、强油价符合双方政治利益，且该诉求已有限产等正向反馈。我们认为下半年油价将会继续超过市场普遍预期，进而对国内通胀水平形成压力。国内的供给侧改革和环保督察持续，会支撑产成品出厂价格水平。价格水平预期差将支持企业经营水平和盈利水平超预期回升，银行信贷冲动和息差水平也将有回升的需求。因此将重点关注下半年大类资产配置转换的时点。

我们坚持认为在今年的债券市场决定因子中，流动性虽然不是正向支持者，但出现所谓“钱荒”的概率也极低。2013 年 6 月的流动性紧张与美联储突然退出 QE、房地产资金链套利、同业与表外房地产非标的强共振有直接关系。综合当前的情况看都不具备流动性极端紧张引发资产大幅度下跌的条件。尤其是在实体经济内生流动性较好，银行信贷支持力度较大的情况下，发生此类事件的概率进一步降低。

今年以来股票市场整体表现较好，在上一轮周期中被抛弃的价值股集体估值回归。周期股虽然表现出较强的交易性特征，但其获利水平也非常丰厚。综上所述，我们看好下半年周期股的阶段性表现。

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、运营总经理及内控合规总经理组成。

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、风险管理人員、内控合规人員及基金运营人員组成（具体人員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，基金运营部业务人員复核后使用。

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

2017 上半年度，基金托管人在建信安心保本三号混合型证券投资基金的托管过程中，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、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017 上半年度，建信基金管理有限责任公司在建信安心保本三号混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

2017 上半年度，由建信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关建信安心保本三号混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信安心保本三号混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 2,832,480,340.73 | 1,889,232,092.15 |
| 结算备付金 | | 8,500,000.00 | 6,588,605.44 |
| 存出保证金 | | 174,572.24 | 222,747.34 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,414,083,411.95 | 2,226,961,890.39 |
| 其中：股票投资 | | 34,611,282.95 | 196,894,817.19 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,379,472,129.00 | 2,030,067,073.20 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | 610,001,475.00 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 36,036,488.98 | 32,282,354.10 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 296.44 | 19,819.82 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 4,291,275,110.34 | 4,765,308,984.24 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 5,914,460.32 | 13,364,206.87 |
| 应付管理人报酬 | | 4,223,971.96 | 4,840,218.34 |
| 应付托管费 | | 14,161,905.96 | 9,683,772.21 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,173,161.34 | 1,490,651.89 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 318,760.79 | 534,651.25 |
| 负债合计 | | 25,792,260.37 | 29,913,500.56 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 4,166,712,038.47 | 4,703,346,972.45 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 98,770,811.50 | 32,048,511.23 |
| 所有者权益合计 | | 4,265,482,849.97 | 4,735,395,483.68 |
| 负债和所有者权益总计 | | 4,291,275,110.34 | 4,765,308,984.24 |

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0240 元，基金份额总额 4,166,712,038.47 份。

6.2 利润表

会计主体：建信安心保本三号混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 4 日(基 金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|--|
| 一、收入 | | 107,814,137.03 | 34,836,531.69 |
| 1.利息收入 | | 80,972,428.97 | 63,207,023.83 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 53,928,196.90 | 8,426,358.09 |
| 债券利息收入 | | 24,867,058.22 | 45,124,252.19 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,177,173.85 | 9,656,413.55 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 35,179,802.87 | -32,571,493.02 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 35,334,273.78 | -26,995,633.67 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -422,460.44 | -7,847,584.92 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 267,989.53 | 2,271,725.57 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -10,523,117.60 | 3,298,679.72 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 2,185,022.79 | 902,321.16 |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| | | | |
| 减：二、费用 | | 32,705,190.69 | 37,412,106.67 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 26,868,802.56 | 28,856,032.25 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 4,478,133.75 | 4,809,338.75 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 950,599.31 | 2,273,251.01 |
| 5. 利息支出 | | 177,142.76 | 1,257,696.70 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 177,142.76 | 1,257,696.70 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 230,512.31 | 215,787.96 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 75,108,946.34 | -2,575,574.98 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 75,108,946.34 | -2,575,574.98 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信安心保本三号混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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） | 4,703,346,972.45 | 32,048,511.23 | 4,735,395,483.68 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 75,108,946.34 | 75,108,946.34 |
| 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） | -536,634,933.98 | -8,386,646.07 | -545,021,580.05 |
| 其中：1. 基金申购款 | 524,917.41 | 8,280.80 | 533,198.21 |
| 2. 基金赎回款 | -537,159,851.39 | -8,394,926.87 | -545,554,778.26 |
| 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) | 4,166,712,038.47 | 98,770,811.50 | 4,265,482,849.97 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016年1月4日(基金合同生效日)至2016年6月30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) | 4,978,395,127.27 | 0.00 | 4,978,395,127.27 |
| 二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润) | 0.00 | -2,575,574.98 | -2,575,574.98 |
| 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) | -75,060,823.36 | 212,320.09 | -74,848,503.27 |
| 其中:1.基金申购款 | 7,019,855.32 | -5,164.71 | 7,014,690.61 |
| 2.基金赎回款 | -82,080,678.68 | 217,484.80 | -81,863,193.88 |
| 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) | 4,903,334,303.91 | -2,363,254.89 | 4,900,971,049.02 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

