

建信社会责任混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 26 日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 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 2018 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	建信社会责任混合
基金主代码	530019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 8 月 14 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,949,139.52 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	采用自上而下的资产配置和自下而上的股票选择相结合的投资策略，本基金在长期价值投资理念的基础上，坚持社会责任投资，重点考察企业社会责任的履行，立足企业基本面，努力实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数收益率+25%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	贺倩
	联系电话	010-66228888	010-66060069
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95599
传真		010-66228001	010-68121816

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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-5,770,589.34	1,616,913.43	-2,602,809.38
本期利润	-7,282,706.00	3,382,993.80	-3,904,201.15
加权平均基金份额本期利润	-0.5247	0.2128	-0.2041
本期基金份额净值增长率	-24.65%	10.70%	-9.88%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.6293	1.1624	0.9528
期末基金资产净值	22,726,763.80	31,333,597.93	33,646,999.57
期末基金份额净值	1.629	2.162	1.953

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	-8.12%	1.42%	-8.58%	1.22%	0.46%	0.20%
过去六个月	-16.12%	1.33%	-9.66%	1.12%	-6.46%	0.21%
过去一年	-24.65%	1.24%	-17.43%	1.00%	-7.22%	0.24%
过去三年	-24.83%	1.25%	-12.00%	0.88%	-12.83%	0.37%
过去五年	34.85%	1.62%	33.52%	1.15%	1.33%	0.47%
自基金合同生效起至今	62.90%	1.52%	32.66%	1.12%	30.24%	0.40%

本基金投资业绩比较基准为 75%×沪深 300 指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。本基金为股票型证券投资基金，股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，故本基金采取 75%作为复合业绩

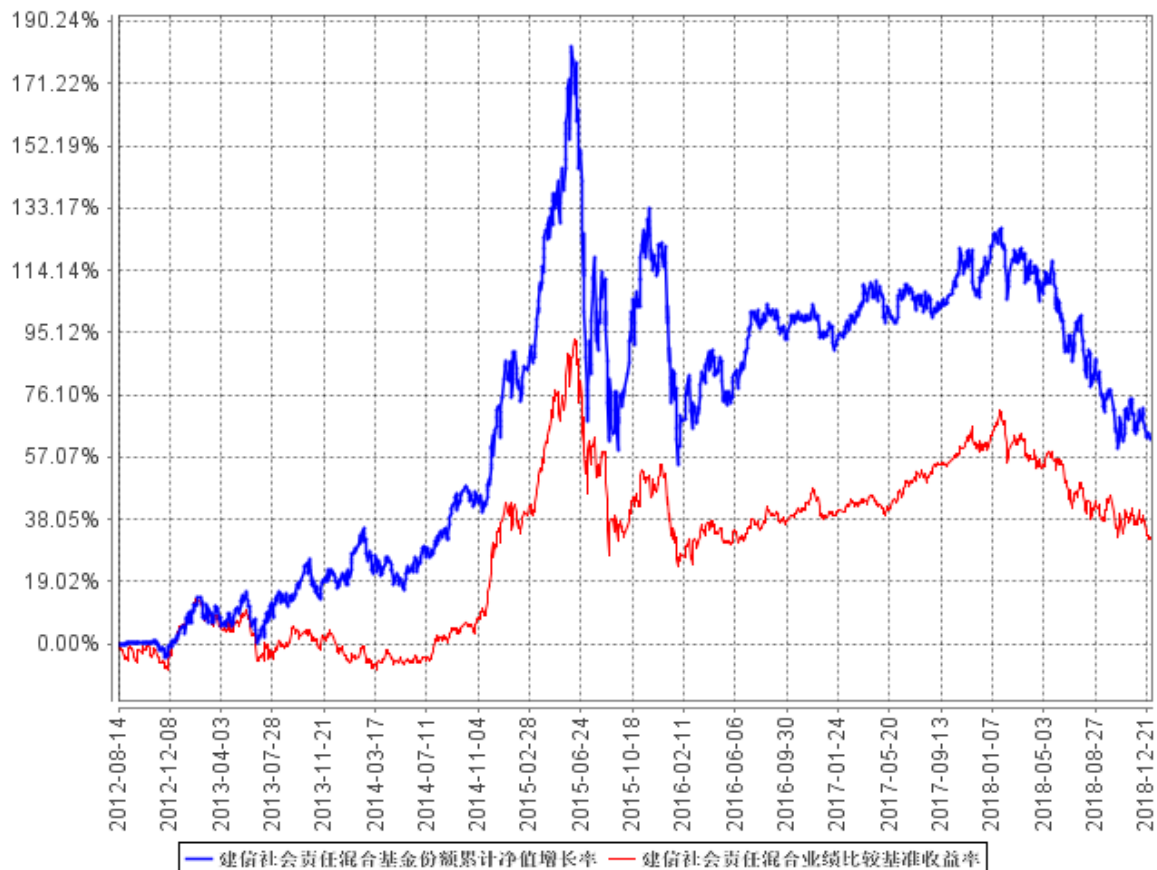
比较基准中衡量股票投资部分业绩表现的权重，相应将 25%作为衡量债券投资部分业绩表现的权重。

