

# 建信多因子量化股票型证券投资基金 2017 年年度报告

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 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>55</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
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.....	65
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	65
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.....	66

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.....	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
8.12 投资组合报告附注.....	66
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>68</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	68
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>69</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>70</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
11.4 基金投资策略的改变.....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
11.8 其他重大事件.....	72
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>74</b>
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.....	74
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>75</b>
13.1 备查文件目录.....	75
13.2 存放地点.....	75
13.3 查阅方式.....	75

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信多因子量化股票型证券投资基金
基金简称	建信多因子量化股票
基金主代码	002952
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月9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	98,857,543.92份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上，力争获取稳定、持续超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用多因子量化型投资策略，综合技术、财务、情绪等多方面指标，精选股票进行投资，优化调整投资组合，力争实现高于业绩基准的投资收益和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为： $85\% \times$ 中证 800 指数收益率 $+15\% \times$ 商业银行活期存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	罗菲菲
	联系电话	010-66228888	010-58560666
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533      010-66228000	95568
传真		010-66228001	010-58560798
注册地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心	北京市西城区复兴门内大街2号

	16 层	
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	100033	100031
法定代表人	许会斌	洪崎

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

## § 3 主要财务指标、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 8 月 9 日 (基金合同生效日)– 2016 年 12 月 31 日	2015 年
本期已实现收益	11,293,414.61	8,413,660.33	-
本期利润	18,538,201.88	-2,156,871.15	-
加权平均基金份额本期利润	0.1093	-0.0073	-
本期加权平均净值利润率	10.79%	-0.72%	-
本期基金份额净值增长率	10.81%	-1.79%	-
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	8,726,955.02	-4,533,049.58	-
期末可供分配基金份额利润	0.0883	-0.0179	-
期末基金资产净值	107,584,498.94	249,086,026.64	-
期末基金份额净值	1.0883	0.9821	-
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	8.83%	-1.79%	-

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	1.10%	0.78%	1.84%	0.65%	-0.74%	0.13%
过去六个月	9.21%	0.75%	6.56%	0.59%	2.65%	0.16%
过去一年	10.81%	0.80%	12.88%	0.55%	-2.07%	0.25%
自基金合同	8.83%	0.78%	14.39%	0.58%	-5.56%	0.20%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

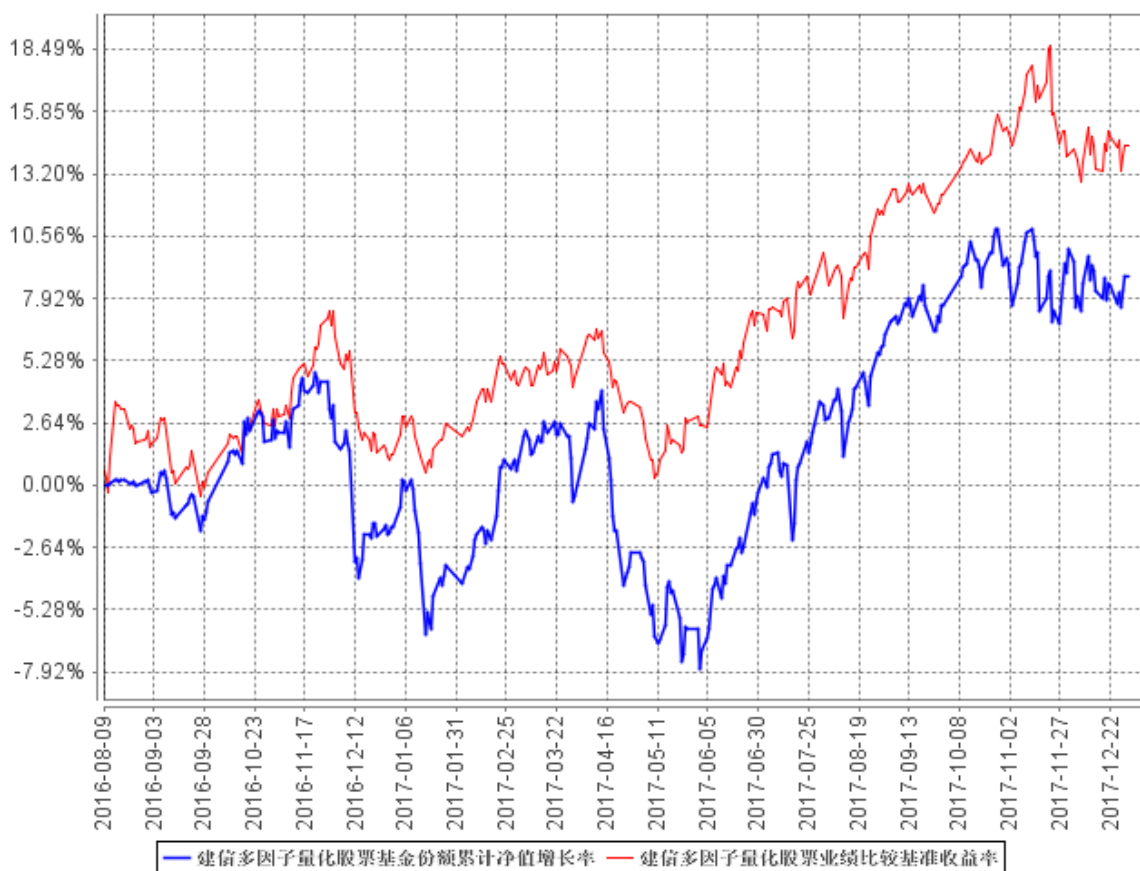
本基金业绩比较基准为： $85\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 15\% \times \text{商业银行活期存款利率（税前）}$ 。

本基金为股票型基金，所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。故在业绩比较基准中给予标的指数收益率 85% 的权重，相应将 15% 作为体现现金或到期日在一年以内的政府债券业绩表现的权重。

本基金选择中证 800 指数作为股票投资部分的业绩比较基准。中证 800 指数编制方法和程序透明、客观，能较好的反映市场的真实情况，在市场代表性、可投资性以及周转率方面能够满足本基金的要求。

