

建信鑫盛回报灵活配置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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
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.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
§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的真实、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	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	建信鑫盛回报灵活配置混合
基金主代码	001700
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 6 月 3 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	242,059,984.23 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置和主动的投资管理，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金以自上而下的投资策略，灵活配置大类资产，动态控制组合风险，力争长期、稳定的回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65% +中债综合指数收益率（全价）×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	罗菲菲
	联系电话	010-66228888	010-58560666
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95568
传真		010-66228001	010-58560798
注册地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心	北京市西城区复兴门内大街2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	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	100033	100031
法定代表人	许会斌	洪崎

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

§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	12,753,970.58
本期利润	20,098,899.86
加权平均基金份额本期利润	0.0238
本期加权平均净值利润率	2.32%
本期基金份额净值增长率	3.62%
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	8,759,733.43
期末可供分配基金份额利润	0.0362
期末基金资产净值	255,259,588.18
期末基金份额净值	1.0545
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	5.45%

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	2.04%	0.23%	3.55%	0.44%	-1.51%	-0.21%
过去三个月	2.34%	0.15%	3.63%	0.41%	-1.29%	-0.26%
过去六个月	3.62%	0.11%	6.13%	0.38%	-2.51%	-0.27%

过去一年	5.38%	0.09%	9.05%	0.44%	-3.67%	-0.35%
自基金合同生效起至今	5.45%	0.09%	8.93%	0.46%	-3.48%	-0.37%

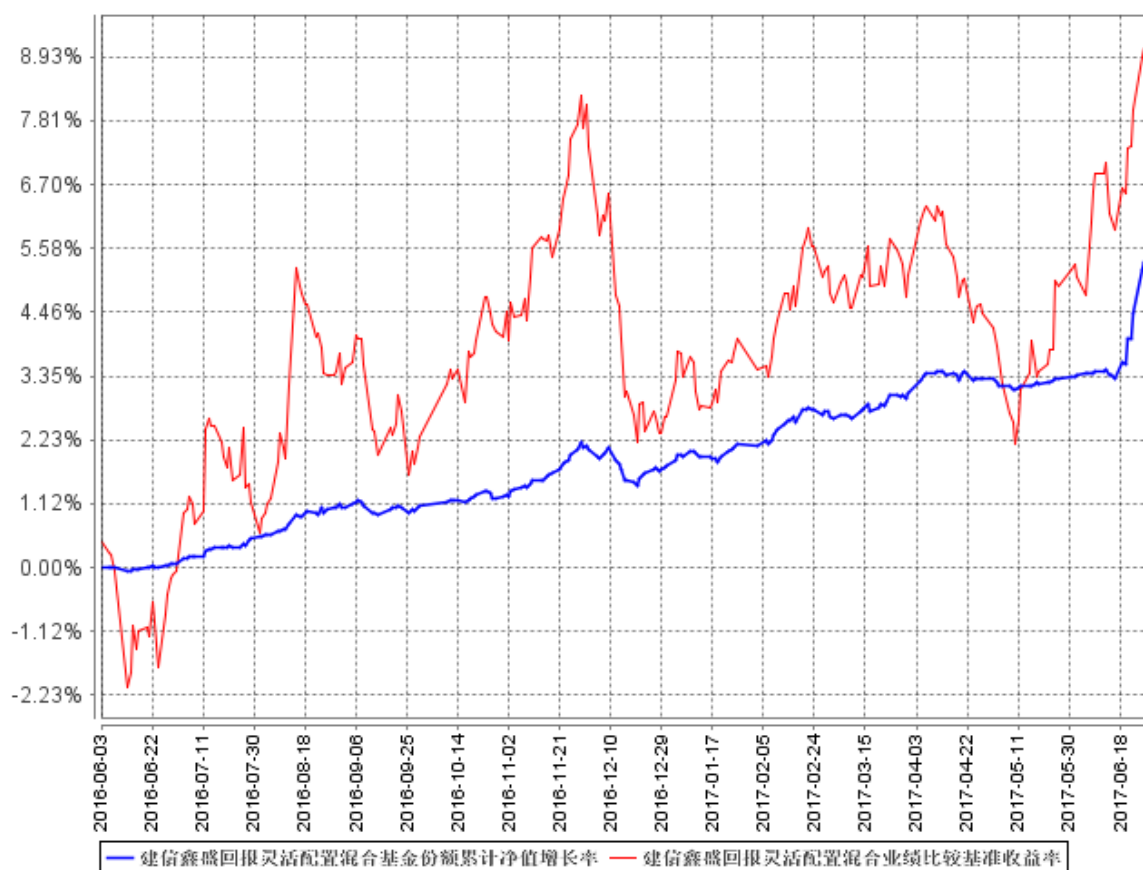
本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65% +中债综合指数收益率（全价）×35%

沪深 300 指数选择科学客观，流动性高，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。

中债综合指数具广泛市场代表性，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。基于本基金的特征，使用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

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

建信鑫盛回报灵活配置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		

王东杰	权益投资部联席投资官、本基金的基金经理	2016年6月3日	2017年6月9日	9	<p>博士。2008年7月至2012年5月在高华证券有限责任公司工作，历任分析员、经理；2012年5月加入我公司，历任初级研究员、研究员、研究主管、基金经理、权益投资部联席投资官，2015年5月13日至2017年7月12日任建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015年7月29日起任建信大安全战略精选股票型证券投资基金基金经理；2016年6月3日至2017年6月9日任建信鑫盛回报灵活配置基金的基金经理。</p>
薛玲	本基金的基金经理	2017年5月27日	-	4	<p>博士。2009年5月至2009年12月在国家电网公司研究院农电配电研究所工作，任项目经理；2010年1月至2013年4月在路通世纪公司亚洲数据收集部门工作，任高级软件工程师；2013年4月至2015年8月在中国中投证券公司工作，历任研究员、投资经理；2015年9月加入我公司金融工程及指数投资部，任基金经理助理，2016年7月4日起任上证社会责任ETF及其联接基金的基金经理；2017年5月27日起任建信鑫盛回报基金的基金经理。</p>
高珊	本基金的基金经理	2016年6月3日	2017年6月9日	11	<p>硕士。2006年7月至2007年6月期间在中信建投证券公司工作，任交易员。2007年6月加入建信基金管理公司，历任</p>

