

建信优势动力混合型证券投资基金
(LOF)
2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信优势动力混合（LOF）
场内简称	建信优势
基金主代码	165313
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2013 年 3 月 19 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	289,838,487.13 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	2013 年 4 月 3 日

2.2 基金产品说明

投资目标	采取定量和定性相结合的方法，寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力、但是价值被低估的优势上市公司，通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产来获取超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人对经济环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析，作出投资决策。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数收益率+25%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	陆志俊
	联系电话	010-66228888	95559

	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95559
传真		010-66228001	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	34,156,495.63	-35,721,787.88	600,328,284.77
本期利润	26,616,562.68	-57,940,595.16	257,663,298.34
加权平均基金份额本期利润	0.0760	-0.1404	0.3992
本期基金份额净值增长率	4.80%	-8.76%	18.68%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.4398	0.3744	0.5057
期末基金资产净值	417,321,519.91	538,878,040.74	647,516,384.81
期末基金份额净值	1.440	1.374	1.506

1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

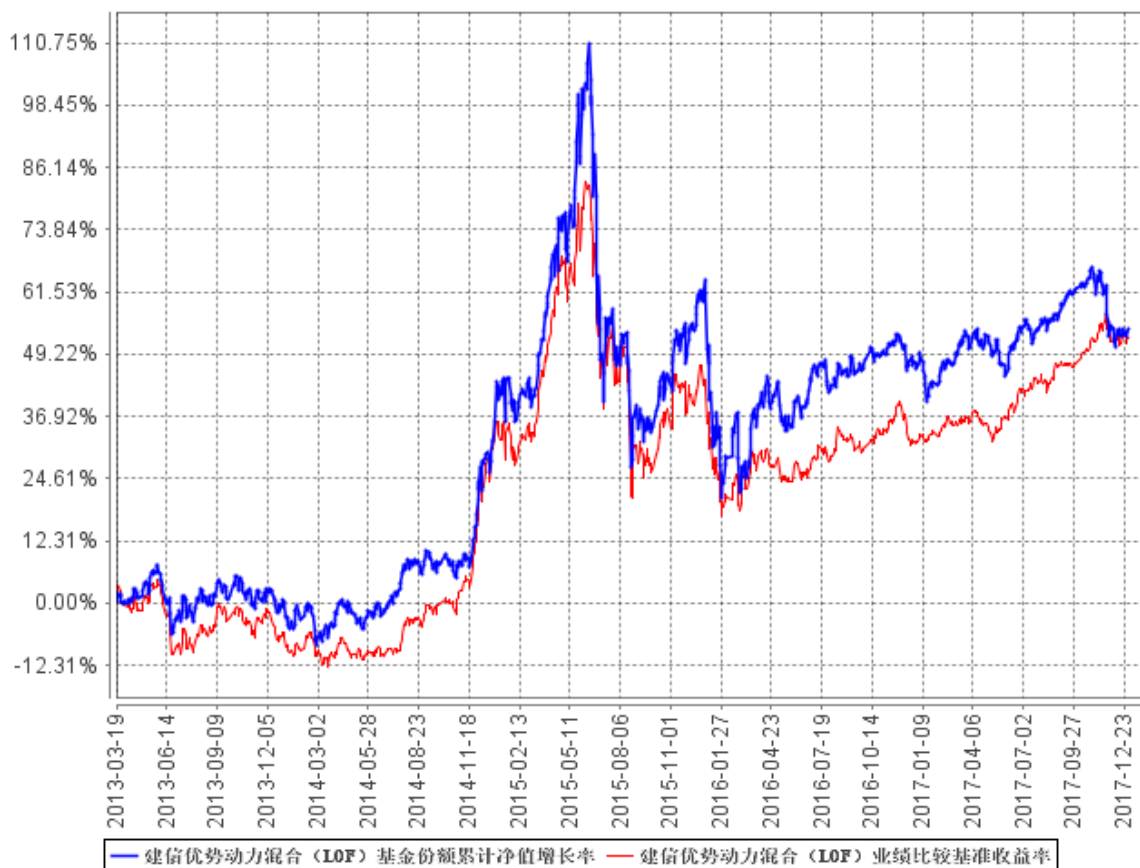
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.95%	0.81%	3.59%	0.60%	-8.54%	0.21%
过去六个月	-0.28%	0.67%	7.28%	0.52%	-7.56%	0.15%
过去一年	4.80%	0.66%	15.69%	0.48%	-10.89%	0.18%
过去三年	13.48%	1.52%	14.82%	1.26%	-1.34%	0.26%
自基金合同 生效起至今	54.18%	1.36%	52.59%	1.16%	1.59%	0.20%

