

建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资 基金（LOF） 2018 年年度报告

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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 26 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 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
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
§4 管理人报告	10
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.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
§6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
§7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	51

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	51
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	52
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
8.11 投资组合报告附注	52
§9 基金份额持有人信息.....	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末上市基金前十名持有人	54
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	54
§10 开放式基金份额变动.....	55
§ 11 重大事件揭示.....	56
11.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
11.4 基金投资策略的改变	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
11.8 其他重大事件	58
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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	60
§13 备查文件目录.....	61
13.1 备查文件目录	61
13.2 存放地点	61
13.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金(LOF)
基金简称	建信中证政策性金融债 1-3 年指数 (LOF)
场内简称	政债一三
基金主代码	501101
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2017 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	12,589,602.44 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，将年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证政策性金融债 1-3 年指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型指数基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.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 16 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号

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	孙志晨	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	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

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 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 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	2018 年	2017 年 8 月 9 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日	2016 年
本期已实现收益	663,335.06	272,419.70	-
本期利润	714,371.06	272,419.70	-
加权平均基金份额本期利润	0.0633	0.0130	-
本期加权平均净值利润率	6.07%	1.30%	-
本期基金份额净值增长率	6.49%	1.18%	-
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	898,502.53	233,260.99	-
期末可供分配基金份额利润	0.0714	0.0118	-
期末基金资产净值	13,565,705.55	20,052,719.29	-
期末基金份额净值	1.0775	1.0118	-
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	7.75%	1.18%	-

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

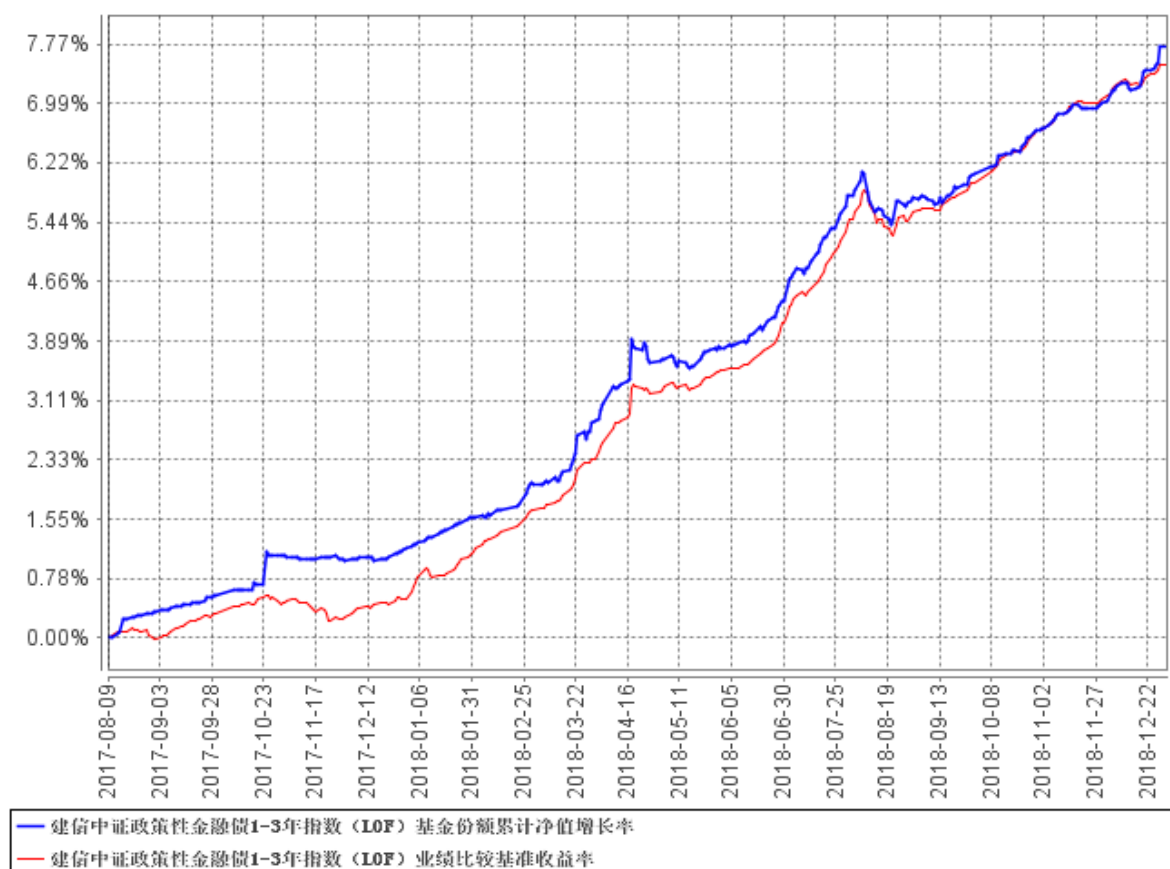
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.58%	0.04%	1.47%	0.03%	0.11%	0.01%
过去六个月	3.19%	0.06%	3.26%	0.04%	-0.07%	0.02%