### 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

建信多因子量化股票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

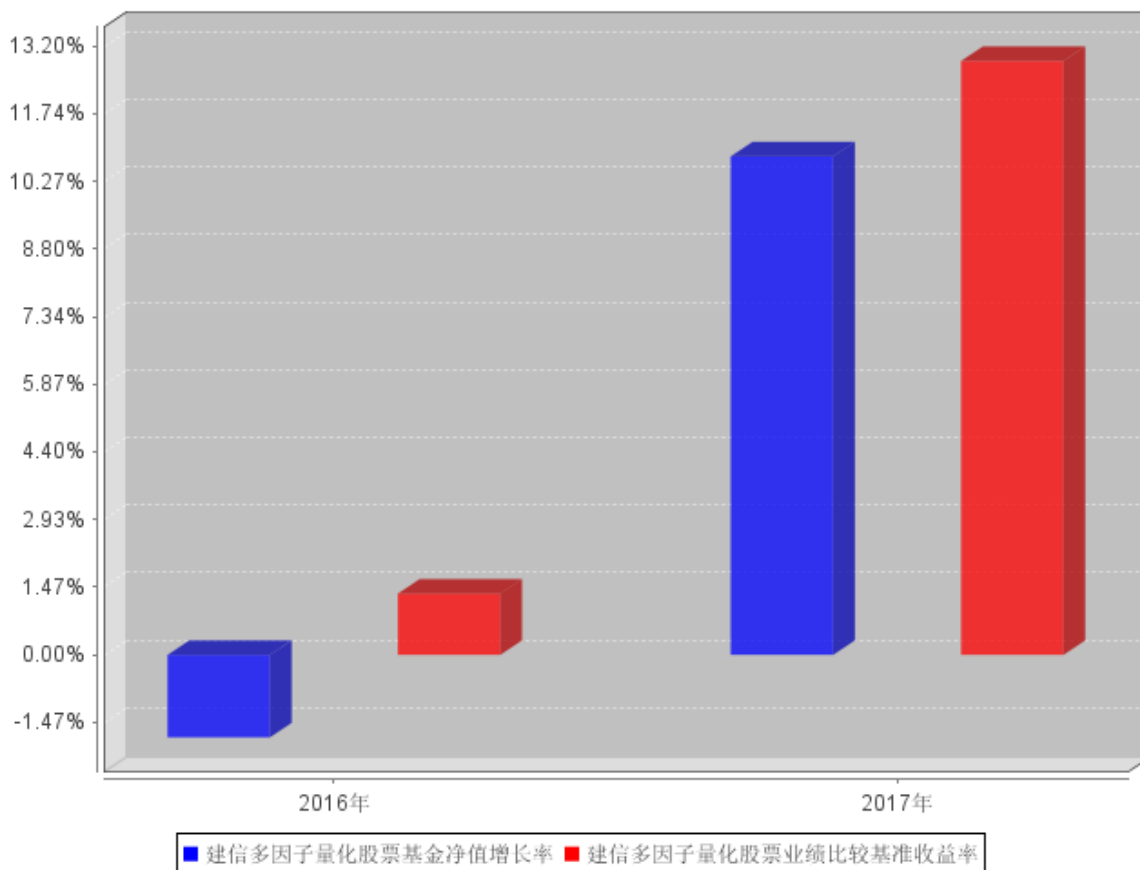


本报告期本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。



### 3.2.3 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

建信多因子量化股票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



本基金基金合同于 2016 年 8 月 9 日生效，基金成立当年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		
叶乐天	金融工程及指数投资部总经理助理、本基金的基金经理	2016年8月9日	-	9	叶乐天先生，金融工程及指数投资部总经理助理，硕士。2008年5月至2011年9月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。2011年9月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理，2012年3月21日至2016年7月20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；2013年3月28日起任建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014年1月27日起任建信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理；2015年8月26日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016年8月9日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017年4月18日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017年5月22日起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；2018年

					1月10日起任建信鑫利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

本基金是采用量化方式管理的主动股票型基金，基金管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型优选个股和风险管理，在 2017 年市场风格比较极端的情况下，坚持量化策略，获取了一定收益。

### 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 10.81%，波动率 0.8%，业绩比较基准收益率 12.88%，波动率 0.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2017 年，个股表现分化极其严重，以上证 50 指数为代表的大盘蓝筹股涨幅超过 20%，然而以创业板指为代表的中小市值股票则下跌较为惨烈，市场整体呈现出明显的“一九分化”行情。同时市场投资者对基本面的关注达到了历史上较高的水平，基本面相对较好的蓝筹龙头股涨幅靠前，而题材股则纷纷下跌。展望 2018 年，我们预计个股的分化仍会持续，但程度应该会略低于 2017 年，同时基本面驱动的逻辑仍将进一步维持，需要更多的进行基本面分析，精选个股。

本基金管理人将坚持量化分析研究，进一步改进量化策略，努力克服市场的波动，力争取得较好的收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司内控合规部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总裁和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施：

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备季度监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由

内控合规部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司年度监察稽核工作计划，实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发违法违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的原则，秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障持有人的合法权益。

#### 4.7 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

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

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 22722 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信多因子量化股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了建信多因子量化股票型证券投资基金(以下简称“建信多因子量化股票基金”)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。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了建信多因子量化股票基金 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于建信多因子量化股票基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>建信多因子量化股票基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重</p>

	<p>大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估建信多因子量化股票基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算建信多因子量化股票基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督建信多因子量化股票基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对建信多因子量化股票基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计</p>

	<p>准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致建信多因子量化股票基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	许康玮   陈熹
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2018 年 3 月 21 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：建信多因子量化股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	5,175,112.29	26,057,373.64
结算备付金		1,675,016.11	4,378,143.17
存出保证金		67,721.71	5,369,957.82
交易性金融资产	7.4.7.2	99,362,841.95	199,526,100.48
其中：股票投资		95,359,342.03	189,539,100.48
基金投资		-	-
债券投资		4,003,499.92	9,987,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	3,000,000.00	15,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	103,187.10	174,155.13
应收股利		-	-
应收申购款		2,893.73	5,284.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		109,386,772.89	250,511,015.15
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4.73	48.30
应付赎回款		75,075.21	18,149.14
应付管理人报酬		138,037.08	321,541.16
应付托管费		23,006.17	53,590.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,146,771.73	833,161.56
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	419,379.03	198,498.16
负债合计		1,802,273.95	1,424,988.51
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	98,857,543.92	253,619,076.22
未分配利润	7.4.7.10	8,726,955.02	-4,533,049.58
所有者权益合计		107,584,498.94	249,086,026.64
负债和所有者权益总计		109,386,772.89	250,511,015.15