沪深 300 指数是由中证指数公司编制的，从上海和深圳股票市场中选取的 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。该指数样本覆盖了沪深市场七成左右的流通市值和超过四分之三的总市值，是具有良好的市场代表性、能够反映 A 股市场整体走势的指数。沪深 300 指数中的很多成份股本身即为业绩优良的蓝筹品种，以其为标的的指数期货也已经推出，从而会为本基金带来新的投资机会和风险管理手段。因此，基金管理人选择沪深 300 指数作为本基金股票部分的比较基准。

中国债券总指数的发布主体是中央国债登记结算有限责任公司。中央国债登记结算公司是全国债券市场内提供国债、金融债券、企业债券和其他固定收益证券的登记、托管、交易结算等服务的国有独资金融机构，是财政部唯一授权主持建立、运营全国国债托管系统的机构，是中国人民银行指定的全国银行间债券市场债券登记、托管、结算机构和商业银行柜台记账式国债交易的一级托管人。同时中国债券总指数是目前国内涵盖范围最广的债券指数之一，具有良好的市场代表性。

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

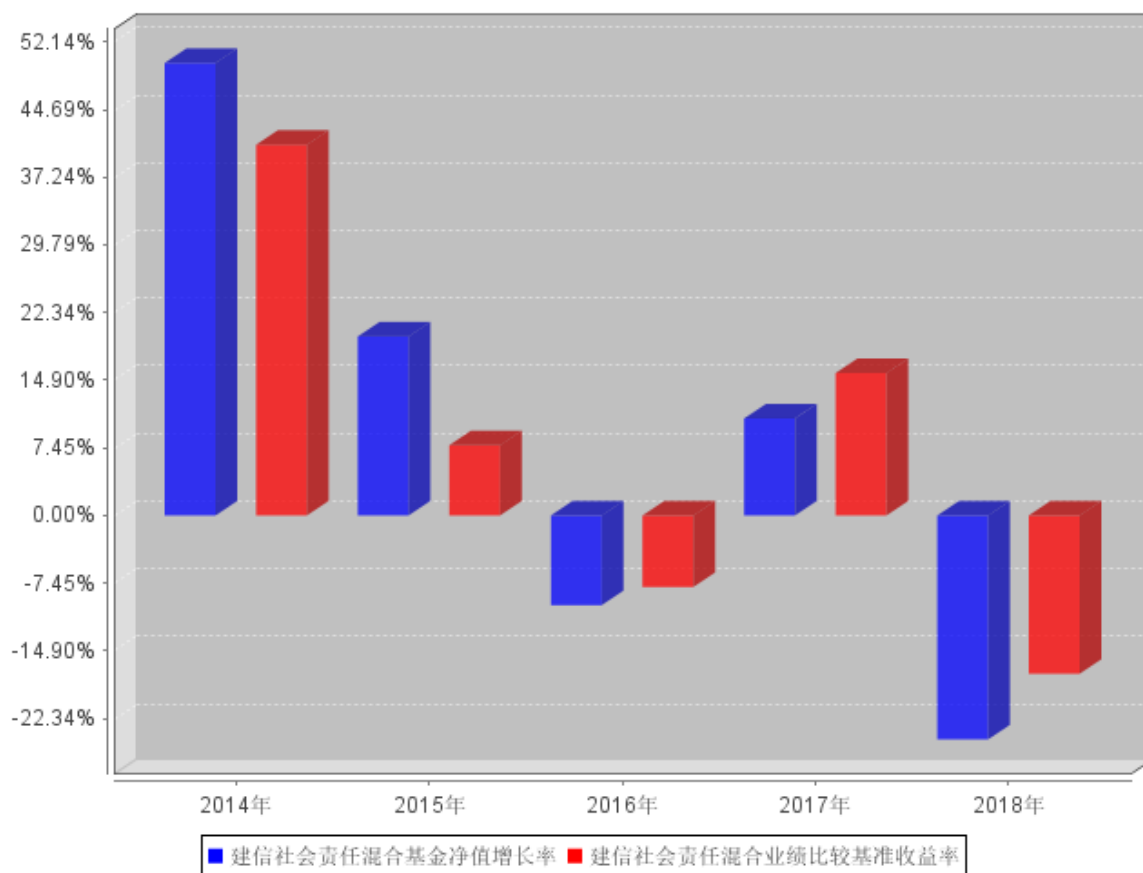
建信社会责任混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信社会责任混合过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



