建信社会责任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:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2019年3月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信社会责任混合
基金主代码	630019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月14日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,949,139.52份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴剑明	贺婧
	联系电话	010-66228988	010-66060069
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tgxxpl@abc.china.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95599
传真		010-66229001	010-68121816

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-5,770,589.34	1,616,913.43	-2,602,809.38
本期利润	-7,282,706.00	3,382,993.80	-3,904,201.15
加权平均基金份额本期利润	-0.5247	0.2128	-0.2041
本期基金份额净值增长率	-24.85%	10.70%	-9.88%
3.1.2期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.6293	1.1624	0.9528
期末基金资产净值	22,726,763.80	31,333,597.93	33,646,999.57
期末基金份额净值	1.629	2.162	1.963

1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分)。

3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

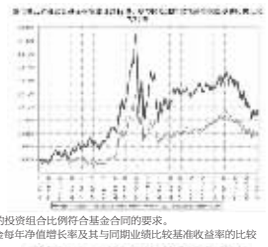
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.12%	1.42%	-8.58%	1.22%	0.46%	0.20%
过去六个月	-16.12%	1.33%	-9.66%	1.12%	-6.46%	0.21%
过去一年	-24.85%	1.24%	-17.43%	1.00%	-7.22%	0.24%
过去三年	-24.83%	1.25%	-12.00%	0.88%	-12.83%	0.37%
过去五年	34.85%	1.62%	33.52%	1.15%	1.33%	0.47%
自基金合同生效起至今	62.90%	1.52%	32.66%	1.12%	30.24%	0.40%

本基金投资业绩比较基准为75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。本基金为股票型证券投资基金,股票资产占基金资产的比例为60%-95%,故本基金采取75%作为复合业绩比较基准中衡量股票投资部分业绩表现的权重,相应将25%作为衡量债券投资部分业绩表现的权重。

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

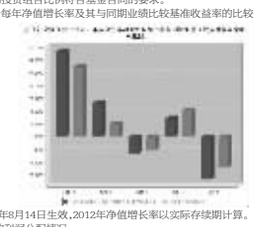
中国债券总指数的发布主体是中央国债登记结算有限责任公司。中央国债登记结算公司是全国债券市场内提供国债、金融债券、企业债券和其他固定收益证券的登记、托管、交易结算等服务的国有独资金融机构,是财政部唯一授权主持建立、运营全国国债托管系统的机构,是中国人民银行指定的全国银行间债券市场债券登记、托管、结算机构和商业银行柜台记账式国债交易的一级托管人。同时中国债券总指数是目前国内涵盖范围最广的债券指数之一,具有良好的市场代表性。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部,以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心,并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观,恪守“持有人利益重于泰山”的原则,以“善建财富 精伴成长”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、建信睿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、建信鑫源回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证500指数增强型发起式证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金,共计104只开放式基金,管理的基金净资产规模共计为6331.39亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许杰	权益投资部副总经理、本基金的基金经理	2012年8月14日	-	16	权益投资部副总经理,硕士,特许金融分析师(CFA),曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员、2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司,历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职,2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理;2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理;2008年5月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011年10月加入我公司,2012年3月21日至2017年1月24日任建信恒稳价值混合型证券投资基金的基金经理;2012年8月14日起任建信社会责任混合型证券投资基金的基金经理;2014年9月10日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的基金经理;2015年2月3日起任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年5月26日起任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年3月22日起任建信中小盘先锋股票型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》,本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下(日内、3日内、5日内)管理的不同投资组合(包括封闭式基金、开放式基金、资产管理计划等)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。经分析,本报告期内未出现公司管理的不同投资组合同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年股票市场出现了较大幅度的调整,全年万得全A指数下跌28.25%。其背后的原因,一方面是投资者对于经济下行的担忧,另一方面是风险偏好的下降。在全球经济放缓、贸易摩擦加剧、基建投资下滑等因素影响下,投资者对中国经济下行的担忧情绪浓重。流动性方面,尽管代表无风险利率的十年期国债收益率全年呈持续的下降状态,但风险事件频发,企业债违约事件增多,部分P2P平台暴雷,股票质押风险暴露,导致信用风险上升,投资者对股权投资的信心下降。

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

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-24.65%,波动率1.24%,业绩比较基准收益率-17.43%,波动率1.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2018年,本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点,坚持独立、客观、公正的原则,在督察长的指导下,公司内控合规部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内,公司实施了不同形式的检查,对发现的潜在合规风险,及时与有关业务部门沟通并向管理层报告,采取相应措施防范风险。依照有关规定,定期向公司董事会、总裁和监管部门报送监察稽核报告,并根据不定期检查结果,形成专项审计报告,促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期,本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施:

1.根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况,在对公司各业务线管理制度和业务流程进新进行梳理后,制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程,使公司基金投资管理运作有章可循。