				<p>初级交易员、交易员，2009 年 7 月起任建信货币市场基金的基金经理助理。2012 年 8 月 28 日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理；2012 年 12 月 20 日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理；2013 年 1 月 29 日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理；2013 年 9 月 17 日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金经理；2013 年 12 月 20 日起任建信货币市场基金基金经理；2015 年 8 月 25 日起任建信现金添利货币市场基金基金经理；2016 年 6 月 3 日至 2017 年 6 月 9 日任建信鑫盛回报灵活配置基金的基金经理；2016 年 7 月 26 日起任建信现金增利货币市场基金基金经理；2016 年 10 月 18 日起任建信天添益货币市场基金基金经理。</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

报告期间，本基金在股票组合的配置上以量化分析研究为基础，利用量化模型进行沪深 300 指数增强和风险管理，获得了较为显著且稳定的超额收益。本基金在债券组合的配置上久期基本保持稳定，主要投向为国有股份制银行以及一类城商行的大额存单和存款，并在资金紧张的时点配置了大量优质资产，杠杆比例较低，并积极参与新股申购增厚收益，给投资人带来了合理的回报。

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 3.62%，波动率 0.11%，业绩比较基准收益率 6.13%，波动率 0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2017 年上半年，随着新股发行加快，新股注册制的实质实行，市场走出了分化走势。上证 50，沪深 300 不断创出新高的同时，中证 500 维持震荡走势，而创业板持续下行。展望

2017 年下半年，经济企稳的趋势有望延续，与此同时，CPI 可能上行。因此，重点关注供给侧改革、环保措施加强对于上市公司业绩的影响，回归基本面精选个股。同时，需关注 CPI 上行趋势，提防央行资金面收紧对于股市的影响。

本基金管理人将根据基金合同，以量化分析研究为基础，克服各种因素的不利影响，不断优化和改进量化模型，为投资者创造更高的投资回报。

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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关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，本基金未进行利润分配。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：建信鑫盛回报灵活配置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	72,780,487.40	76,150,698.81
结算备付金		3,041,843.47	1,897,869.92
存出保证金		1,021,516.73	31,160.79
交易性金融资产	6.4.7.2	159,859,560.52	810,791,403.73
其中：股票投资		147,521,040.52	67,560,862.83
基金投资		-	-
债券投资		12,338,520.00	743,230,540.90
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	17,000,000.00	249,995,614.99
应收证券清算款		2,004,100.14	-
应收利息	6.4.7.5	367,258.29	9,724,643.39
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		256,074,766.55	1,148,591,391.63
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		-	129,601,485.59
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	1,027.06
应付管理人报酬		123,917.61	603,641.41
应付托管费		41,305.87	172,468.95
应付销售服务费		20,652.93	86,234.48
应付交易费用	6.4.7.7	355,100.68	130,014.95

应交税费		-	-
应付利息		-	24,292.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	274,201.28	233,770.50
负债合计		815,178.37	130,852,934.96
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	242,059,984.23	1,000,030,866.93
未分配利润	6.4.7.10	13,199,603.95	17,707,589.74
所有者权益合计		255,259,588.18	1,017,738,456.67
负债和所有者权益总计		256,074,766.55	1,148,591,391.63

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0545 元，基金份额总额 242,059,984.23 份。

6.2 利润表

会计主体：建信鑫盛回报灵活配置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 6 月 3 日(基 金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		25,010,628.52	1,478,979.45
1.利息收入		14,209,785.15	2,029,798.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,382,675.49	1,981,158.55
债券利息收入		5,785,565.35	295.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,041,544.31	48,344.40
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,455,908.75	300,594.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,826,475.04	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	492,071.80	-
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	137,361.91	300,594.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,344,929.28	-851,413.51
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	5.34	-

减：二、费用		4,911,728.66	799,741.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,623,662.35	516,452.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	869,904.03	147,557.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	434,951.99	73,778.93
4. 交易费用	6.4.7.19	626,422.53	23,793.58
5. 利息支出		119,292.74	-
其中：卖出回购金融资产支出		119,292.74	-
6. 其他费用	6.4.7.20	237,495.02	38,158.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,098,899.86	679,238.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,098,899.86	679,238.30

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信鑫盛回报灵活配置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）	1,000,030,866.93	17,707,589.74	1,017,738,456.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,098,899.86	20,098,899.86
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）	-757,970,882.70	-24,606,885.65	-782,577,768.35
其中：1.基金申购款	242,087,823.12	7,963,986.88	250,051,810.00
2.基金赎回款	-1,000,058,705.82	-32,570,872.53	-1,032,629,578.35
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)	242,059,984.23	13,199,603.95	255,259,588.18
项目	上年度可比期间 2016年6月3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)	1,000,137,732.04	-	1,000,137,732.04
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	679,238.30	679,238.30
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	1,000,137,732.04	679,238.30	1,000,816,970.34

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

建信鑫盛回报灵活配置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]1572号《关于准予建信鑫盛回报灵活配置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《建信鑫盛回报灵活配置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 1,000,137,720.00 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 700 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,000,137,732.04 份基金份额，其中认购资金利息折合 12.04 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他依法上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券)、股指期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-100%，其中权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×65% +中债综合指数收益率(全价)×35%。

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》、《建信鑫盛回报灵活配置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 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	780,487.40
定期存款	72,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	12,000,000.00
存款期限 1 个月以内	-
存款期限 3 个月以上	60,000,000.00
其他存款	-
合计：	72,780,487.40

