建信深证100指数增强型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2018年8月25日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信深证100指数增强
场内简称	–
基金主代码	530018
前端交易代码	–
后端交易代码	–
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3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	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	56,032,163.28份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	–
上市日期	–

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对深证100指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略,以深证100指数作为基金投资组合的标的指数,结合深入的基本面研究及数量化投资技术,在指数化投资基础上优化调整投资组合,在控制与比较基准偏离风险的前提下,力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	陆志俊
	联系电话	010-66228888	95559
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95559
传真		010-66228001	021-62701216

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	1,226,016.74
本期利润	-10,133,342.33
加权平均基金份额本期利润	-0.1891
本期基金份额净值增长率	-10.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.6062
期末基金资产净值	90,000,443.56
期末基金份额净值	1.6062

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、上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。

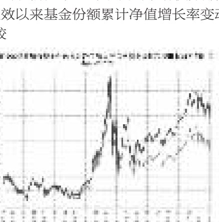
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-6.42%	1.58%	-8.09%	1.57%	1.67%	0.01%
过去三个月	-9.25%	1.31%	-11.38%	1.31%	2.13%	0.00%
过去六个月	-10.36%	1.31%	-13.93%	1.34%	3.57%	-0.03%
过去一年	0.41%	1.12%	-4.08%	1.15%	4.49%	-0.03%
过去三年	-6.69%	1.79%	-20.24%	1.63%	13.55%	0.16%
自基金合同生效起至今	60.62%	1.60%	24.48%	1.52%	36.14%	0.08%

本基金业绩比较基准为95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。深证100指数是中国证券市场第一只定位投资功能和代表多层次市场体系的指数。由深圳证券交易所委托深圳证券信息公司编制维护,此指数包含了深圳市场A股流通市值最大、成交最活跃的100只成份股。商业银行活期存款利率作为衡量本基金现金或到期日在一年以内的政府债券部分的业绩基准。

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



本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日,注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司,其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%,信安金融服务公司出资额占注册资本的25%,中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部,以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心,并在上海设立了子公司--建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持"创新、诚信、专业、稳健、共赢"的核心价值观,恪守"持有人利益重于泰山"的原则,以"建设财富生活"为崇高使命,坚持规范运作,致力成为"国际一流、国内领先的综合性资产管理公司"。

截至2018年6月30日,公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信中证500指数增强型证券投资基金、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信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、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)、建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金(LOF)、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、建信鑫利回报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、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、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,共计101只开放式基金,管理的基金净资产规模共计为6,342.88亿元。

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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理、本基金的基金经理	2012年3月16日	–	15	梁洪昀先生,金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师(CFA),博士。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司,历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金(LOF)的基金经理;2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2011年9月8日至2016年7月20日任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金(ETF)及其联接基金的基金经理;2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金的基金经理;2015年3月25日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理;2015年7月31日起任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理;2015年8月6日至2016年10月25日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理;2018年2月6日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2018年2月7日起任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年4月19日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2018年5月16日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;2018年6月13日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

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 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1次,原因是投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金管理人以量化分析研究为基础,利用量化模型进行指数增强和风险管理,并适当辅以其他策略以进一步提高收益。

在报告期初,市场在发生较大波动的同时,出现了较为明显的风格变换,2017年呈现的大市值股票表现集中占优的"一九现象"出现了明显缓解。基金较好地适应了这一变化,在报告期前期较为平稳地累积了超额收益。

在报告期中期,本基金标的指数中的权重股——中兴通讯出现了较长时间的停牌,并且下调了估值,这使本基金的超额收益出现了明显回撤,但持续时间较短。

在报告期后期,本基金再次实现了超额收益的平稳累积,并且,在整个报告期内,管理人实现了对跟踪误差的较好控制。

在报告期初和期末,本基金管理人积极应对成份股调整,在控制跟踪误差的基础上保持了超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-10.36%,波动率1.31%,业绩比较基准收益率-13.93%,波动率1.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年下半年,国际贸易摩擦、化解债务压力与保持宏观经济稳健增长之间的平衡、资管新规细化与落实节奏等因素都将对资本市场的运行造成深刻影响。在经历了上半年的调整后,预计股票市场总体波动性趋于缓和,但需要关注可能存在的事件冲击对于市场造成的影响。

