

# 建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金

## 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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            | 建信鑫丰回报灵活配置混合       |                    |
| 基金主代码           | 001408             |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                    |
| 基金合同生效日         | 2015 年 6 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           | 中国民生银行股份有限公司       |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 1,662,256,748.82 份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |
| 下属分级基金的基金简称:    | 建信鑫丰回报灵活配置混合 A     | 建信鑫丰回报灵活配置混合 C     |
| 下属分级基金的交易代码:    | 001408             | 002141             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 37,087,893.47 份    | 1,625,168,855.35 份 |

### 2.2 基金产品说明

|               |  |                |
|---------------|--|----------------|
| 投资目标          | 力争每年获得较高的绝对回报。   |                |
| 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、稳定的绝对回报。                |                |
| 业绩比较基准        | 6%/年。  |                |
| 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。 |                |
|               | 建信鑫丰回报灵活配置混合 A   | 建信鑫丰回报灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的风险收益特征 | -  | -              |

### 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          |

## 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 6 月 16 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日 |                |
|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---|----------------|
|               | 建信鑫丰回报灵活配置混合 A | 建信鑫丰回报灵活配置混合 C | 建信鑫丰回报灵活配置混合 A | 建信鑫丰回报灵活配置混合 C | 建信鑫丰回报灵活配置混合 A                            | 建信鑫丰回报灵活配置混合 C |
| 本期已实现收益       | 2,130,748.33   | 90,474,841.69  | 2,065,143.78   | 31,848,753.27  | -736,506.36                               | -268,147.21    |
| 本期利润          | 2,582,073.07   | 109,016,796.60 | 426,030.57     | 4,165,427.35   | -403,592.28                               | 875,907.92     |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0678         | 0.0658         | 0.0097         | 0.0025         | -0.0028                                   | 0.0008         |
| 本期基金份额净值增长率   | 6.51%          | 6.39%          | 0.80%          | 0.31%          | 3.60%                                     | 0.78%          |
| 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        | 0.1123         | 0.1067         | 0.0443         | 0.0402         | 0.0247                                    | 0.0315         |

|                      |                   |                      |                   |                      |                   |                      |
|----------------------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|
| 基金<br>份额<br>利润       |                   |                      |                   |                      |                   |                      |
| 期末<br>基金<br>资产<br>净值 | 41,252,431.<br>63 | 1,798,603,664.<br>58 | 42,118,346.<br>30 | 2,002,493,211.<br>60 | 48,616,246.<br>55 | 1,642,691,006.<br>64 |
| 期末<br>基金<br>份额<br>净值 | 1.1123            | 1.1067               | 1.0443            | 1.0402               | 1.036             | 1.037                |

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信鑫丰回报灵活配置混合 A

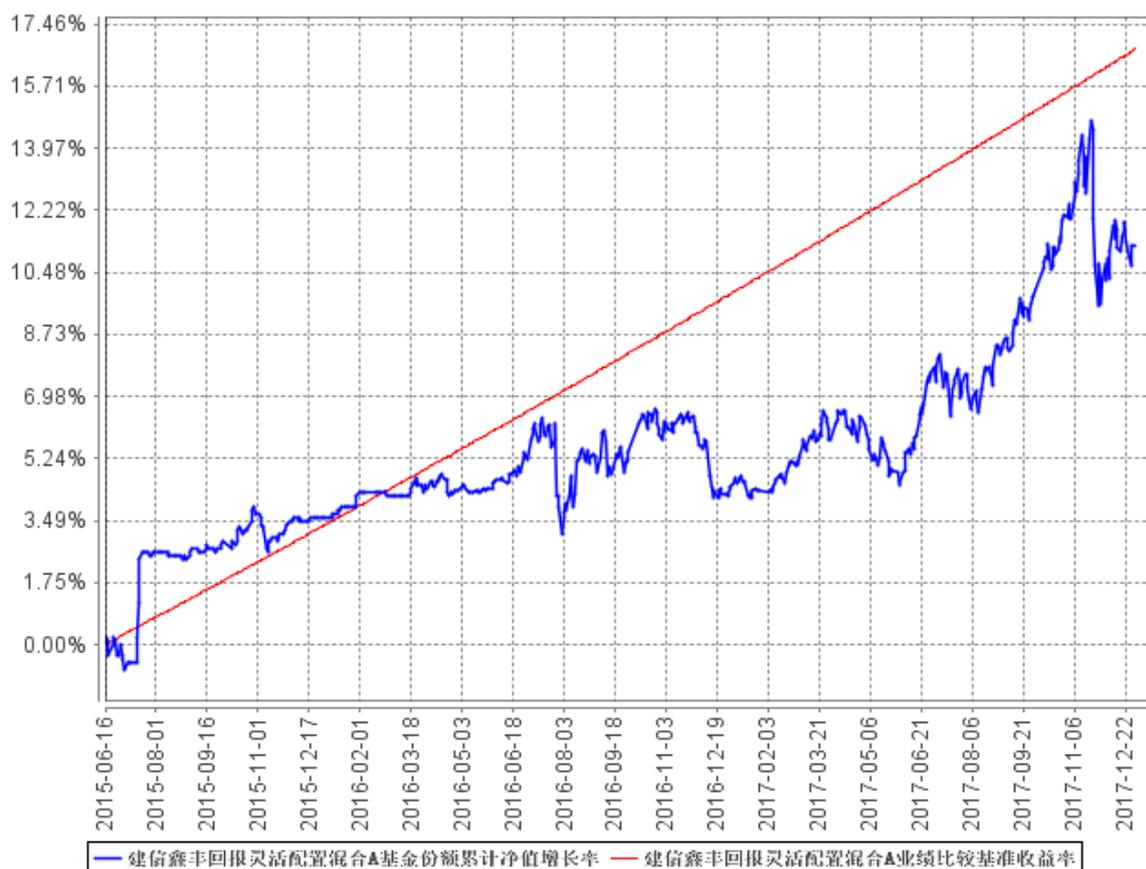
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 1.28%    | 0.57%       | 1.54%      | 0.02%         | -0.26% | 0.55% |
| 过去六个月      | 3.34%    | 0.45%       | 3.11%      | 0.02%         | 0.23%  | 0.43% |
| 过去一年       | 6.51%    | 0.35%       | 6.27%      | 0.02%         | 0.24%  | 0.33% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.23%   | 0.28%       | 16.76%     | 0.02%         | -5.53% | 0.26% |

