

建信深证 100 指数增强型证券投资基金 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	建信深证 100 指数增强
基金主代码	530018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 3 月 16 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	52,617,385.86 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对深证 100 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以深证 100 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，在控制与比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	95%×深证 100 价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	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	15,208,239.93	-3,956,641.51	73,166,460.12
本期利润	26,365,977.71	-10,302,602.95	48,065,669.49
加权平均基金份额本期利润	0.4345	-0.1936	0.6047
本期基金份额净值增长率	30.79%	-13.40%	30.15%
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	0.7918	0.3700	0.5819
期末基金资产净值	94,282,428.22	71,258,568.13	80,158,818.71
期末基金份额净值	1.7918	1.3700	1.5819

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

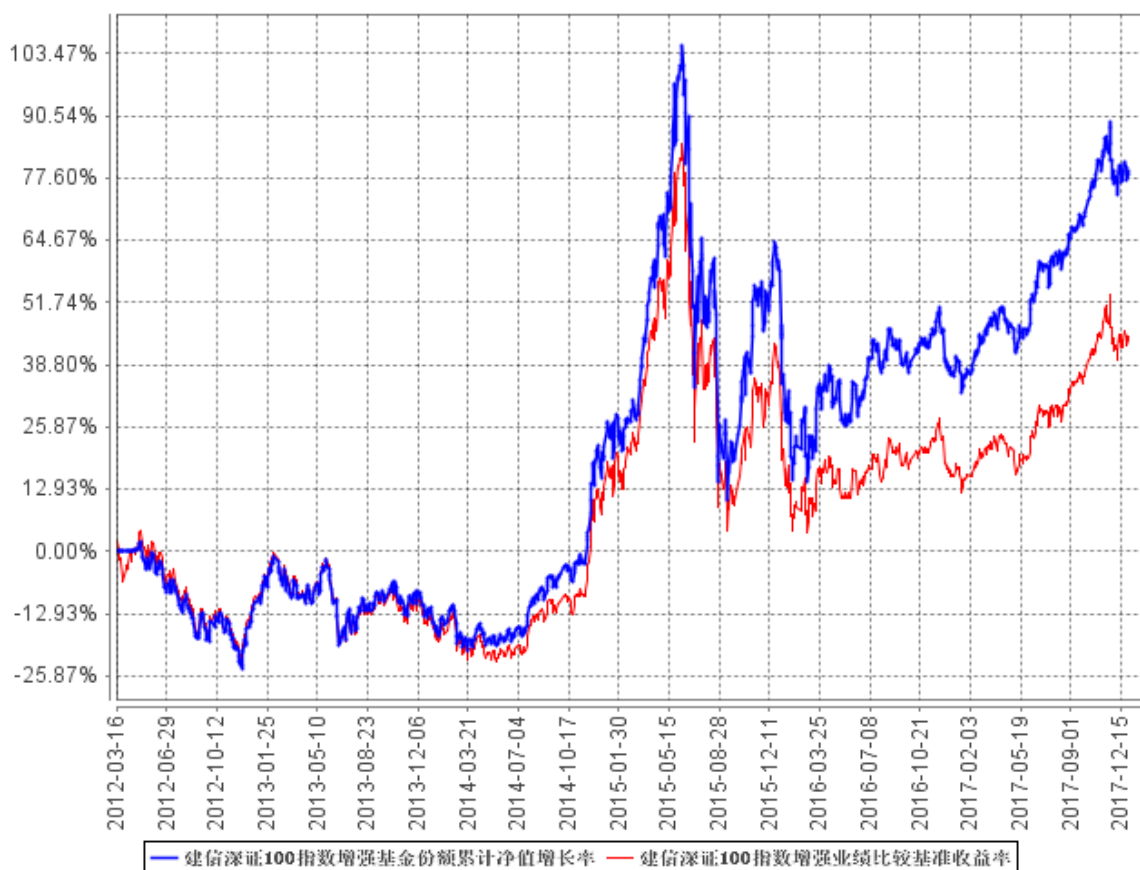
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.28%	1.05%	5.58%	1.09%	-0.30%	-0.04%
过去六个月	12.01%	0.89%	11.45%	0.93%	0.56%	-0.04%
过去一年	30.79%	0.84%	25.02%	0.86%	5.77%	-0.02%
过去三年	47.42%	1.93%	27.73%	1.75%	19.69%	0.18%
过去五年	99.75%	1.68%	59.24%	1.57%	40.51%	0.11%
自基金合同 生效起至今	79.18%	1.62%	44.63%	1.54%	34.55%	0.08%