过去一年	6.49%	0.06%	6.97%	0.04%	-0.48%	0.02%
自基金合同生效起至今	7.75%	0.06%	7.51%	0.04%	0.24%	0.02%

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

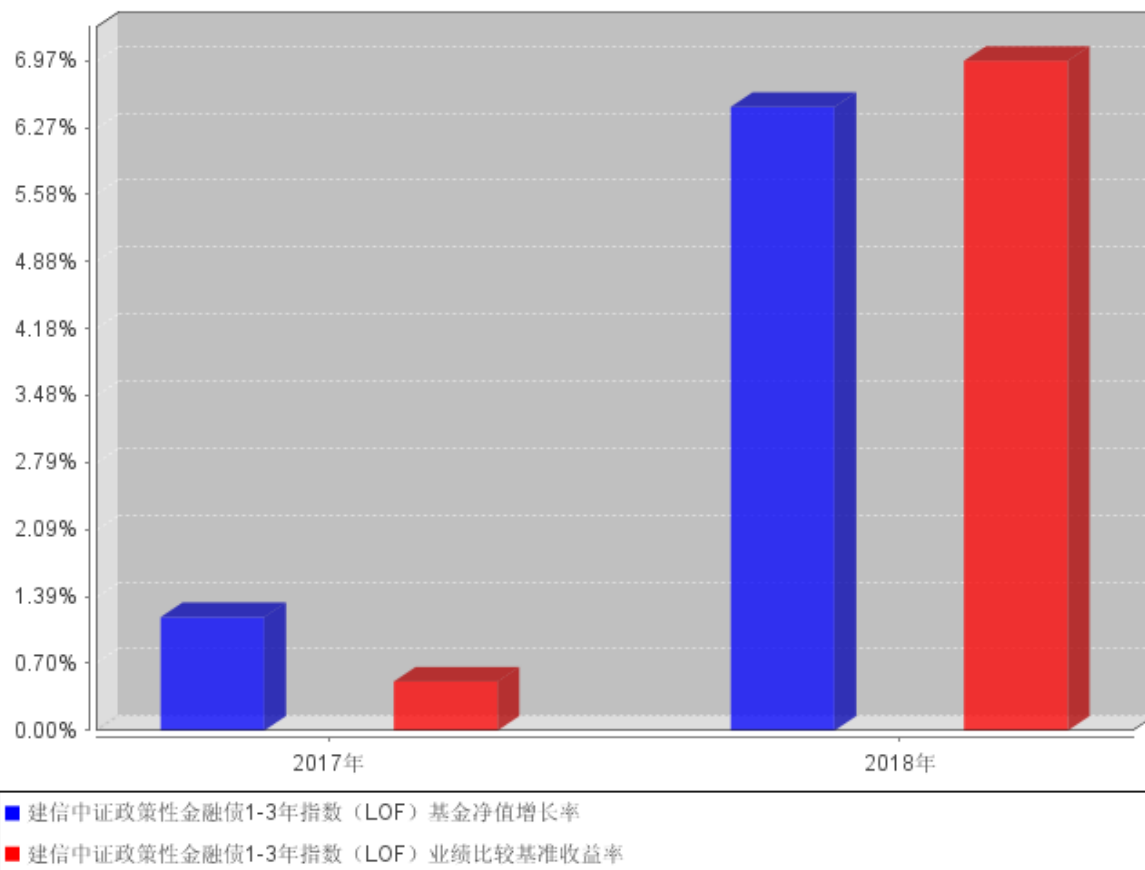
建信中证政策性金融债1-3年指数（LOF）基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

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

建信中证政策性金融债1-3年指数 (LOF) 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



本基金合同自 2017 年 8 月 9 日生效，2017 年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同自 2017 年 8 月 9 日起生效，基金合同生效以来未发生利润分配。