本基金投资业绩比较基准为： $75\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+25\% \times$ 中国债券总指数收益率。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，中国债券总指数收益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交易所中选取 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。中债系列指数由一个总指数（即中国债券总指数），若干个分指数构成。中国债券总指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债券等），理论上能客观反映中国债券总体情况。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

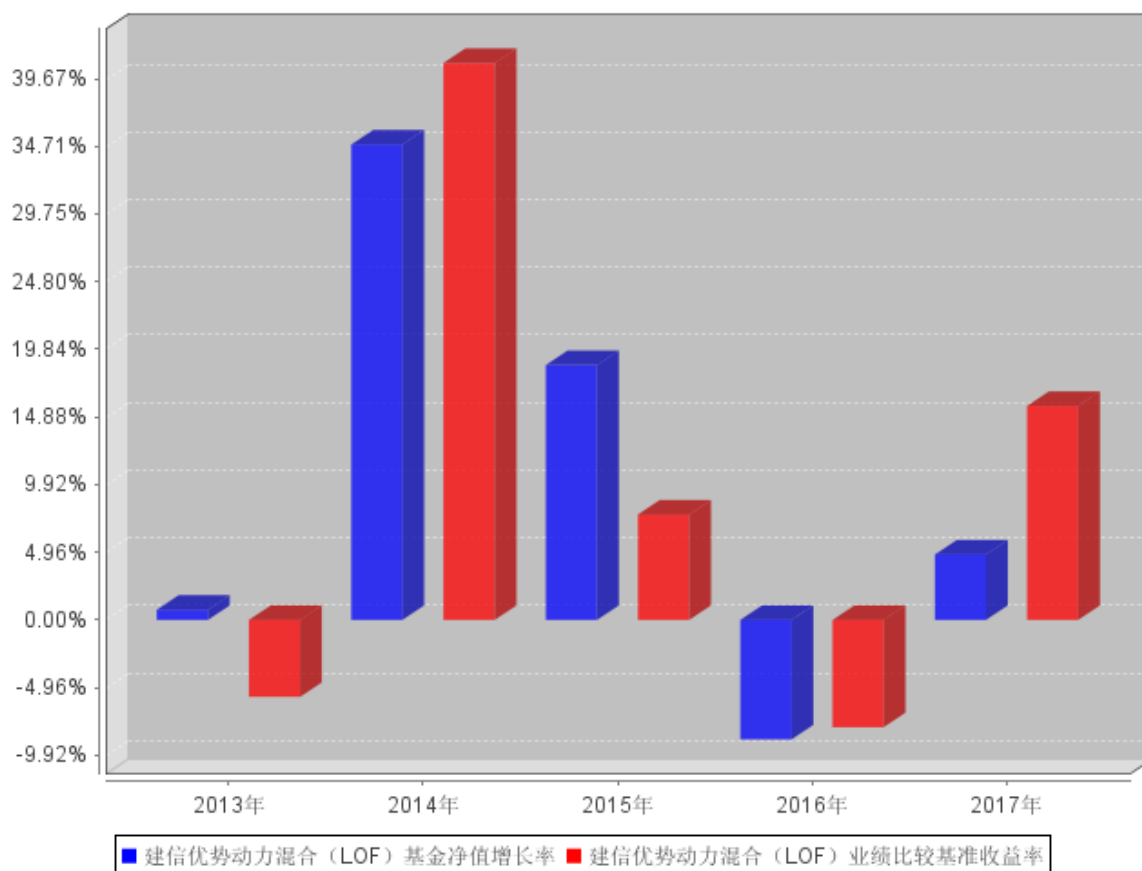
建信优势动力混合（LOF）基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

