

建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF） 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 1 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
6.4 报表附注.....	24
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注.....	67
§8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	69
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
8.4 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.....	70
§9 开放式基金份额变动.....	71
§10 重大事件揭示.....	72
10.1 基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
10.4 基金投资策略的改变.....	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
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.....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
10.8 其他重大事件.....	76
§11 备查文件目录.....	78
11.1 备查文件目录.....	78
11.2 存放地点.....	78
11.3 查阅方式.....	78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	建信沪深 300 指数 (LOF)
场内简称	建信 300
基金主代码	165309
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2009 年 11 月 5 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	458,736,951.61 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2009 年 11 月 30 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+5\% \times$ 商业银行税后活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，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，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	郭明
	联系电话	010-66228888	(010) 66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	(010) 66105798
注册地址		北京市西城区金融大街 7号英蓝国际金融中心 16层	北京市西城区复兴门内大街 55号
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	北京市西城区复兴门内大街 55号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		许会斌	易会满

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	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

§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	4,311,167.23
本期利润	54,770,223.93
加权平均基金份额本期利润	0.1178
本期加权平均净值利润率	11.34%
本期基金份额净值增长率	11.83%
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	51,386,291.00
期末可供分配基金份额利润	0.1120
期末基金资产净值	510,123,242.61
期末基金份额净值	1.1120
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	11.20%

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

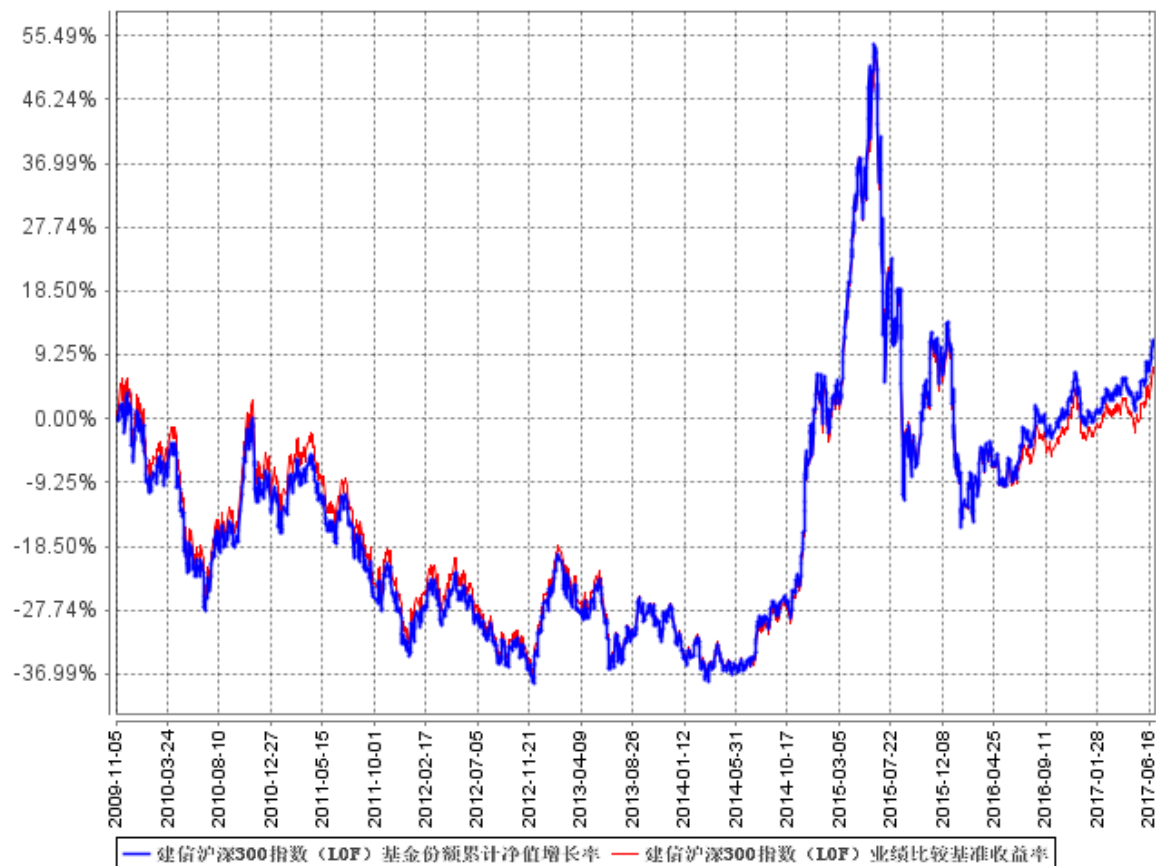
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.32%	0.61%	4.73%	0.64%	0.59%	-0.03%
过去三个月	6.91%	0.57%	5.79%	0.59%	1.12%	-0.02%
过去六个月	11.83%	0.53%	10.23%	0.54%	1.60%	-0.01%
过去一年	18.55%	0.63%	15.44%	0.63%	3.11%	0.00%
过去三年	71.87%	1.70%	65.95%	1.66%	5.92%	0.04%
自基金合同 生效起至今	11.20%	1.47%	7.13%	1.46%	4.07%	0.01%

本基金业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。

其中：沪深 300 指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准，商业银行活期存款利率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。沪深 300 指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，它是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。指数样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值。成份股为市场中市场代表性好，流动性高，交易活跃的主流投资股票，能够反映市场主流投资的收益情况。

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

建信沪深300指数 (LOF) 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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理、本基金的基金经理	2009 年 11 月 5 日	-	14	<p>特许金融分析师 (CFA)，2003 年 1 月获清华大学经济学博士学位。</p> <p>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。</p> <p>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、投资管理部总监、金融工程及指数投资部总监。</p> <p>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</p>