本基金合同自 2012 年 8 月 14 日生效，2012 年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年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“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家 资产管理行业的领跑者”。

截至 2018 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、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债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、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置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、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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 8-10 年指数证券投资基金（LOF）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及其联接基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指

数证券投资基金及其联接基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金，共计 104 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 6331.39 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		
许杰	权益投资部副总经理、本基金的基金经理	2012 年 8 月 14 日	-	16	权益投资部副总经理，硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员，2002 年 3 月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职，2006 年 12 月 23 日至 2011 年 9 月 30 日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理；2010 年 2 月 8 日至 2011 年 9 月 30 日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理；2008 年 9 月 26 日至 2011 年 9 月 30 日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011 年 10 月加入我公司，2012 年 3 月 21 日至 2017 年 1 月 24 日任建信恒稳价值混合型证券投资基金的基金经理；2012 年 8 月 14 日起任建信社会责任混合型证券投资基金的基金经理；2014 年 9 月 10 日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的基金经理；2015 年 2 月 3 日起任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金的基

					金经理；2015 年 5 月 26 日起任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 3 月 22 日起任建信中小盘先锋股票型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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

根据《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》，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、资产管理计划等）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。经分析，本报告期内未出现公司管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

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

2018 年股票市场出现了较大幅度的调整，全年万得全 A 指数下跌 28.25%。其背后的原因，一方面是投资者对于经济下行的担忧，另一方面是风险偏好的下降。在全球经济放缓、贸易摩擦加剧、基建投资下滑等因素影响下，投资者对中国经济下行的担忧情绪浓重。流动性方面，尽管代表无风险利率的十年期国债收益率全年呈持续的下降状态，但风险事件频发，企业债违约事件增多，部分 P2P 平台暴雷，股票质押风险暴露，导致信用风险上升，投资者对股权投资的信心下降。

资产配置方面，本基金全年维持了中性的股票资产配置，并且在 5 月末和 10 月初一定程度上升降低了股票的仓位，减少了股票市场下跌对基金净值带来的损失。

我们认为，中国经济的增长动能正在转变为创新驱动和消费驱动，这类行业有望成为未来的主导产业。从微观层面上上市公司的经营情况来看，这些企业也表现出良好的增长势头和长期潜力。本基金从新材料、新能源、计算机、电子、高端装备等创新类行业以及食品饮料等消费类行业中挑选出竞争力突出、业绩确定性增长同时估值具有安全边际的公司，并重点考察它们对于社会责任的履行情况，从而构建投资组合。为规避流动性压力对企业经营产生的风险，今年在选择股票的标准方面，除了其它基本面因素外，同时重点考察了公司的现金流量表和资产负债表，确保企业的成长是稳健、可持续而且不依靠消耗资本所推动。尽管对这些公司的投资在上半年产生了一定的收益，但受股票市场系统性风险的影响，这些公司在下半年产生了一定的投资亏损。然而，我们坚信，股票市场短期的震荡会带来股价的波动，但只要这些公司从事的业务符合经济的长期发展方向，且公司能够保持核心竞争力，长期来看，其股票价格必然会反映不断提升的企业价值。