本基金业绩比较基准为 $95\% \times \text{深证 100 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率 (税后)}$ 。

深证 100 指数是中国证券市场第一只定位投资功能和代表多层次市场体系的指数。由深圳证券交易所委托深圳证券信息公司编制维护，此指数包含了深圳市场 A 股流通市值最大、成交最活跃的 100 只成份股。商业银行活期存款利率作为衡量本基金现金或到期日在一年以内的政府债券部分的业绩基准。

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

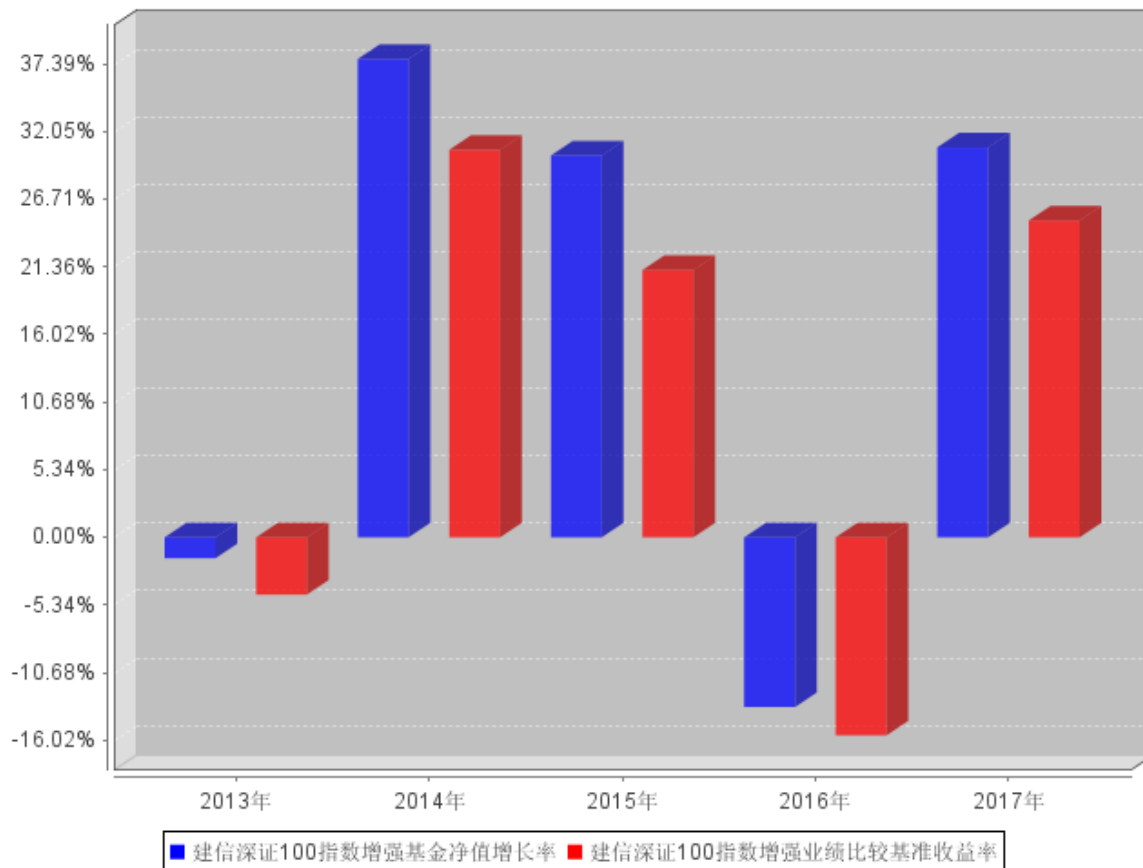
建信深证100指数增强基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.2.3 过去五年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

建信深证100指数增强过去五年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



本基金合同自 2012 年 3 月 16 日生效，2012 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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理、本基金的基金经理	2012 年 3 月 16 日	-	15	梁洪昀先生, 金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师 (CFA), 博士。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