§ 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

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		
刘思	本基金的基金经理	2017年8月9日	-	9	硕士。2009年5月加入建信基金管理公司，历任助理交易员、初级交易员、交易员、交易主管、基金经理助理、基金经理，2016年7月19日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理；2016年11月8日至2018年1月15日任建信睿享纯债债券型证券投资基金的基金经理；2016年11月22日至2017年8月3日任建信恒丰纯债债券型证券投资基金的基金经理；2016年11月25日起任建信睿富纯债债券型证券投资基金的基金经理；2017年8月9日起任建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF)、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理；2017年8月9日至2018年4月11日任建信中证政策性金融债 3-5 年指数证券投资基金 (LOF) 基金经理；2017年8月16日至2018年4月11日任建信中证政策性金融债 5-8 年指数证券投资基金 (LOF)；2017年

					8月16日至2018年5月31日任建信睿源纯债债券型证券投资基金的基金经理；2018年3月26日起任建信双月安心理财债券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

回顾 2018 年, 世界经济延续温和增长, 但动能有所放缓, 主要经济体的增长态势、通胀水平和货币政策分化明显。美国经济在减税增支财政政策的刺激下保持强劲, 但下半年增长势头略缓, 全年加息四次。美国在贸易等方面的政策举措也是今年影响世界经济增长、扰动国际金融市场和改变国际经贸规则的主要源头。由于贸易保护主义和单边主义抬头, 导致一些国家的企业减缓投资, 同时也使消费者信心丧失。发达国家中的德国、意大利和日本在 2018 年下半年都出现了经济收缩, 新兴经济体也呈现资本流出加剧的趋势, 全球金融市场持续震荡。

在错综复杂的国际环境下, 国内经济运行实现了总体平稳和达到预期目标的计划。2018 年国内生产总值 (GDP) 同比是 6.6%, 1-4 季度分别增长 6.8%、6.7%、6.5% 和 6.4%。从城镇居民总体的消费支出看, 虽然表面上 2018 年前三季度城镇居民人均消费支出名义增速达到 6.5%, 但这主要是由于居住消费和日常生活用品与服务等被动型消费支出增速的加快, 剔除被动型消费支出后, 商品和服务两大消费的增速变化实际都在放缓。从投资需求来看, 固定资产投资的实际增速已接近于零, 民间固定资产投资增速虽有回升但势头并不稳固, 利润空间收缩直接影响投资意愿, 而且融资难融资贵的问题还没有妥善解决。从出口需求来看, 贸易战摩擦直接导致出口增速回落, 全年净出口对经济增长的贡献率趋于由正转负。

物价方面, 全国居民消费价格指数 (CPI) 全年同比增长 2.1%, 增幅比上年同期上升 0.6 个百分点, 主要是食品类价格有所回升所致, 核心通胀率保持稳定, 并有所下降。PPI 涨幅明显回落, 呈前高后低走势, 受翘尾因素影响年初 PPI 同比涨幅较高, 5 月份之后受国际原油价格大幅度上涨等因素影响 PPI 涨幅有所扩大, 下半年随着翘尾因素逐月减少加之国际原油价格出现下跌。

外汇方面, 2018 年美元指数波动较大、中美贸易摩擦以及境外机构加大国内债券市场投资等市场供求因素共同影响下, 人民币汇率呈现先强后弱的走势。人民币兑美元交易汇率年末收于 6.8658, 较上年贬值 5.2%, 人民币对美元汇率中间价年末收于 6.8632, 较上年贬值 4.8%。

18 年货币政策一直保持相对宽松, 资金利率基本维持在相对低位, 而且随着经济下行压力加大, 市场对于货币政策进一步放松的预期上升。宽松的货币政策宽松力度不断加码, 人民银行年

内四次降低法定存款准备金率，共释放流动性约 4 万亿元，对冲部分中期借贷便利后，净释放流动性 2.3 万亿元。在帮助解决民营企业、小微企业的融资困难方面，人民银行还联合多个部门发文，从货币政策、监管考核、内部管理、财税激励、优化环境等方面提出了具体措施，宽信用的进程在加快。

