(上接379版)

券投资基金相关业务规则的公告》,生效日为2017年11月4日。根据公告,建信安心保本二号混合型证券投资基金转型为非避险策略基金,基金名称相应变更为“建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金”,建信安心保本二号混合型证券投资基金份额转换为建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金份额。转型后,基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自2017年11月4日起《建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》生效,原《建信安心保本二号混合型证券投资基金基金合同》、《建信安心保本二号混合型证券投资基金托管协议》自同一日起失效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为建信基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金》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(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、地方债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转债(含分离交易可转债)、可交换债、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为:权益类资产占基金资产的比例不高于95%;权证投资占基金资产净值的比例不高于3%;现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例不低于5%, 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65% X沪深300指数收益率+35% X 中债总财富(总值)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》、《建信鑫利灵活配置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

本报告期内所采用的会计政策、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	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11月4日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,303,831.78	1,590,238.22
其中:支付销售机构的客户维护费	2,580,417.34	831,710.61

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11月4日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,050,638.60	265,039.69

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 × 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11月4日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行:活期存款	82,283,184.89	377,573.49	24,578,822.97	141,583.02

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

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
600030	中信证券	2018年12月25日	重大事项	16.01	2019年1月10日	17.15	298,900	5,242,184.47	4,785,389.00	–

本基金截至2018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

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67,706,519.05元,属于第二层次的余额为45,277,389.00元,无属于第三层次的余额 (2017年12月31日:第一层次192,212,412.85元,第二层次68,247,000.00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	72,121,279.05	23.39
	其中:股票	72,121,279.05	23.39
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	40,862,629.00	13.25
	其中:债券	40,862,629.00	13.25
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	83,888,251.51	27.21
8	其他各项资产	111,412,043.88	36.14
9	合计	308,284,203.44	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	2,996,224.00	0.98
B	采矿业	17,662,066.50	5.77
C	制造业	13,177,596.38	4.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,297,883.47	1.08
E	建筑业	4,507,326.75	1.47
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,630,340.35	5.11
J	金融业	4,785,389.00	1.56
K	房地产业	5,318,405.00	1.74
L	租赁和商务服务业	4,746,047.60	1.55
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	72,121,279.05	23.57

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

本基金本报告期未投资港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	000968	蓝焰控股	1,658,410	17,662,066.50	5.77
2	002624	完美世界	368,451	10,261,360.35	3.35
3	002376	新北洋	461,300	7,076,342.00	2.31
4	600872	中炬高新	207,103	6,101,254.38	1.99
5	002410	广联达	258,000	5,368,980.00	1.75
6	601155	新城控股	224,500	5,318,405.00	1.74
7	600030	中信证券	298,900	4,785,389.00	1.56
8	601888	中国国旅	78,838	4,746,047.60	1.55
9	601390	中国中铁	644,825	4,507,326.75	1.47
10	601139	深圳燃气	614,131	3,297,883.47	1.08

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	601336	新华保险	30,949,667.80	4.40
2	601318	中国平安	30,627,280.12	4.35
3	600887	伊利股份	30,528,997.06	4.34
4	000968	蓝焰控股	27,110,812.70	3.85
5	002262	恩华药业	21,479,663.00	3.05
6	600030	中信证券	19,038,527.00	2.70
7	300170	汉得信息	16,158,681.58	2.30
8	601668	中国建筑	15,820,163.00	2.25
9	001979	招商蛇口	14,638,085.26	2.08
10	300498	温氏股份	14,465,490.34	2.06
11	600271	航天信息	14,366,366.17	2.04
12	601155	新城控股	14,121,766.55	2.01
13	601328	交通银行	14,035,512.68	1.99
14	000002	万科A	13,800,781.00	1.96
15	002475	立讯精密	13,252,967.84	1.88
16	600837	海通证券	13,033,057.95	1.85
17	601601	中国太保	12,909,334.29	1.83
18	002410	广联达	12,668,768.20	1.80
19	600999	招商证券	12,580,139.12	1.79
20	300136	信维通信	12,267,244.00	1.74

