

建信内生动力混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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。

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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信内生动力混合
基金主代码	530011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 11 月 16 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	319,967,477.03 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	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，重点投资于消费性内生动力行业、投资性内生动力行业、服务性内生动力行业中具有持续竞争力优势的上市公司股票，力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为： $75\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+25\% \times$ 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	郭明
	联系电话	010-66228888	(010) 66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	(010) 66105798

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	http://www.ccbfund.cn
--------------------	---

址	
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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-58,453,086.09	610,904,055.59	214,910,789.46
本期利润	-86,042,687.53	323,886,170.81	397,406,854.73
加权平均基金份额本期利润	-0.2160	0.5691	0.2389
本期基金份额净值增长率	-11.27%	22.51%	34.97%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2469	0.4382	0.1242
期末基金资产净值	398,969,079.71	681,193,550.34	1,161,741,476.21
期末基金份额净值	1.247	1.438	1.301

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

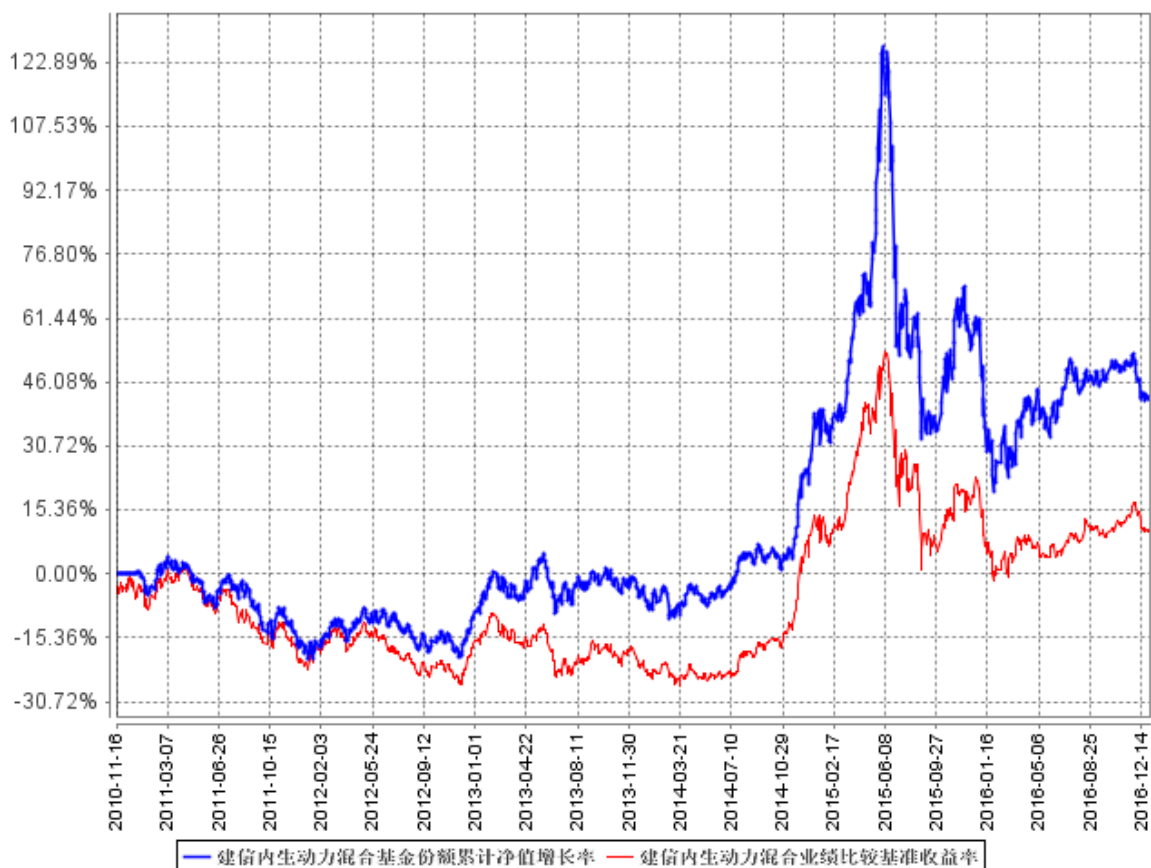
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.78%	0.76%	0.84%	0.55%	-4.62%	0.21%
过去六个月	-1.70%	0.76%	3.74%	0.58%	-5.44%	0.18%
过去一年	-11.27%	1.53%	-7.87%	1.05%	-3.40%	0.48%
过去三年	46.71%	1.65%	39.78%	1.34%	6.93%	0.31%
过去五年	72.29%	1.45%	40.34%	1.22%	31.95%	0.23%
自基金合同生效起至今	42.31%	1.36%	10.44%	1.18%	31.87%	0.18%

