建信创新中国混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人：建信基金管理有限责任公司
基金托管人：中信银行股份有限公司
送出日期：2019年3月26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。

基金托管人中信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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信创新中国混合
基金主代码	000308
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月24日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	41,713,402.87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，追求基金资产的长期增值，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，本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	李修滨
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-21,923,276.30	11,358,527.36	4,201,756.10
本期利润	-21,982,411.85	13,608,842.77	-538,240.78
加权平均基金份额本期利润	-0.5179	0.2974	-0.0152
本期基金份额净值增长率	-20.98%	13.60%	-0.95%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.9738	1.4983	1.1988
期末基金资产净值	82,334,915.70	115,808,822.32	95,878,544.51
期末基金份额净值	1.974	2.498	2.199

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

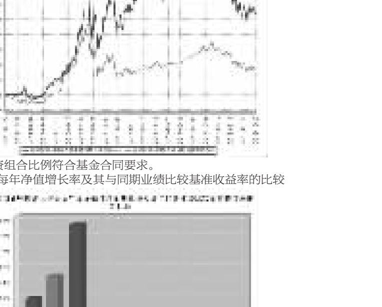
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-4.27%	1.39%	-8.58%	1.22%	4.31%	0.17%
过去六个月	-9.70%	1.35%	-9.66%	1.12%	-0.04%	0.23%
过去一年	-20.98%	1.26%	-17.43%	1.00%	-3.55%	0.26%
过去三年	-11.08%	1.24%	-12.00%	0.88%	0.92%	0.36%
过去五年	95.45%	1.58%	33.52%	1.15%	61.93%	0.43%
自基金合同生效起至今	97.40%	1.54%	27.08%	1.14%	70.32%	0.40%

本基金投资业绩比较基准为：75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。本基金为股票型证券投资基金，投资范围主要包括A股、债券类资产、货币市场投资品种以及现金等金融工具。其中投资于股票的基金资产占基金资产比例为60%-95%，在实际投资运作中，本基金股票投资比例均值约为75%，故本基金采取75%作为复合业绩比较基准中衡量股票投资部分业绩表现的权重，相应将25%作为衡量债券投资部分业绩表现的权重。

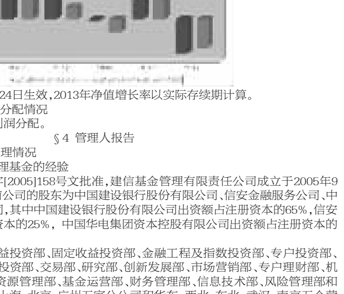
沪深300指数是由中证指数公司编制的，从上海和深圳股票市场中选取的300只A股作为样本编制而成的成份股指数。该指数样本覆盖了沪深市场七成左右的流通市值和超过四分之三的总市值，是具有良好的市场代表性、能够反映A股市场整体走势的指数。沪深300指数中的很多成份股本身即为业绩优良的蓝筹品种，以其为标的的指数期货也已经推出，从而会为本基金带来新的投资机会和风险管理手段。因此，基金管理人选择沪深300指数作为本基金股票部分的比较基准。中国债券总指数的发布主体是中央国债登记结算有限责任公司。中央国债登记结算公司是全国债券市场内提供国债、金融债券、企业债券和其他固定收益证券的登记、托管、交易结算等服务的国有独资金融机构，是财政部唯一授权主持建立、运营全国国债托管系统的机构，是中国人民银行指定的全国银行间债券市场债券登记、托管、结算机构和商业银行柜台记账式国债交易的一级托管人。同时中国债券总指数是目前国内涵盖范围最广的债券指数之一，具有良好的市场代表性。由此可见，上述两个指数的发布主体在证券市场上具有较高的市场代表性、权威性和中立性，适合作本基金的业绩比较基准。