				<p>设计师、机构理财部高级经理。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、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009 年 11 月 5 日起任建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理；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（ETF）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的基金经理；2015 年 3 月 25 日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理；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的基金经理；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的基金经理；2018 年 2 月 6 日起任建信创业板交易型开放式指数证券投</p>
--	--	--	--	--

					资基金的基金经理； 2018 年 2 月 7 日起任 建信鑫泽回报灵活配 置混合型证券投资基金 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。

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

分析结果如下：

当时间窗为 1 日时，配了 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

本基金管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型进行指数增强和风险管理，并适当辅以其他策略，以进一步提高收益。在报告期内，市场波动率比之前几年明显下降，基金跟踪误差亦有下降。基金超额收益在报告期前 10 个月内平稳累积，之后小幅回撤后走平，总体上看，实现了在控制跟踪误差基础上取得明显超额收益的目标。

在报告期中期末，本基金管理人积极应对即将到来的成份股调整，在控制跟踪误差的基础上保持了超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 30.79%，波动率 0.84%，业绩比较基准收益率 25.02%，波动率 0.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年，预计宏观经济将继续保持平稳，各项政策有序推进。股票市场在经历了 2017 年大小市值的剧烈分化后，预计会逐渐变得更为均衡，市场的波动性也会有所上升。

本基金管理人将根据基金合同，继续坚持量化分析研究，进一步改进指数增强策略，适应市场最新发展变化，力争持续获取稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内未实施利润分配，符合法律法规和基金合同中关于利润分配的相关规定。

§ 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，托管人在建信深证 100 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017 年度，建信基金管理有限责任公司在建信深证 100 指数增强型证券投资基金的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。个别工作日，托管人发现本基金个别监督指标因市场波动等原因出现被动超过基金合同限制的情况，托管人及时通知了基金管理人，基金管理人及时进行了调整，不存在违反法律法规及合同约定的情形。

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深证 100 指数增强型证券投资基金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) 审计了建信深证 100 指数增强型证券投资基金(以下简称“建信深证 100 指数增强基金”)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 22716 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：建信深证 100 指数增强型证券投资基金

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		4,358,157.21	1,318,278.15
结算备付金		4,584,586.35	5,878,783.07
存出保证金		11,660.59	11,469.68
交易性金融资产		88,898,228.89	66,454,750.95
其中：股票投资		88,898,228.89	66,454,750.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	253,550.03
应收利息		4,020.96	3,164.29
应收股利		-	-
应收申购款		154,035.42	21,098.31
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		98,010,689.42	73,941,094.48
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		504.00	451,375.76
应付赎回款		1,772,750.86	77,183.36
应付管理人报酬		96,659.40	62,054.32

应付托管费		417,605.27	225,187.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		849,247.26	1,397,242.66
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		591,494.41	469,483.18
负债合计		3,728,261.20	2,682,526.35
所有者权益：			
实收基金		52,617,385.86	52,013,062.39
未分配利润		41,665,042.36	19,245,505.74
所有者权益合计		94,282,428.22	71,258,568.13
负债和所有者权益总计		98,010,689.42	73,941,094.48

报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7918 元，基金份额总额 52,617,385.86 份。

7.2 利润表

会计主体：建信深证 100 指数增强型证券投资基金

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		29,328,336.64	-7,755,943.76
1.利息收入		116,468.12	78,907.82
其中：存款利息收入		114,707.54	78,907.82
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,760.58	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,969,631.64	-1,523,361.71
其中：股票投资收益		16,650,736.76	-2,467,759.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
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		1,318,894.88	944,398.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		11,157,737.78	-6,345,961.44

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		84,499.10	34,471.57
减：二、费用		2,962,358.93	2,546,659.19
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	962,090.70	723,847.76
2. 托管费	7.4.8.2.2	192,418.20	144,769.47
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		1,226,464.40	1,097,953.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		581,385.63	580,088.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,365,977.71	-10,302,602.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,365,977.71	-10,302,602.95

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信深证 100 指数增强型证券投资基金

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）	52,013,062.39	19,245,505.74	71,258,568.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	26,365,977.71	26,365,977.71
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）	604,323.47	-3,946,441.09	-3,342,117.62
其中：1. 基金申购款	51,541,235.21	29,903,815.92	81,445,051.13
2. 基金赎回款	-50,936,911.74	-33,850,257.01	-84,787,168.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-	-