本基金投资业绩比较基准为： $75\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+25\% \times$ 中国债券总指数收益率。其中：沪深 300 指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准，中国债券总指数收益率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。

沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，它是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。指数样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值。成份股为市场中市场代表性好，流动性高，交易活跃的主流投资股票，能够反映市场主流投资的收益情况。中债系列指数由一个总指数（即中国债券总指数），若干个分指数构成。中国债券总指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债券等），理论上能客观反映中国债券总体情况。

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

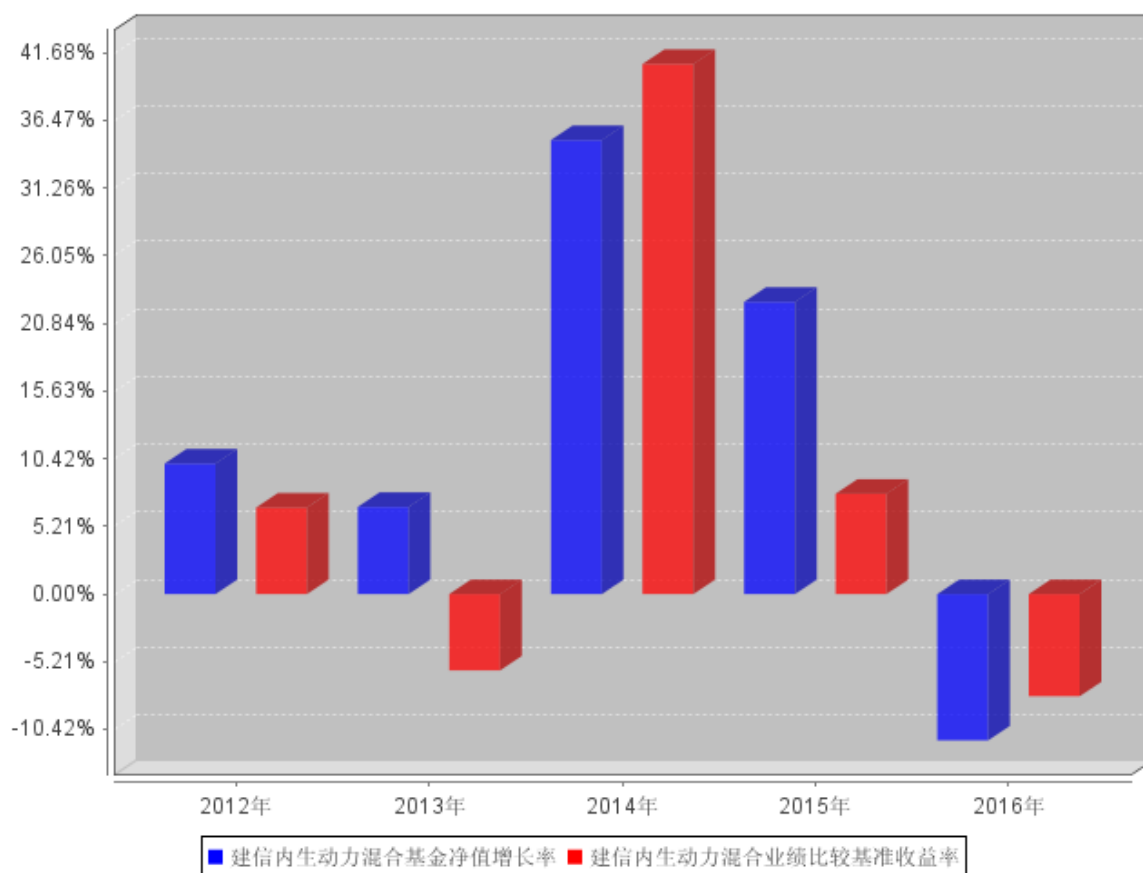
建信内生动力混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