报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0883 元，基金份额总额 98,857,543.92 份。

## 7.2 利润表

会计主体：建信多因子量化股票型证券投资基金

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 8 月 9 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		23,961,046.39	1,406,251.01
1. 利息收入		425,096.19	898,476.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	152,646.91	109,000.27
债券利息收入		172,773.30	67,109.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		99,675.98	722,366.81
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		16,013,294.84	10,735,143.41
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,153,407.15	11,222,180.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-4,632.89	-7,485.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	1,304,900.00	-585,960.00
股利收益	7.4.7.16	1,559,620.58	106,408.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	7,244,787.27	-10,570,531.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	277,868.09	343,162.41

<b>减：二、费用</b>		5,422,844.51	3,563,122.16
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,593,761.89	1,772,842.64
2. 托管费	7.4.10.2.2	432,293.66	295,473.79
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,915,968.58	1,272,027.78
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	480,820.38	222,777.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		18,538,201.88	-2,156,871.15
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		18,538,201.88	-2,156,871.15

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信多因子量化股票型证券投资基金

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）	253,619,076.22	-4,533,049.58	249,086,026.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,538,201.88	18,538,201.88
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）	-154,761,532.30	-5,278,197.28	-160,039,729.58
其中：1. 基金申购款	51,376,943.57	3,169,256.10	54,546,199.67
2. 基金赎回款	-206,138,475.87	-8,447,453.38	-214,585,929.25
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）	98,857,543.92	8,726,955.02	107,584,498.94



项目	上年度可比期间 2016年8月9日(基金合同生效日)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)	323,902,958.56	-	323,902,958.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,156,871.15	-2,156,871.15
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)	-70,283,882.34	-2,376,178.43	-72,660,060.77
其中: 1. 基金申购款	37,807,738.42	731,982.74	38,539,721.16
2. 基金赎回款	-108,091,620.76	-3,108,161.17	-111,199,781.93
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)	253,619,076.22	-4,533,049.58	249,086,026.64

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

建信多因子量化股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1526号《关于准予建信多因子量化股票型证券投资基金注册的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信多因子量化股票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323,755,070.01元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第967号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信多因子量化股票型证券投资基金基金合同》于2016年8月9日正式生效,

基金合同生效日的基金份额总额为 323,902,958.56 份基金份额，其中认购资金利息折合 147,888.55 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信多因子量化股票型证券投资基金基金合同》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（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转债（含分离交易可转债）、中期票据、短期融资券等）、货币市场工具、权证、股指期货、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）。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%；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，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金投资股指期货以套期保值为目的，股指期货、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 85% X 中证 800 指数收益率+15% X 商业银行活期存款利率（税前）。

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》、《建信多因子量化股票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 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2016 年 8 月 9 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现

金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 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，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 11 月 13 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价

的一部分确认为估值增值。自 2017 年 11 月 13 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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[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) 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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	5,175,112.29	26,057,373.64
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	5,175,112.29	26,057,373.64

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	98,687,453.24	95,359,342.03	-3,328,111.21
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,001,132.92	4,003,499.92
	银行间市场	-	-



	合计	4,001,132.92	4,003,499.92	2,367.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		102,688,586.16	99,362,841.95	-3,325,744.21
项目		上年度末 2016年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		200,243,779.86	189,539,100.48	-10,704,679.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	10,013,092.10	9,987,000.00	-26,092.10
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,013,092.10	9,987,000.00	-26,092.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		210,256,871.96	199,526,100.48	-10,730,771.48

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	
项目	上年度末 2016年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	24,708,560.00	-	-	
其中：股指期货投资	24,708,560.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	24,708,560.00	-	-	

衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关

的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。于2016年12月31日,本基金持有的股指期货合约情况如下:

金额单位:人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位:手)	合约市值	公允价值变动
IC1701	中证500指数期货 IC1701 合约	20	24,868,800.00	160,240.00
总额合计	-	20	24,868,800.00	160,240.00
减:可抵销期货 暂收款	-	-	-	160,240.00
期货投资净额	-	-	-	-

买入持仓量以正数表示,卖出持仓量以负数表示。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位:人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
买入返售证券	3,000,000.00	-
合计	3,000,000.00	-
项目	上年度末 2016年12月31日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
买入返售证券	15,000,000.00	-
合计	15,000,000.00	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	1,418.74	4,636.53
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,118.95	5,729.11

应收债券利息	97,546.10	151,863.01
应收买入返售证券利息	3,069.87	11,853.44
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	33.44	73.04
合计	103,187.10	174,155.13

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,146,771.73	833,161.56
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,146,771.73	833,161.56

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	144.05	28.20
预提费用	419,234.98	198,469.96
合计	419,379.03	198,498.16

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	253,619,076.22	253,619,076.22
本期申购	51,376,943.57	51,376,943.57
本期赎回(以“-”号填列)	-206,138,475.87	-206,138,475.87
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	98,857,543.92	98,857,543.92

申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,808,138.46	-11,341,188.04	-4,533,049.58
本期利润	11,293,414.61	7,244,787.27	18,538,201.88
本期基金份额交易产生的变动数	-5,076,771.62	-201,425.66	-5,278,197.28
其中：基金申购款	2,123,125.90	1,046,130.20	3,169,256.10
基金赎回款	-7,199,897.52	-1,247,555.86	-8,447,453.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,024,781.45	-4,297,826.43	8,726,955.02

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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8月9日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	100,190.80	84,112.44
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	49,858.07	23,669.91
其他	2,598.04	1,217.92
合计	152,646.91	109,000.27

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年8月9日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	670,439,298.37	356,370,662.13

减：卖出股票成本总额	657,285,891.22	345,148,482.12
买卖股票差价收入	13,153,407.15	11,222,180.01

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年8月9日(基金合 同生效日)至2016年12月 31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	-4,632.89	-7,485.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-4,632.89	-7,485.00