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	142,971,752.76	147,521,040.52	4,549,287.76
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,381,040.00	2,381,520.00
	银行间市场	9,930,030.00	9,957,000.00
	合计	12,311,070.00	12,338,520.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	155,282,822.76	159,859,560.52	4,576,737.76

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-4,345,380.00	-	-	
其中：股指期货投资	-4,345,380.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-4,345,380.00	-	-	

衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。于2017年6月30日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值 (单位：人民币元)	公允价值变动 (单位：人民币元)
IF1709	沪深300期货 1709合约	-4	-4,356,960.00	-11,580.00
总额合计		-4	-4,356,960.00	-11,580.00
减：可抵销期货暂收款				-11,580.00
期货投资净额				-

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	17,000,000.00	-
合计	17,000,000.00	-

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	292.87
应收定期存款利息	257,177.91
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,596.66
应收债券利息	106,057.35
应收买入返售证券利息	1,085.60
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	47.90
合计	367,258.29

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	352,550.67
银行间市场应付交易费用	2,550.01
合计	355,100.68

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	-
预提费用	274,201.28
合计	274,201.28

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	1,000,030,866.93	1,000,030,866.93
本期申购	242,087,823.12	242,087,823.12
本期赎回(以“-”号填列)	-1,000,058,705.82	-1,000,058,705.82
- 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	242,059,984.23	242,059,984.23

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	20,486,612.88	-2,779,023.14	17,707,589.74
本期利润	12,753,970.58	7,344,929.28	20,098,899.86
本期基金份额交易产生的变动数	-24,480,850.03	-126,035.62	-24,606,885.65
其中：基金申购款	7,991,426.58	-27,439.70	7,963,986.88
基金赎回款	-32,472,276.61	-98,595.92	-32,570,872.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,759,733.43	4,439,870.52	13,199,603.95

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
定期存款利息收入	7,247,441.73
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,827.61
其他	15,032.58
合计	7,382,675.49

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	182,770,486.41
减：卖出股票成本总额	179,944,011.37
买卖股票差价收入	2,826,475.04

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	492,071.80
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	492,071.80

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	864,846,550.58
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	850,355,142.72
减：应收利息总额	13,999,336.06
买卖债券差价收入	492,071.80

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

本基金本报告期未投资贵金属。

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**

本基金本报告期未投资权证。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具收益。

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	137,361.91
基金投资产生的股利收益	-
合计	137,361.91

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	7,356,509.28
——股票投资	5,142,871.21
——债券投资	2,213,638.07
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-11,580.00
——权证投资	-
股指期货投资	-11,580.00
3. 其他	-
合计	7,344,929.28

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	5.34
合计	5.34

本基金基金份额的赎回费率按持有期间递减，并全额进入基金财产。

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	622,495.20
银行间市场交易费用	3,927.33
合计	626,422.53

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	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	5,540.74
其他费用	600.00

持有人大会费用	15,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	237,495.02

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
中国民生银行股份有限公司(“民生银行”)	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6月3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	2,623,662.35	516,452.65
其中：支付销售机构的客户维护费	30.38	28.35

1、于2017年1月5日前，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

0.7%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 0.7% / 当年天数。

根据基金管理人于 2017 年 1 月 6 日发布的《关于建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决意生效的公告》，自 2017 年 1 月 6 日起，本基金管理人报酬调整为按前一日基金资产净值 0.6%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 0.6% / 当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

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6月3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	869,904.03	147,557.91

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国民生银行	12.81
建信基金管理有限责任公司	434,939.18
合计	434,951.99
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2016年6月3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销售服务费
中国民生银行	10.26
建信基金管理有限责任公司	73,768.67
合计	73,778.93

支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

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

单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行	49,434,600.00	145,854,450.00	-	-	-	-
上年度可比期间 2016 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行	-	-	-	-	-	-

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 6 月 3 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
中国民生银行-活期存款	780,487.40	113,373.57	52,722,591.00	85,052.97
中国民生银行-定期存款	-	566,666.60	-	-

本基金的活期银行存款及部分定期存款由基金托管人中国民生银行保管，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
002127	南极电商	2017年6月29日	重大资产重组	12.08	2017年7月6日	12.61	4,300	53,952.00	51,944.00	-
300145	中金环境	2017年6月28日	重大资产重组	16.92	-	-	1,200	19,627.00	20,304.00	-
300404	博济医药	2017年6月20日	重大事项	23.07	-	-	100	2,332.00	2,307.00	-

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

无

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

无

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	72,780,487.40	-	-	-	72,780,487.40
结算备付金	3,041,843.47	-	-	-	3,041,843.47
存出保证金	1,021,516.73	-	-	-	1,021,516.73
交易性金融资产	12,338,520.00	-	-	147,521,040.52	159,859,560.52
买入返售金融资产	17,000,000.00	-	-	-	17,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	2,004,100.14	2,004,100.14
应收利息	-	-	-	367,258.29	367,258.29
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	106,182,367.60	0.00	0.00	149,892,398.95	256,074,766.55
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	123,917.61	123,917.61
应付托管费	-	-	-	41,305.87	41,305.87
应付销售服务费	-	-	-	20,652.93	20,652.93
应付交易费用	-	-	-	355,100.68	355,100.68
其他负债	-	-	-	274,201.28	274,201.28
负债总计	0.00	0.00	0.00	815,178.37	815,178.37
利率敏感度缺口	106,182,367.60	0.00	0.00	149,077,220.58	255,259,588.18
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	76,150,698.81	-	-	-	76,150,698.81
结算备付金	1,897,869.92	-	-	-	1,897,869.92
存出保证金	31,160.79	-	-	-	31,160.79
交易性金融资产	735,630,000.00	7,401,907.30	198,633.60	67,560,862.83	810,791,403.73

衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	249,995,614.99	-	-	-	249,995,614.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,724,643.39	9,724,643.39
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,063,705,344.51	7,401,907.30	198,633.60	77,285,506.22	1,148,591,391.63
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	129,601,485.59	-	-	-	129,601,485.59
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	-	-	-	1,027.06	1,027.06
应付管理人报酬	-	-	-	603,641.41	603,641.41
应付托管费	-	-	-	172,468.95	172,468.95
应付销售服务费	-	-	-	86,234.48	86,234.48
应付交易费用	-	-	-	130,014.95	130,014.95
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	24,292.02	24,292.02
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	233,770.50	233,770.50
负债总计	129,601,485.59	0.00	0.00	1,251,449.37	130,852,934.96
利率敏感度缺口	934,103,858.92	7,401,907.30	198,633.60	76,034,056.85	1,017,738,456.67

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	-17,710.04	-923,652.42

	市场利率下降 25 个基点	17,768.59	927,980.68
--	---------------	-----------	------------

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。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-100%，其中权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。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	147,521,040.52	57.79	67,560,862.83	6.64
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	12,338,520.00	4.83	743,230,540.90	73.03
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	159,859,560.52	62.63	810,791,403.73	79.67

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%	1,653,310.13
业绩比较基准下降 5%	-1,653,310.13	-	

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 147,446,485.52 元，属于第二层次的余额为 12,413,075.00 元，无属于第三层次的余额(2016 年 6 月 30 日：第一层次 22,718,880.72 元，第二层次 4,498,506.96 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(2016 年 6 月 30 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 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	147,521,040.52	57.61
	其中：股票	147,521,040.52	57.61
2	固定收益投资	12,338,520.00	4.82
	其中：债券	12,338,520.00	4.82
	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	17,000,000.00	6.64
	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	75,822,330.87	29.61
7	其他各项资产	3,392,875.16	1.32
8	合计	256,074,766.55	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	889,026.00	0.35
B	采矿业	4,054,322.00	1.59
C	制造业	54,134,748.55	21.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,728,875.66	2.24
E	建筑业	6,788,496.70	2.66
F	批发和零售业	3,525,483.00	1.38
G	交通运输、仓储和邮政业	5,333,783.00	2.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,603,081.76	1.80
J	金融业	49,596,611.00	19.43
K	房地产业	8,962,109.85	3.51

L	租赁和商务服务业	1,904,233.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	2,307.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	896,207.00	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	166,204.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	929,080.00	0.36
S	综合	6,472.00	0.00
	合计	147,521,040.52	57.79

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	601318	中国平安	104,700	5,194,167.00	2.03
2	600036	招商银行	184,300	4,406,613.00	1.73
3	601288	农业银行	942,000	3,315,840.00	1.30
4	601328	交通银行	535,300	3,297,448.00	1.29
5	601988	中国银行	879,800	3,255,260.00	1.28
6	601166	兴业银行	172,200	2,903,292.00	1.14
7	002304	洋河股份	31,700	2,751,877.00	1.08
8	601398	工商银行	492,200	2,584,050.00	1.01
9	601668	中国建筑	254,200	2,460,656.00	0.96
10	600837	海通证券	160,200	2,378,970.00	0.93
11	600030	中信证券	129,600	2,205,792.00	0.86
12	600000	浦发银行	173,600	2,196,040.00	0.86
13	601169	北京银行	221,300	2,029,321.00	0.80
14	000651	格力电器	48,000	1,976,160.00	0.77
15	601628	中国人寿	69,800	1,883,204.00	0.74
16	000725	京东方 A	452,300	1,881,568.00	0.74
17	600887	伊利股份	82,200	1,774,698.00	0.70
18	600900	长江电力	114,657	1,763,424.66	0.69
19	002142	宁波银行	87,600	1,690,680.00	0.66

20	601601	中国太保	49,200	1,666,404.00	0.65
21	000540	中天金融	239,500	1,664,525.00	0.65
22	002007	华兰生物	45,600	1,664,400.00	0.65
23	601766	中国中车	154,600	1,564,552.00	0.61
24	600048	保利地产	155,800	1,553,326.00	0.61
25	000776	广发证券	87,500	1,509,375.00	0.59
26	002415	海康威视	46,200	1,492,260.00	0.58
27	600104	上汽集团	46,400	1,440,720.00	0.56
28	601211	国泰君安	70,200	1,439,802.00	0.56
29	000002	万科A	55,900	1,395,823.00	0.55
30	601006	大秦铁路	151,200	1,268,568.00	0.50
31	000333	美的集团	28,700	1,235,248.00	0.48
32	600276	恒瑞医药	22,400	1,133,216.00	0.44
33	601390	中国中铁	120,000	1,040,400.00	0.41
34	002081	金螳螂	93,900	1,031,022.00	0.40
35	600518	康美药业	47,200	1,026,128.00	0.40
36	601866	中远海发	283,900	1,022,040.00	0.40
37	000517	荣安地产	211,765	984,707.25	0.39
38	600028	中国石化	165,800	983,194.00	0.39
39	600674	川投能源	99,700	979,054.00	0.38
40	601186	中国铁建	80,600	969,618.00	0.38
41	601857	中国石油	125,000	961,250.00	0.38
42	600958	东方证券	67,300	936,143.00	0.37
43	000800	一汽轿车	89,300	908,181.00	0.36
44	002093	国脉科技	101,199	890,551.20	0.35
45	300257	开山股份	42,100	887,468.00	0.35
46	601688	华泰证券	49,200	880,680.00	0.35
47	601238	广汽集团	32,800	854,768.00	0.33
48	601818	光大银行	205,200	831,060.00	0.33
49	000538	云南白药	8,800	825,880.00	0.32
50	002434	万里扬	51,700	823,064.00	0.32
51	000001	平安银行	82,700	776,553.00	0.30
52	000069	华侨城A	77,000	774,620.00	0.30
53	002002	鸿达兴业	96,549	755,978.67	0.30
54	601899	紫金矿业	220,300	755,629.00	0.30
55	002508	老板电器	17,200	747,856.00	0.29
56	002294	信立泰	20,900	745,294.00	0.29
57	000066	中国长城	82,200	740,622.00	0.29
58	000830	鲁西化工	106,300	733,470.00	0.29