| | | |
|------------|------------|-----------|
| <u>孙志晨</u> | <u>吴曙明</u> | <u>丁颖</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信安心保本三号混合型证券投资基金(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[2015]2895号《关于准予建信安心保本三号混合型证券投资基金注册的批复》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《建信安心保本三号混合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4,976,807,466.18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(2016)第 004 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信安心保本三号混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,978,395,127.27 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,587,661.09 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信安心保本三号混合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,本基金可以投资于股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证及中国证监会允许投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金根据投资组合保险机制对安全资产即固定收益类资产(包括各类债券、银行存款、货币市场工具等)和风险资产即权益类资产(股票、权证等)的投资比例进行动态调整。本基金的投资组合比例为:权益类资产占基金资产的比例不高于 40%;固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为 2 年期银行定期存款收益率(税前)。

本基金第一个保本周期到期日,如按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额,则基金管理人应补足该差额,并在保本周期到期日后二十个工作日内(含第二个工作日,下同)将该差额支付给基金份额持有人,保证人对此提供不可撤销的连带责任保证。本基金第一个保本周期由重庆三峡担保集团股份有限公司作为保证人。

于 2017 年 6 月 30 日,本基金的保本期安排列示如下:

单位:人民币元

| 保本周期到期日 | 份额数(份) | 最大保本线 (元) | 截至 2017 年 6 月 30 日基金份额净值 (元) |
|----------------|------------------|--------------|------------------------------------|
| 2018 年 1 月 4 日 | 4,161,688,169.15 | 1.000 | 1.024 |

6.4.2 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《企业会计准则一基

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》、《建信安心保本三号混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年半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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

6.4.6 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补充政策的通知》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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 32,480,340.73 |
| 定期存款 | 2,800,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | 1,000,000,000.00 |
| 存款期限 3 个月以上 | 500,000,000.00 |
| 存款期限 1 个月以内 | 1,300,000,000.00 |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 2,832,480,340.73 |

定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
|---------------|-------|------------------|------------------|---------------|
| 股票 | | 36,287,477.43 | 34,611,282.95 | -1,676,194.48 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 122,038,201.79 | 122,303,129.00 | 264,927.21 |
| | 银行间市场 | 1,264,012,064.30 | 1,257,169,000.00 | -6,843,064.30 |
| | 合计 | 1,386,050,266.09 | 1,379,472,129.00 | -6,578,137.09 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 1,422,337,743.52 | 1,414,083,411.95 | -8,254,331.57 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 5,133.44 |
| 应收定期存款利息 | 15,507,708.63 |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 3,825.00 |
| 应收债券利息 | 20,519,743.31 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 78.60 |
| 合计 | 36,036,488.98 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,171,289.82 |
| 银行间市场应付交易费用 | 1,871.52 |
| 合计 | 1,173,161.34 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 72,129.29 |
| 预提费用 | 246,631.50 |
| 合计 | 318,760.79 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 4,703,346,972.45 | 4,703,346,972.45 |
| 本期申购 | 524,917.41 | 524,917.41 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -537,159,851.39 | -537,159,851.39 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 4,166,712,038.47 | 4,166,712,038.47 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|---------------|
| 上年度末 | 30,539,273.11 | 1,509,238.12 | 32,048,511.23 |
| 本期利润 | 85,632,063.94 | -10,523,117.60 | 75,108,946.34 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -9,156,243.06 | 769,596.99 | -8,386,646.07 |
| 其中：基金申购款 | 8,867.60 | -586.80 | 8,280.80 |
| 基金赎回款 | -9,165,110.66 | 770,183.79 | -8,394,926.87 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 107,015,093.99 | -8,244,282.49 | 98,770,811.50 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 909,863.95 |
| 定期存款利息收入 | 52,996,525.43 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 20,294.26 |
| 其他 | 1,513.26 |
| 合计 | 53,928,196.90 |