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年8月9日(基金合 同生效日)至2016年12月 31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	20,394,570.88	10,119,069.79
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	20,047,091.04	10,012,500.00
减：应收利息总额	352,112.73	114,054.79
买卖债券差价收入	-4,632.89	-7,485.00

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2016年8月9日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
股指期货投资收益	1,304,900.00	-585,960.00
其他	-	-
合计	1,304,900.00	-585,960.00

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年8月9日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,559,620.58	106,408.40
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,559,620.58	106,408.40

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年8月9日(基金合同 生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	7,405,027.27	-10,730,771.48
——股票投资	7,376,568.17	-10,704,679.38
——债券投资	28,459.10	-26,092.10
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-160,240.00	160,240.00
——权证投资	-	-
——股指期货投资	-160,240.00	160,240.00
3. 其他	-	-
合计	7,244,787.27	-10,570,531.48

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年8月9日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
基金赎回费收入	275,557.88	343,016.50
基金转换费收入	2,310.21	145.91
合计	277,868.09	343,162.41

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 3 个月但小于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 25% 归入基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中对于持有期少于 30 日的转出基金份额所收取的赎回费，将赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日但少于 3 个月的转出基金份额所收取的赎回费，将赎回费用 75% 归入基金财产；对于持有期长于 3 个月但小于 6 个月的转出基金份额所收取的赎回费，将赎回费用 50% 归入基金财产；对于持有期长于 6 个月的转出基金份额所收取的赎回费，将赎回费用 25% 归入基金财产。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年8月9日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	1,915,968.58	1,272,027.78
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,915,968.58	1,272,027.78

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年8月9日(基金合同生 效日)至2016年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	400,000.00	158,469.96
银行汇划费用	2,820.38	2,407.99
银行间账户维护费	18,000.00	1,500.00
其他	-	400.00
合计	480,820.38	222,777.95

**7.4.7.21 分部报告**

无。

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

无。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**7.4.9 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、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年8月9日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,593,761.89	1,772,842.64
其中：支付销售机构的客户维护费	1,220,282.21	990,999.65

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 1.50% 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 1.50% / 当年天数。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 8 月 9 日(基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	432,293.66	295,473.79

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 0.25% 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。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 8 月 9 日(基金合同生效日)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	5,175,112.29	100,190.80	26,057,373.64	84,112.44

本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按约定利率计息。

**7.4.10.6 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。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

无。

**7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128028	赣锋转债	2017年12月21日	2018年1月19日	新发未上市	100.00	100.00	123	12,299.92	12,299.92	-

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300116	坚瑞沃能	2017年12月18日	重大资产重组	7.62	-	-	163,800	1,441,727.85	1,248,156.00	-
002260	德奥通航	2017年12月5日	重大资产重组	11.96	-	-	69,351	883,549.74	829,437.96	-
000006	深振业A	2017年9月11日	重大资产重组	9.85	-	-	65,200	543,395.00	642,220.00	-
600309	万华化学	2017年12月5日	重大资产重组	37.94	-	-	15,660	365,380.98	594,140.40	-
300156	神雾环保	2017年7月17日	重大资产重组	23.69	2018年1月17日	21.74	16,500	421,381.94	390,885.00	-
000820	神雾节能	2017年7月17日	重大资产重组	28.96	2018年1月17日	26.06	11,600	379,828.00	335,936.00	-
300364	中文在线	2017年12月28日	重大事项	9.23	2018年1月5日	10.00	29,800	294,953.00	275,054.00	-
300424	航新科技	2017年12月28日	重大事项	23.43	-	-	10,691	237,650.93	250,490.13	-

300040	九洲电气	2017年12月18日	重大事项	9.67	2018年1月2日	9.67	25,300	261,108.00	244,651.00	-
600525	长园集团	2017年12月25日	重大事项	15.79	2018年1月10日	17.30	10,400	202,136.00	164,216.00	-
601313	江南嘉捷	2017年12月22日	重大资产重组	45.97	2018年1月2日	49.00	1,719	20,310.95	79,022.43	-
600734	实达集团	2017年12月20日	重大资产重组	9.40	-	-	5,600	64,240.32	52,640.00	-
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	-
002711	欧浦智网	2017年12月13日	重大事项	10.76	2018年1月11日	10.80	1,700	22,213.14	18,292.00	-
300086	康芝药业	2017年12月6日	重大资产重组	10.80	-	-	500	6,138.79	5,400.00	-

1. 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。

2. 根据江南嘉捷电梯股份有限公司 2018 年 2 月 2 日发布的《关于拟变更公司证券代码和证券简称的提示性公告》，江南嘉捷电梯股份有限公司第四届董事会第十三次会议审议通过了《关于变更公司证券代码和证券简称的议案》，同意江南嘉捷电梯股份有限公司证券代码由“601313”申请变更为“601360”；证券简称由“江南嘉捷”变更为“三六零”。新证券代码和证券简称启用日期为 2018 年 2 月 28 日。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、内控合规部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和内控合规部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按信用评级列示的债券投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债和同业存单以外的债券。

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
A-1	0.0	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

**7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	12,299.92	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	12,299.92	0.00

以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据及同业存单等。

**7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除 7.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%,本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2017 年 12 月 31 日,本基金主动持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例未超过 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内未发生重大流动性风险事件。



#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,175,112.29	0.00	-	-	5,175,112.29
结算备付金	1,675,016.11	-	-	-	1,675,016.11
存出保证金	67,721.71	-	-	-	67,721.71
交易性金融资产	3,991,200.00	0.00	12,299.92	95,359,342.03	99,362,841.95
衍生金融资产	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	3,000,000.00	0.00	-	-	3,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	103,187.10	103,187.10
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	2,893.73	2,893.73
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	13,909,050.11	0.00	12,299.92	95,465,422.86	109,386,772.89
负债					
卖出回购金融	0.00	0.00	-	-	0.00