建信鑫丰回报灵活配置混合 C

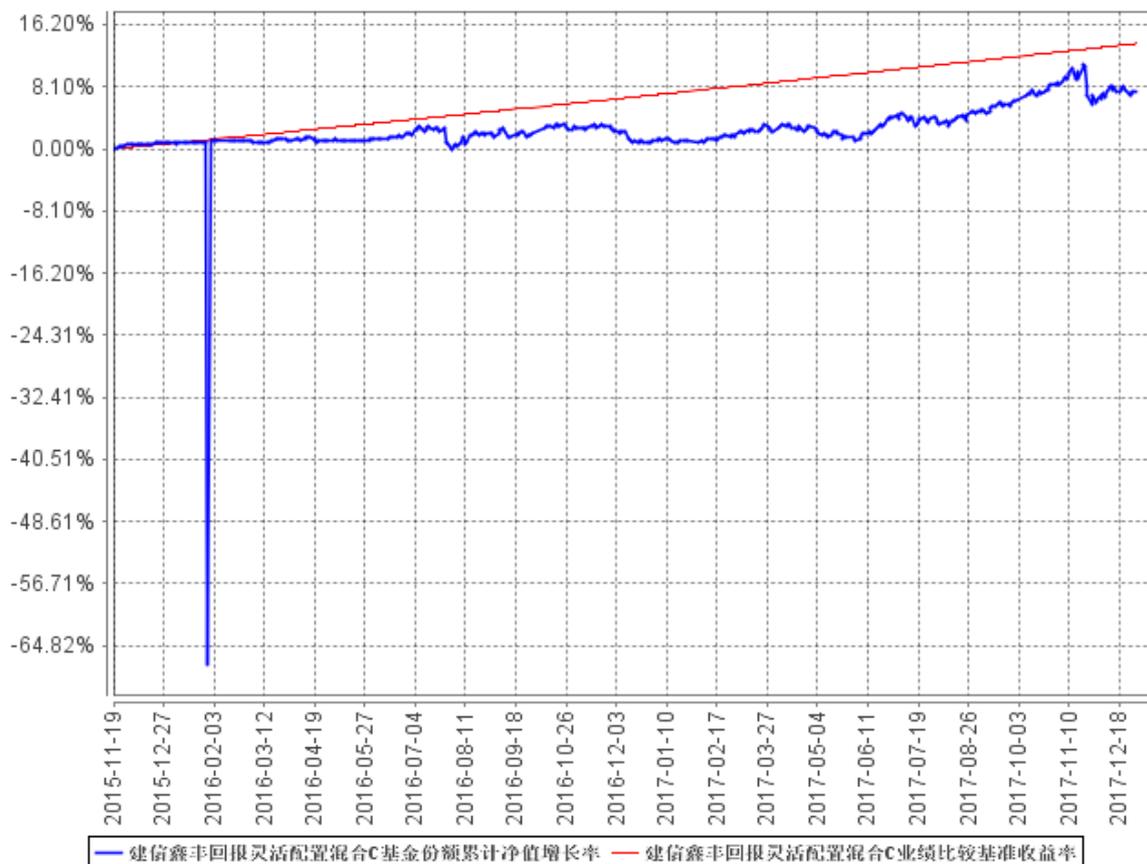
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 1.25%    | 0.57%       | 1.54%      | 0.02%         | -0.29% | 0.55% |
| 过去六个月      | 3.28%    | 0.45%       | 3.11%      | 0.02%         | 0.17%  | 0.43% |
| 过去一年       | 6.39%    | 0.35%       | 6.27%      | 0.02%         | 0.12%  | 0.33% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.55%    | 9.61%       | 13.77%     | 0.02%         | -6.22% | 9.59% |