于 2017 年上半年，本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 378,847,888.13 |
| 减：卖出股票成本总额 | 343,513,614.35 |
| 买卖股票差价收入 | 35,334,273.78 |

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -422,460.44 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | -422,460.44 |

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,167,260,987.60 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,141,759,467.45 |
| 减：应收利息总额 | 25,923,980.59 |
| 买卖债券差价收入 | -422,460.44 |

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资-申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未投资资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期未投资贵金属。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期未投资贵金属。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未投资贵金属。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期末投资衍生工具。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期末投资衍生工具。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|----------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 267,989.53 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 267,989.53 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | -10,523,117.60 |
| ——股票投资 | -10,849,901.39 |
| ——债券投资 | 326,783.79 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | -10,523,117.60 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| | |

| | |
|---------|--------------|
| 基金赎回费收入 | 2,170,038.42 |
| 转换费收入 | 14,984.37 |
| 合计 | 2,185,022.79 |

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 3 个月但小于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中对于持有期少于 30 日的转出基金份额所收取的赎回费，将赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日但少于 3 个月的转出基金份额所收取的赎回费，将赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 3 个月但小于 6 个月的转出基金份额所收取的赎回费，将赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 6 个月的转出基金份额所收取的赎回费，将赎回费用 25% 归入基金财产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 948,499.31 |
| 银行间市场交易费用 | 2,100.00 |
| 合计 | 950,599.31 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 59,507.37 |
| 信息披露费 | 148,764.94 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 银行汇划费用 | 3,640.00 |
| 其他费用 | 600.00 |
| 合计 | 230,512.31 |

6.4.7.21 分部报告

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 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。

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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。

6.4.10.1.2 债券交易

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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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。

6.4.10.1.4 权证交易

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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年 6月30日 | 上年度可比期间 2016年1月4日(基金合同生效日)至 2016年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 26,868,802.56 | 28,856,032.25 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,387,981.79 | 8,237,094.46 |

注：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 1.20% 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 X 1.20% / 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，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|-------------------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 | 2016年1月4日(基金合同生效日)至2016年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,478,133.75 | 4,809,338.75 |

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 X 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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 | | 上年度可比期间 | |
|-----------|----------------------|------------|-------------------------------|--------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 | | 2016年1月4日(基金合同生效日)至2016年6月30日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 交通银行：活期存款 | 32,480,340.73 | 909,863.95 | 23,026,045.50 | 1,420,433.96 |
| 交通银行：定期存款 | 500,000,000.00 | 833,333.28 | - | - |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|-------------|--------|--------|-----------|--------|-------|--------|--------|----|
| 300367 | 东方网力 | 2016年12月15日 | 重大资产重组 | 20.00 | 2017年7月3日 | 18.01 | 9 | 283.34 | 180.00 | - |

注：本基金截至2017年6月30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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末，本基金银行间市场无债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易，故未存在作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和
控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、
内控合规部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的
督察长和内控合规部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人
出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基
金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，
违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券
交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发
行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计
及汇总。按信用评级列示的债券投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末
未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2017年6月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 200,235,000.00 | 219,872,000.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 421,266,000.00 | 643,362,500.00 |
| 合计 | 621,501,000.00 | 863,234,500.00 |

以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据及同业存单等。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2017年6月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 18,480,402.70 | 41,793,912.00 |
| AAA 以下 | 49,622,355.20 | 91,906,098.90 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 68,102,757.90 | 133,700,010.90 |