资产款					
短期借款	-	-	-	-	0.00
交易性金融负债	-	-	-	-	0.00
衍生金融负债	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	4.73	4.73
应付赎回款	-	-	-	75,075.21	75,075.21
应付管理人报酬	-	-	-	138,037.08	138,037.08
应付托管费	-	-	-	23,006.17	23,006.17
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	1,146,771.73	1,146,771.73
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	419,379.03	419,379.03
负债总计	0.00	0.00	0.00	1,802,273.95	1,802,273.95
利率敏感度缺口	13,909,050.11	0.00	12,299.92	93,663,148.91	107,584,498.94
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	26,057,373.64	-	-	-	26,057,373.64
结算备付金	4,378,143.17	-	-	-	4,378,143.17
存出保证金	5,369,957.82	-	-	-	5,369,957.82
交易性金融资产	9,987,000.00	0.00	0.00	189,539,100.48	199,526,100.48
衍生金融资产	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	15,000,000.00	-	-	-	15,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	174,155.13	174,155.13
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,284.91	5,284.91
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	60,792,474.63	0.00	0.00	189,718,540.52	250,511,015.15
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-

交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	48.30	48.30
应付赎回款	-	-	-	18,149.14	18,149.14
应付管理人报酬	-	-	-	321,541.16	321,541.16
应付托管费	-	-	-	53,590.19	53,590.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	833,161.56	833,161.56
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	198,498.16	198,498.16
负债总计	0.00	0.00	0.00	1,424,988.51	1,424,988.51
利率敏感度缺口	60,792,474.63	0.00	0.00	188,293,552.01	249,086,026.64

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-2,915.44	-8,475.22
	市场利率下降25个基点	2,919.70	8,502.68

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金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（含中小板股票、创业板股票，以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规和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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%；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，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金投资股指期货以套期保值为目的，股指期货、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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	95,359,342.03	88.64	189,539,100.48	76.09
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	4,003,499.92	3.72	9,987,000.00	4.01
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	99,362,841.95	92.36	199,526,100.48	80.10

**7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	6,371,461.42	0.00
	业绩比较基准下降 5%	-6,371,461.42	0.00

**7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

无。

**7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

## (1) 公允价值

## (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 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 90,117,189.36 元，属于第二层次的余额为 9,245,652.59 元，无属于第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次 177,961,655.22 元，第二层次 21,564,445.26 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	95,359,342.03	87.18
	其中：股票	95,359,342.03	87.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,003,499.92	3.66
	其中：债券	4,003,499.92	3.66
	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	3,000,000.00	2.74
	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	6,850,128.40	6.26
8	其他各项资产	173,802.54	0.16
9	合计	109,386,772.89	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	1,060,486.00	0.99
B	采矿业	3,022,219.24	2.81
C	制造业	55,309,214.30	51.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,533,208.68	1.43
E	建筑业	2,472,460.12	2.30
F	批发和零售业	6,228,005.19	5.79
G	交通运输、仓储和邮政业	2,371,541.63	2.20
H	住宿和餐饮业	171,150.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,125,311.55	5.69
J	金融业	5,855,859.62	5.44

K	房地产业	5,858,539.76	5.45
L	租赁和商务服务业	226,896.74	0.21
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,920,663.20	2.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	30,706.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	1,853,400.00	1.72
S	综合	319,680.00	0.30
	合计	95,359,342.03	88.64

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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300184	力源信息	164,737	1,868,117.58	1.74
2	300266	兴源环境	68,800	1,857,600.00	1.73
3	601166	兴业银行	93,200	1,583,468.00	1.47
4	002415	海康威视	36,400	1,419,600.00	1.32
5	601318	中国平安	20,000	1,399,600.00	1.30
6	600017	日照港	342,300	1,328,124.00	1.23
7	300116	坚瑞沃能	163,800	1,248,156.00	1.16
8	000951	中国重汽	70,520	1,229,163.60	1.14
9	600519	贵州茅台	1,700	1,185,733.00	1.10
10	300136	信维通信	23,211	1,176,797.70	1.09
11	600161	天坛生物	38,840	1,118,203.60	1.04
12	000651	格力电器	25,100	1,096,870.00	1.02
13	600511	国药股份	38,500	1,070,300.00	0.99
14	000090	天健集团	105,903	1,063,266.12	0.99
15	601225	陕西煤业	129,300	1,055,088.00	0.98
16	300232	洲明科技	73,029	1,044,314.70	0.97
17	000333	美的集团	18,200	1,008,826.00	0.94
18	600325	华发股份	135,400	996,544.00	0.93
19	000060	中金岭南	84,300	941,631.00	0.88



20	002567	唐人神	120,500	932,670.00	0.87
21	600104	上汽集团	29,100	932,364.00	0.87
22	601398	工商银行	143,200	887,840.00	0.83
23	600260	凯乐科技	28,935	842,297.85	0.78
24	000528	柳工	97,900	835,087.00	0.78
25	002260	德奥通航	69,351	829,437.96	0.77
26	600743	华远地产	225,000	823,500.00	0.77
27	601006	大秦铁路	90,009	816,381.63	0.76
28	300094	国联水产	111,880	777,566.00	0.72
29	600887	伊利股份	24,100	775,779.00	0.72
30	000426	兴业矿业	77,200	758,876.00	0.71
31	300297	蓝盾股份	78,800	751,752.00	0.70
32	002648	卫星石化	44,200	733,720.00	0.68
33	600516	方大炭素	24,900	719,112.00	0.67
34	000423	东阿阿胶	11,900	717,213.00	0.67
35	002408	齐翔腾达	55,300	701,204.00	0.65
36	601601	中国太保	16,500	683,430.00	0.64
37	600406	国电南瑞	37,257	681,057.96	0.63
38	002365	永安药业	20,555	680,164.95	0.63
39	002304	洋河股份	5,900	678,500.00	0.63
40	002460	赣锋锂业	9,300	667,275.00	0.62
41	600755	厦门国贸	65,400	660,540.00	0.61
42	002146	荣盛发展	69,300	660,429.00	0.61
43	000006	深振业A	65,200	642,220.00	0.60
44	600282	南钢股份	131,500	636,460.00	0.59
45	300083	劲胜智能	83,800	636,042.00	0.59
46	300122	智飞生物	22,600	634,382.00	0.59
47	000069	华侨城A	73,200	621,468.00	0.58
48	002092	中泰化学	45,500	605,605.00	0.56
49	000822	山东海化	65,900	596,395.00	0.55
50	600633	浙数文化	39,100	594,320.00	0.55
51	600309	万华化学	15,660	594,140.40	0.55
52	002195	二三四五	98,500	575,240.00	0.53
53	000895	双汇发展	21,700	575,050.00	0.53
54	300338	开元股份	26,583	571,002.84	0.53
55	300219	鸿利智汇	50,700	569,361.00	0.53
56	002572	索菲亚	15,300	563,040.00	0.52
57	600308	华泰股份	89,426	561,595.28	0.52
58	601988	中国银行	139,100	552,227.00	0.51