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



本报告期本基金投资组合比例符合基金合同要求。

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



本基金合同自2013年9月24日生效，2013年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2018年12月31日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深300指数证券投资基金（LOF）、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信中证500指数增强型证券投资基金、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造2025股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债1-3年指数证券投资基金（LOF）基金、建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金（LOF）基金、建信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、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		
邵卓	权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官、本基金的基金经理	2015年5月22日	–	8	硕士，权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官。2006年4月至2006年12月任明基（西门子）移动通信研发中心软件工程师；2007年2月至2010年7月任IBM中国软件实验室软件工程师；2010年7月加入广发证券公司，任计算机行业研究员。邵卓于2011年9月加入我公司研究部，历任研究员、研究主管，2015年3月24日起任建信信息产业股票型证券投资基金的基金经理；2015年5月22日起任建信创新中国混合型证券投资基金的基金经理；2017年12月19日起任建信安心保本三号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于2018年1月11日起转型为建信裕利灵活配置混合型证券投资基金，邵卓继续担任该基金的基金经理。

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》、《证券投资基金管理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、正溢价率点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

2018年是A股大幅调整的一年，全年上证综指下跌24.59%，上证50下跌19.83%，沪深300下跌25.31%，创业板指下跌28.65%。电子元器件、有色、传媒等板块跌幅居前，餐饮旅游和银行跌幅最小，各个行业和大小市值股票普跌。

中美贸易摩擦和国内金融去杠杆条件下的流动性紧缩，是A股市场大幅下跌的主要原因，期间也夹杂着市场对民营经济经营环境和信心的担忧。年内各种风险逐步暴露恶化，给组合管理带来难度和挑战。

中美贸易摩擦对科技板块估值带来严重伤害，科技股是全球产业链分工最受益的行业，全球化程度最高，而且美国在IT行业高端领域居于领导地位，因此A股TMT板块对中美贸易摩擦反应最为剧烈，也是全年下跌幅度最大的行业板块。国内的金融去杠杆政策，控制了前几年快速扩张的影子银行规模，是长期正确但会带来短期痛苦的政策选择，副作用是对地方政府的基建投资带来剧烈的调整，拉低了经济增长的动能。P2P等金融产品的清理整顿以及股市下跌，对居民部门消费能力形成挤压，2018年四季度出现消费数据的大幅下滑，贵州茅台季度业绩低于预期带来消费股的集体调整，年中一度表现优异的医药股也在年底带量采购政策的影响下出现补跌。到年底，股市下跌带来大量上市公司大股东质押风险暴露到可能出现控制权易手的风险，严重影响了企业的持续经营和实体经济运行，股权质押已经成为可能导致经济系统性风险的重要因素。正是考虑到各种负面因素交叠的现实情况，国内政策选择也在年底出现了变化，金融去杠杆动作暂缓，钟摆再次向货币宽松托底经济的方向摆动。

建信创新中国基金的配置思路，主要在科技创新领域受益的行业范围内自下而上选股，通过寻找和筛选个股的基本面变化争取实现超额收益。2018年，能够依靠业绩增长的阿尔法抵消系统性下跌的个股数量非常稀缺。作为偏股混合型基金，股票仓位需要在60%以上运行，也给组合管理带来一定难度。

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-20.98%，波动率1.26%，业绩比较基准收益率-17.43%，波动率1.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年，除了延续2018年4月份降准以后的宽松的货币政策以外，金融去杠杆监管政策的转向对金融市场影响更大。从宽货币到宽信用的传导，受制于企业盈利空间有限的现实，顺利传导可能更需要其他结构性改革和政策的支持，或者更长时间的货币宽松环境。尽管经济基本面仍然需要观察信用传导的具体效果，但考虑到2018年底极低的A股市场估值，并考虑到眼下是本轮宽松周期的起点这一现实，我们认为大体上可以对2019年的收益前景保持乐观。政策层面，科创板的推出大概率会带动相关板块的估值和情绪修复。考虑到非洲猪瘟的影响，从2019年下半年开始，可能需要考虑到猪肉价格上涨给CPI带来的压力，警惕宽松周期结束带来的风险。