建信内生动力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 2010 年 11 月 16 日生效，2010 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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2016	0.290	10,155,322.35	849,143.89	11,004,466.24	
2015	1.570	69,330,634.44	4,631,132.49	73,961,766.93	
2014	0.080	6,518,329.85	659,598.90	7,177,928.75	
合计	1.940	86,004,286.64	6,139,875.28	92,144,161.92	

§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、量化衍生品及海外投资部、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、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北两个营销中心，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 2016 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、建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、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、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置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、建信信用增强债券型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、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、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债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、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、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、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、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、建信安心保本二号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、建信瑞盛添利混合型证券投资基金、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、建信恒丰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共 82 只开放式基金，管理的公募基金资产规模共计为 3770.62 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		
吴尚伟	本基金的基金经理	2014 年 11 月 25 日	-	8	硕士。2004 年 9 月至 2007 年 4 月任长城伟业期货经纪有限公司深圳分公司投资顾问；2008 年 8 月至 2011 年 7 月任银华基金管理公司研究员；2011 年 7 月加入我公司，历任研究员、研究主管、研究部总监助理、基金经理。2014 年 11 月 25 日起任建信内生动力混合基金经理，2016 年 9 月 29 日起任建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2017 年 1 月 24 日起任建信恒稳价值混合型证

					券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	------------

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 19338 对投资组合，有 4101 对投资组合未通过 T 检验，其中 1329 对投资组合的正溢价率占优频率小于 55%，其它 2772 对正溢价率占优频率大于 55% 的投资组合中，其中 1807 对平均溢价率低于 2%，其它 965 对平均溢价率超过 2% 的投资组合中，其中

920 对贡献率均未超过 5%，另外 45 对溢价金额占组合净资产比例很小，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 20730 对投资组合，有 4694 对投资组合未通过 T 检验，但其中 822 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 3872 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中，其中 3601 对平均溢价率低于 5%，其它 271 对平均溢价率超过 5%的投资组合中，有 235 对贡献率未超过 5%，另外 36 对溢价金额占组合净资产比例很小，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 21350 对投资组合，有 5960 对投资组合未通过 T 检验，但其中 1162 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 4798 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合，其中 4709 对平均溢价率低于 10%，其它 89 对平均溢价率超过 10%的投资组合中，有 80 对贡献率均未超过 5%，另外 9 对溢价金额占组合净资产比例很小，同样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 2 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 2016 年，人民币汇率贬值较快，外汇储备明显减少，并且市场对于宏观经济硬着陆有较大担忧，资本市场的熔断机制也有放大效应，A 股市场出现恐慌性下跌。在快速下跌释放风险后，由于“供给侧”改革力度较大、阶段性经济增长有所起色、人民币汇率暂时稳定、全球风险资产整体反弹，市场的风险偏好逐渐回升，新能源汽车、智能驾驶、互联网金融等板块引领了市场反弹，食品饮料、家电等稳定类的行业表现也较好，反弹结束调整后，市场进入窄幅震荡区间。下半年在稳增长的大背景下，PPP 项目快速推出带动建筑与建材板块在三季度领涨全行业；2016 年上半年一线城市的房地产销售量价齐升，一线城市的商品房库存的快速下降释放了行业风险，并且价格的高企也有一定的外溢效应，逐步带动三四线城市的地产行业升温。地产行业的销售火爆带动了产业链的繁荣，如家电、家装、家具等；也推动了可选消费品的行业复苏，如白酒、珠宝、中高端汽车、旅游等。同时，随着保险公司资产管理规模的大幅提升，部分低估值高股息优势突出的权益类资产收到青睐，被频繁举牌，对市场带动较大。下半年，去产能持续推进

带来盈利状况改善的钢铁煤炭板块均取得较大涨幅。下半年，计算机、传媒板块受重组监管趋严及高估值消化压力影响，走势一致较弱；前期涨幅过大的电子也出现明显下跌。

本基金由于年初主要配置在新兴产业如生物育种、环保、生物医药、消费电子等行业，在市场快速下跌中受损较大，复牌的重仓股也对净值有较大负贡献；后期经过调整，组合以食品饮料、轻工制造、汽车零配件等稳定类的行业为主要配置，并投资了一些增长与估值基本匹配的成长行业如电商、新材料、快递等板块，也阶段性参与了周期行业的复苏。回顾全年，板块间快速轮动，年初的熔断释放了风险，也为后续风险偏好的修复提供了空间；对经济悲观的预期也在地产的火爆和供给侧改革的推进中逐渐修正，权威人士的谈话烫平了预期的大幅波动，市场在震荡中上行。由于年初熔断导致的跌幅较深，全年没能给投资者带来正贡献，我们深感遗憾和抱歉。