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

建信优势动力混合（LOF）自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



本基金于 2013 年 3 月 19 日由建信优势动力股票型证券投资基金转型而成，转型当年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配，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。

§ 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 12 月 31 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信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、建信鑫利灵活配置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、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金（LOF）基金、建信中证政策性金融债 3-5 年指数证券投资基金（LOF）基金、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金（LOF）基金、建信中证政策性金融债 5-8 年指数证券投资基金（LOF）基金、建信睿源纯债债券型证券投资基金、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金，共计 95 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 3,609.83 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		
姜锋	权益投资部执行投资官、本基金的基金经理	2013 年 3 月 19 日	-	10	硕士，权益投资部执行投资官。2007 年 7 月加入本公司，历任研究员、基金经理、资深基金经理、权益投资部执行投资官。2011 年 7 月 11 日起任建信优势动力股票型证券投资基金的基金经理，该基金于

					2013 年 3 月 19 日起转型为建信优势动力混合型证券投资基金（LOF），姜锋继续担任该基金的基金经理；2014 年 3 月 21 日起任建信健康民生混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 4 月 22 日起任建信环保产业股票型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

定。

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

当时间窗为 1 日时，配了 31458 对投资组合，有 6807 对投资组合未通过 T 检验，其中 3392 对投资组合的正溢价率占优频率小于 55%，其它 3415 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中，2509 对平均溢价率低于 2%，其它 906 对平均溢价率超过 2%的投资组合中，有 20 对投资组合的贡献率超过 5%，但因为其溢价金额占平均净值的比例较低，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为 3 日时，配了 34512 对投资组合，有 8794 对投资组合未通过 T 检验，其中 3914 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 4880 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中，4523 对平均溢价率低于 5%，其它 357 对平均溢价率超过 5%的投资组合，有 5 对投资组合贡献率超过 5%，但因为其溢价金额占平均净值的比例较低，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为 5 日时，配了 35964 对投资组合，有 10419 对投资组合未通过 T 检验，其中 4515 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 5904 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中，5809 对平均溢价率低于 10%，其它 95 对平均溢价率超过 10%的投资组合，有 3 对投资组合贡献率超过 5%，但因为其溢价金额占平均净值的比例较低，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 3 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年股票市场呈现结构化上涨行情，主要的蓝筹指数均取得较好的涨幅，创业板指数全年呈现下跌走势；就行业而言，白酒、保险和家电涨幅领先，军工、传媒和纺织服装领跌。

经济和政策方面，国际经济在欧美持续复苏的背景下稳步上行，全球经济持续回暖。得益于供给侧结构性改革的推进，国内煤炭和钢铁行业过剩的落后产能得到大规模的出清，产品价格持续上涨，行业的盈利水平稳步改善；由于美国的加息周期和国内的金融去杠杆，各期限利率水平呈现稳步上行态势，受益于利率回升和金融行业的整合，国有大型银行和上市保险公司也取得优秀的经营业绩；国内经济的持续复苏带动了消费总需求，以白酒和家电为代表的消费品企业呈现量价齐升的态势，相关上市公司的业绩均大幅增长。上述行业优秀的经营业绩得到了国内外投资者的一致认可，相关行业的龙头公司取得了巨大的涨幅。