我们认为，2019年A股上司公司行业间基本面的分化将更加明显，自下而上的个股选择将更加重要。

从更长的眼光来看，如果贸易摩擦能带来国内结构性改革，重塑利益分配格局，未来也有可能出现企业盈利驱动的牛市行情。否则，货币宽松、资产价格上涨、杠杆率提升的循环下，短期将出现新一轮宽松环境导致的资产上涨行情。

2019年本基金将继续延续积极进取的投资策略，精选科技创新潜力方向和价值低估个股，努力为投资者实现收益。

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[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。

4.7 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对建信创新中国混合型证券投资基金本年度基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了后附的建信创新中国混合型证券投资基金(以下简称“建信创新中国混合基金”)的财务报表，包括2018年12月31日的资产负债表、2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表，并出具了普华永道中天审字(2019)第22597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报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信创新中国混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款		7,339,984.48	10,141,274.99
结算备付金		373,710.68	544,850.87
存出保证金		147,944.51	123,897.23
交易性金融资产		54,428,583.00	95,817,879.66
其中：股票投资		54,428,583.00	92,365,913.26
基金投资		–	–
债券投资		–	3,451,966.40
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		12,300,000.00	10,300,000.00
应收证券清算款		9,441,837.50	2,375,261.61
应收利息		14,937.16	456.07
应收股利		–	–
应收申购款		23,332.29	374,724.89
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		84,070,329.62	119,678,345.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		–	2,314,516.25
应付赎回款		159,109.62	316,680.84
应付管理人报酬		106,688.43	146,935.24
应付托管费		17,781.41	24,489.20
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		1,149,975.18	638,590.96
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		301,859.28	428,310.51
负债合计		1,735,413.92	3,869,523.00
所有者权益：			
实收基金		41,713,402.87	46,354,412.12
未分配利润		40,621,512.83	69,454,410.20
所有者权益合计		82,334,915.70	115,808,822.32
负债和所有者权益总计		84,070,329.62	119,678,345.32

报告截止日2018年12月31日，基金份额净值1.974元，基金份额总额41,713,402.87份。

7.2 利润表

会计主体：建信创新中国混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		-18,101,799.16	17,760,999.78
1.利息收入		213,783.19	233,286.57
其中：存款利息收入		179,948.66	204,059.55
债券利息收入		2,051.89	153.05
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		31,782.64	29,073.97
其他利息收入		–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）		-18,308,417.87	15,201,321.53
其中：股票投资收益		-18,868,660.13	14,410,759.11
基金投资收益		–	–
债券投资收益		-19,328.24	28,583.72
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		579,570.50	761,978.70
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-59,135.55	2,250,315.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）		51,971.07	76,076.27
减：二、费用		3,880,612.69	4,152,157.01
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,411,504.63	1,621,818.10
2. 托管费	7.4.8.2.2	235,250.85	270,302.99
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	–	–
4. 交易费用		1,840,823.90	1,882,404.97
5. 利息支出		–	–
其中：卖出回购金融资产支出		–	–
6. 税金及附加		7.38	–
7. 其他费用		393,025.93	377,630.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-21,982,411.85	13,608,842.77
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-21,982,411.85	13,608,842.77

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信创新中国混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	46,354,412.12	69,454,410.20	115,808,822.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-21,982,411.85	-21,982,411.85
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）	-4,641,009.25	-6,850,485.52	-11,491,494.77
其中：1.基金申购款	16,145,973.17	21,677,298.85	37,823,272.02
2.基金赎回款	-20,786,982.42	-28,527,784.37	-49,314,766.79
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）	41,713,402.87	40,621,512.83	82,334,915.70
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	43,604,070.36	52,274,474.15	95,878,544.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	13,608,842.77	13,608,842.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,750,341.76	3,571,093.28	6,321,435.04
其中：1.基金申购款	33,521,689.10	47,098,783.51	80,620,472.61
2.基金赎回款	-30,771,347.34	-43,527,690.23	-74,299,037.57
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）	46,354,412.12	69,454,410.20	115,808,822.32