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-11.27%，波动率 1.53%，业绩比较基准收益率-7.87%，波动率 1.05%。

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 2017 年，宏观经济可能呈“前高后低”的走势。2016 年在房地产热销、基建规模提升、耐用消费品销售复苏的带动下，2016 年下半年经济出现企稳回升，这个趋势在 2017 年上半年将得到延续。但是 2016 年三季度末房地产政策收紧对经济的负面效果将在 17 年逐步体现，大规模的基建投资是否能对冲地产产业链的下滑还有较大不确定性，通胀预期的背景下中性的货币政策也边际收紧，这些因素的叠加可能导致经济在下半年再次步入调整阶段。

流动性方面，在经济短期趋稳、中心城市房地产价格大涨、上游原材料价格普遍上升等背景下，预计货币政策将维持中性偏紧的基调。IPO、再融资、大股东减持等行为对股票市场的资金需求仍然比较大，资本市场的流动性偏紧。

在经济震荡、流动性偏紧的背景下，2017 年股票市场难以出现趋势性行情，股票选择的重要性显得更加突出。本基金计划对业绩确定性的消费白马蓝筹股维持一定底仓不变，并且择机加大对确定性高增长公司的配置比例，周期品种上适当做一些轮动。

我们将在新的一年，勤勉尽责，尽力为基金持有人创造回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值

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。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总裁、督察长、投资总经理、研究总经理、风险管理总经理、运营总经理及监察稽核总经理组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，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。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，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）。

自 2015 年 3 月 26 日起，公司按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值价格，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）进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内于 2016 年 12 月 24 日发布了基金分红公告，于 2016 年 12 月 27 日向基金份额持有人每 10 份基金份额分配 0.29 元，收益分配基准日为 2016 年 12 月 16 日，共发放红利人民币 11,004,466.24 元，（包含现金和红利再投资形式），达到基金合同约定的利润分配要

求。

§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，本基金托管人在对建信内生动力混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，建信内生动力混合型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信内生动力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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，建信内生动力混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 11,004,466.24 元。

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

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信内生动力混合型证券投资基金 2016 年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了后附的建信内生动力混合型证券投资基金(原建信内生动力股票型证券投资基金，以下简称“建信内生动力混合基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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(2017)第 21859 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：建信内生动力混合型证券投资基金

报告截止日： 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		189,683,001.23	48,359,236.54
结算备付金		2,530,465.55	4,879,730.33
存出保证金		374,477.42	1,335,344.93
交易性金融资产		277,914,460.97	629,457,935.42
其中：股票投资		277,914,460.97	629,457,935.42
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		100,000,000.00	-
应收证券清算款		18,384,205.55	20,472,980.77
应收利息		33,245.42	18,975.36
应收股利		-	-
应收申购款		6,937.49	43,905.69
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		588,926,793.63	704,568,109.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 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		107,016,806.99	11,071,577.38
应付赎回款		74,763,219.17	204,422.93
应付管理人报酬		619,146.80	808,992.99
应付托管费		103,191.14	134,832.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		6,997,400.54	10,917,947.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		457,949.28	236,785.36
负债合计		189,957,713.92	23,374,558.70
所有者权益：			

实收基金		319,967,477.03	473,627,264.34
未分配利润		79,001,602.68	207,566,286.00
所有者权益合计		398,969,079.71	681,193,550.34
负债和所有者权益总计		588,926,793.63	704,568,109.04

报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.247 元，基金份额总额 319,967,477.03 份。