本基金管理人将根据基金合同,继续坚持量化分析研究,进一步改进指数增强策略,密切关注和适应市场最新发展变化,力争持续获取稳健的超额收益。

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、运营总经理及内控合规总经理组成。

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、内控合规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

本报告期内本基金未实施利润分配,符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2018年上半年度,托管人在建信深证100指数增强型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2018年上半年度,建信基金管理有限责任公司在建信深证100指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2018年上半年度,由建信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关建信深证100指数增强型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:建信深证100指数增强型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		8,533,520.03	4,358,157.21
结算备付金		461,100.60	4,584,586.35
存出保证金		17,207.64	11,660.59
交易性金融资产		82,806,916.15	88,898,228.89
其中:股票投资		82,806,916.15	88,898,228.89
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		–	–
应收证券清算款		–	–
应收利息		2,504.00	4,020.96
应收股利		–	–
应收申购款		178,199.93	154,035.42
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		91,999,448.35	98,010,689.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30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		–	504.00
应付赎回款		176,392.28	1,772,750.86
应付管理人报酬		76,507.56	96,659.40
应付托管费		511,307.78	417,605.27
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		901,449.23	849,247.26
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		333,347.94	591,494.41
负债合计		1,999,004.79	3,728,261.20
所有者权益:			
实收基金		56,032,163.28	52,617,385.86
未分配利润		33,968,280.28	41,665,042.36
所有者权益合计		90,000,443.56	94,282,428.22
负债和所有者权益总计		91,999,448.35	98,010,689.42

报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.6062元,基金份额总额56,032,163.28份。

6.2 利润表

会计主体:建信深证100指数增强型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-8,851,427.80	15,616,571.36
1.利息收入		52,378.21	51,790.26
其中:存款利息收入		52,378.21	51,790.26
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		–	–
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		2,420,508.53	4,146,630.31
其中:股票投资收益		1,819,143.08	3,404,334.71
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		601,365.45	742,295.60
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-11,359,359.07	11,394,638.31
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		35,044.53	23,512.48
减:二、费用		1,281,914.53	1,368,676.75
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	468,512.40	412,778.82
2. 托管费	6.4.8.2.2	93,702.51	82,555.78
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	–	–
4. 交易费用		426,650.46	584,114.33
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		293,049.16	289,227.82
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-10,133,342.33	14,247,894.61
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-10,133,342.33	14,247,894.61

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信深证100指数增强型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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)	52,617,385.86	41,665,042.36	94,282,428.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	-10,133,342.33	-10,133,342.33
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)	3,414,777.42	2,436,580.25	5,851,357.67
其中:1.基金申购款	22,372,246.10	17,726,730.58	40,098,976.68
2.基金赎回款	-18,957,468.68	-15,290,150.33	-34,247,619.01
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)	56,032,163.28	33,968,280.28	90,000,443.56
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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)	52,013,062.39	19,245,505.74	71,258,568.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	14,247,894.61	14,247,894.61
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)	13,158,832.50	5,590,570.11	18,749,402.61
其中:1.基金申购款	30,295,684.09	13,632,806.07	43,928,490.16
2.基金赎回款	-17,136,851.59	-8,042,235.96	-25,179,087.55
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)	65,171,894.89	39,083,970.46	104,255,865.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信深证100指数增强型证券投资基金(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[2011]第2130号《关于核准建信深证100指数增强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《建信深证100指数增强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1,747,241,015.70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058号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信深证100指数增强型证券投资基金基金合同》于2012年3月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,747,440,444.36份基金份额,其中认购资金利息折合199,428.66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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信深证100指数增强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、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不低于90%,其中投资于深证100价格指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于80%。现金或到期一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为95%X深证100价格指数收益率+5%X商业银行活期存款利率(税后)。

6.4.2 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》、《建信深证100指数增强型证券投资基金基金合同》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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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日前取得的基金、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基金份额净值、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)对于内地投资者持有的基金类别,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。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别,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该内地基金分配利息时按照7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照10%的税率代扣代缴所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请,由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册,H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利,由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期,存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
交通银行股份有限公司("交通银行")	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2权证交易