### 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

建信鑫丰回报灵活配置混合A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



### 建信鑫丰回报灵活配置混合C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

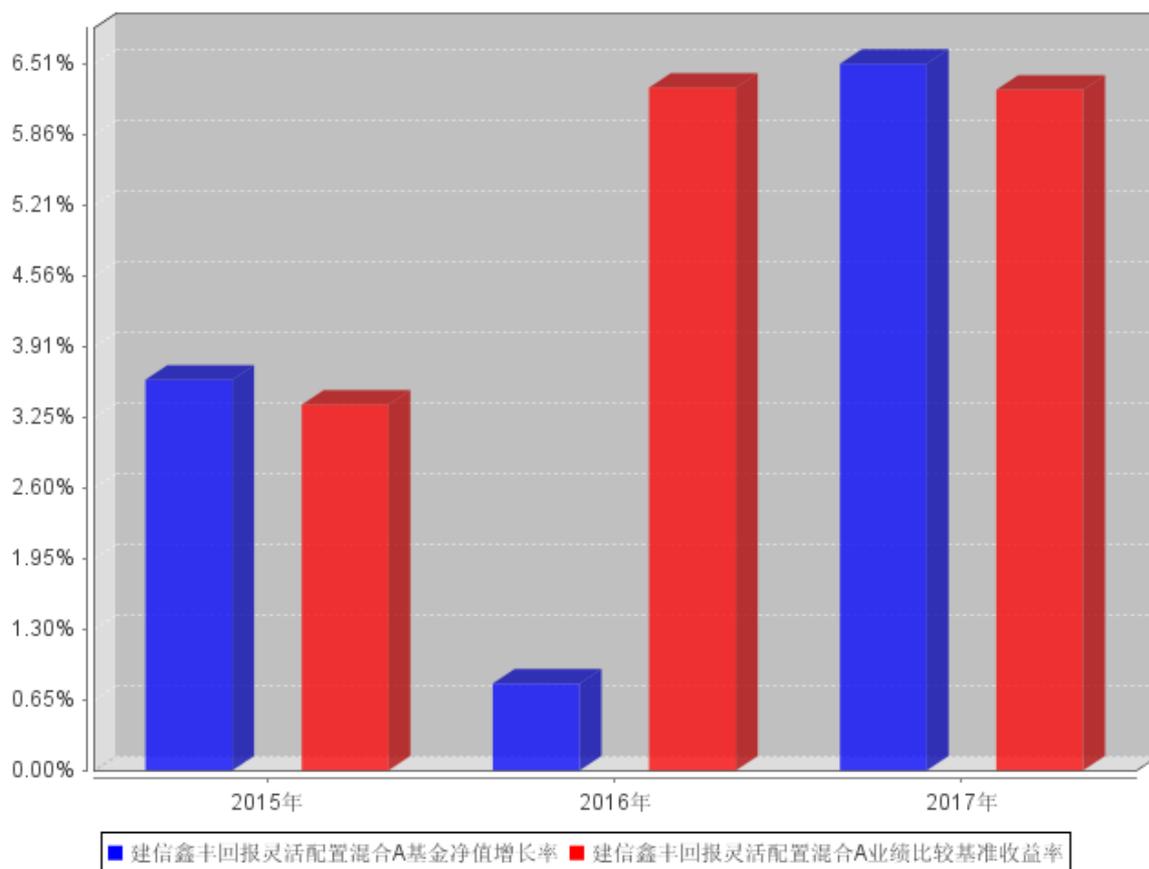


1、本报告期本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

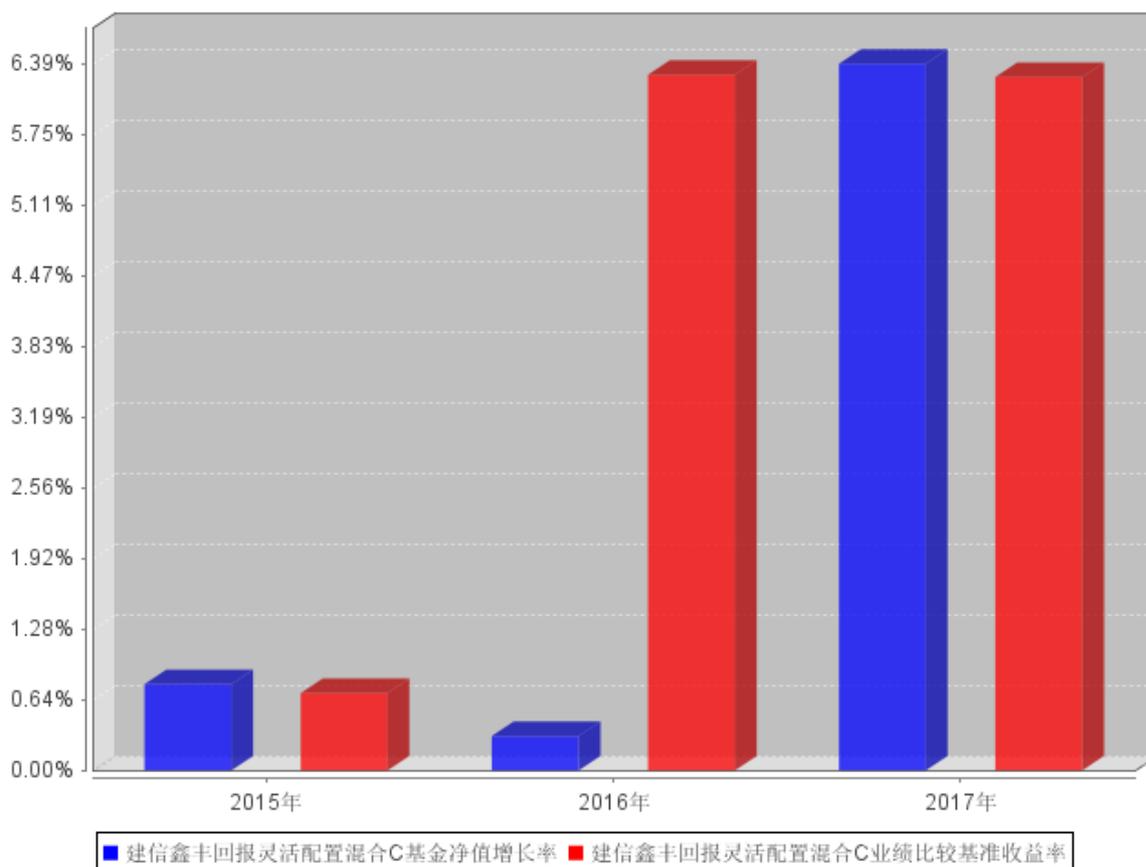
2、本基金于 2015 年 11 月 19 日起新增 C 类份额，原有份额转换 A 类份额。