59	300298	三诺生物	27,400	544,712.00	0.51
60	601801	皖新传媒	51,300	542,754.00	0.50
61	300036	超图软件	34,200	528,048.00	0.49
62	000036	华联控股	56,900	514,376.00	0.48
63	002230	科大讯飞	8,600	508,604.00	0.47
64	600409	三友化工	52,900	507,311.00	0.47
65	000933	神火股份	48,700	494,305.00	0.46
66	002241	歌尔股份	28,400	492,740.00	0.46
67	000959	首钢股份	80,700	482,586.00	0.45
68	300294	博雅生物	16,100	482,195.00	0.45
69	002564	天沃科技	58,400	478,880.00	0.45
70	002376	新北洋	43,000	477,730.00	0.44
71	600566	济川药业	12,500	476,875.00	0.44
72	000898	鞍钢股份	74,400	472,440.00	0.44
73	600529	山东药玻	21,200	469,792.00	0.44
74	600240	华业资本	53,900	462,462.00	0.43
75	601668	中国建筑	51,000	460,020.00	0.43
76	002164	宁波东力	53,100	455,598.00	0.42
77	000066	中国长城	62,400	454,896.00	0.42
78	000605	渤海股份	25,400	452,628.00	0.42
79	300115	长盈精密	22,300	447,561.00	0.42
80	300100	双林股份	28,500	446,310.00	0.41
81	300309	吉艾科技	20,800	444,496.00	0.41
82	600693	东百集团	42,500	436,050.00	0.41
83	603799	华友钴业	5,400	433,242.00	0.40
84	300393	中来股份	12,400	432,760.00	0.40
85	002334	英威腾	50,900	432,650.00	0.40
86	300065	海兰信	23,700	431,814.00	0.40
87	000002	万科A	13,900	431,734.00	0.40
88	002322	理工环科	22,800	428,184.00	0.40
89	000756	新华制药	29,900	418,600.00	0.39
90	300288	朗玛信息	17,300	412,432.00	0.38
91	300296	利亚德	21,100	411,239.00	0.38
92	300070	碧水源	23,500	408,195.00	0.38
93	600452	涪陵电力	11,926	407,630.68	0.38
94	002203	海亮股份	52,200	407,160.00	0.38
95	600067	冠城大通	62,400	406,848.00	0.38
96	300366	创意信息	33,300	400,266.00	0.37
97	000028	国药一致	6,600	397,650.00	0.37

98	300230	永利股份	28,080	392,558.40	0.36
99	002128	露天煤业	35,400	392,232.00	0.36
100	300156	神雾环保	16,500	390,885.00	0.36
101	600392	盛和资源	20,500	389,500.00	0.36
102	300289	利德曼	42,003	386,427.60	0.36
103	600522	中天科技	27,700	386,138.00	0.36
104	002589	瑞康医药	28,100	377,945.00	0.35
105	603108	润达医疗	30,780	377,055.00	0.35
106	002008	大族激光	7,600	375,440.00	0.35
107	002614	奥佳华	19,338	374,190.30	0.35
108	000997	新大陆	20,800	372,944.00	0.35
109	600549	厦门钨业	14,200	365,508.00	0.34
110	600422	昆药集团	39,900	365,085.00	0.34
111	000703	恒逸石化	16,900	364,533.00	0.34
112	300148	天舟文化	41,400	340,308.00	0.32
113	002536	西泵股份	23,300	338,083.00	0.31
114	000820	神雾节能	11,600	335,936.00	0.31
115	600628	新世界	32,633	331,877.61	0.31
116	000830	鲁西化工	20,600	327,952.00	0.30
117	600958	东方证券	23,442	324,906.12	0.30
118	600141	兴发集团	19,000	321,100.00	0.30
119	600777	新潮能源	86,400	319,680.00	0.30
120	300157	恒泰艾普	33,400	304,608.00	0.28
121	000639	西王食品	16,000	304,000.00	0.28
122	002515	金字火腿	36,200	299,374.00	0.28
123	600068	葛洲坝	35,900	294,380.00	0.27
124	002174	游族网络	12,900	287,670.00	0.27
125	300451	创业软件	13,300	287,546.00	0.27
126	000786	北新建材	12,700	285,750.00	0.27
127	000998	隆平高科	11,000	282,920.00	0.26
128	300145	中金环境	23,400	279,630.00	0.26
129	000915	山大华特	9,200	277,288.00	0.26
130	300364	中文在线	29,800	275,054.00	0.26
131	600874	创业环保	21,000	273,210.00	0.25
132	601818	光大银行	67,400	272,970.00	0.25
133	600196	复星医药	6,100	271,450.00	0.25
134	601088	中国神华	11,700	271,089.00	0.25
135	000517	荣安地产	75,702	255,872.76	0.24
136	600642	申能股份	43,200	253,152.00	0.24