另外，本基金下半年适度增加了对电网设备、铁路装备等国家计划加大投资的逆周期行业的投资，获得了一定的投资收益。

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-24.65%，波动率 1.24%，业绩比较基准收益率-17.43%，波动率 1.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2019 年中国经济将继续在调整中前行，流动性环境出现明显改善，市场风险偏好提升，股票市场将出现较好的投资机会。围绕“高质量发展”，选取符合新经济发展方向的龙头公司，将继续是本基金 2019 年最重要的工作。

2019 年中国经济仍将在调整中前行。过去一段时期，政府出台了各项稳经济的政策，包括加快基建、稳消费、减税降费等，会减缓经济周期性下行的压力。在积极的财政政策支持下，基建投资增速将出现回升，会在一定程度上对冲房地产投资增速的下行。2018 年消费一度出现疲软的迹象，但从非制造业 PMI 服务指数来看，四季度消费出现一定程度的回升。同美国进行的贸易谈判进行顺利，如果达成一致的成果，将有利于出口的回升。

流动性方面，1 月份社会融资总量明显放大，意味着宽货币到宽信用的传导基本实现。政府对于直接融资的重视、贸易战缓和、汇率企稳等，都将推动风险偏好提升。从股市的资金供给方面来看，海外资金、国内机构资金和散户资金都会成为 A 股市场流动性的重要推动力量。海外资金在 MSCI 扩大指数纳入比例、富时罗素等国际重要指数纳入 A 股的带动下，将更大规模进入中国 A 股市场。保险资金等机构资金投资 A 股仍有较大的空间。股票市场好转，个人投资者参与 A 股市场投资的意愿也会上升。

我国经济正在由高速增长阶段转向高质量发展阶段，经济的增长动能正从要素驱动转向创新驱动，从中国制造转向中国创造，从制造大国转向制造强国，从中国速度转向中国质量。在微观层面，我们也欣喜地看到很多上市公司的创新动能在加强，部分产业的竞争力已经走在了世界前列，传统产业的结构升级也在加快。我们期待，正如在上一轮以房地产行业为龙头行业、以重化工业为主导产业的周期中产生了一批优秀公司一样，本次“高质量发展阶段”同样能产生一批优秀公司。通过研究发掘新经济下主导产业中的龙头企业，跟随企业成长，将成为我们获取投资回报的重要手段。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2018 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日，本基金基金资产净值低于五千万元超过连续 20 个工作日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》（2014 年 8 月 8 日生效）第四十一条的要求，现将该情况在本次报告中予以披露。

§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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—建信基金管理有限责任公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了建信社会责任混合型证券投资基金（以下简称“建信社会责任混合基金”）的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 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（2019）第 22652 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信社会责任混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		5,750,607.73	4,282,085.73
结算备付金		92,325.26	171,565.49
存出保证金		33,659.06	44,006.78
交易性金融资产		17,491,931.58	25,972,367.30
其中：股票投资		17,491,931.58	25,972,367.30
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	1,500,000.00
应收证券清算款		340,229.99	226,879.32
应收利息		1,429.62	2,953.31
应收股利		-	-
应收申购款		5,193.04	25,908.52
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		23,715,376.28	32,225,766.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		400,527.05	-
应付赎回款		3,599.80	35,127.59
应付管理人报酬		29,572.86	39,657.11
应付托管费		4,928.81	6,609.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		242,116.37	358,990.26
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		307,867.59	451,784.04
负债合计		988,612.48	892,168.52
所有者权益：			
实收基金		13,949,139.52	14,490,428.37
未分配利润		8,777,624.28	16,843,169.56
所有者权益合计		22,726,763.80	31,333,597.93
负债和所有者权益总计		23,715,376.28	32,225,766.45

报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.629 元，基金份额总额 13,949,139.52 份。

7.2 利润表

会计主体：建信社会责任混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-5,863,899.14	4,920,533.71
1. 利息收入		52,944.20	121,805.80
其中：存款利息收入		50,741.45	53,669.50
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,202.75	68,136.30
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,409,573.95	3,024,490.03
其中：股票投资收益		-4,615,192.59	2,851,164.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		205,618.64	173,325.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-1,512,116.66	1,766,080.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		4,847.27	8,157.51
减：二、费用		1,418,806.86	1,537,539.91