7.2 利润表

会计主体：建信内生动力混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-66,387,060.50	364,024,368.75
1. 利息收入		919,261.80	1,143,675.26
其中：存款利息收入		866,600.26	1,135,714.50
债券利息收入		1,534.15	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		51,127.39	7,960.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-39,801,827.66	649,416,918.89
其中：股票投资收益		-43,268,922.20	642,522,449.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益		106,682.25	-
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		3,360,412.29	6,894,469.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-27,589,601.44	-287,017,884.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		85,106.80	481,659.38
减：二、费用		19,655,627.03	40,138,197.94
1. 管理人报酬		7,573,421.83	13,299,578.46
2. 托管费		1,262,236.98	2,216,596.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		10,433,653.46	24,186,197.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		386,314.76	435,826.03

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-86,042,687.53	323,886,170.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-86,042,687.53	323,886,170.81

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信内生动力混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	473,627,264.34	207,566,286.00	681,193,550.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-86,042,687.53	-86,042,687.53
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）	-153,659,787.31	-31,517,529.55	-185,177,316.86
其中：1. 基金申购款	10,770,342.23	2,786,126.78	13,556,469.01
2. 基金赎回款	-164,430,129.54	-34,303,656.33	-198,733,785.87
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）	-	-11,004,466.24	-11,004,466.24
五、期末所有者权益（基金净值）	319,967,477.03	79,001,602.68	398,969,079.71
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	892,676,853.45	269,064,622.76	1,161,741,476.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	323,886,170.81	323,886,170.81

润)			
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)	-419,049,589.11	-311,422,740.64	-730,472,329.75
其中：1. 基金申购款	244,208,520.73	129,159,505.94	373,368,026.67
2. 基金赎回款	-663,258,109.84	-440,582,246.58	-1,103,840,356.42
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)	-	-73,961,766.93	-73,961,766.93
五、期末所有者权益(基金净值)	473,627,264.34	207,566,286.00	681,193,550.34

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 赵乐峰 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

建信内生动力混合型证券投资基金(原名为建信内生动力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[2010]1206号《关于核准建信内生动力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《建信内生动力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5,387,627,567.80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(2010)第299号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信内生动力股票型证券投资基金基金合同》于2010年11月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为5,388,220,664.00份基金份额，其中认购资金利息折合593,096.20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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。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》，建信内生动力股票型证券投资基金于2015年8月8日公告后更名为建信内生动力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《建信内生动力混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：投资于股票的基金资产占基金资产比例为60%-

95%，其中投资于内生动力行业(包括消费性内生动力行业、投资性内生动力行业和服务性内生动力行业)的基金资产占投资于股票的基金资产的比例不低于 80%；现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-40%，其中，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%，资产支持证券占基金资产净值的比例为 0%-20%，权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 X 75% + 中国债券总指数收益率 X 25%。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 2017 年 3 月 27 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》、《建信内生动力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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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股票投资和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公允价值变动计入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和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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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。

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，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[2008]38号《关于进一步规范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、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,573,421.83	13,299,578.46
其中：支付销售机构的客户维护费	1,394,804.02	2,896,046.75

1、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；

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,262,236.98	2,216,596.33

支付基金托管人中国工商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。

7.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

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

本报告期末及上年度末未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日（ 2010 年 11 月 16 日）持有的 基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	5,172,745.17
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	5,172,745.17
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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
工商银行：活期存款	189,683,001.23	800,161.72	48,359,236.54	1,027,889.55

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

本报告期末及上年度末，本基金未发生其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新发未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新发未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新发未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新发未上市	23.16	23.16	2,078	48,126.48	48,126.48	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新发未上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新发未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新发未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新发未上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-

002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新发未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新发未上市	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新发未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新发未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新发未上市	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新发未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002659	中泰桥梁	2016年11月3日	重大事项	23.08	2017年1月6日	19.60	463,800	10,170,802.24	10,704,504.00	-
300323	华灿光电	2016年4月18日	重大资产重组	8.99	2017年1月9日	8.65	600,000	5,023,680.00	5,394,000.00	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大资产重组	15.80	-	-	199,941	3,055,955.25	3,159,067.80	-

本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的

股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

至本报告期末，本基金银行间市场无债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

至本报告期末，本基金交易所市场无债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

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 2016 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 258,209,376.21 元，属于第二层次的余额为 19,705,084.76 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 563,762,532.82 元，第二层次 65,695,402.60 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或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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 2016 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(2015 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	277,914,460.97	47.19
	其中：股票	277,914,460.97	47.19
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	100,000,000.00	16.98
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	192,213,466.78	32.64
7	其他各项资产	18,798,865.88	3.19
8	合计	588,926,793.63	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	34,169,500.00	8.56
B	采矿业	5,139,500.00	1.29
C	制造业	192,370,174.88	48.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.01
E	建筑业	22,760,596.23	5.70