					<p>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 日起任建信双利分级股票基金的基金经理；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。</p>
--	--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

在报告期内，本基金根据基金合同规定，采取了对指数的被动复制策略，将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。

在报告期内，标的指数中工商银行和建设银行两只股票限于规定无法投资，而必须用其他股票进行替代，这是基金跟踪误差的主要来源之一。本基金管理人以量化分析研究为基础，制定及执行了相应的替代策略，并根据市场情况，对替代方案进行持续的优化和调整，以尽可能降低跟踪误差及偏离度。

在报告期内，组合中股票停牌、基金申赎、成份股分红等因素也对跟踪误差及偏离度产生了一定影响。本基金管理人已通过选择适当的策略尽力克服这些不利影响。

在报告期后期，沪深 300 指数进行了成份股调整。本基金积极应对，较好地控制了期间基金组合的跟踪误差。

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 11.83%，波动率 0.53%，业绩比较基准收益率 10.23%，波动率 0.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年，宏观经济实际表现强于年初预期，股票市场分化明显，大市值股票比较强势，但在股票数量上占比较少，这与此前数年特点相反。

展望下半年，预计宏观经济仍能保持平稳态势，政策继续以稳为主，兼顾经济增长和控制债务杠杆。小市值股票在经历半年左右的反复调整后，与大市值股票表现的落差可能不再像上半年那样明显。

本管理人将根据基金合同，继续秉承被动复制策略，并以量化分析研究为基础，克服个别成份股无法投资、基金日常申赎、成份股停牌等各种因素造成的不利影响，不断优化和改进量化模型，将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

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、风险管理人员、内控合规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）。

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

本报告期内，本基金托管人在对建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

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	35,072,830.94	40,235,483.68
结算备付金		-	699,821.98
存出保证金		17,276.35	19,497.11
交易性金融资产	6.4.7.2	477,375,547.91	424,567,501.98
其中：股票投资		477,375,547.91	424,469,779.98
基金投资		-	-
债券投资		-	97,722.00
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	-	-
应收证券清算款		223,364.39	-
应收利息	6.4.7.5	7,263.21	10,021.99
应收股利		-	-
应收申购款		73,362.01	157,231.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		512,769,644.81	465,689,558.66
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		1,208,245.41	751,432.59
应付管理人报酬		307,368.61	302,167.18
应付托管费		61,473.71	60,433.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	772,224.23	1,092,030.16
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	297,090.24	326,676.54
负债合计		2,646,402.20	2,532,739.93
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	458,736,951.61	465,745,060.44
未分配利润	6.4.7.10	51,386,291.00	-2,588,241.71
所有者权益合计		510,123,242.61	463,156,818.73
负债和所有者权益总计		512,769,644.81	465,689,558.66

报告截止日 2017 年 6 月 30 日, 基金份额净值 1.1120 元, 基金份额总额 458,736,951.61 份。

6.2 利润表

会计主体: 建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

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	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		57,262,644.97	-70,513,341.12
1.利息收入		134,147.50	133,322.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	134,065.52	133,203.80
债券利息收入		81.98	118.65
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）		6,629,451.39	-7,425,600.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,710,087.23	-11,461,848.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	19,001.39	-
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	3,900,362.77	4,036,247.85
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	50,459,056.70	-63,245,987.93
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	39,989.38	24,925.01
减：二、费用		2,492,421.04	2,497,115.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,793,606.01	1,639,315.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	358,721.24	327,863.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	121,090.93	291,170.07

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	219,002.86	238,767.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		54,770,223.93	-73,010,456.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		54,770,223.93	-73,010,456.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

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)	465,745,060.44	-2,588,241.71	463,156,818.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	54,770,223.93	54,770,223.93
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)	-7,008,108.83	-795,691.22	-7,803,800.05
其中：1.基金申购款	59,342,667.99	2,285,999.96	61,628,667.95
2.基金赎回款	-66,350,776.82	-3,081,691.18	-69,432,468.00

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)	458,736,951.61	51,386,291.00	510,123,242.61
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 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)	457,322,875.93	45,654,127.09	502,977,003.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-73,010,456.65	-73,010,456.65
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)	33,319,244.84	-3,081,876.73	30,237,368.11
其中：1.基金申购款	70,193,449.99	-5,521,586.21	64,671,863.78
2.基金赎回款	-36,874,205.15	2,439,709.48	-34,434,495.67
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)	490,642,120.77	-30,438,206.29	460,203,914.48

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:

_____ 孙志晨	_____ 吴曙明	_____ 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (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[2009]第 882 号《关于核准建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 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《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2009 年 9 月 21 日至 2009 年 10 月 30 日止。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 5,324,471,976.73 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 233 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2009 年 11 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,326,413,369.61 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,941,392.88 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2009]第 157 号文审核同意,本基金 59,552,590.00 份基金份额于 2009 年 11 月 30 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%,投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。本基金业绩比较基准为 95%×沪深 300 指数收益率 + 5%×商业银行税后活期存款利率。本基金的标的指数使用费由基金管理人建信基金管理有限责任公司承担,不计入本基金费用。

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—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》、《建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)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 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.4.1 会计年度

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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。

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	35,072,830.94
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	35,072,830.94

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	441,556,053.21	477,375,547.91	35,819,494.70
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	441,556,053.21	477,375,547.91	35,819,494.70

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

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
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	7.80
合计	7,263.21

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	772,224.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	772,224.23

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	2,792.01
预提费用	294,298.23
合计	297,090.24