无。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	468,512.40	412,778.82
其中:支付销售机构的客户维护费	–	172,235.89

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1.00%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 1.00% / 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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	93,702.51	82,555.78

支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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X0.2%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	8,533,520.03	17,554.78	131,570.02	10,167.09

1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2018年6月30日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示(2017年6月30日:同)。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 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
002739	万达电影	2017年7月4日	重大资产重组	38.03	–	–	38,600	2,007,206.00	1,467,958.00	–
002310	东方园林	2018年5月25日	重大资产重组	15.03	–	–	52,400	1,023,597.58	787,572.00	–
300072	三聚环保	2018年6月15日	重大事项	23.28	2018年7月10日	24.00	25,147	769,975.43	585,422.16	–
002450	康得新	2018年6月2日	重大资产重组	17.08	–	–	24,300	537,744.95	415,044.00	–
002668	奥马电器	2018年6月15日	重大事项	20.10	–	–	15,800	341,297.00	317,580.00	–
002252	上海莱士	2018年2月23日	重大资产重组	19.52	–	–	8,100	157,284.00	158,112.00	–

本基金截至2018年6月30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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)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。

(2)持续的以公允价值计量的金融工具

(a)各层次金融工具公允价值

于2018年6月30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级的余额为79,075,227.99元,属于第二层级的余额为3,731,688.16元,无属于第三层级的余额(2017年6月30日:第一层级95,716,372.18元,第二层级4,378,730.40元,无第三层级)。

(b)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。

(3)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年06月30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06月30日:同)。

(4)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。

§7 投资组合报告

7.1 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	82,806,916.15	90.01
	其中:股票	82,806,916.15	90.01
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	–	–
	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	8,994,620.63	9.78
7	其他各项资产	197,911.57	0.22
8	合计	91,999,448.35	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,183,090.56	1.31
B	采矿业	–	–
C	制造业	43,170,013.53	47.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	1,236,012.00	1.37
F	批发和零售业	1,539,899.50	1.71
G	交通运输、仓储和邮政业	414,000.00	0.46
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,547,152.90	3.94
J	金融业	4,924,123.91	5.47
K	房地产业	5,338,476.20	5.93
L	租赁和商务服务业	1,229,936.40	1.37
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	347,024.16	0.39
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	1,467,958.00	1.63
S	综合	–	–
	合计	64,397,687.16	71.55

以上行业分类以2018年6月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.2.2 期末积极投资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	289,329.18	0.32
B	采掘业	759,035.00	0.84
C	制造业	11,109,801.01	12.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	346,704.00	0.39
E	建筑业	729,759.00	0.81
F	批发和零售业	368,542.00	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	94,403.00	0.10
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	946,804.00	1.05
J	金融业	2,193,395.00	2.44
K	房地产业	236,860.00	0.26
L	租赁和商务服务业	174,624.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	434,960.80	0.48
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	720,940.00	0.80
R	文化、体育和娱乐业	4,072.00	0.00
S	综合	–	–
	合计	18,409,228.99	20.45

以上行业分类以2018年6月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.3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

7.3.1 指数投资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	000651	格力电器	131,054	6,179,196.10	6.87
2	000333	美的集团	102,187	5,336,205.14	5.93
3	002415	海康威视	99,003	3,675,981.39	4.08
4	000858	五 粮 液	41,393	3,145,868.00	3.50
5	000002	万 科A	94,092	2,314,663.20	2.57
6	000725	京东方A	637,500	2,256,750.00	2.51
7	002304	洋河股份	15,500	2,039,800.00	2.27
8	000001	平安银行	223,320	2,029,978.80	2.26
9	000568	泸州老窖	28,300	1,722,338.00	1.91
10	001979	招商蛇口	82,600	1,573,530.00	1.75

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。

7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002422	科伦药业	53,300	1,710,930.00	1.90
2	601988	中国银行	228,800	825,968.00	0.92
3	002001	新 和 成	39,170	742,663.20	0.83
4	002061	浙江交科	69,700	729,759.00	0.81
5	002044	美年健康	31,900	720,940.00	0.80