本基金全年下来错误的评估了经济形势和市场风格，取得了较为一般的收益水平。具体来看，上半年组合配置了一定比例的消费龙头和消费电子，组合取得了不错的收益，中间配置航空和火电未能取得好的效果；下半年配置新能源车、消费和银行板块取得一定的收益但过早的减持消费龙头股，十一月份市场大幅波动时的错误调整也给组合带来较大的回撤。

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 4.8%，波动率 0.66%，业绩比较基准收益率 15.69%，波动率 0.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，美国经济预计仍将保持强劲态势，2018 年美联储大概率会加快加息的进程，其对全球资金的流向将产生深刻的影响，特朗普政府的贸易政策也将对全球贸易格局产生影响。受这两方面因素的影响，国内经济在 2018 年预计将出现一定程度的波动。

在此经济背景下，国内资本市场预计将从过去两年低波动单一风格模式向高波动多元风格模式漂移，市场全年可能呈现宽幅振荡走势。本基金 2018 年在控制系统性风险前提下将采取相对均衡的配置策略，积极寻找业绩增速与估值相匹配的优质公司投资。

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[2017]13 号文《中国证监会关于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。

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、风险管理部和资产核算部门负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负

责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，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。

本公司根据《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》，与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）；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），本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣，对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2017 年度，托管人在建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017 年度，建信基金管理有限责任公司在建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发

现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017 年度，由建信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 审计了建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“建信优势动力混合基金(LOF)”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。并出具了普华永道中天审字(2018)第 22672 号标准无保留意见。投资者可通过年度报告正文查看审计报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		10,616,574.03	1,443,681.31
结算备付金		144,348,238.29	178,233,404.00
存出保证金		228,841.05	457,914.91
交易性金融资产		270,219,496.08	349,795,066.66
其中：股票投资		270,219,496.08	349,795,066.66
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		112,200,000.00	-
应收证券清算款		-	17,433,379.52
应收利息		76,859.55	88,788.43
应收股利		-	-
应收申购款		3,944.85	839.28
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		537,693,953.85	547,453,074.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		112,200,000.00	-
应付赎回款		353,870.27	201,211.80
应付管理人报酬		443,470.38	581,016.81
应付托管费		3,419,145.25	2,164,387.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,858,759.80	4,623,604.56
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,097,188.24	1,004,812.78
负债合计		120,372,433.94	8,575,033.37
所有者权益:			
实收基金		289,838,487.13	392,092,263.31
未分配利润		127,483,032.78	146,785,777.43
所有者权益合计		417,321,519.91	538,878,040.74
负债和所有者权益总计		537,693,953.85	547,453,074.11

报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.440 元，基金份额总额 289,838,487.13 份。

7.2 利润表

会计主体：建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日
一、收入		38,782,579.69	-43,032,957.64
1. 利息收入		2,195,123.42	2,436,407.71
其中：存款利息收入		2,195,123.42	2,427,020.33
债券利息收入		-	9,387.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		44,094,619.15	-23,278,763.25
其中：股票投资收益		38,811,827.11	-25,303,891.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	627,018.32
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		5,282,792.04	1,398,109.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-7,539,932.95	-22,218,807.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		32,770.07	28,205.18
减：二、费用		12,166,017.01	14,907,637.52
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	6,273,788.98	6,841,064.89
2. 托管费	7.4.8.2.2	1,254,757.83	1,368,212.83
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		4,195,319.67	6,247,817.63
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		442,150.53	450,542.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,616,562.68	-57,940,595.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,616,562.68	-57,940,595.16