59	000858	五 粮 液	13,000	723,580.00	0.28
60	002589	瑞康医药	46,400	714,560.00	0.28
61	002714	牧原股份	26,100	710,442.00	0.28
62	600999	招商证券	39,500	680,190.00	0.27
63	002024	苏宁云商	60,000	675,000.00	0.26
64	600018	上港集团	104,600	663,164.00	0.26
65	300251	光线传媒	79,700	652,743.00	0.26
66	600009	上海机场	17,400	649,194.00	0.25
67	000028	国药一致	7,700	622,930.00	0.24
68	300136	信维通信	15,500	620,310.00	0.24
69	000630	铜陵有色	217,400	617,416.00	0.24
70	002500	山西证券	63,700	610,246.00	0.24
71	600415	小商品城	83,600	605,264.00	0.24
72	002456	欧菲光	33,300	605,061.00	0.24
73	600340	华夏幸福	17,800	597,724.00	0.23
74	002475	立讯精密	20,100	587,724.00	0.23
75	000338	潍柴动力	44,500	587,400.00	0.23
76	000625	长安汽车	40,500	584,010.00	0.23
77	600309	万华化学	20,200	578,528.00	0.23
78	600031	三一重工	70,300	571,539.00	0.22
79	601985	中国核电	72,200	563,882.00	0.22
80	002064	华峰氨纶	116,500	561,530.00	0.22
81	603517	绝味食品	16,000	557,920.00	0.22
82	300418	昆仑万维	24,300	555,741.00	0.22
83	000089	深圳机场	59,200	553,520.00	0.22
84	002266	浙富控股	113,100	551,928.00	0.22
85	000581	威孚高科	21,100	546,490.00	0.21
86	000895	双汇发展	22,700	539,125.00	0.21
87	002707	众信旅游	40,900	537,017.00	0.21
88	601336	新华保险	10,300	529,420.00	0.21
89	000685	中山公用	46,800	512,460.00	0.20
90	601800	中国交建	32,030	508,956.70	0.20
91	000963	华东医药	9,800	487,060.00	0.19
92	600528	中铁工业	33,800	483,002.00	0.19
93	000426	兴业矿业	53,500	482,570.00	0.19
94	601888	中国国旅	15,400	464,156.00	0.18
95	600398	海澜之家	48,200	457,418.00	0.18
96	601788	光大证券	29,500	440,435.00	0.17
97	600606	绿地控股	56,000	437,920.00	0.17

98	601225	陕西煤业	60,600	428,442.00	0.17
99	300296	利亚德	21,900	411,720.00	0.16
100	600567	山鹰纸业	114,200	408,836.00	0.16
101	000596	古井贡酒	8,000	407,600.00	0.16
102	000676	智度股份	27,000	404,190.00	0.16
103	000997	新大陆	17,700	401,613.00	0.16
104	002414	高德红外	21,600	395,280.00	0.15
105	000898	鞍钢股份	69,800	395,068.00	0.15
106	600029	南方航空	45,200	393,240.00	0.15
107	600823	世茂股份	79,700	390,530.00	0.15
108	002450	康得新	17,300	389,596.00	0.15
109	002595	豪迈科技	17,300	384,579.00	0.15
110	300072	三聚环保	10,374	384,356.70	0.15
111	002601	龙蟠佰利	23,100	378,378.00	0.15
112	300324	旋极信息	20,734	378,188.16	0.15
113	000690	宝新能源	62,400	373,152.00	0.15
114	600111	北方稀土	32,400	367,092.00	0.14
115	300033	同花顺	5,900	367,039.00	0.14
116	002557	洽洽食品	24,700	357,409.00	0.14
117	000421	南京公用	48,200	351,860.00	0.14
118	002555	三七互娱	13,600	347,752.00	0.14
119	002530	金财互联	11,800	347,628.00	0.14
120	002174	游族网络	10,900	346,184.00	0.14
121	300338	开元股份	16,000	344,000.00	0.13
122	600628	新世界	29,600	341,880.00	0.13
123	600312	平高电气	23,800	327,012.00	0.13
124	002285	世联行	40,000	320,800.00	0.13
125	002310	东方园林	19,000	317,680.00	0.12
126	002338	奥普光电	9,100	312,312.00	0.12
127	600019	宝钢股份	45,200	303,292.00	0.12
128	600690	青岛海尔	19,900	299,495.00	0.12
129	600115	东方航空	43,300	294,440.00	0.12
130	001979	招商蛇口	13,500	288,360.00	0.11
131	600282	南钢股份	76,600	284,186.00	0.11
132	601198	东兴证券	16,400	282,736.00	0.11
133	000797	中国武夷	29,800	279,524.00	0.11
134	000598	兴蓉环境	49,600	278,752.00	0.11
135	600547	山东黄金	9,500	274,835.00	0.11
136	601009	南京银行	24,000	269,040.00	0.11