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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000568	泸州老窖	2,864,459.00	3.04
2	000538	云南白药	2,483,383.00	2.63
3	001979	招商蛇口	2,206,690.00	2.34
4	000858	五粮液	2,200,994.00	2.33
5	000100	TCL集团	2,030,676.00	2.15
6	002415	海康威视	2,000,672.32	2.12
7	000063	中兴通讯	1,872,633.80	1.99
8	000651	格力电器	1,693,221.00	1.80
9	601988	中国银行	1,663,069.00	1.76
10	002422	科伦药业	1,616,946.00	1.72
11	002241	歌尔股份	1,590,069.00	1.69
12	000333	美的集团	1,506,996.00	1.60
13	002736	国信证券	1,392,857.12	1.48
14	002027	分众传媒	1,374,713.00	1.46
15	300136	信维通信	1,373,367.72	1.46
16	000338	潍柴动力	1,327,648.00	1.41
17	002146	荣盛发展	1,314,221.00	1.39
18	000001	平安银行	1,286,490.00	1.36
19	002299	圣农发展	1,282,932.90	1.36
20	002164	宁波东力	1,274,501.00	1.35

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。

7.4.2 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	000651	格力电器	3,310,554.80	3.51
2	000538	云南白药	3,142,334.01	3.33
3	000338	潍柴动力	2,766,291.00	2.93
4	000858	五粮液	2,398,193.22	2.54
5	002241	歌尔股份	2,120,039.00	2.25
6	000060	中金岭南	1,994,564.16	2.12
7	000568	泸州老窖	1,846,199.00	1.96
8	000063	中兴通讯	1,785,670.00	1.89
9	000963	华东医药	1,749,695.00	1.86
10	000776	广发证券	1,719,993.15	1.82
11	300136	信维通信	1,685,589.24	1.79
12	002146	荣盛发展	1,578,501.00	1.67
13	002299	圣农发展	1,496,556.08	1.59
14	000050	深天马A	1,475,630.67	1.57
15	000402	金融街	1,419,533.03	1.51
16	002415	海康威视	1,415,457.00	1.50
17	002164	宁波东力	1,407,903.50	1.49
18	002572	索菲亚	1,380,961.30	1.46
19	002304	洋河股份	1,304,647.00	1.38
20	601288	农业银行	1,272,858.00	1.35

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。

7.4.3 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	143,160,169.90
卖出股票收入(成交)总额	139,711,266.65

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8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。

7.9 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。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1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。

7.10.2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。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1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。

7.11.2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。

7.11.3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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	17,207.64
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,504.00
5	应收申购款	178,199.93
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	197,911.57

7.12.4 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。

7.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
9,340	5,999.16	0.00	0.00%	56,032,163.28	100.00%

8.3 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	140,122.31	0.25%

8.4 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

截至本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年3月16日)基金份额总额	1,747,440,444.36
本报告期期初基金份额总额	52,617,385.86
本报告期基金总申购份额	22,372,246.10
减:本报告期基金总赎回份额	18,957,468.68
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	56,032,163.28

上述总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今,本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 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、证券业协会、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,本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
招商证券	3	121,458,508.08	43.05%	113,114.57	43.19%	–
华创证券	1	59,954,363.15	21.25%	55,838.69	21.32%	–
中泰证券	3	56,243,086.58	19.93%	52,381.42	20.00%	–
长江证券	2	44,507,234.07	15.77%	40,546.75	15.48%	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
安信证券	2	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
太平洋证券	1	–	–	–	–	–
华泰证券	4	–	–	–	–	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	2	–	–	–	–	–
瑞银证券	1	–	–	–	–	–
东吴证券	1	–	–	–	–	–
海通证券	1	–	–	–	–	–
中投证券	3	–	–	–	–	–
高华证券	1	–	–	–	–	–
中银国际	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、个股、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、本期本报告期内无新增或剔除交易单元。

4、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金公用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本报告期内,本基金租用的证券公司交易单元未进行其他证券投资。

建信基金管理有限责任公司

2018年8月25日