2018 年国内债市迎来一波牛市行情，收益率整体呈现震荡下行趋势，10 年期国债和 10 年期国开估值收益率全年分别下行了 71 个 bp 和 145 个 bp。年初国内结构性去杠杆的力度加大，且银行存在较大的负债压力和资管新规带来的表外资产回表压力，收益率还处于上行趋势。1 月末，临时准备金动用安排 (CRA) 和降准的政策释放了万亿流动性，推动收益率开始下行。3 月由于中美贸易冲突爆发，导致市场对经济的悲观预期升温，避险情绪上升，股市大跌，利率快速下行。2-3 季度，在贸易战和国内各种政策多重因素的综合作用下，收益率经历了震荡行情。进入 4 季度之后，由于流动性保持宽松并出现分层，国内信用风险不断凸显，同时市场预期美国经济将大幅下滑，美联储加息将放缓，促使利率债交易活跃，收益率再次进入下行通道。

综上所述，2018 年度，该基金较好得模拟了指数走势，重点配置了久期较长并且流动较好的指数成份券。但是由于基金规模较小，交易成本较高，本基金没有进行杠杆操作。截至年底时点，业绩表现良好。

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 6.49%，波动率 0.06%，业绩比较基准收益率 6.97%，波动率 0.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，由于美联储在 18 年 12 月的联储会议上的表述较鸽派，目前市场普遍预期美国未来一年最多只会加息两次，全球流动性收缩步骤略缓。但是全球的贸易战和关税摩擦仍在持续发酵，在一定程度上会继续拖累全球经济增速。

内部基本上，预计宏观经济增速将会持续下行，但托底政策有望陆续出台，下半年经济增长可能略强于上半年。进出口方面，目前全球经济走弱叠加贸易摩擦，如果后续中美谈判效果不佳，2019 年的净出口压力可能较大。投资方面，上半年的高基数效应叠加后期棚改目标下调、土地购置下降等多重因素可能会拖累地产投资下行，但是房地产政策是否松动也是 19 年政策的核心变量之一，后续需密切关注地产政策走向。基建投资可能会企稳回升，目前 2019 年的专项债额度增加，发行进度相比 18 年有所提前，一季度开始会加快发行，更有利于及时托底经济。制造业投资预计整体小幅回落，供给侧改革行业面临价格下行压力较大，叠加整体需求下行，企业进一步

扩产增资意愿不强，但是明年民企融资环境预计将有改善，货币政策传导机制下贷款加权利率可能有所下行，减税等政策在边际上也有一定促进。消费方面，地产下游消费面临较大压力，汽车消费边际可能企稳，可选消费周期回落压力较大。

2019 年的通胀压力可控，预计全年 CPI 中枢前高后底，高位出现在二季度，全年中枢可能在 2.5%。猪价将是主要影响因素，猪瘟导致的禁运影响母猪存栏和生猪的补库，对于 19 年生猪出栏影响较大，进而抬升猪价。目前市场对于石油减产承诺的有效性和执行效率有一定怀疑，因此油价整体对于通胀的影响不大。PPI 预计保持下行态势，中枢大概在 1.5%左右的水平。明年需求下行叠加“去产能”政策有所弱化，工业品价格在供需压力下仍有下行压力。

政策会适当对冲经济的下行压力，主要体现在积极的财政（加强基建、扩大赤字）和稳健的货币政策上。财政政策方面，通过扩大地方政府专项债规模和适度提高财政赤字率来为基础设施建设提供资金来源，进一步增强经济托底、补短板重要作用。货币政策方面，中央经济工作会议定调“稳健的货币政策要松紧适度，保持流动性合理充裕”，在宽信用未出效果、货币政策传导机制未理顺之前，预计货币政策仍将维持宽松格局。19 年到期的 MLF 较多，预计通过降准操作置换部分 MLF 来对冲基础货币的压力，同时下调 OMO、SLF、MLF 等工具利率来引导市场利率下行，关注美联储暂停加息时点。

不过对于 2019 年，投资也需更加谨慎，获得收益的难度要高于 2018 年。市场有可能对利空因素越来越敏感，而对利好因素越来越钝化，这就需要仔细评估每个时点发生的宏观事件，密切关注任何可能引发市场转向的因素。整体来看，经济下行与政策托底角力，无风险收益下行幅度会不及 2018 年，节奏不会顺畅，某阶段经济数据企稳或者股市反弹等情况的出现，可能导致对债市配置需求的减弱，收益可能出现较大的波动。