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

建信创新中国混合型证券投资基金（原名为建信创新中国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[2013]737号《关于核准建信创新中国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《建信创新中国股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币938,108,917.07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(2013)第603号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信创新中国股票型证券投资基金基金合同》于2013年9月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为938,476,234.90份基金份额，其中认购资金利息折合367,317.83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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

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》，建信创新中国股票型证券投资基金于2015年8月8日公告后更名为建信创新中国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《建信创新中国混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票占基金资产的比例为60%-95%；债券、权证、货币市场工具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，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为75% X 沪深300指数收益率 + 25% X 中国债券总指数收益率。

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》、《建信创新中国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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司(“建信基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	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

7.4.8.1.1 股票交易

无。

7.4.8.1.2 债券交易

无。

7.4.8.1.3 债券回购交易

无。

7.4.8.1.4 权证交易

无。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,411,504.63	1,621,818.10
其中：支付销售机构的客户维护费	558,488.80	634,211.21

支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 1.50%/ 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	235,250.85	270,302.99

支付基金托管人中信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

无。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行-活期存款	7,339,984.48	169,386.93	10,141,274.99	193,397.64

本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（ 2018年12月31日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为54,428,583.00元，无属于第二或第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次92,717,166.63元，第二层次3,100,713.03元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	54,428,583.00	64.74
	其中：股票	54,428,583.00	64.74
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	12,300,000.00	14.63
	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	7,713,695.16	9.18
8	其他各项资产	9,628,051.46	11.45
9	合计	84,070,329.62	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	3,010,743.12	3.66
B	采矿业	1,607,095.65	1.95
C	制造业	29,248,286.83	35.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,981,642.00	7.27
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	5,035,086.00	6.12
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,634,463.00	6.84
J	金融业	1,292,396.40	1.57
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	878,920.00	1.07
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	1,739,950.00	2.11
S	综合	–	–
	合计	54,428,583.00	66.11

以上行业分类以2018年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	600548	深高速	560,700	5,035,086.00	6.12
2	600011	华能国际	577,700	4,263,426.00	5.18
3	300628	亿联网络	54,223	4,210,958.18	5.11
4	600406	国电南瑞	170,700	3,163,071.00	3.84
5	002299	圣农发展	182,028	3,010,743.12	3.66
6	603218	日月股份	178,100	2,942,212.00	3.57
7	600038	中直股份	75,062	2,804,316.32	3.41
8	002531	天顺风能	591,900	2,633,955.00	3.20
9	002230	科大讯飞	100,300	2,471,392.00	3.00
10	300207	欣旺达	282,500	2,426,675.00	2.95