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	465,745,060.44	465,745,060.44
本期申购	59,342,667.99	59,342,667.99
本期赎回(以“-”号填列)	-66,350,776.82	-66,350,776.82
- 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	458,736,951.61	458,736,951.61

1、申购含转换入份额，赎回含转换出份额；

2、截至 2017 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 2,776,004.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 455,960,947.61 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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	265,983,439.22	-268,571,680.93	-2,588,241.71
本期利润	4,311,167.23	50,459,056.70	54,770,223.93
本期基金份额交易产生的变动数	-4,032,759.43	3,237,068.21	-795,691.22
其中：基金申购款	34,067,594.82	-31,781,594.86	2,285,999.96
基金赎回款	-38,100,354.25	35,018,663.07	-3,081,691.18

本期已分配利润	-	-	-
本期末	266,261,847.02	-214,875,556.02	51,386,291.00

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	132,629.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,252.37
其他	183.46
合计	134,065.52

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	42,608,376.66
减：卖出股票成本总额	39,898,289.43
买卖股票差价收入	2,710,087.23

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	19,001.39
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	19,001.39

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	568,283.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	548,997.60
减：应收利息总额	284.21
买卖债券差价收入	19,001.39

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

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

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	3,900,362.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,900,362.77

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	50,459,056.70
——股票投资	50,466,779.09
——债券投资	-7,722.39

——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	50,459,056.70

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	39,076.36
转换费收入	913.02
基金转换费收入	-
证管费返还	-
合计	39,989.38

1、本基金的场内份额赎回费率为赎回金额 0.5%，场外份额赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产；

2、本基金在转出时收取的转换费由本基金赎回费和适用情况下的申购补差费构成，其中赎回费部分的 25% 归入基金资产。

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	121,090.93
银行间市场交易费用	-
合计	121,090.93

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	29,752.78
信息披露费	148,765.71
上市费用	29,752.78
债券托管账户维护费	9,000.00
银行费用	1,731.59
上市年费	-
银行划款手续费	-
债券托管账户维护费	-
合计	219,002.86

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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。

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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,793,606.01	1,639,315.32
其中：支付销售机构的客户维护费	400,912.14	396,465.45

1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 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 0.75% / 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 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	358,721.24	327,863.05

支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 0.15% / 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1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
工商银行：活期存款	35,072,830.94	132,629.69	35,424,093.52	131,080.16

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生其他关联交易事项。

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

金额单位: 人民币元

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新发未上市	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新发未上市	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新发未上市	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新发未上市	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新发未上市	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月	2017 年	新发未上市	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

		30 日	7 月 12 日							
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新发未 上市	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新发未 上市	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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。

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
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	重大事项	7.47	2017 年 8 月 21 日	8.22	396,090	2,186,334.45	2,958,792.30	-
601989	中国重工	2017 年 5 月 31 日	重大事项	6.21	-	-	428,902	4,047,088.19	2,663,481.42	-
601088	中国神华	2017 年 6 月 5 日	重大事项	22.29	-	-	92,365	1,857,232.08	2,058,815.85	-
600795	国电电力	2017 年 6 月 5 日	重大事项	3.60	-	-	550,800	1,810,616.20	1,982,880.00	-
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大资产重组	28.62	-	-	55,475	2,900,416.86	1,587,694.50	-

000100	TCL 集团	2017 年 4 月 21 日	重大事 项	3.43	2017 年 7 月 26 日	3.72	342,446	1,313,556.38	1,174,589.78	-
600100	同方 股份	2017 年 4 月 21 日	重大事 项	14.12	-	-	83,073	1,098,414.60	1,172,990.76	-
601727	上海 电气	2017 年 6 月 22 日	重大资 产重组	7.57	2017 年 7 月 3 日	7.54	143,585	1,628,427.41	1,086,938.45	-
600485	信威 集团	2016 年 12 月 26 日	重大事 项	14.59	-	-	66,949	1,582,730.94	976,785.91	-
601919	中远 海控	2017 年 5 月 17 日	重大事 项	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	178,310	1,923,709.45	953,958.50	-
002252	上海 莱士	2017 年 4 月 21 日	重大事 项	20.24	-	-	46,383	994,239.74	938,791.92	-
000503	海虹 控股	2017 年 5 月 11 日	重大事 项	24.93	-	-	33,556	1,253,500.84	836,551.08	-
600959	江苏 有线	2017 年 6 月 19 日	重大事 项	10.57	-	-	71,110	913,287.87	751,632.70	-
002426	胜利 精密	2017 年 1 月 16 日	重大事 项	8.07	-	-	79,200	755,263.00	639,144.00	-
600666	奥瑞 德	2017 年 5 月 31 日	重大资 产重组	17.40	-	-	34,400	676,476.95	598,560.00	-
002129	中环 股份	2016 年 4 月 25 日	重大事 项	8.27	-	-	65,082	719,245.62	538,228.14	-
002049	紫光 国芯	2017 年 2 月 20 日	重大事 项	30.82	2017 年 7 月 17 日	27.74	17,000	577,828.93	523,940.00	-
601872	招商 轮船	2017 年 5 月 2 日	重大事 项	5.16	-	-	99,000	568,900.82	510,840.00	-
600654	*ST 中安	2017 年 6 月 7 日	重大资 产重组	13.48	-	-	35,200	677,061.00	474,496.00	-
601608	中信	2017 年	重大事 项	5.54	2017 年	5.26	60,800	406,540.89	336,832.00	-

	重工	4 月 19 日	项		7 月 26 日				
--	----	----------	---	--	----------	--	--	--	--

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。

本基金风险管理的目标是通过事前监测、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	0.00	-
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	-	-