137	300424	航新科技	10,691	250,490.13	0.23
138	000676	智度股份	22,192	246,775.04	0.23
139	600690	青岛海尔	13,044	245,748.96	0.23
140	300040	九洲电气	25,300	244,651.00	0.23
141	002094	青岛金王	13,700	240,983.00	0.22
142	300072	三聚环保	6,800	238,884.00	0.22
143	000525	红太阳	11,600	233,972.00	0.22
144	000709	河钢股份	58,000	226,200.00	0.21
145	000538	云南白药	2,200	223,938.00	0.21
146	600340	华夏幸福	7,000	219,730.00	0.20
147	601238	广汽集团	8,828	217,698.48	0.20
148	000970	中科三环	15,100	217,138.00	0.20
149	002544	杰赛科技	13,600	213,928.00	0.20
150	002555	三七互娱	10,400	213,616.00	0.20
151	601800	中国交建	16,400	209,920.00	0.20
152	300124	汇川技术	7,200	208,944.00	0.19
153	300014	亿纬锂能	10,400	203,944.00	0.19
154	600660	福耀玻璃	7,000	203,000.00	0.19
155	000965	天保基建	35,400	202,488.00	0.19
156	000402	金融街	17,300	192,203.00	0.18
157	000596	古井贡酒	2,900	190,443.00	0.18
158	300463	迈克生物	7,900	189,363.00	0.18
159	600188	兖州煤业	13,012	188,934.24	0.18
160	600415	小商品城	32,200	186,116.00	0.17
161	002916	深南电路	2,109	183,968.07	0.17
162	000049	德赛电池	4,600	182,114.00	0.17
163	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.17
164	601012	隆基股份	4,900	178,556.00	0.17
165	300237	美晨生态	10,400	173,368.00	0.16
166	002508	老板电器	3,600	173,160.00	0.16
167	000524	岭南控股	15,000	171,150.00	0.16
168	002434	万里扬	15,800	165,900.00	0.15
169	002410	广联达	8,400	164,640.00	0.15
170	600525	长园集团	10,400	164,216.00	0.15
171	002449	国星光电	9,400	162,808.00	0.15
172	300209	天泽信息	8,800	160,864.00	0.15
173	002091	江苏国泰	17,400	156,078.00	0.15
174	000848	承德露露	16,400	155,144.00	0.14
175	600191	华资实业	20,800	152,256.00	0.14

176	600291	西水股份	6,400	150,528.00	0.14
177	600085	同仁堂	4,655	150,077.20	0.14
178	600563	法拉电子	2,900	147,349.00	0.14
179	300003	乐普医疗	5,800	140,128.00	0.13
180	600507	方大特钢	11,000	139,590.00	0.13
181	600808	马钢股份	32,300	133,399.00	0.12
182	600160	巨化股份	12,500	132,875.00	0.12
183	002271	东方雨虹	3,300	131,868.00	0.12
184	300024	机器人	7,000	131,740.00	0.12
185	600550	保变电气	19,500	121,680.00	0.11
186	600535	天士力	3,400	120,972.00	0.11
187	600580	卧龙电气	14,700	117,747.00	0.11
188	000625	长安汽车	9,300	117,180.00	0.11
189	600966	博汇纸业	19,400	116,400.00	0.11
190	000666	经纬纺机	5,900	114,578.00	0.11
191	300089	文化长城	10,400	108,160.00	0.10
192	600477	杭萧钢构	10,000	106,700.00	0.10
193	002419	天虹股份	6,900	105,294.00	0.10
194	600310	桂东电力	20,200	104,434.00	0.10
195	300201	海伦哲	14,538	103,219.80	0.10
196	600585	海螺水泥	3,500	102,655.00	0.10
197	600020	中原高速	21,000	102,060.00	0.09
198	600551	时代出版	8,600	100,964.00	0.09
199	002080	中材科技	3,700	97,495.00	0.09
200	000400	许继电气	7,300	96,287.00	0.09
201	000050	深天马 A	4,800	94,608.00	0.09
202	002636	金安国纪	5,900	93,397.00	0.09
203	600528	中铁工业	7,600	92,264.00	0.09
204	002416	爱施德	9,700	91,859.00	0.09
205	600782	新钢股份	13,900	91,462.00	0.09
206	002503	搜于特	16,500	91,410.00	0.08
207	002136	安纳达	6,400	91,136.00	0.08
208	002640	跨境通	4,700	89,958.00	0.08
209	000701	厦门信达	8,400	84,168.00	0.08
210	601313	江南嘉捷	1,719	79,022.43	0.07
211	600372	中航电子	5,700	78,033.00	0.07
212	002530	金财互联	3,200	76,992.00	0.07
213	002441	众业达	7,500	74,625.00	0.07
214	603589	口子窖	1,600	73,680.00	0.07

215	300415	伊之密	4,100	70,889.00	0.07
216	002310	东方园林	3,400	68,578.00	0.06
217	600031	三一重工	7,500	68,025.00	0.06
218	002601	龙蟠佰利	4,200	67,284.00	0.06
219	002373	千方科技	4,500	65,925.00	0.06
220	300324	旋极信息	4,500	65,835.00	0.06
221	002440	闰土股份	3,300	64,977.00	0.06
222	600326	西藏天路	6,300	64,638.00	0.06
223	000716	黑芝麻	11,000	61,600.00	0.06
224	002040	南京港	4,800	60,528.00	0.06
225	600110	诺德股份	6,400	60,416.00	0.06
226	000963	华东医药	1,100	59,268.00	0.06
227	002385	大北农	8,700	52,722.00	0.05
228	600734	实达集团	5,600	52,640.00	0.05
229	002217	合力泰	5,200	52,000.00	0.05
230	600050	中国联通	8,200	51,906.00	0.05
231	000552	靖远煤电	14,600	51,392.00	0.05
232	002372	伟星新材	2,800	50,344.00	0.05
233	000039	中集集团	2,100	47,985.00	0.04
234	600280	中央商场	6,000	47,220.00	0.04
235	600717	天津港	4,400	46,156.00	0.04
236	002562	兄弟科技	2,700	44,172.00	0.04
237	002038	双鹭药业	1,400	43,358.00	0.04
238	002812	创新股份	400	41,160.00	0.04
239	300269	联建光电	3,201	40,780.74	0.04
240	002019	亿帆医药	1,800	40,050.00	0.04
241	600201	生物股份	1,260	39,992.40	0.04
242	600665	天地源	9,300	39,711.00	0.04
243	000877	天山股份	3,800	39,520.00	0.04
244	000338	潍柴动力	4,600	38,364.00	0.04
245	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.04
246	300730	科创信息	821	34,112.55	0.03
247	002479	富春环保	3,500	33,985.00	0.03
248	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.03
249	300197	铁汉生态	2,600	31,590.00	0.03
250	300244	迪安诊断	1,300	30,706.00	0.03
251	002611	东方精工	2,300	30,199.00	0.03
252	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.03
253	000726	鲁泰A	2,600	28,470.00	0.03