### 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

建信鑫丰回报灵活配置混合A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



### 建信鑫丰回报灵活配置混合C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



- 1、本基金基金合同于 2015 年 6 月 16 日生效，基金成立当年年净值增长率以实际存续期计算。
- 2、本基金于 2015 年 11 月 19 日起新增 C 类份额，原有份额转换 A 类份额。新增份额 2015 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

自基金合同生效以来，本基金未实施利润分配。

## § 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 |        |  |
| 朱建华 | 本基金的基金经理 | 2016 年 3 月 14 日 | -    | 10     | 硕士。曾任大连博达系统工程公司职员、中诚信国际信用评级公司项目组长，2007 年 10 月起任中诚信证券评估有限公司信用评级部总经理助理，2008 年 8 月起任国泰基金管理公司高级研究员。朱建华于 2011 年 6 月加入本公司，历任高级债券研究员、货币市场基金的基金经 |

|     |          |            |            |   |   |
|-----|----------|------------|------------|---|---|
|     |          |            |            |   | <p>理助理，2012年8月28日至2015年8月11日任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理；2012年11月15日至2014年3月6日任建信纯债债券型证券投资基金基金经理；2012年12月20日至2014年3月27日任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理；2013年5月14日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金经理；2013年12月10日起任建信稳定添利债券型证券投资基金基金经理；2016年3月14日起任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年4月28日起任建信安心保本六号基金经理；2016年6月1日任建信转债增强债券基金经理；2016年11月1日起任建信瑞丰添利混合型证券投资基金基金经理。</p> |
| 牛兴华 | 本基金的基金经理 | 2015年6月16日 | 2018年1月23日 | 7 | <p>硕士，2008年毕业于英国卡迪夫大学国际经济、银行与金融学专业，同年进入神州数码中国有限公司，任投资专员；2010年9月，加入中诚信国际信用评级有限责任公司，担任高级分析师；2013年4月加入本公司，任债券研究员。2014年12月2日至2017年6月30日任建信稳定得利债券型证券投资基金的基金经理；2015年4月17日起任</p>   |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 5 月 13 日起任建信回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 5 月 14 日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 6 月 16 日至 2018 年 1 月 23 日任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2015 年 11 月 25 日任建信鑫裕回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 10 月 29 日至 2017 年 7 月 12 日任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 2 月 22 日至 2018 年 1 月 23 日任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理；2016 年 10 月 25 日至 2017 年 12 月 6 日任建信瑞盛添利混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 12 月 2 日起任建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 12 月 23 日至 2017 年 12 月 29 日任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 3 月 1 日起任建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</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

2017 年虽然面临房地产调控、金融去杠杆、供给侧改革等因素的影响，但宏观经济的表现整体好于市场预期，全年 GDP 同比增长 6.9%，增速较前一年提高 0.2 个百分点。同时企业的利润水平在 2017 年出现明显上升态势，PMI 连续处于 50 分位值以上，显示经济的较强的韧性，这也在部分程度上抵消了投资下滑所带来的冲击。虽然 2017 年全国各地出台了一系列地产调控措施，但全年地方政府卖地收入依然创出历史新高，这也在很大程度上弥补了地方基建投资的缺口。在棚改货币化的推动下，四五线城市的地产销售依然火爆，政府去杠杆居民加杠杆成为 2017 年的一个显著现象。此外人民币的持续升值也带来外汇储备的微幅增长。在环保限产和补库存的带动下，2017 年商品价格震荡上行，国内煤炭钢铁价格创出几年新高，而国际市场上以石油、铜为代表大宗商品价格同样创出几年新高，显示全球经济回暖的态势正在加速。市场在经历了这一轮的供给侧改革后，周期类行业的集中度和抗风险能力比以往都有了明显回升，未来盈利的波动性也有望下降。通胀方面，2017 年全年 CPI 同比温和上行，全年同比涨幅 1.6%，其中食品价格涨幅回落较大在很大程度上拉低了 CPI 的涨幅，而工业品价格指数 PPI 则由于基数效应涨幅趋缓，通胀的压力整体不大。货币政策方面，央行依然延续了中性偏紧的货币政策，资金面维持紧平衡。

一方面，央行通过提高逆回购和中期借贷便利的操作利率引导资金成本小幅上行，另一方面监管机构在这一年颁布了诸多监管文件并将表外理财纳入广义信贷考核，这在很大程度上限制了金融机构的盲目扩张行为，对于金融市场以及机构业务影响较大。

债券方面，2017 年是金融去杠杆、加强金融监管的重要一年，受同业理财大规模收缩、MPA 考核、表外回表等影响，全年债券市场大幅调整，债券收益率呈现上行，全年下来除短端外，其余期限品种均出现较大调整，这也进一步引导市场资金集中在短端，相比而言长债交易平淡，配置资金难觅踪影。另外市场对信用债的担忧也越发加剧，部分城投和高收益信用债受到抛弃，短久期获得票息收入已成为当下市场的主要操作思路。转债方面，转债市场全年波动较大，虽然在三季度伴随权益市场出现了一波上行，但是四季度一方面由于供给加速另一方面随着权益市场的调整带来的正股的下跌以及流动性的阶段性收紧加剧了转债市场的抛售，特别是部分转债因成交量低迷在市场资金的悲观预期下出现较大跌幅。从转债的估值看，转债估值在 2017 年年底已经创出 2014 年四季度以来的新低。权益市场方面，2017 年是权益市场分化的一年，其中以上证 50 指数为代表的大市值蓝筹股不断创出新高，而以科技创新类为代表的创业板则创下两年新低。这种极端分化的走势进一步推动机构大量增持蓝筹白马股，板块的选择的重要性在一定程度上已大过个股选择的重要性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信鑫丰回报 A 净值增长率 6.51%，波动率 0.35%，建信鑫丰回报 C 净值增长率 6.39%，波动率 0.35%；业绩比较基准收益率 6.27%，波动率 0.02%。