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,349,500.00	2.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,222,492.20	1.06
J	金融业	106,780.00	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,758,000.00	2.45
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	277,914,460.97	69.66

以上行业分类以 2016 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沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

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	000998	隆平高科	1,050,000	22,501,500.00	5.64
2	603808	歌力思	440,000	14,119,600.00	3.54
3	300285	国瓷材料	320,000	12,515,200.00	3.14
4	300207	欣旺达	900,000	12,510,000.00	3.14
5	600298	安琪酵母	700,000	12,474,000.00	3.13
6	000858	五粮液	360,000	12,412,800.00	3.11
7	002202	金风科技	700,000	11,977,000.00	3.00
8	000651	格力电器	450,000	11,079,000.00	2.78
9	002659	中泰桥梁	463,800	10,704,504.00	2.68
10	600596	新安股份	1,000,000	10,240,000.00	2.57

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站

www.ccbfund.cn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	000858	五 粮 液	63,904,498.16	9.38
2	300202	聚龙股份	54,857,245.21	8.05
3	000333	美的集团	54,063,523.08	7.94
4	000596	古井贡酒	41,123,638.13	6.04
5	600887	伊利股份	39,467,600.56	5.79
6	300207	欣旺达	37,949,021.85	5.57
7	002582	好想你	35,234,486.32	5.17
8	000998	隆平高科	35,217,668.87	5.17
9	601233	桐昆股份	34,611,058.03	5.08
10	600155	宝硕股份	33,583,296.59	4.93
11	000959	首钢股份	32,672,252.18	4.80
12	300113	顺网科技	29,979,748.78	4.40
13	002311	海大集团	29,070,325.43	4.27
14	600519	贵州茅台	28,700,984.60	4.21
15	601199	江南水务	27,804,348.37	4.08
16	002714	牧原股份	27,465,834.48	4.03
17	600547	山东黄金	27,294,441.13	4.01
18	000807	云铝股份	26,953,503.78	3.96
19	002624	完美世界	26,341,617.90	3.87
20	001979	招商蛇口	25,758,262.39	3.78
21	600298	安琪酵母	25,443,449.30	3.74
22	002271	东方雨虹	24,581,535.62	3.61
23	000651	格力电器	24,013,706.80	3.53
24	600848	上海临港	23,638,466.96	3.47
25	002051	中工国际	23,628,028.77	3.47
26	600114	东睦股份	23,518,024.86	3.45
27	600029	南方航空	21,872,781.00	3.21
28	600406	国电南瑞	21,682,663.28	3.18

29	000878	云南铜业	21,650,423.92	3.18
30	600549	厦门钨业	21,179,015.00	3.11
31	000983	西山煤电	20,843,411.30	3.06
32	600303	曙光股份	20,526,229.06	3.01
33	601058	赛轮金宇	19,751,271.83	2.90
34	002127	南极电商	19,359,247.02	2.84
35	600855	航天长峰	19,308,800.57	2.83
36	000059	华锦股份	19,000,765.04	2.79
37	000848	承德露露	18,886,130.00	2.77
38	000418	小天鹅A	18,859,774.09	2.77
39	603111	康尼机电	18,807,475.38	2.76
40	600325	华发股份	18,793,255.65	2.76
41	603808	歌力思	18,758,172.90	2.75
42	600198	大唐电信	18,285,249.50	2.68
43	000920	南方汇通	18,127,240.00	2.66
44	000925	众合科技	17,375,821.64	2.55
45	000911	南宁糖业	17,192,961.40	2.52
46	002518	科士达	17,071,263.00	2.51
47	600452	涪陵电力	17,064,173.99	2.51
48	000860	顺鑫农业	16,992,255.50	2.49
49	002202	金风科技	16,984,870.70	2.49
50	300219	鸿利智汇	16,306,499.50	2.39
51	600197	伊力特	15,711,825.01	2.31
52	000831	*ST 五稀	15,626,197.00	2.29
53	000055	方大集团	15,585,099.00	2.29
54	300285	国瓷材料	15,436,012.46	2.27
55	002626	金达威	15,254,747.09	2.24
56	601088	中国神华	15,143,785.76	2.22
57	600362	江西铜业	15,142,320.20	2.22
58	002680	长生生物	15,105,879.00	2.22
59	002394	联发股份	15,067,777.77	2.21
60	000783	长江证券	15,058,381.89	2.21
61	002196	方正电机	14,749,083.95	2.17
62	002050	三花智控	14,662,959.00	2.15
63	600068	葛洲坝	14,588,071.05	2.14
64	002152	广电运通	14,550,015.25	2.14