以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据及同业存单等。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除 6.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券和买入返售金融资产等，本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2017年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|------------------|----------------|---------------|---------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 2,832,480,340.73 | - | - | - | 2,832,480,340.73 |
| 结算备付金 | 8,500,000.00 | - | - | - | 8,500,000.00 |
| 存出保证金 | 174,572.24 | - | - | - | 174,572.24 |
| 交易性金融资产 | 958,411,662.70 | 400,651,328.00 | 20,409,138.30 | 34,611,282.95 | 1,414,083,411.95 |
| 应收利息 | - | - | - | 36,036,488.98 | 36,036,488.98 |
| 应收申购款 | - | - | - | 296.44 | 296.44 |
| 资产总计 | 3,799,566,575.67 | 400,651,328.00 | 20,409,138.30 | 70,648,068.37 | 4,291,275,110.34 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 5,914,460.32 | 5,914,460.32 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 4,223,971.96 | 4,223,971.96 |
| 应付托管费 | - | - | - | 14,161,905.96 | 14,161,905.96 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,173,161.34 | 1,173,161.34 |
| 其他负债 | - | - | - | 318,760.79 | 318,760.79 |
| 负债总计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 25,792,260.37 | 25,792,260.37 |
| 利率敏感度缺口 | 3,799,566,575.67 | 400,651,328.00 | 20,409,138.30 | 44,855,808.00 | 4,265,482,849.97 |
| 上年度末 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |

| 2016 年 12 月 31 日 | | | | | |
|------------------|------------------|----------------|---------------|----------------|-------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 1,889,232,092.15 | - | - | - | -1,889,232,092.15 |
| 结算备付金 | 6,588,605.44 | - | - | - | 6,588,605.44 |
| 存出保证金 | 222,747.34 | - | - | - | 222,747.34 |
| 交易性金融资产 | 1,455,733,914.20 | 497,688,727.40 | 76,644,431.60 | 196,894,817.19 | 2,226,961,890.39 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 610,001,475.00 | - | - | - | 610,001,475.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 32,282,354.10 | 32,282,354.10 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 19,819.82 | 19,819.82 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 3,961,778,834.13 | 497,688,727.40 | 76,644,431.60 | 229,196,991.11 | 4,765,308,984.24 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 13,364,206.87 | 13,364,206.87 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 4,840,218.34 | 4,840,218.34 |
| 应付托管费 | - | - | - | 9,683,772.21 | 9,683,772.21 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,490,651.89 | 1,490,651.89 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 534,651.25 | 534,651.25 |
| 负债总计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 29,913,500.56 | 29,913,500.56 |
| 利率敏感度缺口 | 3,961,778,834.13 | 497,688,727.40 | 76,644,431.60 | 199,283,490.55 | 4,735,395,483.68 |

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
|----|---------------|-----------------------------|-------------------|
| | | 本期末（2017年6月30日） | 上年度末（2016年12月31日） |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -2,455,984.04 | -4,602,943.70 |
| | 市场利率下降 25 个 | 2,471,673.66 | 4,645,169.60 |

| | | |
|--|----|--|
| | 基点 | |
|--|----|--|

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金权益类资产占基金资产的比例不高于 40%；固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 | |
|--------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 34,611,282.95 | 0.81 | 196,894,817.19 | 4.16 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 1,379,472,129.00 | 32.34 | 2,030,067,073.20 | 42.87 |

| | | | | |
|---------------|------------------|-------|------------------|-------|
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,414,083,411.95 | 33.15 | 2,226,961,890.39 | 47.03 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
|-------------|-----------------|-----------------------------|-------------------|
| | | 本期末（2017年6月30日） | 上年度末（2016年12月31日） |
| | | 业绩比较基准上升 5% | 353,488,016.64 |
| 业绩比较基准下降 5% | -353,488,016.64 | -175,087,884.42 | |

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无

6.4.14 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 2017 年 6 月 30 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 82,221,157.35 元，属于第二层次的余额为 1,331,862,254.60 元，无属于第三层级的余额(2016 年 6 月 30 日：第一层次 101,826,817.35 元，第二层次 3,854,191,366.57 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 2017 年 6 月 30 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定:(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益),不征收增值税;(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期,不属于金融商品转让;(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外,根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§7 投资组合报告

7.1 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 | 34,611,282.95 | 0.81 |
| | 其中：股票 | 34,611,282.95 | 0.81 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,379,472,129.00 | 32.15 |
| | 其中：债券 | 1,379,472,129.00 | 32.15 |
| | 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 | 2,840,980,340.73 | 66.20 |
| 7 | 其他各项资产 | 36,211,357.66 | 0.84 |
| 8 | 合计 | 4,291,275,110.34 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 6,516,844.62 | 0.15 |
| C | 制造业 | 8,980,949.63 | 0.21 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,725,615.00 | 0.06 |
| E | 建筑业 | 8,365,456.00 | 0.20 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,361,289.10 | 0.08 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|---------------|------|
| 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 | 4,661,128.60 | 0.11 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 34,611,282.95 | 0.81 |