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	22,943,743.00	19.81
2	600048	保利地产	18,853,823.80	16.28
3	600519	贵州茅台	15,108,189.00	13.05
4	600703	三安光电	12,977,794.05	11.21
5	002415	海康威视	12,150,104.47	10.49
6	300628	亿联网络	11,972,203.00	10.34
7	000063	中兴通讯	11,127,658.73	9.61
8	002127	南极电商	11,041,869.47	9.53
9	002236	大华股份	9,254,896.20	7.99
10	600487	亨通光电	9,167,320.00	7.92
11	002212	南洋股份	8,711,495.00	7.52
12	601888	中国国旅	8,534,102.03	7.37
13	600011	华能国际	7,633,890.49	6.59
14	000717	韶钢松山	7,620,454.01	6.58
15	000938	紫光股份	7,474,514.00	6.45
16	600028	中国石化	7,303,772.00	6.31
17	002310	东方园林	7,265,520.75	6.27
18	300308	中际旭创	7,206,749.45	6.22
19	000661	长春高新	7,184,185.47	6.20
20	603019	中科曙光	7,140,943.00	6.17
21	000725	京东方A	6,638,722.00	5.73
22	000968	蓝焰控股	6,319,199.68	5.46
23	002007	华兰生物	6,067,964.60	5.24
24	000932	华菱钢铁	5,886,300.00	5.08
25	000002	万科A	5,639,484.00	4.87
26	300138	晨光生物	5,585,125.40	4.82
27	600583	海油工程	5,554,054.25	4.80
28	002153	石基信息	5,548,473.82	4.79
29	603986	兆易创新	5,371,861.56	4.64
30	300398	飞凯材料	5,172,378.43	4.47
31	002912	中新赛克	5,164,480.60	4.46
32	600566	济川药业	5,140,357.00	4.44
33	601398	工商银行	5,079,069.00	4.39
34	600548	深高速	4,993,202.77	4.31
35	000066	中国长城	4,915,200.94	4.24
36	600029	南方航空	4,880,817.00	4.21
37	002466	天齐锂业	4,868,943.55	4.20
38	601111	中国国航	4,856,010.91	4.19
39	002920	德赛西威	4,452,485.03	3.84
40	002916	深南电路	4,281,286.00	3.70
41	601088	中国神华	4,273,142.00	3.69
42	002110	三钢闽光	4,223,035.00	3.65
43	600702	舍得酒业	4,119,762.00	3.56
44	002299	圣农发展	4,106,888.42	3.55
45	300107	建新股份	4,073,691.00	3.52
46	601607	上海医药	4,049,568.00	3.50
47	300070	碧水源	3,941,107.40	3.40
48	603008	喜临门	3,934,494.10	3.40
49	002373	千方科技	3,922,677.87	3.39
50	300136	信维通信	3,888,824.36	3.36
51	002396	星网锐捷	3,811,571.00	3.29
52	002463	沪电股份	3,792,337.69	3.27
53	600340	华夏幸福	3,765,928.00	3.25
54	601318	中国平安	3,697,060.00	3.19
55	601877	正泰电器	3,648,383.00	3.15
56	002371	北方华创	3,647,288.00	3.15
57	601225	陕西煤业	3,642,862.00	3.15
58	600038	中直股份	3,400,793.54	2.94
59	600498	烽火通信	3,396,671.00	2.93
60	600570	恒生电子	3,392,947.90	2.93
61	600406	国电南瑞	3,369,570.00	2.91
62	300296	利亚德	3,355,696.00	2.90
63	600741	华域汽车	3,345,474.83	2.89
64	601699	潞安环能	3,297,132.00	2.85
65	600312	平高电气	3,250,275.00	2.81
66	600585	海螺水泥	3,090,553.00	2.67
67	600352	浙江龙盛	3,060,804.91	2.64
68	002042	华孚时尚	3,060,648.92	2.64
69	600196	复星医药	3,052,209.00	2.64
70	000910	大亚圣象	3,042,673.00	2.63
71	002717	岭南股份	2,962,179.00	2.56
72	300422	博世科	2,957,065.00	2.55
73	000651	格力电器	2,948,788.00	2.55
74	603833	欧派家居	2,911,258.48	2.51
75	601717	郑煤机	2,851,784.24	2.46
76	601155	新城控股	2,835,733.50	2.45
77	002707	众信旅游	2,807,814.00	2.42
78	002531	天顺风能	2,571,615.40	2.22
79	000977	浪潮信息	2,536,217.00	2.19
80	601668	中国建筑	2,534,714.59	2.19
81	603533	掌阅科技	2,520,989.00	2.18
82	603660	苏州科达	2,516,428.40	2.17
83	300207	欣旺达	2,512,362.00	2.17
84	000963	华东医药	2,508,392.00	2.17
85	601288	农业银行	2,482,515.00	2.14
86	603218	日月股份	2,478,597.00	2.14
87	002230	科大讯飞	2,478,098.50	2.14
88	002572	索菲亚	2,406,419.00	2.08
89	002496	ST辉丰	2,365,357.00	2.04
90	002146	荣盛发展	2,363,394.00	2.04
91	002705	新宝股份	2,363,040.00	2.04
92	300081	恒信东方	2,340,029.00	2.02