6.4.13.2.2 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	0.00	97,722.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	97,722.00

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。

6.4.13.3 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同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、结算备付金和买入返售金融资产等, 其余大部分金融资产和金融负债不计息, 因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2017 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	35,072,830.94	-	-	-	35,072,830.94
存出保证金	17,276.35	-	-	-	17,276.35
交易性金融资产	-	-	-	477,375,547.91	477,375,547.91
应收证券清算款	-	-	-	223,364.39	223,364.39
应收利息	-	-	-	7,263.21	7,263.21
应收申购款	-	-	-	73,362.01	73,362.01
资产总计	35,090,107.29	0.00	0.00	477,679,537.52	512,769,644.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,208,245.41	1,208,245.41
应付管理人报酬	-	-	-	307,368.61	307,368.61
应付托管费	-	-	-	61,473.71	61,473.71
应付交易费用	-	-	-	772,224.23	772,224.23
其他负债	-	-	-	297,090.24	297,090.24
负债总计	0.00	0.00	0.00	2,646,402.20	2,646,402.20
利率敏感度缺口	35,090,107.29	0.00	0.00	475,033,135.32	510,123,242.61
上年度末					
2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	40,235,483.68	-	-	-	40,235,483.68
结算备付金	699,821.98	-	-	-	699,821.98
存出保证金	19,497.11	-	-	-	19,497.11
交易性金融资产	0.00	97,722.00	0.00	424,469,779.98	424,567,501.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	10,021.99	10,021.99

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	157,231.92	157,231.92
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	40,954,802.77	97,722.00	0.00	424,637,033.89	465,689,558.66
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	-	-	-	751,432.59	751,432.59
应付管理人报酬	-	-	-	302,167.18	302,167.18
应付托管费	-	-	-	60,433.46	60,433.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,092,030.16	1,092,030.16
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	326,676.54	326,676.54
负债总计	0.00	0.00	0.00	2,532,739.93	2,532,739.93
利率敏感度缺口	40,954,802.77	97,722.00	0.00	422,104,293.96	463,156,818.73

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

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

本基金为以完全复制为目标的被动型指数基金，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 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	477,375,547.91	93.58	424,469,779.98	91.65
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	97,722.00	0.02
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	477,375,547.91	93.58	424,567,501.98	91.67

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%	25,095,079.65
业绩比较基准下降 5%	-25,095,079.65	-23,886,245.68	

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 06 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 454,493,561.12 元, 属于第二层次的余额为 22,881,986.79 元, 无属于第三层次的余额 (2016 年 06 月 30 日: 第一层次 408,415,425.15 元, 第二层次 18,744,508.18 元, 无属于第三层次的余额)。

(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 06 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	477,375,547.91	93.10
	其中：股票	477,375,547.91	93.10
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	35,072,830.94	6.84
7	其他各项资产	321,265.96	0.06
8	合计	512,769,644.81	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,144,856.08	0.22
B	采矿业	15,370,764.39	3.01
C	制造业	170,345,289.67	33.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,974,931.88	2.54
E	建筑业	22,072,505.11	4.33

F	批发和零售业	10,282,152.59	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	13,945,057.80	2.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术 服务业	24,359,647.77	4.78
J	金融业	163,722,814.56	32.09
K	房地产业	25,397,309.62	4.98
L	租赁和商务服务业	4,177,881.64	0.82
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理 业	3,941,560.59	0.77
O	居民服务、修理和其他服务 业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	941,800.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	4,396,114.12	0.86
S	综合	1,392,766.64	0.27
	合计	474,465,452.46	93.01

以上行业分类以 2017 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,597,867.86	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产 和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	323,266.60	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术 服务业	476,712.19	0.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	512,248.80	0.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理 业	-	-
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	2,910,095.45	0.57

以上行业分类以 2017 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.2.3 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

7.3.1 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	601318	中国平安	495,732	24,593,264.52	4.82

2	600036	招商银行	517,783	12,380,191.53	2.43
3	600519	贵州茅台	23,010	10,857,268.50	2.13
4	601166	兴业银行	591,102	9,965,979.72	1.95
5	600016	民生银行	1,212,182	9,964,136.04	1.95
6	000651	格力电器	220,226	9,066,704.42	1.78
7	000333	美的集团	207,140	8,915,305.60	1.75
8	601288	农业银行	2,352,799	8,281,852.48	1.62
9	601328	交通银行	1,291,420	7,955,147.20	1.56
10	000002	万科 A	311,579	7,780,127.63	1.53
11	601668	中国建筑	686,393	6,644,284.24	1.30
12	600000	浦发银行	514,439	6,507,653.35	1.28
13	600030	中信证券	360,190	6,130,433.80	1.20
14	600887	伊利股份	278,172	6,005,733.48	1.18
15	601988	中国银行	1,543,071	5,709,362.70	1.12
16	600837	海通证券	370,275	5,498,583.75	1.08
17	002415	海康威视	168,908	5,455,728.40	1.07
18	601169	北京银行	556,721	5,105,131.57	1.00
19	600104	上汽集团	160,337	4,978,463.85	0.98
20	601601	中国太保	143,858	4,872,470.46	0.96
21	000858	五粮液	86,787	4,830,564.42	0.95
22	600900	长江电力	302,020	4,645,067.60	0.91
23	000725	京东方 A	1,087,719	4,524,911.04	0.89
24	601766	中国中车	445,376	4,507,205.12	0.88
25	601211	国泰君安	206,384	4,232,935.84	0.83
26	600276	恒瑞医药	77,342	3,912,731.78	0.77
27	000001	平安银行	392,879	3,689,133.81	0.72
28	600048	保利地产	325,608	3,246,311.76	0.64
29	600050	中国联通	396,090	2,958,792.30	0.58