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	405,462.93	489,274.43
2. 托管费	7.4.10.2.2	67,577.17	81,545.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用		563,075.74	587,145.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		382,691.02	379,574.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,282,706.00	3,382,993.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,282,706.00	3,382,993.80

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信社会责任混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	14,490,428.37	16,843,169.56	31,333,597.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,282,706.00	-7,282,706.00
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）	-541,288.85	-782,839.28	-1,324,128.13
其中：1. 基金申购款	3,131,101.43	2,991,809.97	6,122,911.40
2. 基金赎回款	-3,672,390.28	-3,774,649.25	-7,447,039.53
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）	13,949,139.52	8,777,624.28	22,726,763.80

项目	上年度可比期间 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）	17,230,162.45	16,416,837.12	33,646,999.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,382,993.80	3,382,993.80
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）	-2,739,734.08	-2,956,661.36	-5,696,395.44
其中：1. 基金申购款	3,446,679.44	3,612,471.83	7,059,151.27
2. 基金赎回款	-6,186,413.52	-6,569,133.19	-12,755,546.71
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）	14,490,428.37	16,843,169.56	31,333,597.93

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：

_____	_____	_____
张军红	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

建信社会责任混合型证券投资基金(原名为建信社会责任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[2012]484号《关于核准建信社会责任股票型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信社会责任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1,111,324,695.07元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第288号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信社会责任股票型证券投资基金基金合

同》于 2012 年 8 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,111,390,620.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 65,925.28 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，建信社会责任股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 8 日公告后更名为建信社会责任混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信社会责任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良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货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，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：

股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中本基金投资于积极履行社会责任的上市公司股票比例不低于股票资产的 80%；债券、货币市场工具、银行存款、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证券品种占基金资产的比例为 0-40%，其中权证占基金资产净值的 0-3%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 X75%+中国债券总指数收益率 X25%。

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 2019 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》、《建信社会责任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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，

基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2018 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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[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》、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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进

项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东

中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	405,462.93	489,274.43
其中：支付销售机构的客户维护费	158,763.68	190,328.50

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 × 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	67,577.17	81,545.66

支付基金托管行中国农业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 × 0.25%/ 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
农业银行： 活期存款	5,750,607.73	47,524.27	4,282,085.73	49,906.50

本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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 2018 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 17,491,931.58 元，无属于第二或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 25,972,367.30 元，无第二或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 2018 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(2017 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)除公允价值外，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	17,491,931.58	73.76
	其中：股票	17,491,931.58	73.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,842,932.99	24.64
8	其他各项资产	380,511.71	1.60
9	合计	23,715,376.28	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	215,416.96	0.95
B	采矿业	459,520.80	2.02
C	制造业	12,100,245.87	53.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,915,338.95	12.83
J	金融业	-	-

K	房地产业	639,876.00	2.82
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	342,926.00	1.51
N	水利、环境和公共设施管理业	209,595.00	0.92
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	609,012.00	2.68
S	综合	-	-
	合计	17,491,931.58	76.97

以上行业分类以 2018 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	600312	平高电气	114,811	927,672.88	4.08
2	601766	中国中车	102,118	921,104.36	4.05
3	002632	道明光学	118,462	820,941.66	3.61
4	002376	新北洋	51,976	797,311.84	3.51
5	300316	晶盛机电	78,783	789,405.66	3.47
6	002384	东山精密	68,800	776,752.00	3.42
7	600406	国电南瑞	41,300	765,289.00	3.37
8	002174	游族网络	40,100	745,459.00	3.28
9	002624	完美世界	25,807	718,724.95	3.16
10	300285	国瓷材料	41,701	695,155.67	3.06