上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	22,528,108.03	19.45
2	000858	五粮液	20,991,047.56	18.13
3	002127	南极电商	19,351,874.28	16.71
4	600048	保利地产	18,449,696.54	15.93
5	600487	亨通光电	14,380,682.23	12.42
6	000063	中兴通讯	12,327,897.00	10.65
7	300138	晨光生物	12,245,064.80	10.57
8	600703	三安光电	10,735,725.46	9.27
9	000661	长春高新	10,431,962.82	9.01
10	002415	海康威视	9,049,846.09	7.81
11	002236	大华股份	8,440,840.00	7.29
12	000498	山东路桥	8,391,560.00	7.25
13	300628	亿联网络	7,993,572.30	6.90
14	000938	紫光股份	7,859,260.00	6.79
15	002212	南洋股份	7,512,686.13	6.49
16	600028	中国石化	7,461,877.00	6.44
17	002310	东方园林	7,458,718.70	6.44
18	000717	韶钢松山	7,340,071.05	6.34
19	601888	中国国旅	7,331,194.89	6.33
20	603019	中科曙光	6,701,430.00	5.79
21	300308	中际旭创	6,617,803.02	5.71
22	002007	华兰生物	6,097,288.30	5.26
23	000932	华菱钢铁	5,903,759.48	5.10
24	000725	京东方A	5,888,165.16	5.08
25	002153	石基信息	5,877,658.00	5.08
26	000002	万科A	5,658,269.00	4.89
27	600183	生益科技	5,649,010.94	4.88
28	002912	中新赛克	5,601,277.83	4.84
29	600887	伊利股份	5,576,103.36	4.81
30	300398	飞凯材料	5,482,403.52	4.73
31	600583	海油工程	5,427,658.44	4.69
32	603986	兆易创新	5,267,722.00	4.55
33	000066	中国长城	5,169,045.13	4.46
34	601398	工商银行	4,952,833.00	4.28
35	601088	中国神华	4,672,571.00	4.03
36	002463	沪电股份	4,613,041.00	3.98
37	002916	深南电路	4,527,074.00	3.91
38	000651	格力电器	4,471,570.45	3.86
39	002466	天齐锂业	4,425,881.37	3.82
40	601111	中国国航	4,419,600.00	3.82
41	600029	南方航空	4,384,510.00	3.79
42	002920	德赛西威	4,316,827.42	3.73
43	000968	蓝焰控股	4,290,664.32	3.70
44	002110	三钢闽光	4,059,580.00	3.51
45	300070	碧水源	4,009,936.15	3.46
46	002371	北方华创	3,995,229.00	3.45
47	300107	建新股份	3,869,544.90	3.34
48	601607	上海医药	3,835,565.07	3.31
49	601225	陕西煤业	3,819,332.00	3.30
50	300136	信维通信	3,808,689.55	3.29
51	600809	山西汾酒	3,714,021.25	3.21
52	601877	正泰电器	3,673,555.00	3.17
53	600702	舍得酒业	3,652,646.00	3.15
54	600340	华夏幸福	3,532,418.00	3.05
55	600031	三一重工	3,510,283.00	3.03
56	600416	湘电股份	3,496,961.12	3.02
57	603008	喜临门	3,454,583.67	2.98
58	002373	千方科技	3,452,875.36	2.98
59	601318	中国平安	3,416,211.13	2.95
60	600000	浦发银行	3,374,487.00	2.91
61	600566	济川药业	3,330,947.28	2.88
62	601699	潞安环能	3,315,590.71	2.86
63	600570	恒生电子	3,305,111.00	2.85
64	002496	ST辉丰	3,297,942.00	2.85
65	600498	烽火通信	3,263,321.00	2.82
66	600741	华域汽车	3,227,023.70	2.79
67	600011	华能国际	3,197,881.02	2.76
68	300422	博世科	3,085,391.11	2.66
69	002707	众信旅游	3,038,326.82	2.62
70	600585	海螺水泥	3,003,615.70	2.59
71	000998	隆平高科	2,985,733.88	2.58
72	600438	通威股份	2,935,379.86	2.53
73	601155	新城控股	2,924,111.00	2.52
74	002717	岭南股份	2,911,979.99	2.51
75	603833	欧派家居	2,822,908.60	2.44
76	600196	复星医药	2,766,678.00	2.39
77	600352	浙江龙盛	2,748,024.00	2.37
78	601717	郑煤机	2,744,150.28	2.37
79	601668	中国建筑	2,609,755.00	2.25
80	600298	安琪酵母	2,587,562.05	2.23
81	603660	苏州科达	2,585,191.00	2.23
82	002146	荣盛发展	2,549,441.00	2.20
83	000977	浪潮信息	2,458,682.00	2.12
84	002042	华孚时尚	2,409,380.00	2.08
85	603501	韦尔股份	2,377,962.46	2.05
86	600312	平高电气	2,371,673.00	2.05
87	603533	掌阅科技	2,345,383.00	2.03
88	300156	神雾环保	2,333,603.97	2.02