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	392,092,263.31	146,785,777.43	538,878,040.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	26,616,562.68	26,616,562.68
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）	-102,253,776.18	-45,919,307.33	-148,173,083.51
其中：1. 基金申购款	2,660,190.99	1,129,046.54	3,789,237.53
2. 基金赎回款	-104,913,967.17	-47,048,353.87	-151,962,321.04
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）	289,838,487.13	127,483,032.78	417,321,519.91
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	430,030,673.60	217,485,711.21	647,516,384.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-57,940,595.16	-57,940,595.16
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）	-37,938,410.29	-12,759,338.62	-50,697,748.91
其中：1. 基金申购款	18,045,624.61	6,644,391.35	24,690,015.96
2. 基金赎回款	-55,984,034.90	-19,403,729.97	-75,387,764.87
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）	392,092,263.31	146,785,777.43	538,878,040.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 孙志晨 _____	_____ 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)(原名为建信优势动力股票型证券投资基金(LOF),以下简称“本基金”)是根据原建信优势动力股票型证券投资基金(以下简称“建信优势动力基金”)基金份额持有人大会 2013 年 1 月 28 日决议通过的《关于建信优势动力股票型证券投资基金转型有关事项的议案》,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]204 号《关于核准建信优势动力股票型证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》核准,由原建信优势动力基金转型而来。原建信优势动力基金为契约型封闭式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期限为 5 年期,至 2013 年 3 月 18 日止。根据深交所深证上[2013]82 号《终止上市通知书》,原建信优势动力基金于 2013 年 3 月 15 日终止上市权利登记,于 2013 年 3 月 18 日终止上市。自 2013 年 3 月 19 日(基金合同生效日)起,原建信优势动力基金转型为上市契约型开放式基金,更名为建信优势动力股票型证券投资基金(LOF),原《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》失效,《建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

建信优势动力基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 4,336,702,117.48 元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值,并于 2013 年 3 月 19 日完成了变更登记。

经深交所深证上[2013]106 号审核同意,建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)2,348,989,482.00 份基金份额于 2013 年 4 月 3 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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,建信优势动

力股票型证券投资基金(LOF)于2015年8月8日公告后更名为建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票投资占基金资产净值的比例为60%-95%,权证占基金资产净值的比例不超过3%,现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。本基金投资业绩比较基准为75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于2018年3月21日批准报出。

7.4.2 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》、《建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司(“建信基金”)	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,273,788.98	6,841,064.89
其中：支付销售机构的客户维护费	359,312.64	390,213.86

支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.25% / 当年天数。

7.4.8.2.2 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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付	1,254,757.83	1,368,212.83

的托管费		
------	--	--

支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2013 年 3 月 19 日）持有的基金份额	10,003,950.00	10,003,950.00
期初持有的基金份额	3,591,235.63	3,591,235.63
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	3,591,235.63	3,591,235.63
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.24%	0.92%

7.4.8.4.2 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

无。

7.4.8.5 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 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	10,616,574.03	166,317.25	1,443,681.31	159,962.68

本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	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
600146	商赢环球	2017年9月5日	重大资产重组	22.06	2018年1月16日	22.88	732,500	17,466,318.00	16,158,950.00	-
601600	中国铝业	2017年9月12日	重大资产重组	6.66	2018年2月26日	7.28	1,309,800	9,589,780.00	8,723,268.00	-

本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 245,337,278.08 元，属于第二层次的余额为 24,882,218.00 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 344,200,666.66 元，第二层次 5,594,400.00 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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)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，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。

根据财政部、国家税务总局于 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金 2017 年 12 月 31 日财务状况和 2017 年度经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	270,219,496.08	50.26
	其中：股票	270,219,496.08	50.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	112,200,000.00	20.87
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	154,964,812.32	28.82
8	其他各项资产	309,645.45	0.06
9	合计	537,693,953.85	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	158,971,457.31	38.09
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,370,208.00	2.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	53,836,436.00	12.90
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	49,041,394.77	11.75
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	270,219,496.08	64.75

以上行业分类以 2017 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600887	伊利股份	900,000	28,971,000.00	6.94
2	601818	光大银行	6,147,500	24,897,375.00	5.97
3	002127	南极电商	1,800,289	21,945,522.91	5.26