137	600015	华夏银行	28,800	265,536.00	0.10
138	600816	安信信托	19,400	263,646.00	0.10
139	000046	泛海控股	29,900	261,027.00	0.10
140	002179	中航光电	8,364	260,873.16	0.10
141	601229	上海银行	10,100	257,954.00	0.10
142	002293	罗莱生活	21,931	251,329.26	0.10
143	300003	乐普医疗	11,136	246,216.96	0.10
144	002354	天神娱乐	11,400	245,100.00	0.10
145	002366	台海核电	5,200	243,932.00	0.10
146	601111	中国国航	23,900	233,025.00	0.09
147	000036	华联控股	25,600	232,960.00	0.09
148	002073	软控股份	27,100	229,808.00	0.09
149	002027	分众传媒	16,700	229,792.00	0.09
150	601933	永辉超市	32,400	229,392.00	0.09
151	002463	沪电股份	50,200	228,410.00	0.09
152	000783	长江证券	23,300	220,651.00	0.09
153	002247	帝龙文化	16,500	216,480.00	0.08
154	002094	青岛金王	9,900	211,167.00	0.08
155	600804	鹏博士	11,700	207,675.00	0.08
156	000525	红太阳	11,000	204,710.00	0.08
157	002080	中材科技	10,200	202,164.00	0.08
158	002241	歌尔股份	10,400	200,512.00	0.08
159	603288	海天味业	4,900	199,822.00	0.08
160	000732	泰禾集团	11,900	198,492.00	0.08
161	000063	中兴通讯	8,300	197,042.00	0.08
162	002405	四维图新	9,700	191,672.00	0.08
163	000400	许继电气	10,600	190,376.00	0.07
164	600180	瑞茂通	13,400	188,136.00	0.07
165	600452	涪陵电力	4,000	182,680.00	0.07
166	002857	三晖电气	5,100	180,489.00	0.07
167	002572	索菲亚	4,400	180,400.00	0.07
168	002429	兆驰股份	58,200	178,674.00	0.07
169	600919	江苏银行	19,200	178,368.00	0.07
170	600585	海螺水泥	7,800	177,294.00	0.07
171	002311	海大集团	9,700	177,219.00	0.07
172	002230	科大讯飞	4,400	175,560.00	0.07
173	300156	神雾环保	5,200	170,352.00	0.07
174	601801	皖新传媒	12,000	165,840.00	0.06
175	600039	四川路桥	39,600	164,736.00	0.06

176	600315	上海家化	5,000	162,250.00	0.06
177	002078	太阳纸业	21,300	156,555.00	0.06
178	002242	九阳股份	7,900	155,393.00	0.06
179	000418	小天鹅 A	3,300	154,407.00	0.06
180	600201	生物股份	4,300	152,951.00	0.06
181	002035	华帝股份	6,300	152,460.00	0.06
182	300182	捷成股份	15,800	151,048.00	0.06
183	002334	英威腾	20,700	150,075.00	0.06
184	000883	湖北能源	29,500	148,090.00	0.06
185	000761	本钢板材	27,800	145,394.00	0.06
186	000521	美菱电器	22,700	145,280.00	0.06
187	002032	苏泊尔	3,500	143,675.00	0.06
188	002097	山河智能	15,800	140,462.00	0.06
189	000055	方大集团	18,700	136,136.00	0.05
190	603040	新坐标	2,100	135,072.00	0.05
191	002100	天康生物	16,700	134,101.00	0.05
192	601991	大唐发电	29,500	133,340.00	0.05
193	600663	陆家嘴	5,500	130,020.00	0.05
194	601012	隆基股份	7,500	128,250.00	0.05
195	600875	东方电气	13,300	127,414.00	0.05
196	002215	诺普信	15,000	126,900.00	0.05
197	002091	江苏国泰	13,200	126,060.00	0.05
198	002496	辉丰股份	25,300	125,488.00	0.05
199	300498	温氏股份	5,300	124,232.00	0.05
200	000869	张裕 A	3,300	122,760.00	0.05
201	000959	首钢股份	17,300	120,927.00	0.05
202	002092	中泰化学	9,400	119,380.00	0.05
203	002563	森马服饰	13,900	117,872.00	0.05
204	002479	富春环保	9,900	117,810.00	0.05
205	300124	汇川技术	4,600	117,484.00	0.05
206	601881	中国银河	9,900	117,414.00	0.05
207	002065	东华软件	5,300	115,487.00	0.05
208	000983	西山煤电	12,900	113,133.00	0.04
209	600612	老凤祥	2,300	112,631.00	0.04
210	600373	中文传媒	4,700	110,497.00	0.04
211	601158	重庆水务	15,000	107,250.00	0.04
212	600820	隧道股份	10,500	106,050.00	0.04
213	002425	凯撒文化	11,600	106,024.00	0.04
214	300122	智飞生物	5,500	105,105.00	0.04

215	002465	海格通信	9,300	99,882.00	0.04
216	000425	徐工机械	26,400	99,000.00	0.04
217	600160	巨化股份	8,100	97,443.00	0.04
218	000933	神火股份	13,100	95,499.00	0.04
219	300316	晶盛机电	7,100	88,679.00	0.03
220	002583	海能达	5,500	88,495.00	0.03
221	601877	正泰电器	4,400	88,396.00	0.03
222	300115	长盈精密	3,000	87,540.00	0.03
223	300347	泰格医药	3,600	87,120.00	0.03
224	000423	东阿阿胶	1,200	86,268.00	0.03
225	002445	中南文化	6,700	86,095.00	0.03
226	603960	克来机电	2,000	85,960.00	0.03
227	600703	三安光电	4,100	80,770.00	0.03
228	002202	金风科技	5,200	80,444.00	0.03
229	002537	海立美达	6,600	80,388.00	0.03
230	300015	爱尔眼科	3,400	79,084.00	0.03
231	002433	太安堂	8,400	77,700.00	0.03
232	002090	金智科技	3,200	76,000.00	0.03
233	600873	梅花生物	13,400	75,978.00	0.03
234	600377	宁沪高速	7,700	75,460.00	0.03
235	002152	广电运通	9,000	74,790.00	0.03
236	300631	久吾高科	1,700	73,729.00	0.03
237	002740	爱迪尔	7,000	73,570.00	0.03
238	600166	福田汽车	25,700	72,988.00	0.03
239	002441	众业达	6,300	72,828.00	0.03
240	600023	浙能电力	13,100	71,526.00	0.03
241	300285	国瓷材料	3,604	70,998.80	0.03
242	002228	合兴包装	14,900	69,434.00	0.03
243	600271	航天信息	3,300	68,112.00	0.03
244	600010	宝钢股份	30,900	67,671.00	0.03
245	002736	国信证券	5,100	67,575.00	0.03
246	002029	七匹狼	6,900	66,033.00	0.03
247	300070	碧水源	3,500	65,275.00	0.03
248	000498	山东路桥	9,100	65,065.00	0.03
249	002068	黑猫股份	7,700	64,757.00	0.03
250	002376	新北洋	4,700	64,484.00	0.03
251	600383	金地集团	5,500	63,085.00	0.02
252	000903	云内动力	13,700	62,335.00	0.02
253	002558	巨人网络	1,320	61,010.40	0.02