#### 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 2018 年，我们认为经济在经历了 2017 年的回升后仍有一定的韧性，但是二三季度应该重点防范经济出现短期增速不及预期的风险。一方面二季度开始将面临一个去库存的小周期，这将对部分工业企业利润产生一定影响，另一方面，在严控地方政府债务的背景下，地方投资热情受到抑制，而两年前开始那一轮的基建高峰在今年下半年有可能过去如果届时投资跟不上对经济也会形成短期压制。此外考虑到地产调控的持续性，在信贷紧缩的背景下，居民加杠杆空间有限，随着 2018 年棚改货币化接近尾声，房地产销售数据在二三季度恐将出现压力。但是在去杠杆的大周期下，国内经济结构已经出现明显优化，消费、出口在一定程度上将对冲这种风险，即使出现短期增速下滑中长期经济增长的质量也将得到提升。通胀方面，我们认为 2018 年通胀风险整体可控，目前看最大的不确定性来自于原油价格的超预期上涨，输入性通胀如果在下半年超预期

会引发市场的担忧。另外全球经济复苏的大背景下，全球的利率环境正在逐步正常化，全球央行的缩表、美联储持续加息等因素恐怕将引发市场更大的震动。债券方面，我们认为在金融去杠杆的背景下为防止金融的系统性风险央行对资金面的呵护将持续，目前的长债已经提前反应了诸多的债市利空因素，如果没有新的超预期的监管条文或货币政策的收紧等因素干扰，长债的下跌空间有限，更大可能是短期维持目前的收益率水平震荡并等待机会上攻，长债的性价比已经大幅提升。而权益方面，2018 年 A 股的波动率将很难维持 2017 年的超低水平，大小股票两级分化的走势很难一直持续，部分低估值成长性股票的投资价值已经显现，相比 2017 年，2018 年更多是自下而上的选择个股，无论大小股票跌多了就买的策略将有望取得较好的收益。

建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金在 2017 年年底因受权益市场调整的影响净值出现一定回撤。展望 2018 年，本基金因面临潜在的赎回压力，因此债券方面将以维持流动性为主短期闲置资金可参与逆回购交易。权益方面本基金在 2018 年将秉承价值投资兼顾成长的理念，采取自下而上的投资策略分散持仓，并将密切关注市场风格的转化情况，以期给投资者带来较好的回报。

#### 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[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 审计报告**

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“建信鑫丰回报灵活配置混合基金”)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 22691 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：建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金

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<br>2017 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            |            | 42,319,689.39                   | 398,538,412.15                   |
| 结算备付金           |            | 32,671,577.40                   | 32,693,178.74                    |
| 存出保证金           |            | 901,128.49                      | 607,534.78                       |
| 交易性金融资产         |            | 1,172,248,743.96                | 977,550,670.23                   |
| 其中：股票投资         |            | 576,534,960.66                  | 325,930,227.43                   |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 595,713,783.30                  | 651,620,442.80                   |
| 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        |            | 580,753,058.26                  | 611,200,685.00                   |
| 应收证券清算款         |            | 3,471,127.72                    | 9,398,642.48                     |
| 应收利息            |            | 13,648,514.23                   | 19,447,636.41                    |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 2,995.51                        | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            |            | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 1,846,016,834.96                | 2,049,436,759.79                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                 |                                  |
| 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         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                               | 100.00                           |
| 应付管理人报酬         |            | 1,248,073.78                    | 1,391,400.57                     |
| 应付托管费           |            | 312,018.44                      | 347,850.17                       |

|               |  |                  |                  |
|---------------|--|------------------|------------------|
| 应付销售服务费       |  | 152,511.50       | 170,319.92       |
| 应付交易费用        |  | 4,008,135.03     | 2,595,531.04     |
| 应交税费          |  | -                | -                |
| 应付利息          |  | -                | -                |
| 应付利润          |  | -                | -                |
| 递延所得税负债       |  | -                | -                |
| 其他负债          |  | 440,000.00       | 320,000.19       |
| 负债合计          |  | 6,160,738.75     | 4,825,201.89     |
| <b>所有者权益：</b> |  |                  |                  |
| 实收基金          |  | 1,662,256,748.82 | 1,965,476,957.85 |
| 未分配利润         |  | 177,599,347.39   | 79,134,600.05    |
| 所有者权益合计       |  | 1,839,856,096.21 | 2,044,611,557.90 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 1,846,016,834.96 | 2,049,436,759.79 |

报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,662,256,748.82 份。其中建信鑫丰回报灵活配置混合基金 A 类基金份额净值 1.1123 元，基金份额总额 37,087,893.47 份；建信鑫丰回报灵活配置混合基金 C 类基金份额净值 1.1067 元，基金份额总额 1,625,168,855.35 份。