4	300398	飞凯材料	912,900	19,307,835.00	4.63
5	600146	商赢环球	732,500	16,158,950.00	3.87
6	002322	理工环科	799,362	15,012,018.36	3.60
7	002027	分众传媒	1,000,000	14,080,000.00	3.37
8	601888	中国国旅	299,974	13,015,871.86	3.12
9	601222	林洋能源	1,227,300	12,444,822.00	2.98
10	601601	中国太保	295,900	12,256,178.00	2.94

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600795	国电电力	69,974,488.00	12.99
2	601988	中国银行	61,837,242.75	11.48
3	601398	工商银行	39,708,733.47	7.37
4	002050	三花智控	32,961,028.64	6.12
5	600029	南方航空	31,843,976.00	5.91
6	000858	五粮液	30,457,839.88	5.65
7	600887	伊利股份	29,334,741.46	5.44
8	601288	农业银行	28,953,350.00	5.37
9	600409	三友化工	26,374,497.50	4.89
10	601818	光大银行	25,611,130.00	4.75
11	300426	唐德影视	25,244,580.00	4.68
12	600872	中炬高新	24,768,274.00	4.60
13	600050	中国联通	24,527,194.00	4.55
14	601088	中国神华	22,848,911.38	4.24
15	000933	神火股份	22,607,714.20	4.20
16	300083	劲胜智能	22,420,550.60	4.16
17	002127	南极电商	22,413,476.27	4.16
18	601058	赛轮金宇	21,951,925.02	4.07
19	601231	环旭电子	19,387,902.32	3.60
20	000002	万科 A	19,355,928.10	3.59
21	601888	中国国旅	19,293,507.01	3.58

22	300398	飞凯材料	19,267,067.50	3.58
23	600373	中文传媒	19,263,640.32	3.57
24	600584	长电科技	18,650,350.04	3.46
25	300567	精测电子	17,972,208.00	3.34
26	000683	远兴能源	16,172,265.20	3.00
27	000998	隆平高科	16,107,993.00	2.99
28	002068	黑猫股份	15,777,455.51	2.93
29	002027	分众传媒	15,546,180.00	2.88
30	603808	歌力思	15,043,849.88	2.79
31	000639	西王食品	14,476,329.00	2.69
32	601318	中国平安	14,441,965.00	2.68
33	002479	富春环保	14,017,629.97	2.60
34	601222	林洋能源	13,966,446.17	2.59
35	002440	闰土股份	13,605,477.83	2.52
36	601588	北辰实业	12,597,366.43	2.34
37	601601	中国太保	12,365,183.91	2.29
38	300196	长海股份	12,329,044.10	2.29
39	600282	南钢股份	12,288,448.00	2.28
40	300081	恒信东方	12,200,167.06	2.26
41	600298	安琪酵母	12,165,217.45	2.26
42	600873	梅花生物	10,917,001.36	2.03
43	000963	华东医药	10,781,184.88	2.00

上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600795	国电电力	75,272,238.00	13.97
2	002050	三花智控	67,546,913.90	12.53
3	601988	中国银行	63,629,870.43	11.81
4	000858	五粮液	57,807,462.78	10.73
5	601398	工商银行	41,211,871.07	7.65
6	002640	跨境通	34,797,258.04	6.46
7	600029	南方航空	31,477,949.99	5.84
8	600298	安琪酵母	31,422,147.80	5.83
9	601288	农业银行	30,213,259.60	5.61