30	601390	中国中铁	341,118	2,957,493.06	0.58
31	600518	康美药业	135,793	2,952,139.82	0.58
32	601818	光大银行	728,742	2,951,405.10	0.58
33	600028	中国石化	481,063	2,852,703.59	0.56
34	600019	宝钢股份	404,644	2,715,161.24	0.53
35	600015	华夏银行	293,364	2,704,816.08	0.53
36	601688	华泰证券	149,424	2,674,689.60	0.52
37	601989	中国重工	428,902	2,663,481.42	0.52
38	000063	中兴通讯	108,852	2,584,146.48	0.51
39	002450	康得新	113,060	2,546,111.20	0.50
40	601186	中国铁建	210,503	2,532,351.09	0.50
41	002304	洋河股份	27,500	2,387,275.00	0.47
42	000776	广发证券	135,371	2,335,149.75	0.46
43	001979	招商蛇口	108,470	2,316,919.20	0.45
44	601006	大秦铁路	272,177	2,283,565.03	0.45
45	000538	云南白药	23,823	2,235,788.55	0.44
46	600703	三安光电	111,908	2,204,587.60	0.43
47	600690	青岛海尔	139,540	2,100,077.00	0.41
48	600585	海螺水泥	91,474	2,079,204.02	0.41
49	601088	中国神华	92,365	2,058,815.85	0.40
50	601628	中国人寿	76,174	2,055,174.52	0.40
51	600795	国电电力	550,800	1,982,880.00	0.39
52	600958	东方证券	142,448	1,981,451.68	0.39
53	601336	新华保险	38,097	1,958,185.80	0.38
54	002024	苏宁云商	170,359	1,916,538.75	0.38
55	601901	方正证券	188,371	1,870,524.03	0.37
56	601009	南京银行	166,360	1,864,895.60	0.37
57	600340	华夏幸福	54,061	1,815,368.38	0.36

58	600999	招商证券	104,664	1,802,314.08	0.35
59	600309	万华化学	62,518	1,790,515.52	0.35
60	002230	科大讯飞	44,421	1,772,397.90	0.35
61	600089	特变电工	171,276	1,769,281.08	0.35
62	600741	华域汽车	72,113	1,748,019.12	0.34
63	000423	东阿阿胶	24,038	1,728,091.82	0.34
64	002142	宁波银行	89,227	1,722,081.10	0.34
65	601857	中国石油	222,330	1,709,717.70	0.34
66	600660	福耀玻璃	64,129	1,669,919.16	0.33
67	601985	中国核电	213,700	1,668,997.00	0.33
68	601669	中国电建	210,018	1,663,342.56	0.33
69	600009	上海机场	44,081	1,644,662.11	0.32
70	601899	紫金矿业	474,992	1,629,222.56	0.32
71	000568	泸州老窖	32,000	1,618,560.00	0.32
72	002241	歌尔股份	83,950	1,618,556.00	0.32
73	300070	碧水源	86,015	1,604,179.75	0.31
74	601377	兴业证券	214,520	1,593,883.60	0.31
75	300104	乐视网	55,475	1,587,694.50	0.31
76	002456	欧菲光	87,092	1,582,461.64	0.31
77	000166	申万宏源	275,309	1,541,730.40	0.30
78	601607	上海医药	52,767	1,523,910.96	0.30
79	300072	三聚环保	40,960	1,517,568.00	0.30
80	002236	大华股份	66,290	1,512,074.90	0.30
81	000069	华侨城 A	150,210	1,511,112.60	0.30
82	002736	国信证券	112,520	1,490,890.00	0.29
83	002466	天齐锂业	27,300	1,483,755.00	0.29
84	600886	国投电力	186,286	1,471,659.40	0.29
85	000338	潍柴动力	110,752	1,461,926.40	0.29

86	000783	长江证券	151,800	1,437,546.00	0.28
87	600196	复星医药	45,963	1,424,393.37	0.28
88	600031	三一重工	175,200	1,424,376.00	0.28
89	600068	葛洲坝	126,400	1,420,736.00	0.28
90	300059	东方财富	117,688	1,414,609.76	0.28
91	600029	南方航空	160,632	1,397,498.40	0.27
92	600010	包钢股份	625,918	1,370,760.42	0.27
93	601600	中国铝业	300,900	1,360,068.00	0.27
94	002008	大族激光	39,021	1,351,687.44	0.26
95	601888	中国国旅	44,816	1,350,754.24	0.26
96	600066	宇通客车	60,724	1,334,106.28	0.26
97	601788	光大证券	89,349	1,333,980.57	0.26
98	600637	东方明珠	60,437	1,309,669.79	0.26
99	600606	绿地控股	167,000	1,305,940.00	0.26
100	000625	长安汽车	89,173	1,285,874.66	0.25
101	000839	中信国安	125,550	1,254,244.50	0.25
102	601099	太平洋	311,945	1,254,018.90	0.25
103	002594	比亚迪	24,900	1,243,755.00	0.24
104	601933	永辉超市	175,168	1,240,189.44	0.24
105	601555	东吴证券	109,818	1,233,256.14	0.24
106	600535	天士力	29,666	1,232,325.64	0.24
107	601618	中国中冶	245,100	1,227,951.00	0.24
108	600893	航发动力	44,586	1,217,197.80	0.24
109	000413	东旭光电	107,300	1,203,906.00	0.24
110	600383	金地集团	103,284	1,184,667.48	0.23
111	600522	中天科技	98,221	1,183,563.05	0.23
112	600406	国电南瑞	66,624	1,175,913.60	0.23
113	000100	TCL 集团	342,446	1,174,589.78	0.23