同时，2019 年大量信用债到期，信用风险相对显著。宽信用会逐步开启，但较难快速产生效果，低等级券信用风险依然较高，尾部风险需重点防范。预计高等级债券疯抢和垃圾债无人问津的局面依旧会延续，利差分化短时间难以修复。在无风险收益率中枢已经下行的环境下，更加考验信用择券和定价能力，重点关注有国资控股背景、负债率相对适中、有一定竞争力的企业与行业龙头企业发行的债券。

整体来看，基本面和流动性仍有利于未来债市行情。2019 年，本指数基金将主要持仓指数成份债券来模拟指数变化，同时依据市场情况利用杠杆操作来增厚收益，在保证组合流动性的同时力争保证组合能够跟随市场的发展变化为投资人获得合理的收益。

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

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(2019)第 22580 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	建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人:
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“建信中证政策性金融债 1-3 年指数基金 (LOF)”) 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。</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, 公允反映了建信中证政策性金融债 1-3 年指数基金 (LOF) 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。</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, 我们独立于建信中证政策性金融债 1-3 年指数基金 (LOF), 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>建信中证政策性金融债 1-3 年指数基金 (LOF) 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、</p>

	<p>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中证政策性金融债 1-3 年指数基金(LOF)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中证政策性金融债 1-3 年指数基金(LOF)、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中证政策性金融债 1-3 年指数基金(LOF)的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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,就可能导致对建信中证政策性金融债 1-3 年指数基金(LOF)持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是</p>

	<p>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中证政策性金融债 1-3 年指数基金 (LOF) 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 沈兆杰
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2019 年 3 月 21 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF)

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	7.4.7.1	265,708.88	20,102,842.84
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	13,059,000.00	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		13,059,000.00	-
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	67,913.72	31,160.24
应收股利		-	-
应收申购款		300,730.38	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	17,918.48	7,918.48
资产总计		13,711,271.46	20,141,921.56
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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,149.53	1,815.93
应付托管费		1,049.85	605.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,866.25	-
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	139,500.28	86,781.10
负债合计		145,565.91	89,202.27
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	12,589,602.44	19,819,458.30
未分配利润	7.4.7.10	976,103.11	233,260.99
所有者权益合计		13,565,705.55	20,052,719.29
负债和所有者权益总计		13,711,271.46	20,141,921.56

报告截止日 2018 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.0775 元, 基金份额总额 12,589,602.44 份。

7.2 利润表

会计主体: 建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF)

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 8 月 9 日(基 金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		782,700.80	347,600.23
1. 利息收入		496,396.47	285,673.01
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	98,412.01	285,673.01
债券利息收入		397,984.46	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		231,979.30	-
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	231,979.30	-
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	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.17	51,036.00	-
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	3,289.03	61,927.22
减: 二、费用		68,329.74	75,180.53
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	35,241.16	22,446.75

2. 托管费	7.4.10.2.2	11,747.02	7,482.22
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,189.50	-
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	7.4.7.20	19,152.06	45,251.56
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		714,371.06	272,419.70
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		714,371.06	272,419.70

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF)

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)	19,819,458.30	233,260.99	20,052,719.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	714,371.06	714,371.06
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)	-7,229,855.86	28,471.06	-7,201,384.80
其中: 1. 基金申购款	8,896,212.63	579,196.57	9,475,409.20
2. 基金赎回款	-16,126,068.49	-550,725.51	-16,676,794.00
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)	12,589,602.44	976,103.11	13,565,705.55
项目	上年度可比期间 2017 年 8 月 9 日 (基金合同生效日) 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)	244,540,496.47	-	244,540,496.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	272,419.70	272,419.70
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)	-224,721,038.17	-39,158.71	-224,760,196.88
其中: 1. 基金申购款	30,789,284.14	212,607.10	31,001,891.24
2. 基金赎回款	-255,510,322.31	-251,765.81	-255,762,088.12
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)	19,819,458.30	233,260.99	20,052,719.29

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

建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF) (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[2016]2546 号《关于准予建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF) 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《建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2017 年 5 月 5 日至 2017 年 8 月 4 日止。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 244,540,103.52 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 (2017) 第 516 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2017 年 8 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 244,540,496.47 份基金份额,其中认购

资金利息折合 392.95 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《建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的政策性金融债、国债、债券回购、银行存款、国债期货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相关规定。本基金不参与股票、权证等权益类资产的投资。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；其中标的指数成份券、备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债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。本基金业绩比较基准为中证政策性金融债 1-3 年指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 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》、《建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 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。

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债券投资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。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中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