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	596,505,442.55
卖出股票收入（成交）总额	615,463,183.52

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未投资于国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未披露被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	147,944.51
2	应收证券清算款	9,441,837.50
3	应收股利	–
4	应收利息	14,937.16
5	应收申购款	23,332.29
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	9,628,051.46

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
12,079	3,453.38	197,637.46	0.47%	41,515,765.41	99.53%

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	32,903.05	0.08%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年9月24日）基金份额总额	938,476,234.90
本报告期期初基金份额总额	46,354,412.12
本报告期期间基金总申购份额	16,145,973.17
减：本报告期期间基金总赎回份额	20,786,982.42
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	41,713,402.87

总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，本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	
中金公司	2	256,707,592.63	21.18%	236,674.42	21.17%	–
华融证券	1	194,032,654.91	16.01%	180,703.34	16.17%	–
广发证券	1	120,281,898.02	9.92%	112,018.48	10.02%	–
天风证券	1	106,271,274.60	8.77%	96,847.38	8.66%	–
民族证券	1	90,867,172.18	7.50%	82,805.71	7.41%	–
安信证券	1	89,843,988.73	7.41%	83,671.98	7.49%	–
上海证券	1	63,715,511.80	5.26%	58,063.08	5.19%	–
光大证券	1	51,608,185.17	4.26%	48,063.34	4.30%	–
东兴证券	1	48,455,445.53	4.00%	45,127.27	4.04%	–
光大证券	1	46,098,476.78	3.80%	42,006.28	3.76%	–
渤海证券	1	37,916,281.91	3.13%	34,553.20	3.09%	–
中投证券	1	34,579,621.23	2.85%	31,513.39	2.82%	–
中信建投	1	22,677,990.27	1.87%	20,667.46	1.85%	–
信达证券	2	21,484,761.23	1.77%	19,577.97	1.75%	–
宏信证券	1	19,909,124.58	1.64%	18,541.23	1.66%	–
民生证券	1	7,518,646.50	0.62%	7,002.21	0.63%	–
长江证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	1	–	–	–	–	–
申万宏源	2	–	–	–	–	–
华创证券	1	–	–	–	–	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
太平洋证券	1	–	–	–	–	–
国信证券	1	–	–	–	–	–
国泰君安	1	–	–	–	–	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	1	–	–	–	–	–
广州证券	1	–	–	–	–	–
东北证券	1	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
方正证券	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、本基金本报告期内新增广发证券、天风证券、上海证券各一个交易单元，未剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	3,487,341.80	100.00%	–	–	–	–
华融证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
天风证券	–	–	–	–	–	–
民族证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
上海证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
渤海证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	20,500,000.00	100.00%	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–
宏信证券	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
太平洋证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
广州证券	–	–	–	–	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–

建信基金管理有限责任公司

2019年3月26日