114	600100	同方股份	83,073	1,172,990.76	0.23
115	000768	中航飞机	63,284	1,166,956.96	0.23
116	300124	汇川技术	45,665	1,166,284.10	0.23
117	600705	中航资本	205,360	1,160,284.00	0.23
118	002673	西部证券	80,082	1,138,766.04	0.22
119	600109	国金证券	96,885	1,135,492.20	0.22
120	600816	安信信托	83,360	1,132,862.40	0.22
121	002475	立讯精密	38,721	1,132,202.04	0.22
122	600111	北方稀土	99,676	1,129,329.08	0.22
123	601800	中国交建	69,800	1,109,122.00	0.22
124	000963	华东医药	22,300	1,108,310.00	0.22
125	002202	金风科技	71,550	1,106,878.50	0.22
126	601727	上海电气	143,585	1,086,938.45	0.21
127	000895	双汇发展	45,229	1,074,188.75	0.21
128	600570	恒生电子	22,663	1,057,908.84	0.21
129	600271	航天信息	51,124	1,055,199.36	0.21
130	601018	宁波港	180,800	1,021,520.00	0.20
131	600023	浙能电力	186,700	1,019,382.00	0.20
132	600739	辽宁成大	55,723	1,004,685.69	0.20
133	600177	雅戈尔	98,345	995,251.40	0.20
134	600352	浙江龙盛	104,210	993,121.30	0.19
135	600674	川投能源	100,700	988,874.00	0.19
136	000728	国元证券	80,807	987,461.54	0.19
137	601992	金隅股份	152,600	987,322.00	0.19
138	600547	山东黄金	33,920	981,305.60	0.19
139	600485	信威集团	66,949	976,785.91	0.19
140	300024	机器人	49,922	973,479.00	0.19
141	000623	吉林敖东	42,448	971,634.72	0.19

142	601225	陕西煤业	137,283	970,590.81	0.19
143	600221	海航控股	300,836	968,691.92	0.19
144	600018	上港集团	151,516	960,611.44	0.19
145	601919	中远海控	178,310	953,958.50	0.19
146	002508	老板电器	21,700	943,516.00	0.18
147	002044	美年健康	55,400	941,800.00	0.18
148	002252	上海莱士	46,383	938,791.92	0.18
149	002065	东华软件	43,037	937,776.23	0.18
150	002007	华兰生物	25,597	934,290.50	0.18
151	000793	华闻传媒	92,254	933,610.48	0.18
152	600804	鹏博士	51,748	918,527.00	0.18
153	600115	东方航空	134,600	915,280.00	0.18
154	000157	中联重科	200,985	902,422.65	0.18
155	600415	小商品城	124,510	901,452.40	0.18
156	603993	洛阳钼业	177,800	899,668.00	0.18
157	000540	中天金融	128,900	895,855.00	0.18
158	601111	中国国航	91,150	888,712.50	0.17
159	600208	新湖中宝	196,694	885,123.00	0.17
160	601998	中信银行	140,184	881,757.36	0.17
161	600085	同仁堂	25,030	875,048.80	0.17
162	600820	隧道股份	86,300	871,630.00	0.17
163	601198	东兴证券	50,400	868,896.00	0.17
164	002465	海格通信	78,538	843,498.12	0.17
165	600436	片仔癀	13,800	842,352.00	0.17
166	600153	建发股份	64,810	837,993.30	0.16
167	000503	海虹控股	33,556	836,551.08	0.16
168	000826	启迪桑德	23,527	826,268.24	0.16
169	000630	铜陵有色	289,040	820,873.60	0.16

170	002310	东方园林	49,000	819,280.00	0.16
171	000709	河钢股份	194,400	814,536.00	0.16
172	600157	永泰能源	227,443	811,971.51	0.16
173	600362	江西铜业	47,473	800,394.78	0.16
174	300017	网宿科技	66,041	797,114.87	0.16
175	002081	金螳螂	72,530	796,379.40	0.16
176	000009	中国宝安	98,296	795,214.64	0.16
177	600663	陆家嘴	33,600	794,304.00	0.16
178	000060	中金岭南	70,823	793,217.60	0.16
179	000876	新希望	96,444	792,769.68	0.16
180	600489	中金黄金	78,906	791,427.18	0.16
181	600061	国投安信	50,700	788,385.00	0.15
182	002146	荣盛发展	79,558	785,237.46	0.15
183	600170	上海建工	203,768	778,393.76	0.15
184	601229	上海银行	30,200	771,308.00	0.15
185	002027	分众传媒	55,900	769,184.00	0.15
186	601155	新城控股	41,300	765,702.00	0.15
187	002074	国轩高科	24,100	760,355.00	0.15
188	601216	君正集团	154,400	755,016.00	0.15
189	600959	江苏有线	71,110	751,632.70	0.15
190	600118	中国卫星	26,969	750,816.96	0.15
191	600332	白云山	25,653	744,963.12	0.15
192	002500	山西证券	77,680	744,174.40	0.15
193	000750	国海证券	135,000	742,500.00	0.15
194	600682	南京新百	20,100	741,690.00	0.15
195	600297	广汇汽车	98,100	738,693.00	0.14
196	300315	掌趣科技	89,900	733,584.00	0.14
197	601633	长城汽车	55,140	732,810.60	0.14