2.将公司监察稽核工作重心放在事前审查上,把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内,在公司自身经营和受托资产管理过程中,为化解和控制合规风险,事前制定了明确的合规风险控制指标,并相应地将其嵌入系统,实现系统自动管控,减少人工干预环节;对潜在合规风险事项,加强事前审查,以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3.要求业务部门进行风险自查工作,以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督,业务部门作为合规性风险防范的第一道防线,需经常开展合规性风险的自查工作。在准备季度监察稽核报告之前,皆要求业务部门进行风险自查,由内控合规部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查,以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4.把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司年度监察稽核工作计划,实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目,重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节,尤其加强了对容易触发违法违规事件的防控检查,对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改,并对整改情况进行跟踪检查,促进了公司各项业务的持续健康发展。

5.大力推动监控系统的建设,充分发挥了系统自动监控的作用,尽量减少人工干预可能诱发的合规风险,提高了内控监督检查的效率。

6.通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报,加强了风险管理的宣传,强化了员工的遵规守法意识。

7.在公司内控管理方面,注重督鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈,重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见,并按部门一一沟通,认真进行整改、落实。

8.高度重视与信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流,以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9.依据相关法规要求,认真做好本基金的信息披露工作,确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的原则,秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,以充分保障持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[2017]13号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产估值委员会,主要负责审核和决定关于证券产品估值相关事宜,确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、风险管理部和资产核算部门负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作,熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金和理财类基金);对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》,并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣,对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了建信社会责任混合型证券投资基金(以下简称“建信社会责任混合基金”)的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表、2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。并出具了普华永道中天审字(2019)第22652号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:建信社会责任混合型证券投资基金
报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		5,750,607.73	4,282,085.73
结算备付金		92,325.26	171,549.49
存出保证金		33,659.06	44,006.78
交易性金融资产		17,491,931.58	25,972,367.30
其中:股票投资		17,491,931.58	25,972,367.30
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	1,500,000.00
应收证券清算款		340,229.99	226,879.32
应收利息		1,429.62	2,953.31
应收股利		-	-
应收申购款		5,193.04	25,908.52
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		23,715,376.28	32,225,766.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		400,527.05	-
应付赎回款		3,589.80	36,127.59
应付管理人报酬		29,572.96	39,657.11
应付托管费		4,921.81	6,609.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		242,116.37	358,990.26
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		307,887.59	451,784.04
负债合计		988,612.48	892,168.52
所有者权益:			
实收基金		13,949,139.52	14,400,428.37
未分配利润		8,777,624.28	16,933,169.56
所有者权益合计		22,726,763.80	31,333,597.93
负债和所有者权益总计		23,715,376.28	32,225,766.45

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

7.2 利润表

会计主体:建信社会责任混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		-5,863,899.14	4,920,533.71
1.利息收入		52,944.20	121,808.80
其中:存款利息收入		50,741.45	53,669.50
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,202.75	68,139.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-4,409,673.96	3,024,400.03
其中:股票投资收益		-4,615,192.69	2,851,164.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		206,618.64	173,326.17
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-1,512,116.66	1,766,080.37
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		4,847.27	8,153.51
减:二、费用		1,418,806.86	1,537,539.91
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	405,462.93	489,274.43
2. 托管费	7.4.10.2.2	67,577.17	81,545.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用		563,075.74	587,148.35
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		382,691.02	379,574.47
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-7,282,706.00	3,382,993.80
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-7,282,706.00	3,382,993.80

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信社会责任混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	14,400,428.37	16,933,169.56	31,333,597.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,282,706.00	-7,282,706.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-451,288.85	-782,839.28	-1,324,128.13
其中:1.基金申购款	3,131,101.43	2,991,809.97	6,122,911.40
2.基金赎回款	-3,582,390.28	-3,774,649.25	-7,447,039.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	13,949,139.52	8,777,624.28	22,726,763.80
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	17,230,162.45	16,416,837.12	33,646,999.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,382,993.80	3,382,993.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,729,734.08	-2,966,661.36	-5,696,395.44
其中:1.基金申购款	3,446,679.44	3,612,471.83	7,059,151.27
2.基金赎回款	-6,176,413.52	-6,569,133.19	-12,745,546.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	14,490,428.37	16,843,169.56	31,333,597.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

_____张军红_____ _____吴剑明_____ _____丁颖_____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信社会责任混合型证券投资基金(原名为建信社会责任股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]484号《关于核准建信社会责任股票型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信社会责任股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,111,324,695.07元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第288号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信社会责任股票型证券投资基金基金合同》于2012年8月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,111,390,620.35份基金份额,其中认购资金利息折合65,925.28份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信社会责任混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为0-40%,其中权证占基金资产净值的0-3%,任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率X75%+中国债券总指数收益率X25%。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于2019年3月21日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信社会责任混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关