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	600585	海螺水泥	5,203,870.99	16.61
2	600519	贵州茅台	4,930,966.55	15.74
3	601318	中国平安	3,786,473.00	12.08
4	300316	晶盛机电	3,453,576.00	11.02
5	002624	完美世界	3,131,339.62	9.99
6	600115	东方航空	3,078,156.00	9.82
7	300398	飞凯材料	2,785,128.26	8.89
8	002368	太极股份	2,185,904.99	6.98
9	300285	国瓷材料	2,174,789.47	6.94
10	600352	浙江龙盛	2,116,337.00	6.75
11	600036	招商银行	2,090,710.00	6.67
12	300054	鼎龙股份	2,074,229.00	6.62
13	600048	保利地产	2,024,726.00	6.46
14	600588	用友网络	2,011,730.00	6.42
15	002376	新北洋	1,990,012.00	6.35
16	600426	华鲁恒升	1,894,667.00	6.05
17	002027	分众传媒	1,886,802.00	6.02
18	300373	扬杰科技	1,850,242.00	5.90
19	300166	东方国信	1,847,173.34	5.90
20	002812	恩捷股份	1,822,836.00	5.82
21	601601	中国太保	1,800,281.00	5.75
22	300101	振芯科技	1,766,785.00	5.64
23	600029	南方航空	1,765,352.00	5.63
24	002815	崇达技术	1,723,546.00	5.50
25	300324	旋极信息	1,666,096.00	5.32
26	600196	复星医药	1,637,338.00	5.23
27	002384	东山精密	1,621,418.00	5.17
28	600809	山西汾酒	1,610,798.00	5.14
29	600887	伊利股份	1,546,376.00	4.94
30	300136	信维通信	1,543,809.00	4.93
31	600031	三一重工	1,540,132.00	4.92
32	300097	智云股份	1,513,634.00	4.83
33	002632	道明光学	1,469,481.00	4.69
34	002299	圣农发展	1,457,600.00	4.65
35	601766	中国中车	1,456,272.00	4.65

36	600702	舍得酒业	1,449,268.00	4.63
37	601231	环旭电子	1,417,063.00	4.52
38	002262	恩华药业	1,411,421.00	4.50
39	600845	宝信软件	1,406,503.00	4.49
40	601888	中国国旅	1,388,846.00	4.43
41	600028	中国石化	1,378,553.00	4.40
42	300459	金科文化	1,372,434.00	4.38
43	002554	惠博普	1,363,274.00	4.35
44	002396	星网锐捷	1,310,221.00	4.18
45	600801	华新水泥	1,309,058.00	4.18
46	002179	中航光电	1,303,101.00	4.16
47	002456	欧菲科技	1,288,796.00	4.11
48	601857	中国石油	1,262,987.00	4.03
49	600339	中油工程	1,260,615.00	4.02
50	600967	内蒙一机	1,256,449.15	4.01
51	603588	高能环境	1,251,642.00	3.99
52	601699	潞安环能	1,249,093.40	3.99
53	002050	三花智控	1,224,960.00	3.91
54	603043	广州酒家	1,215,671.00	3.88
55	000968	蓝焰控股	1,203,672.00	3.84
56	600570	恒生电子	1,198,114.52	3.82
57	600879	航天电子	1,163,772.00	3.71
58	300081	恒信东方	1,154,889.00	3.69
59	000858	五粮液	1,153,309.00	3.68
60	600900	长江电力	1,152,028.00	3.68
61	002353	杰瑞股份	1,126,480.00	3.60
62	002042	华孚时尚	1,119,727.60	3.57
63	002217	合力泰	1,059,765.00	3.38
64	300545	联得装备	1,048,235.00	3.35
65	300271	华宇软件	1,044,039.00	3.33
66	000568	泸州老窖	1,039,255.00	3.32
67	002304	洋河股份	1,031,412.00	3.29
68	300433	蓝思科技	1,022,414.00	3.26
69	000333	美的集团	1,019,745.00	3.25
70	000596	古井贡酒	1,019,313.00	3.25
71	600583	海油工程	1,000,719.00	3.19