65	300383	光环新网	14,453,767.54	2.12
66	300156	神雾环保	14,358,394.00	2.11
67	600104	上汽集团	14,017,075.99	2.06
68	300209	天泽信息	13,997,781.00	2.05
69	002601	佰利联	13,942,273.00	2.05
70	600872	中炬高新	13,835,635.85	2.03
71	300322	硕贝德	13,809,766.19	2.03
72	600559	老白干酒	13,792,589.07	2.02
73	002001	新和成	13,642,801.79	2.00
74	600079	人福医药	13,640,901.83	2.00

上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300202	聚龙股份	78,555,984.53	11.53
2	000333	美的集团	53,662,506.23	7.88
3	000858	五粮液	50,085,896.97	7.35
4	000596	古井贡酒	49,471,562.73	7.26
5	002582	好想你	46,277,324.90	6.79
6	600887	伊利股份	45,579,215.16	6.69
7	000998	隆平高科	42,833,372.03	6.29
8	601058	赛轮金宇	35,825,419.96	5.26
9	601233	桐昆股份	35,603,995.98	5.23
10	002426	胜利精密	35,091,891.44	5.15
11	600155	宝硕股份	34,121,505.37	5.01
12	000959	首钢股份	33,362,030.30	4.90
13	300113	顺网科技	32,247,043.17	4.73
14	600477	杭萧钢构	32,084,574.24	4.71
15	600547	山东黄金	31,450,553.55	4.62
16	600519	贵州茅台	28,683,563.13	4.21
17	002311	海大集团	28,277,867.33	4.15
18	600715	文投控股	27,022,197.62	3.97
19	300017	网宿科技	26,905,706.78	3.95
20	002714	牧原股份	26,891,532.46	3.95
21	601888	中国国旅	26,070,356.70	3.83

22	600873	梅花生物	26,062,665.67	3.83
23	600718	东软集团	25,583,751.00	3.76
24	002394	联发股份	25,458,307.03	3.74
25	002624	完美世界	24,940,743.99	3.66
26	000807	云铝股份	24,638,382.90	3.62
27	001979	招商蛇口	24,417,134.00	3.58
28	600485	信威集团	24,227,417.00	3.56
29	601199	江南水务	24,152,422.00	3.55
30	002271	东方雨虹	24,031,337.62	3.53
31	300207	欣旺达	23,983,662.37	3.52
32	300322	硕贝德	23,512,242.47	3.45
33	600114	东睦股份	23,511,615.60	3.45
34	002094	青岛金王	23,494,905.33	3.45
35	600848	上海临港	23,339,832.21	3.43
36	600406	国电南瑞	21,692,955.00	3.18
37	000920	南方汇通	21,672,765.02	3.18
38	000878	云南铜业	21,588,800.00	3.17
39	002601	佰利联	21,584,060.09	3.17
40	603111	康尼机电	21,406,701.49	3.14
41	000983	西山煤电	21,329,244.10	3.13
42	002051	中工国际	21,009,809.42	3.08
43	600029	南方航空	20,871,917.16	3.06
44	000055	方大集团	20,336,612.58	2.99
45	600549	厦门钨业	19,903,930.00	2.92
46	600452	涪陵电力	19,502,874.80	2.86
47	600855	航天长峰	19,422,573.45	2.85
48	000848	承德露露	19,228,002.63	2.82
49	002518	科士达	19,149,731.00	2.81
50	002434	万里扬	19,010,308.31	2.79
51	002368	太极股份	18,999,690.04	2.79
52	600303	曙光股份	18,926,552.42	2.78
53	600325	华发股份	18,847,612.73	2.77
54	000963	华东医药	18,655,150.92	2.74
55	000418	小天鹅A	18,537,820.60	2.72
56	002630	华西能源	17,935,442.94	2.63
57	300362	天翔环境	17,683,990.73	2.60
58	600730	中国高科	17,490,671.38	2.57
59	600198	大唐电信	17,238,059.95	2.53