10	000651	格力电器	29,631,936.00	5.50
11	600409	三友化工	28,964,587.77	5.37
12	000998	隆平高科	28,592,304.31	5.31
13	300083	劲胜智能	27,825,228.52	5.16
14	300285	国瓷材料	26,759,128.20	4.97
15	000002	万科 A	25,197,288.70	4.68
16	601088	中国神华	24,349,595.85	4.52
17	600050	中国联通	23,011,674.00	4.27
18	600872	中炬高新	21,602,470.80	4.01
19	300567	精测电子	21,555,385.50	4.00
20	600963	岳阳林纸	20,381,602.40	3.78
21	000925	众合科技	19,942,474.60	3.70
22	601058	赛轮金宇	19,209,634.80	3.56
23	601231	环旭电子	19,169,317.58	3.56
24	300426	唐德影视	18,743,195.74	3.48
25	600373	中文传媒	18,232,321.70	3.38
26	300128	锦富技术	17,625,509.90	3.27
27	002068	黑猫股份	17,073,328.46	3.17
28	600584	长电科技	16,171,963.70	3.00
29	000683	远兴能源	15,218,364.00	2.82
30	601318	中国平安	14,191,112.00	2.63
31	300436	广生堂	13,961,562.00	2.59
32	002440	闰土股份	13,915,708.14	2.58
33	000959	首钢股份	13,607,480.00	2.53
34	002479	富春环保	13,255,216.00	2.46
35	601678	滨化股份	13,150,650.40	2.44
36	000963	华东医药	12,466,870.00	2.31
37	000639	西王食品	12,462,627.00	2.31
38	000830	鲁西化工	12,289,709.00	2.28
39	601588	北辰实业	12,165,311.44	2.26
40	603808	歌力思	11,658,507.15	2.16
41	601888	中国国旅	11,652,452.89	2.16
42	600282	南钢股份	11,533,432.00	2.14
43	002127	南极电商	10,996,036.20	2.04
44	600068	葛洲坝	10,993,861.00	2.04
45	600873	梅花生物	10,888,079.00	2.02

上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,316,257,267.74
卖出股票收入（成交）总额	1,427,104,732.48

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未投资于国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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

8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	228,841.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	76,859.55
5	应收申购款	3,944.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	309,645.45

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600146	商赢环球	16,158,950.00	3.87	重大资产重组

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
15,441	18,770.71	10,647,374.68	3.67%	279,191,112.45	96.33%

9.2 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	上海西上海投资发展有限公 司	1,985,111.00	3.16%
2	张瑞平	1,380,772.00	2.20%
3	肖正巧	994,001.00	1.58%
4	淄博市自来水公司节水技术 开发部	990,514.00	1.58%
5	邓福灵	948,000.00	1.51%
6	李雪梅	877,800.00	1.40%
7	李志军	692,361.00	1.10%
8	邓彬	600,336.00	0.96%
9	徐满花	533,752.00	0.85%
10	赵玉林	500,340.00	0.80%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末本公司从业人员未持有本基金。

9.4 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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、该只基金的基金经理未持有该只基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年3月19日）基金份额总额	4,642,655,005.00
本报告期期初基金份额总额	392,092,263.31
本报告期基金总申购份额	2,660,190.99
减:本报告期基金总赎回份额	104,913,967.17
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	289,838,487.13

总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	3	655,827,356.86	23.91%	601,673.82	23.83%	-
华创证券	1	457,807,612.43	16.69%	426,355.92	16.89%	-
天风证券	1	428,609,815.98	15.62%	390,591.28	15.47%	-
华泰证券	4	267,420,024.49	9.75%	243,696.84	9.65%	-
国金证券	1	258,170,069.36	9.41%	240,434.58	9.52%	-
太平洋证券	1	223,497,237.10	8.15%	208,142.63	8.24%	-
瑞银证券	1	128,085,376.82	4.67%	116,723.20	4.62%	-
安信证券	2	116,663,260.16	4.25%	106,318.34	4.21%	-
东方证券	1	100,563,391.16	3.67%	93,654.68	3.71%	-
长江证券	1	65,505,984.79	2.39%	59,694.37	2.36%	-
中投证券	3	41,211,871.07	1.50%	37,556.58	1.49%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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

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

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

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

（4）佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内新增一个太平洋证券交易单元，剔除一个长江证券交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	112,200,000.00	100.00%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司
2018年3月28日