## 7.2 利润表

会计主体：建信鑫丰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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 |
|------------------|-----|---|--|
| <b>一、收入</b>      |     | 140,419,005.22                            | 28,283,063.17                                  |
| 1.利息收入           |     | 48,056,478.82                             | 38,165,660.73                                  |
| 其中：存款利息收入        |     | 10,223,435.86                             | 3,517,780.08                                   |
| 债券利息收入           |     | 19,756,231.97                             | 25,314,060.59                                  |
| 资产支持证券利息收入       |     | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入       |     | 18,076,810.99                             | 9,333,820.06                                   |
| 其他利息收入           |     | -   | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |     | 73,366,401.88                             | 19,265,892.68                                  |
| 其中：股票投资收益        |     | 74,740,338.92                             | 31,267,745.27                                  |
| 基金投资收益           |     | -   | -  |
| 债券投资收益           |     | -3,423,715.39                             | -13,378,908.01                                 |
| 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             |     | 2,049,778.35                              | 1,377,055.42                                   |
| 3.公允价值变动收益（损失以   |     | 18,993,279.65                             | -29,322,439.13                                 |

|                            |           |                |               |
|----------------------------|-----------|----------------|---------------|
| “-”号填列)                    |           |                |               |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列)          |           | -              | -             |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列)          |           | 2,844.87       | 173,948.89    |
| <b>减:二、费用</b>              |           | 28,820,135.55  | 23,691,605.25 |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.8.2.1 | 14,557,958.39  | 14,025,361.96 |
| 2. 托管费                     | 7.4.8.2.2 | 3,639,489.68   | 3,506,340.55  |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.8.2.3 | 1,778,785.34   | 1,706,836.86  |
| 4. 交易费用                    |           | 8,181,121.30   | 4,069,724.14  |
| 5. 利息支出                    |           | 217,077.22     | -             |
| 其中: 卖出回购金融资产支出             |           | 217,077.22     | -             |
| 6. 其他费用                    |           | 445,703.62     | 383,341.74    |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |           | 111,598,869.67 | 4,591,457.92  |
| 减: 所得税费用                   |           | -              | -             |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |           | 111,598,869.67 | 4,591,457.92  |

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 建信鑫丰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12月31日

单位: 人民币元

| 项目                                | 本期<br>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)                   | 1,965,476,957.85            | 79,134,600.05  | 2,044,611,557.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)         | -                           | 111,598,869.67 | 111,598,869.67   |
| 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) | -303,220,209.03             | -13,134,122.33 | -316,354,331.36  |
| 其中: 1. 基金申购款                      | 304,042.56                  | 19,629.74      | 323,672.30       |
| 2. 基金赎回款                          | -303,524,251.59             | -13,153,752.07 | -316,678,003.66  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基              | -                           | -              | -                |



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(2015)第 740 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 632,657,955.89 份基金份额,其中认购资金利息折合 4,410.26 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。

此外,根据《关于建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》并报证监会备案,本基金于 2015 年 11 月 19 日起根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间可以互相转换。2015 年 11 月 19 日前原有的基金份额在增加 C 类基金份额后全部转换为 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信鑫丰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、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票)、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 6%/年。

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》、《建信鑫丰回报灵活配置混合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 |
| 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            |
| 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

##### 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  | 14,557,958.39                    | 14,025,361.96                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,004.37                         | 11,024.88                        |

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 0.80% 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 0.80% / 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 | 3,639,489.68                     | 3,506,340.55                     |

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 0.20% 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

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                               |                |              |
|----------------|----------------------------------|----------------|--------------|
|                | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |                |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |                |              |
|                | 建信鑫丰回报灵活配置混合 A                   | 建信鑫丰回报灵活配置混合 C | 合计           |
| 建信基金           | 0.00                             | 1,788,757.03   | 1,788,757.03 |
| 合计             | 0.00                             | 1,788,757.03   | 1,788,757.03 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                          |                |              |
|                | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |                |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |                |              |

|      | 建信鑫丰回报灵活配置混合 A | 建信鑫丰回报灵活配置混合 C | 合计           |
|------|----------------|----------------|--------------|
| 建信基金 | -              | 1,706,606.38   | 1,706,606.38 |
| 合计   | -              | 1,706,606.38   | 1,706,606.38 |

支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额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 C 类基金份额销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

#### 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

单位：人民币元

| 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日      |               |      |       |      |       |      |
|---|---------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易<br>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                                      | 90,232,414.45 | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |               |      |       |      |       |      |
| 银行间市场交易<br>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 |

#### 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自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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |              | 上年度可比期间<br>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       |
| 中国民生银行—活期存款 | 42,319,689.39                          | 291,385.96   | 8,538,412.15                                | 1,167,183.35 |
| 中国民生银行—定期存款 | -                                      | 1,445,000.14 | 300,000,000.00                              | 1,644,999.86 |

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。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**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

| 7.4.9.1.1 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<br>(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 603080              | 新疆火炬 | 2017 年 12 月 25 日 | 2018 年 1 月 3 日 | 新发未上市  | 13.60 | 13.60  | 1,187        | 16,143.20 | 16,143.20 | -  |

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 |
|--------|------|-----------------|--------|--------|------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 600309 | 万华化学 | 2017 年 12 月 6 日 | 重大资产重组 | 37.94  | -    | -      | 300,000 | 11,029,551.32 | 11,382,000.00 | -  |
| 002507 | 涪陵榨菜 | 2017 年 12 月     | 重大事项   | 16.77  | -    | -      | 500,000 | 8,912,343.00  | 8,385,000.00  | -  |

|        |      |                     |      |       |                   |       |     |           |           |   |
|--------|------|---------------------|------|-------|-------------------|-------|-----|-----------|-----------|---|
|        |      | 4日                  |      |       |                   |       |     |           |           |   |
| 300730 | 科创信息 | 2017年<br>12月<br>25日 | 重大事项 | 41.55 | 2018<br>年1月<br>2日 | 45.71 | 821 | 6,863.56  | 34,112.55 | - |
| 002919 | 名臣健康 | 2017年<br>12月<br>28日 | 重大事项 | 35.26 | 2018<br>年1月<br>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 590,684,039.75 元，属于第二层次的余额为 581,564,704.21 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 264,773,389.73 元，第二层次 712,777,280.50 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 日的财务状况和 2017 年度的经营成果无影响。