60	300383	光环新网	16,908,542.80	2.48
61	000860	顺鑫农业	16,897,417.00	2.48
62	600362	江西铜业	16,652,836.80	2.44
63	600197	伊力特	16,573,411.99	2.43
64	002120	新海股份	15,738,778.50	2.31
65	300356	光一科技	15,687,757.00	2.30
66	300156	神雾环保	15,473,635.76	2.27
67	300219	鸿利智汇	15,452,823.20	2.27
68	000911	南宁糖业	15,385,521.15	2.26
69	000955	欣龙控股	15,376,226.48	2.26
70	002680	长生生物	15,330,699.10	2.25
71	000831	*ST 五稀	15,181,160.00	2.23
72	002626	金达威	15,036,904.40	2.21
73	600872	中炬高新	14,840,931.97	2.18
74	002152	广电运通	14,696,722.13	2.16
75	002196	方正电机	14,623,044.22	2.15
76	002001	新 和 成	14,350,935.35	2.11
77	600298	安琪酵母	14,221,702.75	2.09
78	000705	浙江震元	14,068,712.28	2.07
79	601088	中国神华	14,018,252.58	2.06
80	600661	新南洋	13,997,807.33	2.05
81	000783	长江证券	13,862,145.12	2.03
82	300385	雪浪环境	13,853,630.37	2.03
83	600104	上汽集团	13,654,092.68	2.00

上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,264,297,414.01
卖出股票收入（成交）总额	3,544,982,364.82

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），不含相关交易费用。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	374,477.42
2	应收证券清算款	18,384,205.55
3	应收股利	-
4	应收利息	33,245.42
5	应收申购款	6,937.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,798,865.88

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处于转股期的可转换债券。

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	002659	中泰桥梁	10,704,504.00	2.68	重大事项停牌

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
8,136	39,327.37	146,055,708.93	45.65%	173,911,768.10	54.35%

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	34,866.60	0.01%

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（2010年11月16日）基金份额总额	5,388,220,664.00
本报告期期初基金份额总额	473,627,264.34
本报告期基金总申购份额	10,770,342.23
减：本报告期基金总赎回份额	164,430,129.54
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	319,967,477.03

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

我公司于2016年11月22日第四届董事会第五次会议决定调整高管职务名称，曲寅军任首席投资官（副总裁）、张威威任首席市场官（副总裁）。2016年12月23日公司第四届董事会第十二次临时会议决定吴曙明任首席风险官（副总裁）、吴灵玲任首席财务官（副总裁），已按有关规定报中国基金业协会和北京证监局备案，并于12月27日对外公告。

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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	1,480,148,133.31	21.75%	1,378,465.00	21.93%	-
中信建投	3	1,162,959,560.36	17.09%	1,080,218.51	17.19%	-
方正证券	1	1,138,935,208.29	16.74%	1,037,912.64	16.51%	-
国泰君安	1	748,866,972.40	11.00%	697,420.08	11.10%	-
渤海证券	1	545,444,283.02	8.02%	507,974.15	8.08%	-
长江证券	1	508,079,349.64	7.47%	463,010.45	7.37%	-
华泰证券	1	376,397,680.88	5.53%	343,006.46	5.46%	-
中投证券	2	370,504,167.26	5.44%	345,051.00	5.49%	-
安信证券	2	165,213,494.69	2.43%	150,558.72	2.40%	-
中银国际	1	128,011,132.44	1.88%	116,656.77	1.86%	-
申万宏源	2	122,885,457.85	1.81%	111,986.23	1.78%	-
中信证券	1	57,839,015.31	0.85%	52,708.80	0.84%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券(浙江)	1	-	-	-	-	-

银河证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	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、本报告期内剔除民生证券一个交易单元，新增天风证券一个交易单元；

4、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	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	120,000,000.00	28.92%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	924,216.40	100.00%	295,000,000.00	71.08%	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(浙江)	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司
2017年3月29日