72	002343	慈文传媒	995,249.00	3.18
73	002511	中顺洁柔	994,607.90	3.17
74	600312	平高电气	957,138.00	3.05
75	600019	宝钢股份	945,924.00	3.02
76	000789	万年青	938,260.00	2.99
77	300059	东方财富	934,232.00	2.98
78	002174	游族网络	931,271.00	2.97
79	300164	通源石油	909,862.00	2.90
80	600562	国睿科技	908,288.00	2.90
81	603986	兆易创新	905,579.00	2.89
82	600201	生物股份	888,232.00	2.83
83	600535	天士力	887,012.60	2.83
84	601088	中国神华	870,330.00	2.78
85	300170	汉得信息	836,707.00	2.67
86	002821	凯莱英	832,983.00	2.66
87	300408	三环集团	822,610.00	2.63
88	600600	青岛啤酒	780,750.00	2.49
89	000998	隆平高科	763,121.00	2.44
90	601599	鹿港文化	756,666.00	2.41
91	300138	晨光生物	742,853.00	2.37
92	603605	珀莱雅	738,519.00	2.36
93	600409	三友化工	731,727.00	2.34
94	600038	中直股份	731,469.00	2.33
95	300351	永贵电器	717,583.00	2.29
96	600030	中信证券	705,346.00	2.25
97	600406	国电南瑞	699,336.00	2.23
98	000002	万科 A	686,530.00	2.19
99	002867	周大生	686,420.00	2.19
100	603228	景旺电子	680,317.00	2.17
101	001979	招商蛇口	659,742.11	2.11
102	600479	千金药业	645,627.99	2.06
103	601998	中信银行	639,036.00	2.04
104	002450	康得新	635,588.00	2.03
105	600000	浦发银行	635,153.00	2.03
106	002475	立讯精密	635,089.00	2.03
107	002583	海能达	632,834.00	2.02

108	000983	西山煤电	632,562.00	2.02
-----	--------	------	------------	------

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	600519	贵州茅台	7,382,097.66	23.56
2	600585	海螺水泥	4,959,219.58	15.83
3	601318	中国平安	4,720,771.64	15.07
4	002304	洋河股份	3,132,007.51	10.00
5	300398	飞凯材料	3,096,220.33	9.88
6	600887	伊利股份	2,995,155.87	9.56
7	600115	东方航空	2,954,392.00	9.43
8	601601	中国太保	2,814,294.62	8.98
9	002624	完美世界	2,532,148.60	8.08
10	000858	五粮液	2,497,072.76	7.97
11	002027	分众传媒	2,480,904.24	7.92
12	300166	东方国信	2,200,327.88	7.02
13	600809	山西汾酒	2,109,247.62	6.73
14	600352	浙江龙盛	2,026,319.22	6.47
15	600872	中炬高新	2,006,711.75	6.40
16	300316	晶盛机电	1,970,765.69	6.29
17	002368	太极股份	1,952,977.22	6.23
18	600036	招商银行	1,854,438.00	5.92
19	600426	华鲁恒升	1,852,361.00	5.91
20	600588	用友网络	1,841,390.80	5.88
21	600031	三一重工	1,815,092.60	5.79
22	601336	新华保险	1,796,854.00	5.73
23	002815	崇达技术	1,775,478.76	5.67
24	300373	扬杰科技	1,759,447.86	5.62
25	600196	复星医药	1,725,590.94	5.51
26	600029	南方航空	1,719,125.48	5.49
27	002812	恩捷股份	1,698,139.78	5.42
28	000423	东阿阿胶	1,627,788.88	5.20
29	300324	旋极信息	1,622,088.00	5.18
30	600048	保利地产	1,568,080.00	5.00
31	000596	古井贡酒	1,565,978.00	5.00

32	300101	振芯科技	1,560,530.22	4.98
33	002717	岭南股份	1,551,502.00	4.95
34	000333	美的集团	1,542,131.92	4.92
35	601888	中国国旅	1,513,738.74	4.83
36	002146	荣盛发展	1,512,805.70	4.83
37	300408	三环集团	1,490,225.55	4.76
38	603588	高能环境	1,457,993.75	4.65
39	002867	周大生	1,452,171.54	4.63
40	300285	国瓷材料	1,403,884.50	4.48
41	600339	中油工程	1,355,325.73	4.33
42	300097	智云股份	1,350,868.92	4.31
43	600702	舍得酒业	1,347,819.00	4.30
44	600028	中国石化	1,339,555.00	4.28
45	300054	鼎龙股份	1,274,481.80	4.07
46	002353	杰瑞股份	1,239,217.11	3.95
47	002299	圣农发展	1,226,454.52	3.91
48	601857	中国石油	1,213,834.80	3.87
49	600801	华新水泥	1,206,035.00	3.85
50	002554	惠博普	1,201,165.66	3.83
51	600570	恒生电子	1,197,491.90	3.82
52	600845	宝信软件	1,189,232.00	3.80
53	601699	潞安环能	1,187,172.00	3.79
54	002376	新北洋	1,185,000.80	3.78
55	002456	欧菲科技	1,172,481.61	3.74
56	002262	恩华药业	1,166,365.00	3.72
57	600900	长江电力	1,151,778.14	3.68
58	600879	航天电子	1,132,989.00	3.62
59	002050	三花智控	1,128,753.56	3.60
60	603043	广州酒家	1,125,429.00	3.59
61	300136	信维通信	1,116,711.00	3.56
62	601231	环旭电子	1,086,621.64	3.47
63	000789	万年青	1,079,930.11	3.45
64	002396	星网锐捷	1,077,573.30	3.44
65	300271	华宇软件	1,041,824.06	3.32
66	600967	内蒙一机	1,021,978.00	3.26
67	300081	恒信东方	994,106.25	3.17
68	002217	合力泰	987,592.65	3.15
69	002343	慈文传媒	983,260.00	3.14