254	600798	宁波海运	11,200	58,800.00	0.02
255	002267	陕天然气	6,600	58,014.00	0.02
256	000559	万向钱潮	5,400	57,348.00	0.02
257	000697	炼石有色	2,700	55,269.00	0.02
258	600389	江山股份	3,300	54,714.00	0.02
259	000666	经纬纺机	2,400	54,576.00	0.02
260	000718	苏宁环球	8,900	52,154.00	0.02
261	002127	南极电商	4,300	51,944.00	0.02
262	002390	信邦制药	5,900	51,389.00	0.02
263	300293	蓝英装备	3,600	50,832.00	0.02
264	601100	恒立液压	3,100	50,499.00	0.02
265	002483	润邦股份	7,500	49,425.00	0.02
266	002737	葵花药业	1,600	49,280.00	0.02
267	002503	搜于特	6,900	48,507.00	0.02
268	002656	摩登大道	2,800	48,412.00	0.02
269	002200	云投生态	2,800	48,328.00	0.02
270	600406	国电南瑞	2,700	47,655.00	0.02
271	600886	国投电力	6,000	47,400.00	0.02
272	000059	华锦股份	4,700	47,047.00	0.02
273	300525	博思软件	1,000	47,000.00	0.02
274	300204	舒泰神	3,000	46,770.00	0.02
275	601179	中国西电	8,300	46,148.00	0.02
276	000528	柳工	5,300	45,792.00	0.02
277	002221	东华能源	4,100	44,731.00	0.02
278	603167	渤海轮渡	4,100	44,567.00	0.02
279	000550	江铃汽车	2,100	43,470.00	0.02
280	000570	苏常柴A	6,200	43,400.00	0.02
281	300160	秀强股份	4,700	42,159.00	0.02
282	300233	金城医药	2,000	41,980.00	0.02
283	000936	华西股份	5,900	41,418.00	0.02
284	000890	法尔胜	5,000	40,700.00	0.02
285	000568	泸州老窖	800	40,464.00	0.02
286	300068	南都电源	2,400	40,416.00	0.02
287	600622	嘉宝集团	2,470	40,211.60	0.02
288	000823	超声电子	2,700	38,934.00	0.02
289	002322	理工环科	1,600	38,336.00	0.02
290	002262	恩华药业	2,500	37,825.00	0.01
291	000930	中粮生化	3,500	37,730.00	0.01
292	600584	长电科技	2,300	36,915.00	0.01

293	300266	兴源环境	1,200	36,864.00	0.01
294	000756	新华制药	2,400	36,432.00	0.01
295	600885	宏发股份	900	35,901.00	0.01
296	002599	盛通股份	2,400	35,256.00	0.01
297	600267	海正药业	3,000	35,040.00	0.01
298	600170	上海建工	8,800	33,616.00	0.01
299	002568	百润股份	2,000	33,240.00	0.01
300	002673	西部证券	2,300	32,706.00	0.01
301	300342	天银机电	2,100	32,046.00	0.01
302	002245	澳洋顺昌	3,500	31,570.00	0.01
303	300408	三环集团	1,500	31,485.00	0.01
304	000926	福星股份	2,500	30,500.00	0.01
305	600566	济川药业	800	30,424.00	0.01
306	002534	杭锅股份	3,200	30,272.00	0.01
307	000860	顺鑫农业	1,500	30,015.00	0.01
308	300097	智云股份	1,100	29,700.00	0.01
309	000639	西王食品	1,500	29,685.00	0.01
310	000546	金圆股份	2,700	29,430.00	0.01
311	601018	宁波港	5,200	29,380.00	0.01
312	300026	红日药业	6,200	29,202.00	0.01
313	000541	佛山照明	3,200	29,152.00	0.01
314	000729	燕京啤酒	4,300	28,896.00	0.01
315	002146	荣盛发展	2,900	28,623.00	0.01
316	002117	东港股份	1,100	28,468.00	0.01
317	002335	科华恒盛	800	28,352.00	0.01
318	002603	以岭药业	1,600	27,936.00	0.01
319	300202	聚龙股份	1,600	26,432.00	0.01
320	300179	四方达	4,000	26,160.00	0.01
321	601669	中国电建	3,200	25,344.00	0.01
322	002195	二三四五	3,500	25,025.00	0.01
323	002222	福晶科技	1,700	24,259.00	0.01
324	002489	浙江永强	3,800	24,244.00	0.01
325	300473	德尔股份	500	23,800.00	0.01
326	300034	钢研高纳	1,500	23,715.00	0.01
327	600808	马钢股份	6,500	23,010.00	0.01
328	300031	宝通科技	1,200	22,068.00	0.01
329	300231	银信科技	1,600	21,120.00	0.01
330	300145	中金环境	1,200	20,304.00	0.01
331	002564	天沃科技	2,200	20,086.00	0.01