198	600008	首创股份	110,236	725,352.88	0.14
199	600369	西南证券	129,120	724,363.20	0.14
200	000425	徐工机械	192,346	721,297.50	0.14
201	600150	中国船舶	31,522	720,908.14	0.14
202	601333	广深铁路	155,200	701,504.00	0.14
203	300144	宋城演艺	33,200	692,884.00	0.14
204	000559	万向钱潮	62,915	668,157.30	0.13
205	000792	盐湖股份	63,750	666,187.50	0.13
206	600688	上海石化	100,300	662,983.00	0.13
207	000686	东北证券	64,178	644,988.90	0.13
208	002195	二三四五	90,170	644,715.50	0.13
209	000402	金融街	54,687	640,931.64	0.13
210	002426	胜利精密	79,200	639,144.00	0.13
211	000983	西山煤电	72,100	632,317.00	0.12
212	600583	海油工程	101,158	631,225.92	0.12
213	601117	中国化学	90,300	631,197.00	0.12
214	600718	东软集团	39,761	618,283.55	0.12
215	300027	华谊兄弟	76,424	618,270.16	0.12
216	300033	同花顺	9,800	609,658.00	0.12
217	600498	烽火通信	24,000	608,400.00	0.12
218	600649	城投控股	57,817	607,656.67	0.12
219	002411	必康股份	21,000	607,320.00	0.12
220	600895	张江高科	35,400	597,552.00	0.12
221	600827	百联股份	36,678	596,017.50	0.12
222	600256	广汇能源	143,305	593,282.70	0.12
223	600373	中文传媒	25,154	591,370.54	0.12
224	002385	大北农	93,800	590,002.00	0.12
225	000917	电广传媒	51,837	585,758.10	0.11

226	002183	怡亚通	67,800	585,114.00	0.11
227	600704	物产中大	78,755	574,123.95	0.11
228	600588	用友网络	33,419	572,133.28	0.11
229	000415	渤海金控	84,900	571,377.00	0.11
230	600074	保千里	44,600	571,326.00	0.11
231	000008	神州高铁	77,100	561,288.00	0.11
232	600060	海信电器	35,872	544,178.24	0.11
233	002470	金正大	71,756	540,322.68	0.11
234	600376	首开股份	47,200	539,968.00	0.11
235	600919	江苏银行	58,100	539,749.00	0.11
236	601718	际华集团	60,300	530,037.00	0.10
237	002049	紫光国芯	17,000	523,940.00	0.10
238	601866	中远海发	145,163	522,586.80	0.10
239	002602	世纪华通	14,100	511,266.00	0.10
240	601872	招商轮船	99,000	510,840.00	0.10
241	002558	巨人网络	11,040	510,268.80	0.10
242	000959	首钢股份	72,600	507,474.00	0.10
243	002352	顺丰控股	9,500	505,020.00	0.10
244	600909	华安证券	49,700	501,473.00	0.10
245	002174	游族网络	15,700	498,632.00	0.10
246	601997	贵阳银行	31,500	498,015.00	0.10
247	600038	中直股份	10,727	490,974.79	0.10
248	300168	万达信息	33,400	485,970.00	0.10
249	002555	三七互娱	19,000	485,830.00	0.10
250	600977	中国电影	25,600	479,232.00	0.09
251	000977	浪潮信息	27,400	474,568.00	0.09
252	600021	上海电力	39,100	472,719.00	0.09
253	000627	天茂集团	58,400	471,872.00	0.09

254	600037	歌华有线	31,800	463,008.00	0.09
255	002152	广电运通	55,500	461,205.00	0.09
256	600737	中粮糖业	46,900	442,736.00	0.09
257	002714	牧原股份	15,900	432,798.00	0.08
258	000671	阳光城	74,100	431,262.00	0.08
259	600549	厦门钨业	19,722	423,825.78	0.08
260	002131	利欧股份	128,100	421,449.00	0.08
261	600372	中航电子	24,094	418,512.78	0.08
262	600685	中船防务	15,000	410,700.00	0.08
263	000738	航发控制	20,984	410,656.88	0.08
264	000938	紫光股份	6,700	409,504.00	0.08
265	601118	海南橡胶	71,956	408,710.08	0.08
266	000718	苏宁环球	69,400	406,684.00	0.08
267	002292	奥飞娱乐	23,992	405,464.80	0.08
268	600446	金证股份	23,000	404,340.00	0.08
269	600482	中国动力	15,900	402,111.00	0.08
270	601877	正泰电器	19,500	391,755.00	0.08
271	000156	华数传媒	26,184	390,403.44	0.08
272	601375	中原证券	36,700	369,202.00	0.07
273	601021	春秋航空	10,970	368,921.10	0.07
274	002424	贵州百灵	19,400	365,884.00	0.07
275	300133	华策影视	31,923	357,537.60	0.07
276	601881	中国银河	29,500	349,870.00	0.07
277	601608	中信重工	60,800	336,832.00	0.07
278	002153	石基信息	14,639	332,744.47	0.07
279	000961	中南建设	50,900	331,868.00	0.07
280	300251	光线传媒	40,200	329,238.00	0.06
281	601958	金钼股份	44,241	317,207.97	0.06

282	002299	圣农发展	20,400	303,348.00	0.06
283	600233	圆通速递	15,400	301,686.00	0.06
284	601611	中国核建	24,100	288,477.00	0.06
285	601163	三角轮胎	10,900	286,670.00	0.06
286	600871	石化油服	82,600	275,884.00	0.05
287	600926	杭州银行	18,400	273,240.00	0.05
288	601966	玲珑轮胎	10,900	244,487.00	0.05
289	603858	步长制药	3,400	243,576.00	0.05
290	603160	汇顶科技	2,200	220,660.00	0.04
291	000555	神州信息	13,200	220,440.00	0.04
292	600188	兖州煤业	17,600	215,424.00	0.04
293	601127	小康股份	8,200	163,590.00	0.03
294	002797	第一创业	17,680	162,832.80	0.03
295	002831	裕同科技	2,000	150,000.00	0.03
296	002841	视源股份	2,000	148,440.00	0.03
297	002839	张家港行	9,100	143,052.00	0.03
298	002739	万达电影	70	3,567.90	0.00