(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              | 576,534,960.66   | 31.23  |
|   | 其中：股票             | 576,534,960.66   | 31.23  |
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 595,713,783.30   | 32.27  |
|   | 其中：债券             | 595,713,783.30   | 32.27  |
|   | 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          | 580,753,058.26   | 31.46  |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 91,782,604.80    | 4.97   |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 74,991,266.79    | 4.06   |
| 8 | 其他各项资产            | 18,023,765.95    | 0.98   |
| 9 | 合计                | 1,846,016,834.96 | 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         | 53,769,407.40  | 2.92          |
| B  | 采矿业              | -              | -             |
| C  | 制造业              | 455,316,192.41 | 24.75         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,143.20      | 0.00          |
| E  | 建筑业              | -              | -             |
| F  | 批发和零售业           | -              | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 17,957.94      | 0.00          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 34,112.55      | 0.00          |
| J  | 金融业              | 66,339,454.40  | 3.61          |
| K  | 房地产业             | 1,041,692.76   | 0.06          |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -             |
| 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        | 576,534,960.66 | 31.34 |

注：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

本基金本报告期末投资港股通股票。

### 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  | 000858 | 五粮液  | 902,665    | 72,104,880.20 | 3.92         |
| 2  | 002444 | 巨星科技 | 5,139,851  | 71,084,139.33 | 3.86         |
| 3  | 601398 | 工商银行 | 10,699,912 | 66,339,454.40 | 3.61         |
| 4  | 300232 | 洲明科技 | 4,339,976  | 62,061,656.80 | 3.37         |
| 5  | 600519 | 贵州茅台 | 84,985     | 59,276,187.65 | 3.22         |
| 6  | 300498 | 温氏股份 | 2,249,766  | 53,769,407.40 | 2.92         |
| 7  | 601633 | 长城汽车 | 3,999,893  | 45,958,770.57 | 2.50         |
| 8  | 601127 | 小康股份 | 1,299,885  | 26,140,687.35 | 1.42         |
| 9  | 000799 | 酒鬼酒  | 930,000    | 25,500,600.00 | 1.39         |
| 10 | 600809 | 山西汾酒 | 309,924    | 17,662,568.76 | 0.96         |

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  | 601398 | 工商银行 | 105,080,950.62 | 5.14           |
| 2  | 002475 | 立讯精密 | 97,492,095.43  | 4.77           |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 96,019,952.84  | 4.70           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 4  | 600584 | 长电科技 | 87,273,760.72 | 4.27 |
| 5  | 002444 | 巨星科技 | 85,894,914.25 | 4.20 |
| 6  | 300232 | 洲明科技 | 69,438,934.17 | 3.40 |
| 7  | 601633 | 长城汽车 | 69,024,418.93 | 3.38 |
| 8  | 600208 | 新湖中宝 | 63,557,111.40 | 3.11 |
| 9  | 600373 | 中文传媒 | 58,163,570.42 | 2.84 |
| 10 | 002310 | 东方园林 | 56,228,187.55 | 2.75 |
| 11 | 600309 | 万华化学 | 55,789,655.57 | 2.73 |
| 12 | 600519 | 贵州茅台 | 55,736,837.79 | 2.73 |
| 13 | 300498 | 温氏股份 | 55,267,890.45 | 2.70 |
| 14 | 002152 | 广电运通 | 52,977,082.83 | 2.59 |
| 15 | 000799 | 酒鬼酒  | 49,465,881.54 | 2.42 |
| 16 | 300408 | 三环集团 | 49,078,756.16 | 2.40 |
| 17 | 603019 | 中科曙光 | 48,295,440.39 | 2.36 |
| 18 | 000063 | 中兴通讯 | 46,096,950.97 | 2.25 |
| 19 | 300322 | 硕贝德  | 44,505,930.83 | 2.18 |
| 20 | 300481 | 濮阳惠成 | 44,419,912.84 | 2.17 |
| 21 | 600507 | 方大特钢 | 44,168,951.97 | 2.16 |
| 22 | 600196 | 复星医药 | 43,682,285.93 | 2.14 |
| 23 | 600315 | 上海家化 | 41,913,921.09 | 2.05 |
| 24 | 600645 | 中源协和 | 40,969,331.18 | 2.00 |

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 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  | 002475 | 立讯精密 | 108,491,865.91 | 5.31           |
| 2  | 600584 | 长电科技 | 87,905,037.45  | 4.30           |
| 3  | 600208 | 新湖中宝 | 64,392,637.14  | 3.15           |
| 4  | 002310 | 东方园林 | 55,123,204.12  | 2.70           |
| 5  | 600373 | 中文传媒 | 53,843,644.63  | 2.63           |
| 6  | 300450 | 先导智能 | 53,826,974.69  | 2.63           |
| 7  | 300408 | 三环集团 | 52,327,343.48  | 2.56           |
| 8  | 603019 | 中科曙光 | 51,698,727.45  | 2.53           |
| 9  | 000063 | 中兴通讯 | 51,673,455.15  | 2.53           |
| 10 | 600507 | 方大特钢 | 51,518,317.57  | 2.52           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 11 | 002152 | 广电运通 | 50,920,420.25 | 2.49 |
| 12 | 600196 | 复星医药 | 49,019,387.75 | 2.40 |
| 13 | 000858 | 五粮液  | 48,962,001.90 | 2.39 |
| 14 | 600309 | 万华化学 | 45,971,437.98 | 2.25 |
| 15 | 300415 | 伊之密  | 45,639,423.72 | 2.23 |
| 16 | 600315 | 上海家化 | 45,498,704.72 | 2.23 |
| 17 | 600645 | 中源协和 | 44,002,882.93 | 2.15 |
| 18 | 300322 | 硕贝德  | 43,269,211.84 | 2.12 |
| 19 | 600487 | 亨通光电 | 42,208,660.19 | 2.06 |
| 20 | 601398 | 工商银行 | 40,865,974.00 | 2.00 |