254	600210	紫江企业	5,300	25,228.00	0.02
255	300274	阳光电源	1,300	24,401.00	0.02
256	300308	中际旭创	400	23,400.00	0.02
257	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.02
258	002711	欧浦智网	1,700	18,292.00	0.02
259	002923	润都股份	954	16,227.54	0.02
260	002025	航天电器	700	15,799.00	0.01
261	601100	恒立液压	500	13,720.00	0.01
262	300183	东软载波	700	13,454.00	0.01
263	600600	青岛啤酒	300	11,799.00	0.01
264	300017	网宿科技	1,100	11,704.00	0.01
265	300684	中石科技	827	11,528.38	0.01
266	601588	北辰实业	1,800	10,422.00	0.01
267	002913	奥士康	211	10,121.67	0.01
268	002918	蒙娜丽莎	175	9,747.50	0.01
269	002911	佛燃股份	300	8,169.00	0.01
270	300086	康芝药业	500	5,400.00	0.01
271	002917	金奥博	128	4,185.60	0.00
272	002909	集泰股份	59	1,296.23	0.00
273	000888	峨眉山 A	100	1,077.00	0.00
274	002142	宁波银行	50	890.50	0.00

## 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	002457	青龙管业	5,485,640.76	2.20
2	601328	交通银行	4,951,207.00	1.99
3	601318	中国平安	4,831,312.00	1.94
4	300384	三联虹普	4,635,907.20	1.86
5	601398	工商银行	4,256,454.00	1.71
6	600519	贵州茅台	4,193,273.08	1.68
7	002671	龙泉股份	4,035,752.66	1.62
8	002305	南国置业	3,993,573.80	1.60

9	000936	华西股份	3,908,557.46	1.57
10	600186	莲花健康	3,884,904.16	1.56
11	000061	农产品	3,773,149.00	1.51
12	300241	瑞丰光电	3,738,797.92	1.50
13	603198	迎驾贡酒	3,705,052.32	1.49
14	000725	京东方A	3,606,069.00	1.45
15	600067	冠城大通	3,456,354.58	1.39
16	600805	悦达投资	3,454,732.00	1.39
17	000421	南京公用	3,360,272.01	1.35
18	002567	唐人神	3,349,323.50	1.34
19	000023	深天地A	3,117,703.23	1.25
20	601128	常熟银行	3,110,805.00	1.25

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	601318	中国平安	9,687,166.60	3.89
2	002457	青龙管业	9,418,938.04	3.78
3	600036	招商银行	6,794,025.60	2.73
4	600984	建设机械	6,708,830.20	2.69
5	600186	莲花健康	6,012,732.01	2.41
6	002080	中材科技	5,822,835.70	2.34
7	002172	澳洋科技	5,781,914.07	2.32
8	600075	新疆天业	5,571,195.03	2.24
9	300141	和顺电气	5,410,473.46	2.17
10	601313	江南嘉捷	5,399,912.86	2.17
11	002305	南国置业	5,396,455.47	2.17
12	600291	西水股份	5,128,013.57	2.06
13	002108	沧州明珠	5,124,592.24	2.06
14	603011	合锻智能	5,084,660.79	2.04
15	002441	众业达	5,003,583.91	2.01
16	600900	长江电力	4,989,883.56	2.00
17	601328	交通银行	4,924,102.00	1.98
18	300384	三联虹普	4,694,129.10	1.88
19	000725	京东方A	4,676,530.00	1.88



20	002001	新和成	4,615,504.59	1.85
----	--------	-----	--------------	------

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	555,709,749.35
卖出股票收入（成交）总额	670,439,298.37

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	3,991,200.00	3.71
	其中：政策性金融债	3,991,200.00	3.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	12,299.92	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,003,499.92	3.72

### 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	108601	国开 1703	40,000	3,991,200.00	3.71
2	128028	赣锋转债	123	12,299.92	0.01

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的、与业绩基准相关度较高的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效控制风险并力争超越业绩基准的目的。

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

## 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

2017 年 12 月 28 日，河南银监局（豫银监罚决字（2017）13 号）对兴业银行股份有限公司郑州分行因违反国家规定从事投资业务的违法行为，没收违法所得 6588.246 万元，并处 1 倍罚

款，罚没合计 13176.492 万元；对兴业银行股份有限公司郑州分行严重违反审慎经营规则的违法行为罚款 50 万元。

#### 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	67,721.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	103,187.10
5	应收申购款	2,893.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	173,802.54

#### 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

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	300116	坚瑞沃能	1,248,156.00	1.16	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
1,912	51,703.74	39,224,613.40	39.68%	59,632,930.52	60.32%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	77,773.49	0.08%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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（2016年8月9日）基金份额总额	323,902,958.56
本报告期期初基金份额总额	253,619,076.22
本报告期基金总申购份额	51,376,943.57
减:本报告期基金总赎回份额	206,138,475.87
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	98,857,543.92

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 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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
光大证券		2675,428,836.35	55.34%	621,381.56	55.15%	-
招商证券		2452,682,710.57	37.09%	421,208.07	37.38%	-
东北证券	1	49,752,520.52	4.08%	45,343.57	4.02%	-
德邦证券	1	42,617,310.54	3.49%	38,848.86	3.45%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	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	29,278,113.59	99.95%	101,000,000.00	77.69%	-	-
招商证券	14,406.00	0.05%	3,000,000.00	2.31%	-	-
东北证券	-	-	26,000,000.00	20.00%	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	建信基金管理有限责任公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2017年12月5日
2	建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2017年9月29日
3	关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2017年9月1日
4	建信基金管理有限责任公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2017年6月12日
5	建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加交	指定报刊和/或公司网站	2017年4月24日



	通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告		
6	关于新增华融证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2017 年 4 月 20 日
7	关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2017 年 2 月 23 日
8	关于旗下部分开放式基金参加凤凰金信转换费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2017 年 2 月 21 日
9	关于新增渤海银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2017 年 2 月 18 日
10	关于新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2017 年 1 月 17 日

## §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

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 09 月 14 日-2017 年 12 月 31 日	0.00	39,224,613.40	0.00	39,224,613.40	39.68%
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>							

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信多因子量化股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信多因子量化股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信多因子量化股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信多因子量化股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2018年3月28日