332	300197	铁汉生态	1,500	19,920.00	0.01
333	300187	永清环保	1,700	19,448.00	0.01
334	000597	东北制药	1,700	19,006.00	0.01
335	600461	洪城水业	2,600	18,746.00	0.01
336	000961	中南建设	2,800	18,256.00	0.01
337	601515	东风股份	1,600	18,080.00	0.01
338	002437	誉衡药业	2,400	17,472.00	0.01
339	601021	春秋航空	500	16,815.00	0.01
340	600089	特变电工	1,600	16,528.00	0.01
341	002400	省广股份	2,000	16,060.00	0.01
342	002375	亚厦股份	1,800	16,038.00	0.01
343	002462	嘉事堂	400	15,716.00	0.01
344	600236	桂冠电力	2,700	15,390.00	0.01
345	000799	酒鬼酒	800	14,704.00	0.01
346	002419	天虹股份	500	7,190.00	0.00
347	000620	新华联	1,000	7,110.00	0.00
348	002672	东江环保	400	6,756.00	0.00
349	000009	中国宝安	800	6,472.00	0.00
350	002440	闰土股份	400	6,104.00	0.00
351	600021	上海电力	500	6,045.00	0.00
352	000711	京蓝科技	400	6,024.00	0.00
353	002493	荣盛石化	600	5,856.00	0.00
354	002131	利欧股份	1,700	5,593.00	0.00
355	002217	合力泰	500	4,940.00	0.00
356	600183	生益科技	400	4,936.00	0.00
357	000402	金融街	400	4,688.00	0.00
358	000090	天健集团	400	4,440.00	0.00
359	601117	中国化学	600	4,194.00	0.00
360	300261	雅本化学	400	3,712.00	0.00
361	300337	银邦股份	400	3,548.00	0.00
362	601618	中国中冶	500	2,505.00	0.00
363	300404	博济医药	100	2,307.00	0.00
364	600521	华海药业	100	2,104.00	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	000001	平安银行	33,553,547.01	3.30
2	601328	交通银行	12,746,813.00	1.25
3	601398	工商银行	8,147,230.00	0.80
4	601169	北京银行	7,899,501.36	0.78
5	600036	招商银行	7,593,872.24	0.75
6	000089	深圳机场	5,461,690.00	0.54
7	002508	老板电器	5,341,581.73	0.52
8	601988	中国银行	5,280,949.00	0.52
9	000998	隆平高科	5,134,295.00	0.50
10	002202	金风科技	5,073,545.99	0.50
11	601318	中国平安	5,039,264.55	0.50
12	600873	梅花生物	4,853,438.00	0.48
13	600068	葛洲坝	4,810,400.00	0.47
14	601800	中国交建	4,506,511.29	0.44
15	601166	兴业银行	4,368,767.00	0.43
16	601288	农业银行	3,295,728.00	0.32
17	601818	光大银行	2,803,770.00	0.28
18	002304	洋河股份	2,763,680.97	0.27
19	600688	上海石化	2,733,395.00	0.27
20	000895	双汇发展	2,608,351.00	0.26

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	000001	平安银行	38,443,808.56	3.78
2	600674	川投能源	9,996,631.60	0.98
3	601328	交通银行	9,495,703.27	0.93
4	601398	工商银行	8,546,933.00	0.84
5	600900	长江电力	8,398,094.71	0.83

6	000895	双汇发展	7,484,082.14	0.74
7	601668	中国建筑	7,440,000.00	0.73
8	600068	葛洲坝	6,017,408.00	0.59
9	000998	隆平高科	5,447,577.85	0.54
10	000089	深圳机场	5,164,898.77	0.51
11	601169	北京银行	5,108,174.52	0.50
12	002508	老板电器	5,093,974.72	0.50
13	600873	梅花生物	4,865,556.00	0.48
14	000625	长安汽车	4,642,637.20	0.46
15	002202	金风科技	4,477,719.67	0.44
16	601800	中国交建	4,228,077.00	0.42
17	600036	招商银行	3,761,940.23	0.37
18	002717	岭南园林	3,756,455.00	0.37
19	002366	台海核电	3,437,731.40	0.34
20	601166	兴业银行	3,101,813.00	0.30

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	254,761,317.85
卖出股票收入（成交）总额	182,770,486.41

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	2,381,520.00	0.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,957,000.00	3.90
	其中：政策性金融债	9,957,000.00	3.90
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	12,338,520.00	4.83
----	----	---------------	------

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	170204	17 国开 04	100,000	9,957,000.00	3.90
2	020178	17 贴债 22	24,000	2,381,520.00	0.93

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1709	IF1709	-4	-4,356,960.00	-11,580.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-11,580.00
股指期货投资本期收益（元）					0.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-11,580.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，海通证券（600837）于 2017 年 5 月 23 日收到中国证监会行政处罚事先告知书，因违反了《证券公司融资融券业务管理办法》第十一条的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条 第（七）项“未按照规定与客户签订业务合同，或者未在与客户的业务合同中载入规定的必要条款”的情形。被中国证监会责令改正，给予警告，没收违法所得 509,653.15 元，并处罚款 2,548,265.75 元。

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	1,021,516.73
2	应收证券清算款	2,004,100.14
3	应收股利	-
4	应收利息	367,258.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,392,875.16

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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
213	1,136,431.85	242,036,983.25	99.99%	23,000.98	0.01%

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	119.63	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6月3日）基金份额总额	1,000,137,732.04
本报告期期初基金份额总额	1,000,030,866.93
本报告期基金总申购份额	242,087,823.12
减：本报告期基金总赎回份额	1,000,058,705.82
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	242,059,984.23

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金基金份额持有人大会于 2017 年 1 月 6 日表决通过了《关于建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金降低基金管理费率有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

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	
东兴证券	1	218,147,098.25	50.12%	198,757.94	49.57%	-

光大证券	2	155,127,712.94	35.64%	144,470.87	36.03%	-
招商证券	1	61,961,589.38	14.24%	57,705.08	14.39%	-
天源证券	1	-	-	-	-	-

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

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

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

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、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、本基金本报告期末新增或剔除交易单元，与同一托管行托管的基金共用原有交易单元。

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
东兴证券	15,248,969.32	98.80%	797,700,000.00	100.00%	-	-
光大证券	184,451.35	1.20%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-

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	关于建信鑫盛回报灵活配置混合	指定报刊和/或公司	2017年6月13日

	型证券投资基金基金经理变更的公告	网站	
2	关于建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2017 年 6 月 1 日
3	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 05 月 30 日	1,000,000,000.00	0.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00
	2	2017 年 05 月 26 日-2017 年 06 月 30 日	0.00	242,036,983.25	0.00	242,036,983.25	99.99
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。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鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信鑫盛回报灵活配置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