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	52,617,385.86	41,665,042.36	94,282,428.22
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）	50,673,936.70	29,484,882.01	80,158,818.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-10,302,602.95	-10,302,602.95
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）	1,339,125.69	63,226.68	1,402,352.37
其中：1. 基金申购款	26,870,465.52	9,738,435.74	36,608,901.26
2. 基金赎回款	-25,531,339.83	-9,675,209.06	-35,206,548.89
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）	52,013,062.39	19,245,505.74	71,258,568.13

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

基金管理人负责人

吴曙明

主管会计工作负责人

丁颖

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信深证 100 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]2130 号《关于核准建信深证 100 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,747,241,015.70 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(2012)第 058 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,747,440,444.36 份基金份额,其中认购资金利息折合 199,428.66 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。股票资产占基金资产的比例不低于 90%,其中,投资于深证 100 指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%。现金或到期一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为 95% X 深证 100 价格指数收益率+5% X 商业银行活期存款利率(税后)。

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》、《建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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政策变更。

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

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	962,090.70	723,847.76
其中：支付销售机构的客户维护费	369,988.42	326,682.37

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 1.00% 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 1.00% / 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的托管费	192,418.20	144,769.47

支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

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

无。

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	4,358,157.21	25,667.93	1,318,278.15	30,502.57

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

金额单位：人民币元

7.4.9.1-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
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新发未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新发未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-

1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	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
002739	万达电影	2017 年 7 月	重大事项	45.92	-	-	38,600	2,007,206.00	1,772,512.00	-

		4 日								
600309	万华化学	2017 年 12 月 6 日	重大资产重组	37.94	-	-	13,900	551,996.00	527,366.00	-
300116	坚瑞沃能	2017 年 12 月 18 日	重大资产重组	7.62	-	-	37,100	325,344.00	282,702.00	-
600525	长园集团	2017 年 12 月 25 日	重大事项	15.79	-	-	2,400	37,560.00	37,896.00	-
300730	科创信息	2017 年 12 月 25 日	重大事项	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	重大事项	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

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 86,166,141.14 元，属于第二层次的余额为 2,732,087.75 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 64,536,326.49 元，第二层次 1,918,424.46 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、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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	88,898,228.89	90.70
	其中：股票	88,898,228.89	90.70
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	-	-
	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	8,942,743.56	9.12
8	其他各项资产	169,716.97	0.17
9	合计	98,010,689.42	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,656,939.20	1.76
B	采矿业	-	-
C	制造业	44,735,628.60	47.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	1,331,220.00	1.41
F	批发和零售业	1,924,933.00	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	700,004.00	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,125,955.00	2.25
J	金融业	9,084,153.30	9.64
K	房地产业	3,489,901.52	3.70
L	租赁和商务服务业	740,608.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,326,874.44	1.41
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	1,772,512.00	1.88
S	综合	-	-
	合计	68,888,729.06	73.07

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 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	231,234.39	0.25
B	采矿业	335,624.00	0.36
C	制造业	11,980,413.85	12.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	231,660.00	0.25
E	建筑业	1,119,470.04	1.19
F	批发和零售业	1,105,748.00	1.17
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	2,032,178.55	2.16
J	金融业	867,908.00	0.92

K	房地产业	1,756,775.80	1.86
L	租赁和商务服务业	105,264.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.03
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	210,900.00	0.22
	合计	20,009,499.83	21.22

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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

8.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	158,654	6,933,179.80	7.35
2	000333	美的集团	91,787	5,087,753.41	5.40
3	000725	京东方 A	678,700	3,929,673.00	4.17
4	000858	五粮液	41,993	3,354,400.84	3.56
5	002415	海康威视	83,503	3,256,617.00	3.45
6	000776	广发证券	182,270	3,040,263.60	3.22
7	000001	平安银行	186,620	2,482,046.00	2.63
8	000002	万科 A	78,992	2,453,491.52	2.60
9	002304	洋河股份	19,100	2,196,500.00	2.33
10	002739	万达电影	38,600	1,772,512.00	1.88