以上行业分类以 2017 年 06 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 601668 | 中国建筑 | 864,200 | 8,365,456.00 | 0.20 |
| 2 | 002155 | 湖南黄金 | 680,966 | 6,516,844.62 | 0.15 |
| 3 | 600761 | 安徽合力 | 363,400 | 4,760,540.00 | 0.11 |
| 4 | 000888 | 峨眉山 A | 367,018 | 4,661,128.60 | 0.11 |
| 5 | 000960 | 锡业股份 | 310,083 | 4,220,229.63 | 0.10 |
| 6 | 600004 | 白云机场 | 182,085 | 3,361,289.10 | 0.08 |
| 7 | 601139 | 深圳燃气 | 315,100 | 2,725,615.00 | 0.06 |
| 8 | 300367 | 东方网力 | 9 | 180.00 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 | 601111 | 中国国航 | 22,904,314.76 | 0.48 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 2 | 601857 | 中国石油 | 22,855,841.70 | 0.48 |
| 3 | 600000 | 浦发银行 | 18,426,000.60 | 0.39 |
| 4 | 601668 | 中国建筑 | 18,362,756.00 | 0.39 |
| 5 | 601006 | 大秦铁路 | 13,805,973.94 | 0.29 |
| 6 | 601225 | 陕西煤业 | 12,682,703.35 | 0.27 |
| 7 | 000960 | 锡业股份 | 9,439,196.73 | 0.20 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 9,414,381.00 | 0.20 |
| 9 | 601117 | 中国化学 | 9,299,675.00 | 0.20 |
| 10 | 601377 | 兴业证券 | 9,299,519.40 | 0.20 |
| 11 | 601866 | 中远海发 | 9,299,266.15 | 0.20 |
| 12 | 600761 | 安徽合力 | 9,255,046.99 | 0.20 |
| 13 | 600362 | 江西铜业 | 9,139,793.80 | 0.19 |
| 14 | 600366 | 宁波韵升 | 4,635,863.86 | 0.10 |
| 15 | 002032 | 苏泊尔 | 4,604,149.00 | 0.10 |
| 16 | 002155 | 湖南黄金 | 4,602,660.00 | 0.10 |
| 17 | 600004 | 白云机场 | 2,991,656.55 | 0.06 |
| 18 | 300625 | 三雄极光 | 75,926.20 | 0.00 |
| 19 | 601228 | 广州港 | 75,366.19 | 0.00 |
| 20 | 601212 | 白银有色 | 71,125.24 | 0.00 |

注：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。

7.4.2 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 | 601111 | 中国国航 | 24,927,665.48 | 0.53 |
| 2 | 000538 | 云南白药 | 23,839,674.15 | 0.50 |
| 3 | 601857 | 中国石油 | 22,569,785.00 | 0.48 |
| 4 | 000401 | 冀东水泥 | 19,485,604.77 | 0.41 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 18,185,345.24 | 0.38 |
| 6 | 600068 | 葛洲坝 | 17,925,579.47 | 0.38 |
| 7 | 600352 | 浙江龙盛 | 16,337,951.00 | 0.35 |
| 8 | 601006 | 大秦铁路 | 15,554,850.50 | 0.33 |
| 9 | 000960 | 锡业股份 | 14,275,477.89 | 0.30 |
| 10 | 601225 | 陕西煤业 | 12,446,225.50 | 0.26 |
| 11 | 601668 | 中国建筑 | 12,050,000.00 | 0.25 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 12 | 000975 | 银泰资源 | 11,801,513.91 | 0.25 |
| 13 | 601117 | 中国化学 | 10,929,991.04 | 0.23 |
| 14 | 601607 | 上海医药 | 10,379,256.02 | 0.22 |
| 15 | 600104 | 上汽集团 | 10,310,076.80 | 0.22 |
| 16 | 002078 | 太阳纸业 | 9,886,026.00 | 0.21 |
| 17 | 600567 | 山鹰纸业 | 9,585,699.26 | 0.20 |
| 18 | 600030 | 中信证券 | 9,461,534.00 | 0.20 |
| 19 | 601866 | 中远海发 | 9,134,709.73 | 0.19 |
| 20 | 000731 | 四川美丰 | 9,072,884.67 | 0.19 |