7.3.2 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	600666	奥瑞德	34,400	598,560.00	0.12
2	002129	中环股份	65,082	538,228.14	0.11
3	300058	蓝色光标	65,324	510,833.68	0.10
4	600654	*ST 中安	35,200	474,496.00	0.09
5	600648	外高桥	17,455	323,266.60	0.06

6	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
7	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
8	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
9	002863	今飞凯达	2,249	36,343.84	0.01
10	300647	超频三	1,244	30,602.40	0.01
11	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
12	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
13	603269	海鸥股份	795	23,357.10	0.00
14	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
15	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
16	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
17	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
18	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
19	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
20	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
21	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
22	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
23	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
24	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
25	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
26	300663	科蓝软件	93	2,216.19	0.00
27	300662	科锐国际	56	1,415.12	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	002456	欧菲光	2,133,350.91	0.46
2	002415	海康威视	1,272,500.00	0.27
3	600019	宝钢股份	1,159,464.43	0.25
4	001979	招商蛇口	1,141,213.00	0.25
5	600522	中天科技	1,139,636.60	0.25
6	601992	金隅股份	1,045,491.00	0.23
7	002508	老板电器	980,104.00	0.21
8	002044	美年健康	874,889.00	0.19
9	600436	片仔癀	780,597.00	0.17
10	601988	中国银行	772,885.00	0.17
11	601229	上海银行	756,060.00	0.16
12	600682	南京新百	742,510.00	0.16
13	000540	中天金融	693,732.00	0.15
14	601288	农业银行	621,514.00	0.13
15	601117	中国化学	609,205.00	0.13
16	002411	必康股份	595,097.00	0.13
17	600663	陆家嘴	561,518.00	0.12
18	601166	兴业银行	553,598.61	0.12
19	600919	江苏银行	545,970.00	0.12
20	002352	顺丰控股	513,650.00	0.11

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	002456	欧菲光	2,135,657.37	0.46
2	601166	兴业银行	1,307,234.00	0.28
3	002739	万达电影	1,153,344.00	0.25
4	600867	通化东宝	945,766.24	0.20
5	600005	武钢股份	865,294.43	0.19
6	601318	中国平安	831,791.00	0.18
7	000540	中天金融	811,304.00	0.18
8	002085	万丰奥威	765,697.20	0.17
9	000778	新兴铸管	712,272.00	0.15
10	601258	庞大集团	657,156.00	0.14
11	601988	中国银行	638,217.00	0.14
12	300015	爱尔眼科	617,077.50	0.13
13	601288	农业银行	612,721.00	0.13
14	000039	中集集团	601,346.45	0.13
15	600839	四川长虹	599,488.81	0.13
16	000415	渤海金控	575,060.00	0.12
17	300002	神州泰岳	539,073.87	0.12
18	600252	中恒集团	523,379.30	0.11
19	600875	东方电气	520,465.74	0.11
20	601200	上海环境	500,567.38	0.11

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	42,337,278.27
卖出股票收入（成交）总额	42,608,376.66

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。

7.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	17,276.35
2	应收证券清算款	223,364.39
3	应收股利	-
4	应收利息	7,263.21
5	应收申购款	73,362.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	321,265.96

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 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	600666	奥瑞德	598,560.00	0.12	重大资产重组
2	002129	中环股份	538,228.14	0.11	重大事项
3	600654	*ST 中安	474,496.00	0.09	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
27,210	16,859.13	22,800,285.07	4.97%	435,936,666.54	95.03%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	赵新霞	330,726.00	11.91%
2	漆勇	187,574.00	6.76%
3	张雁	125,460.00	4.52%
4	陈素萍	103,827.00	3.74%
5	孙新建	101,318.00	3.65%
6	龚秀琴	100,000.00	3.60%
7	黎雯婧	73,600.00	2.65%
8	郭艳荣	68,928.00	2.48%
9	张超明	57,800.00	2.08%
10	韩连星	57,755.00	2.08%

8.3 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	496,734.19	0.11%

持有本基金		
-------	--	--

8.4 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、基金投资和研究 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	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2009 年 11 月 5 日) 基金份额总额	5,326,413,369.61
本报告期期初基金份额总额	465,745,060.44
本报告期基金总申购份额	59,342,667.99
减:本报告期基金总赎回份额	66,350,776.82
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	458,736,951.61

上述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	
国信证券	1	35,636,177.74	45.14%	32,475.68	44.70%	-
长城证券	3	24,593,528.12	31.15%	22,903.48	31.53%	-
天风证券	1	10,644,548.19	13.48%	9,913.64	13.65%	-
川财证券	1	6,454,342.01	8.18%	5,879.84	8.09%	-
长江证券	1	1,618,071.01	2.05%	1,474.49	2.03%	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证 券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	3	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中信证券(山东)	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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、本报告期内剔除上海证券 2 个交易单元和中投证券 1 个交易单元，无新增交易单元；

4、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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
国信证券	471,335.20	82.94%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	96,948.00	17.06%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(山	-	-	-	-	-	-

东)						
中投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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	关于凤凰金信增加代销建信基金旗下部分开放式基金的公告	指定报刊和/或公司网站	2017年6月5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	关于继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2017年3月31日
6	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

7	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 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 2、《建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）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。

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

11.3 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