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。

8.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000090	天健集团	111,501	1,119,470.04	1.19

2	002572	索菲亚	27,100	997,280.00	1.06
3	002146	荣盛发展	97,500	929,175.00	0.99
4	300184	力源信息	75,200	852,768.00	0.90
5	000050	深天马 A	36,500	719,415.00	0.76

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	000858	五粮液	5,762,084.37	8.09
2	002736	国信证券	5,590,600.28	7.85
3	000651	格力电器	5,511,350.00	7.73
4	002304	洋河股份	5,428,914.62	7.62
5	002065	东华软件	4,886,361.24	6.86
6	000001	平安银行	4,639,173.00	6.51
7	000060	中金岭南	4,617,498.00	6.48
8	300498	温氏股份	4,575,864.66	6.42
9	000338	潍柴动力	4,459,306.01	6.26
10	000783	长江证券	4,413,246.00	6.19
11	000725	京东方 A	4,172,874.00	5.86
12	000063	中兴通讯	4,143,985.68	5.82
13	000895	双汇发展	4,120,924.00	5.78
14	002466	天齐锂业	4,112,165.70	5.77
15	300136	信维通信	4,014,600.44	5.63
16	001979	招商蛇口	3,881,485.70	5.45
17	002500	山西证券	3,837,916.00	5.39
18	000776	广发证券	3,688,393.86	5.18
19	002142	宁波银行	3,671,467.79	5.15
20	000002	万科 A	3,657,971.00	5.13
21	002007	华兰生物	3,584,125.19	5.03
22	000686	东北证券	3,508,571.31	4.92
23	002415	海康威视	3,461,386.00	4.86
24	000069	华侨城 A	3,428,754.00	4.81

25	002024	苏宁易购	3,417,681.00	4.80
26	002092	中泰化学	3,413,472.00	4.79
27	002310	东方园林	3,378,114.97	4.74
28	000423	东阿阿胶	3,315,111.00	4.65
29	002230	科大讯飞	3,300,887.00	4.63
30	000333	美的集团	3,241,127.00	4.55
31	000046	泛海控股	3,152,573.00	4.42
32	000630	铜陵有色	3,138,799.00	4.40
33	000963	华东医药	3,135,402.16	4.40
34	000528	柳工	3,089,221.00	4.34
35	000540	中天金融	2,971,256.00	4.17
36	000538	云南白药	2,940,345.40	4.13
37	000425	徐工机械	2,912,661.00	4.09
38	000568	泸州老窖	2,846,116.00	3.99
39	002739	万达电影	2,829,138.00	3.97
40	300464	星徽精密	2,819,835.64	3.96
41	300070	碧水源	2,767,370.14	3.88
42	002460	赣锋锂业	2,725,839.00	3.83
43	300072	三聚环保	2,550,386.65	3.58
44	002456	欧菲科技	2,511,162.00	3.52
45	000625	长安汽车	2,441,814.00	3.43
46	002601	龙蟠佰利	2,420,785.00	3.40
47	002027	分众传媒	2,417,912.20	3.39
48	300408	三环集团	2,412,656.00	3.39
49	601238	广汽集团	2,375,000.00	3.33
50	002475	立讯精密	2,198,880.00	3.09
51	300253	卫宁健康	2,173,199.21	3.05
52	002202	金风科技	2,149,603.00	3.02
53	600415	小商品城	2,068,667.00	2.90
54	000830	鲁西化工	2,051,778.37	2.88
55	300184	力源信息	2,037,345.00	2.86
56	002434	万里扬	2,035,946.23	2.86
57	300418	昆仑万维	2,018,673.04	2.83
58	000166	申万宏源	1,992,615.00	2.80
59	002365	永安药业	1,967,392.30	2.76
60	000415	渤海金控	1,963,999.00	2.76