注：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。

7.4.3 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 | 192,079,981.50 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 378,847,888.13 |

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），不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 74,398,371.10 | 1.74 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 615,470,000.00 | 14.43 |
| | 其中：政策性金融债 | 615,470,000.00 | 14.43 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 621,501,000.00 | 14.57 |
| 6 | 中期票据 | 20,198,000.00 | 0.47 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 47,904,757.90 | 1.12 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,379,472,129.00 | 32.34 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 150317 | 15 进出 17 | 2,800,000 | 276,780,000.00 | 6.49 |
| 2 | 170203 | 17 国开 03 | 2,000,000 | 199,280,000.00 | 4.67 |
| 3 | 041654057 | 16 船重 CP001 | 1,200,000 | 120,264,000.00 | 2.82 |
| 4 | 011760067 | 17 鲁商 SCP006 | 1,000,000 | 100,360,000.00 | 2.35 |
| 5 | 150414 | 15 农发 14 | 1,000,000 | 99,570,000.00 | 2.33 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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 | 174,572.24 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 36,036,488.98 |
| 5 | 应收申购款 | 296.44 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 36,211,357.66 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1 | 132006 | 16 皖新 EB | 23,832,262.40 | 0.56 |
| 2 | 113009 | 广汽转债 | 8,770,494.50 | 0.21 |
| 3 | 132004 | 15 国盛 EB | 4,681,000.00 | 0.11 |
| 4 | 128010 | 顺昌转债 | 3,047,071.50 | 0.07 |
| 5 | 128011 | 汽模转债 | 1,171,410.80 | 0.03 |
| 6 | 127003 | 海印转债 | 900,619.00 | 0.02 |
| 7 | 128013 | 洪涛转债 | 178,288.00 | 0.00 |

7.12.5 期末前十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 | 占基金资产净值比 | 流通受限情况说明 |
|----|------|------|-----------|----------|----------|
|----|------|------|-----------|----------|----------|

| | | | 价值 | 例 (%) | |
|---|--------|------|--------|-------|--------|
| 1 | 300367 | 东方网力 | 180.00 | 0.00 | 重大资产重组 |

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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 |
| 15,132 | 275,357.66 | 1,807,489,975.16 | 43.38% | 2,359,222,063.31 | 56.62% |

8.2 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 | 20,473.08 | 0.00% |

8.3 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

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2016年1月4日）基金份额总额 | 4,978,395,127.27 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,703,346,972.45 |
| 本报告期基金总申购份额 | 524,917.41 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 537,159,851.39 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 4,166,712,038.47 |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 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、证券业协会、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，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | |
| 天风证券 | 1 | 313,783,015.08 | 55.35% | 285,947.45 | 55.06% | - |
| 中泰证券 | 3 | 197,500,460.01 | 34.84% | 182,697.42 | 35.18% | - |
| 长江证券 | 1 | 55,591,555.32 | 9.81% | 50,659.95 | 9.76% | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |

注：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、本基金本报告期内增加天风证券一个交易单元, 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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|---------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 天风证券 | 55,567,456.50 | 96.39% | 2,032,600,000.00 | 83.56% | - | - |
| 中泰证券 | 2,079,400.00 | 3.61% | 400,000,000.00 | 16.44% | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|-------------|------------|
| 1 | 建信基金管理有限责任公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2017年6月12日 |
| 2 | 关于新增华泰证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2017年5月26日 |
| 3 | 建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2017年4月24日 |
| 4 | 关于新增华融证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2017年4月20日 |
| 5 | 关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2017年2月23日 |
| 6 | 关于旗下部分开放式基金参加凤凰金信转换费率优惠活动的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2017年2月21日 |
| 7 | 关于新增渤海银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2017年2月18日 |
| 8 | 关于新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下开放式基金代销机构的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2017年1月17日 |

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|------------------------------------|------------------|------|------|------------------|-------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2017 年 01 月 01 日 -2017 年 06 月 30 日 | 1,000,224,000.00 | 0.00 | 0.00 | 1,000,224,000.00 | 24.01 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。</p> <p>本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。</p> | | | | | | | |

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信安心保本三号混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信安心保本三号混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信安心保本三号混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信安心保本三号混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2017 年 8 月 26 日