70	600019	宝钢股份	973,848.00	3.11
71	600562	国睿科技	966,279.00	3.08
72	002042	华孚时尚	961,505.49	3.07
73	600583	海油工程	932,591.14	2.98
74	300545	联得装备	930,784.94	2.97
75	000568	泸州老窖	925,325.30	2.95
76	002179	中航光电	922,003.00	2.94
77	002511	中顺洁柔	919,519.25	2.93
78	603605	珀莱雅	919,180.11	2.93
79	601088	中国神华	914,156.16	2.92
80	300426	唐德影视	909,863.00	2.90
81	300433	蓝思科技	895,234.76	2.86
82	300059	东方财富	890,708.00	2.84
83	000983	西山煤电	864,404.65	2.76
84	600201	生物股份	857,165.00	2.74
85	000968	蓝焰控股	850,648.14	2.71
86	300138	晨光生物	840,328.18	2.68
87	300164	通源石油	835,951.80	2.67
88	603986	兆易创新	810,271.47	2.59
89	300459	金科文化	798,267.00	2.55
90	600535	天士力	783,409.38	2.50
91	600600	青岛啤酒	770,795.58	2.46
92	600038	中直股份	762,311.52	2.43
93	601818	光大银行	751,449.00	2.40
94	300628	亿联网络	725,801.00	2.32
95	000998	隆平高科	710,845.00	2.27
96	600030	中信证券	695,523.00	2.22
97	601998	中信银行	691,767.00	2.21
98	300351	永贵电器	675,690.22	2.16
99	601599	鹿港文化	675,244.89	2.16
100	603228	景旺电子	668,904.00	2.13
101	002384	东山精密	657,242.00	2.10
102	001979	招商蛇口	654,192.00	2.09

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	184,848,381.83
卖出股票收入（成交）总额	187,201,508.30

上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未投资于国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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披露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	33,659.06
2	应收证券清算款	340,229.99
3	应收股利	-
4	应收利息	1,429.62
5	应收申购款	5,193.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	380,511.71

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,359	4,152.77	29,644.56	0.21%	13,919,494.96	99.79%

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	201,168.59	1.44%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年8月14日）基金份额总额	1,111,390,620.35
本报告期期初基金份额总额	14,490,428.37
本报告期期间基金总申购份额	3,131,101.43
减:本报告期期间基金总赎回份额	3,672,390.28
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	13,949,139.52

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

经本基金管理人建信基金管理有限责任公司 2018 年第一次临时股东会和第五届董事会第一次会议审议通过，自 2018 年 4 月 18 日起，许会斌先生不再担任本公司董事长（法定代表人），由孙志晨先生担任本公司董事长（法定代表人）；孙志晨先生不再担任本公司总裁，由张军红先生担任本公司总裁。上述事项本公司已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案并于 2018 年 4 月 20 日公告。

本报告期内，本行总行聘任刘琳同志、李智同志为行托管业务部高级专家。

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 55,000.00 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	
海通证券	1	1,138,849,019.95	37.32%	126,533.22	36.91%	-
中信证券	1	1,115,277,806.89	30.98%	107,359.24	31.31%	-
银河证券	1	73,227,125.45	19.68%	68,197.07	19.89%	-
国金证券	1	33,707,723.40	9.06%	30,717.11	8.96%	-
安信证券	1	9,036,789.34	2.43%	8,234.41	2.40%	-
东海证券	1	1,951,425.10	0.52%	1,817.38	0.53%	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

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

- （1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- （3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。
- （4）佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内新增东方证券和东海证券两个交易单元。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
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司

2019年3月26日