61	002241	歌尔股份	1,942,024.00	2.73
62	000402	金融街	1,941,154.00	2.72
63	000709	河钢股份	1,908,605.00	2.68
64	002236	大华股份	1,898,077.00	2.66
65	002352	顺丰控股	1,898,035.00	2.66
66	601988	中国银行	1,877,548.00	2.63
67	002008	大族激光	1,838,592.00	2.58
68	002558	巨人网络	1,818,310.76	2.55
69	002146	荣盛发展	1,755,730.00	2.46
70	000617	中油资本	1,752,663.00	2.46
71	000517	荣安地产	1,745,257.41	2.45
72	600031	三一重工	1,742,775.00	2.45
73	002405	四维图新	1,674,773.00	2.35
74	600160	巨化股份	1,673,904.00	2.35
75	002064	华峰氨纶	1,636,932.00	2.30
76	000997	新大陆	1,562,340.00	2.19
77	002589	瑞康医药	1,558,137.00	2.19
78	300179	四方达	1,557,192.43	2.19
79	000839	中信国安	1,557,080.00	2.19
80	300083	劲胜智能	1,551,430.00	2.18
81	300251	光线传媒	1,538,084.00	2.16
82	300400	劲拓股份	1,532,658.50	2.15
83	002450	康得新	1,514,480.00	2.13
84	002340	格林美	1,494,001.00	2.10
85	600633	浙数文化	1,493,432.00	2.10
86	000090	天健集团	1,467,525.00	2.06
87	000728	国元证券	1,451,669.00	2.04
88	000639	西王食品	1,429,637.00	2.01
89	002252	上海莱士	1,427,047.00	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	000858	五粮液	6,199,228.00	8.70

2	002142	宁波银行	5,720,226.00	8.03
3	000001	平安银行	5,416,816.78	7.60
4	300498	温氏股份	5,329,395.60	7.48
5	002736	国信证券	5,280,073.43	7.41
6	000333	美的集团	5,169,546.61	7.25
7	002304	洋河股份	5,095,985.00	7.15
8	002065	东华软件	4,963,741.49	6.97
9	000002	万科 A	4,653,246.00	6.53
10	001979	招商蛇口	4,527,848.00	6.35
11	002466	天齐锂业	4,514,287.00	6.34
12	000651	格力电器	4,348,942.00	6.10
13	000895	双汇发展	4,304,332.09	6.04
14	002230	科大讯飞	4,246,617.97	5.96
15	002007	华兰生物	4,021,256.00	5.64
16	000046	泛海控股	3,950,476.36	5.54
17	000069	华侨城 A	3,762,925.50	5.28
18	000063	中兴通讯	3,671,232.00	5.15
19	000423	东阿阿胶	3,613,196.89	5.07
20	002500	山西证券	3,612,925.00	5.07
21	000060	中金岭南	3,514,562.20	4.93
22	002415	海康威视	3,377,744.19	4.74
23	000783	长江证券	3,341,316.54	4.69
24	000725	京东方 A	3,340,181.00	4.69
25	000538	云南白药	3,285,365.97	4.61
26	300136	信维通信	3,267,580.00	4.59
27	000686	东北证券	3,249,324.40	4.56
28	000630	铜陵有色	3,239,966.00	4.55
29	000338	潍柴动力	3,226,790.71	4.53
30	002092	中泰化学	3,207,952.00	4.50
31	300070	碧水源	3,185,843.00	4.47
32	002456	欧菲科技	3,093,987.00	4.34
33	000540	中天金融	3,092,012.92	4.34
34	000528	柳工	2,994,969.00	4.20
35	002460	赣锋锂业	2,971,634.00	4.17
36	000425	徐工机械	2,927,989.00	4.11
37	300251	光线传媒	2,865,452.00	4.02
38	002024	苏宁易购	2,809,809.00	3.94
39	300464	星徽精密	2,660,722.32	3.73