本基金持有的债券投资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。

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

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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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，其中场外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，场内基金份额持有人只能选择现金分红。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》提供的现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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、可交换债券、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、可交换债券、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债金融估值中心有限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》、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 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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	265,708.88	1,602,842.84
定期存款	-	18,500,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	18,500,000.00
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	265,708.88	20,102,842.84

定期存款的存款期限指票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	13,007,964.00	13,059,000.00	51,036.00
	合计	13,007,964.00	13,059,000.00	51,036.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	13,007,964.00	13,059,000.00	51,036.00	
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所	-	-	-	

黄金合约			
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	93.45	352.65
应收定期存款利息	-	30,807.59
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	67,820.27	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	67,913.72	31,160.24

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日

其他应收款	17,918.48	7,918.48
待摊费用	-	-
合计	17,918.48	7,918.48

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	1,866.25	-
合计	1,866.25	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	139,500.28	86,781.10
合计	139,500.28	86,781.10

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	19,819,458.30	19,819,458.30
本期申购	8,896,212.63	8,896,212.63
本期赎回(以“-”号填列)	-16,126,068.49	-16,126,068.49
- 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	12,589,602.44	12,589,602.44

截至2018年12月31日止,本基金于上交所上市的基金份额为4,985.00份(2017年12月31日:4,985.00份),托管在场外未上市交易的基金份额为12,584,617.44份(2017年12月31日:19,814,473.30份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统,可选择按市价流通或按基金份额

净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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	233,260.99	-	233,260.99
本期利润	663,335.06	51,036.00	714,371.06
本期基金份额交易产生的变动数	1,906.48	26,564.58	28,471.06
其中：基金申购款	423,690.64	155,505.93	579,196.57
基金赎回款	-421,784.16	-128,941.35	-550,725.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	898,502.53	77,600.58	976,103.11

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
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年8月9日(基金合同生效日)至2017年12月31日
活期存款利息收入	8,766.85	13,758.41
定期存款利息收入	89,622.27	266,557.59
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	22.89	5,357.01
合计	98,412.01	285,673.01

于 2018 年度，本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况 (2017 年度：同)。

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

无。

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 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年8月9日(基金合 同生效日)至2017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	231,979.30	-
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	231,979.30	-

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 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年8月9日(基金合 同生效日)至2017年12月31 日
卖出债券(、债转股及债券到期兑 付)成交总额	12,516,939.90	-
减：卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成本总额	11,843,323.20	-
减：应收利息总额	441,637.40	-
买卖债券差价收入	231,979.30	-

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

无。

7.4.7.16 股利收益

无。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 8 月 9 日(基金合同 生效日)至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	51,036.00	-
——股票投资	-	-
——债券投资	51,036.00	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	51,036.00	-

7.4.7.18 其他收入

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 8 月 9 日(基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日

基金赎回费收入	3,289.03	61,927.22
合计	3,289.03	61,927.22

本基金的赎回费率按持有期间递减, 赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

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 8 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	2,189.50	-
交易基金产生的费用	-	-
其中: 申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	2,189.50	-

7.4.7.20 其他费用

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 8 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	-	12,827.80
信息披露费	-	13,589.16
指数使用费	-	16,847.83
银行划款手续费	1,152.06	1,586.77
其他	-	400.00
银行间账户维护费	18,000.00	-
合计	19,152.06	45,251.56

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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 8 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	35,241.16	22,446.75
其中：支付销售机构的客	428.77	9.99

户维护费		
------	--	--

支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

7.4.10.2.2 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 8 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,747.02	7,482.22

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 0.10% 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 0.10% / 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

份额单位：份

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 8 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	9,897,060.28	-
期间申购/买入总份额	-	9,897,060.28
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,897,060.28	9,897,060.28
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	78.61%	49.94%

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 8 月 9 日 (基金合同生效日) 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
中国民生银行一活期存款	265,708.88	8,766.85	1,602,842.84	13,758.41
中国民生银行一定期存款	-	89,622.27	18,500,000.00	62,682.59

本基金的活期存款和部分定期存款由基金托管人中国民生银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.6 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 (2018 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**

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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、资产支持证券和同业存单的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、政策性金融债以外的债券。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