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 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 | 2,806,413,098.14 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,658,202,461.02 |

注：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

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  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 371,838,000.00 | 20.21        |
|    | 其中：政策性金融债 | 371,838,000.00 | 20.21        |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 110,224,500.00 | 5.99         |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 33,995,283.30  | 1.85         |
| 8  | 同业存单      | 79,656,000.00  | 4.33         |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 595,713,783.30 | 32.38        |

### 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

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 | 170301    | 17 进出 01         | 1,000,000 | 99,920,000.00 | 5.43   |
| 2 | 160403    | 16 农发 03         | 1,000,000 | 95,080,000.00 | 5.17   |
| 3 | 111770123 | 17 汉口银行<br>CD156 | 800,000   | 79,656,000.00 | 4.33   |
| 4 | 011754199 | 17 淮南矿<br>SCP005 | 600,000   | 59,952,000.00 | 3.26   |
| 5 | 130205    | 13 国开 05         | 500,000   | 49,160,000.00 | 2.67   |

### 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   | 901,128.49    |
| 2  | 应收证券清算款 | 3,471,127.72  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 13,648,514.23 |
| 5  | 应收申购款   | 2,995.51      |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 18,023,765.95 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|--------------|---------------|
| 1  | 113011 | 光大转债     | 8,870,406.30 | 0.48          |
| 2  | 132007 | 16 凤凰 EB | 4,455,360.00 | 0.24          |
| 3  | 113008 | 电气转债     | 3,951,200.00 | 0.21          |
| 4  | 110032 | 三一转债     | 2,426,400.00 | 0.13          |
| 5  | 120001 | 16 以岭 EB | 1,102,886.40 | 0.06          |
| 6  | 127003 | 海印转债     | 817,689.40   | 0.04          |
| 7  | 113010 | 江南转债     | 571,010.00   | 0.03          |
| 8  | 128013 | 洪涛转债     | 162,536.00   | 0.01          |
| 9  | 113012 | 骆驼转债     | 75,302.80    | 0.00          |

### 8.12.5 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未存在流通受限的情况。

### 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

| 份额级别           | 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 |
| 建信鑫丰回报灵活配置混合 A | 166      | 223,421.05    | 35,885,548.01    | 96.76% | 1,202,345.46 | 3.24%  |
| 建信鑫丰回报灵活配置混合 C | 39       | 41,670,996.29 | 1,624,927,815.21 | 99.99% | 241,040.14   | 0.01%  |
| 合计             | 205      | 8,108,569.51  | 1,660,813,363.22 | 99.91% | 1,443,385.60 | 0.09%  |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别           | 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 | 建信鑫丰回报灵活配置混合 A | 136.34    | 0.00%    |
|                  | 建信鑫丰回报灵活配置混合 C | 91.88     | 0.00%    |
|                  | 合计             | 228.22    | 0.00%    |

## 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

| 项目                                 | 建信鑫丰回报灵<br>活配置混合 A | 建信鑫丰回报灵<br>活配置混合 C |
|------------------------------------|--------------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2015 年 6 月 16 日）基金<br>份额总额 | 632,657,955.89     | -                  |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 40,331,833.25      | 1,925,145,124.60   |
| 本报告期基金总申购份额                        | 168,525.87         | 135,516.69         |
| 减:本报告期基金总赎回份额                      | 3,412,465.65       | 300,111,785.94     |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”<br>填列）       | -                  | -                  |
| 本报告期末基金份额总额                        | 37,087,893.47      | 1,625,168,855.35   |

注：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 100,000.00 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 |    |
| 光大证券 | 2      | 1,801,187,991.21 | 33.00%       | 1,669,940.72 | 33.19%     | -  |
| 招商证券 | 2      | 1,547,640,501.17 | 28.36%       | 1,433,527.54 | 28.49%     | -  |
| 东北证券 | 1      | 728,835,531.57   | 13.35%       | 664,183.65   | 13.20%     | -  |
| 东兴证券 | 1      | 666,724,149.55   | 12.22%       | 607,582.26   | 12.08%     | -  |
| 德邦证券 | 1      | 390,845,483.53   | 7.16%        | 356,172.85   | 7.08%      | -  |
| 中信证券 | 1      | 322,468,068.74   | 5.91%        | 300,314.94   | 5.97%      | -  |
| 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、本基金本报告期内无新增或剔除交易单元。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 |
| 光大证券 | 26,886,182.48 | 100.00%      | 2,377,000,000.00  | 4.73%          | -    | -            |
| 招商证券 | -             | -            | 9,535,000,000.00  | 18.99%         | -    | -            |
| 东北证券 | -             | -            | 14,714,000,000.00 | 29.30%         | -    | -            |
| 东兴证券 | -             | -            | 18,464,500,000.00 | 36.77%         | -    | -            |
| 德邦证券 | -             | -            | 5,122,000,000.00  | 10.20%         | -    | -            |
| 中信证券 | -             | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 天源证券 | -             | -            | -                 | -              | -    | -            |

## § 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

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 12 月 31 日 | 1,924,927,815.21 | 0.00 | 300,000,000.00 | 1,624,927,815.21 | 97.75% |
| 个人    | -              | -                                 | -                | -    | -              | -                | -      |

|   |   |   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -   | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险  |   |   |   |   |   |   |   |
| <p>本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。</p> <p>本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。</p> |   |   |   |   |   |   |   |

建信基金管理有限责任公司  
2018 年 3 月 28 日