40	000839	中信国安	2,634,888.00	3.70
41	002310	东方园林	2,627,554.00	3.69
42	300072	三聚环保	2,568,850.20	3.60
43	002601	龙鳞佰利	2,479,802.08	3.48
44	000625	长安汽车	2,303,603.00	3.23
45	000983	西山煤电	2,279,251.80	3.20
46	000830	鲁西化工	2,277,207.57	3.20
47	000568	泸州老窖	2,272,442.00	3.19
48	002594	比亚迪	2,262,286.04	3.17
49	000977	浪潮信息	2,243,510.00	3.15
50	000776	广发证券	2,228,118.00	3.13
51	002202	金风科技	2,171,686.00	3.05
52	002241	歌尔股份	2,139,285.00	3.00
53	300017	网宿科技	2,116,934.13	2.97
54	002027	分众传媒	2,079,555.00	2.92
55	000709	河钢股份	2,074,587.00	2.91
56	600415	小商品城	2,067,594.00	2.90
57	000963	华东医药	2,053,796.00	2.88
58	000166	申万宏源	1,982,114.88	2.78
59	300418	昆仑万维	1,950,204.19	2.74
60	002434	万里扬	1,936,308.29	2.72
61	300253	卫宁健康	1,883,799.30	2.64
62	002365	永安药业	1,878,694.30	2.64
63	600031	三一重工	1,878,651.00	2.64
64	000415	渤海金控	1,873,581.00	2.63
65	000728	国元证券	1,872,459.00	2.63
66	601988	中国银行	1,853,118.00	2.60
67	000413	东旭光电	1,809,918.00	2.54
68	600160	巨化股份	1,789,939.00	2.51
69	002709	天赐材料	1,787,756.08	2.51
70	000402	金融街	1,755,755.00	2.46
71	002558	巨人网络	1,745,215.24	2.45
72	000517	荣安地产	1,716,629.21	2.41
73	300408	三环集团	1,687,532.43	2.37
74	002589	瑞康医药	1,668,353.50	2.34
75	300179	四方达	1,647,367.53	2.31
76	002450	康得新	1,642,900.00	2.31
77	002064	华峰氨纶	1,612,742.68	2.26

78	002081	金螳螂	1,610,763.00	2.26
79	601238	广汽集团	1,604,967.00	2.25
80	002176	江特电机	1,581,474.40	2.22
81	000997	新大陆	1,545,441.28	2.17
82	300400	劲拓股份	1,510,665.80	2.12
83	002673	西部证券	1,490,226.29	2.09
84	000617	中油资本	1,481,709.00	2.08
85	600633	浙数文化	1,464,000.50	2.05
86	002008	大族激光	1,461,254.00	2.05
87	600487	亨通光电	1,459,099.26	2.05
88	002405	四维图新	1,443,851.00	2.03
89	000639	西王食品	1,426,165.00	2.00

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	401,141,152.92
卖出股票收入（成交）总额	406,506,149.52

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，广发证券股份有限公司（000776）于 2016 年 11 月 28 日发布公告称 11 月 26 日收到中国证监会行政处罚决定书：2015 年 1 月 16 日，中国证监会公开通报 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司因存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题，且涉及客户数量较多，受

到责令限期改正的行政监管措施。2015 年 8 月 24 日，收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（鄂证调查字 2015023 号）。因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立案调查。2015 年 9 月 12 日，因在接入恒生 HOMES 系统期间未采取有效措施严格审查客户身份的真实性，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，因此受到中国证监会责令整改，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款等处罚。

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	11,660.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,020.96
5	应收申购款	154,035.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	169,716.97

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002739	万达电影	1,772,512.00	1.88	重大资产重组

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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
8,399	6,264.72	0.00	0.00%	52,617,385.86	100.00%

9.3 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 持有本基金	145,082.85	0.28%

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（2012年3月16日）基金份额总额	1,747,440,444.36
本报告期期初基金份额总额	52,013,062.39
本报告期基金总申购份额	51,541,235.21
减：本报告期基金总赎回份额	50,936,911.74
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	52,617,385.86

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
华创证券	1	309,239,867.42	38.40%	287,998.94	38.48%	-
中泰证券	3	239,413,807.07	29.73%	222,857.85	29.78%	-
太平洋证券	1	157,468,707.33	19.55%	146,653.00	19.59%	-
中投证券	3	34,860,407.99	4.33%	31,755.92	4.24%	-
高华证券	1	27,505,205.07	3.42%	25,618.47	3.42%	-
天风证券	1	25,706,037.56	3.19%	23,403.01	3.13%	-
华泰证券	4	8,238,402.94	1.02%	7,511.26	1.00%	-
长江证券	1	2,942,588.70	0.37%	2,668.31	0.36%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	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
华创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	3,600,000.00	39.56%	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	5,500,000.00	60.44%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

份额单位：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 05 月 12 日- 2017 年 12 月 24 日	0.00	14,086,778.90	14,086,778.90	0.00	0.00%
产品特有风险							

本基金本报告期末不存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

建信基金管理有限责任公司
2018 年 3 月 28 日