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

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金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、债券和买入返售金融资产等，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 2018 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	265,708.88	0.00	-	-	265,708.88
结算备付金	0.00	-	-	-	0.00
存出保证金	0.00	-	-	-	0.00
交易性金融资产	1,002,300.00	12,056,700.00	0.00	0.00	13,059,000.00
衍生金融资产	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	67,913.72	67,913.72
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	200.00	-	-	300,530.38	300,730.38
其他资产	-	-	-	17,918.48	17,918.48
资产总计	1,268,208.88	12,056,700.00	0.00	386,362.58	13,711,271.46
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	-	-	0.00
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	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	3,149.53	3,149.53
应付托管费	-	-	-	1,049.85	1,049.85
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	1,866.25	1,866.25
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	-	-	-	139,500.28	139,500.28
负债总计	0.00	0.00	0.00	145,565.91	145,565.91
利率敏感度缺口	1,268,208.88	12,056,700.00	0.00	240,796.67	13,565,705.55
上年度末 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	20,102,842.84	0.00	-	-	20,102,842.84
结算备付金	0.00	-	-	-	0.00
存出保证金	0.00	-	-	-	0.00
交易性金融资产	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融资产	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	31,160.24	31,160.24
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	7,918.48	7,918.48
资产总计	20,102,842.84	0.00	0.00	39,078.72	20,141,921.56
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	-	-	0.00
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	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	1,815.93	1,815.93
应付托管费	-	-	-	605.24	605.24
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	0.00	0.00
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	-	-	-	86,781.10	86,781.10
负债总计	0.00	0.00	0.00	89,202.27	89,202.27
利率敏感度缺口	20,102,842.84	0.00	0.00	-50,123.55	20,052,719.29

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 (2018 年 12 月 31 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
	市场利率上升 25 个基点	-82,210.41	0.00
	市场利率下降 25 个基点	82,967.08	0.00

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。本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

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 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二层次的余额为 13,059,000.00 元，无属于第一或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：本基金未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)。

(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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,059,000.00	95.24
	其中：债券	13,059,000.00	95.24
	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	265,708.88	1.94
8	其他各项资产	386,562.58	2.82
9	合计	13,711,271.46	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

本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	13,059,000.00	96.26
	其中：政策性金融债	13,059,000.00	96.26
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,059,000.00	96.26

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	160218	16 国开 18	100,000	10,024,000.00	73.89
2	180409	18 农发 09	10,000	1,021,700.00	7.53
3	180212	18 国开 12	10,000	1,011,000.00	7.45
4	180312	18 进出 12	10,000	1,002,300.00	7.39

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

本基金投资的前十名证券未超出基金合同规定的备选证券库。

8.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	67,913.72
5	应收申购款	300,730.38
6	其他应收款	17,918.48
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	386,562.58

8.11.4 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处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

8.11.6 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
225	55,953.79	9,897,060.28	78.61%	2,692,542.16	21.39%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	吴荆	1,994.00	40.00%
2	周淑婷	1,994.00	40.00%
3	朱胜元	997.00	20.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	493.21	0.00%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2017 年 8 月 9 日) 基金份额总额	244,540,496.47
本报告期期初基金份额总额	19,819,458.30
本报告期期间基金总申购份额	8,896,212.63
减:本报告期期间基金总赎回份额	16,126,068.49
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	12,589,602.44

§ 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。

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2018 年 4 月 19 日公告，根据工作需要，任命张庆先生担任本公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。

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 30,000.00 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	
东北证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
九州证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
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、本基金基金合同于 2017 年 8 月 9 日生效，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
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	关于增加北京加和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	2018年11月13日
2	关于新增北京肯特瑞财富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	2018年11月9日
3	关于增加南京苏宁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	2018年9月18日
4	建信基金管理有限责任公司关于增加上海挖财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	2018年9月12日
5	关于新增蚂蚁(杭州)基金销售有限公司为建信中证政策性金融	指定报刊和/或公司网站	2018年4月13日

	债 1-3 年指数 (LOF) 等基金销售机构的公告		
6	关于建信基金管理有限责任公司旗下部分证券投资基金修改基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 3 月 23 日
7	关于建信基金管理有限责任公司旗下部分证券投资基金调整赎回费率及赎回费计入基金财产比例的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 3 月 23 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

单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018 年 01 月 01 日-2018 年 12 月 31 日	9,897,060.28	0.00	0.00	9,897,060.28	78.61%
	2	2018 年 01 月 01 日-2018 年 02 月 04 日	9,897,060.28	0.00	9,897,060.28	0.00	0.00%
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。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中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 2、《建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金（LOF）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

2019 年 3 月 26 日