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	600887	伊利股份	37,327,677.02	5.30
2	601336	新华保险	34,962,170.26	4.97
3	601318	中国平安	27,928,202.50	3.97
4	000651	格力电器	27,079,784.25	3.85
5	002262	恩华药业	19,512,367.00	2.77
6	601601	中国太保	18,624,109.03	2.65
7	601668	中国建筑	16,629,769.00	2.36
8	300170	汉得信息	15,211,715.56	2.16
9	000063	中兴通讯	14,940,316.00	2.12
10	300498	温氏股份	14,438,100.48	2.05
11	001979	招商蛇口	13,604,580.00	1.93
12	601328	交通银行	13,482,137.18	1.92
13	000002	万科A	13,322,946.83	1.89
14	600030	中信证券	13,255,708.16	1.88
15	600487	亨通光电	13,140,313.50	1.87
16	600271	航天信息	12,549,806.05	1.78
17	002475	立讯精密	12,340,721.00	1.75
18	601818	光大银行	12,169,500.00	1.73
19	600282	南钢股份	11,995,874.00	1.70
20	600837	海通证券	11,984,759.00	1.70

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	1,072,618,763.73
卖出股票收入(成交)总额	1,059,631,931.12

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	40,492,000.00	13.23
	其中:政策性金融债	40,492,000.00	13.23
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	370,629.00	0.12
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	40,862,629.00	13.35

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150216	15国开16	400,000	40,492,000.00	13.23
2	132010	17桐昆EB	3,780	370,629.00	0.12

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	502,430.36
2	应收证券清算款	110,158,219.16
3	应收股利	–
4	应收利息	739,053.80
5	应收申购款	12,340.56
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	111,412,043.88

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132010	17桐昆EB	370,629.00	0.12

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	600030	中信证券	4,785,389.00	1.56	重大资产重组

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
6,034	62,267.30	5,000,212.15	1.33%	370,720,663.06	98.67%

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	9.94	0.00%

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(2017年11月4日)基金份额总额	1,216,532,419.72
本报告期期初基金份额总额	680,734,779.38
本报告期期间基金总申购份额	2,209,558.71
减:本报告期期间基金总赎回份额	307,223,462.88
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	375,720,875.21

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。 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	
广发证券	1	420,535,435.91	19.72%	391,645.10	19.96%	–
民族证券	1	293,882,300.71	13.78%	267,815.66	13.65%	–
信达证券	2	291,125,516.13	13.65%	269,005.88	13.71%	–
中信建投	1	242,532,847.93	11.37%	221,019.43	11.26%	–
国泰君安	1	197,344,908.02	9.26%	179,838.36	9.16%	–
天风证券	1	184,393,448.63	8.65%	168,036.69	8.56%	–
光大证券	2	119,768,354.24	5.62%	110,558.00	5.63%	–
东北证券	1	105,415,688.07	4.94%	98,174.25	5.00%	–
中金公司	2	104,595,499.44	4.91%	97,410.21	4.96%	–
民生证券	1	54,087,185.18	2.54%	50,371.67	2.57%	–
中投证券	1	45,777,607.07	2.15%	41,716.87	2.13%	–
招商证券	1	39,752,509.07	1.86%	36,226.45	1.85%	–
华融证券	1	20,561,728.40	0.96%	19,149.32	0.98%	–
太平洋证券	1	12,450,097.40	0.58%	11,594.96	0.59%	–
兴业证券	1	–	–	–	–	–
广证恒生	1	–	–	–	–	–
中信证券	1	–	–	–	–	–
华创证券	1	–	–	–	–	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
方正证券	1	–	–	–	–	–
渤海证券	1	–	–	–	–	–
东兴证券	1	–	–	–	–	–

1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》,基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准, 具体如下:(1)财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格,能够满足基金运作高度保密的要求,在最近一年内没有重大违规行为;

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

(3)具备较强的研究能力,有固定的研究机构和专门的研究人员,能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究,能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人,能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务;

(4)佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后,基金管理人确定券商,与被选择的券商签订委托协议,并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本报告期内新增广发证券、信达证券、国泰君安、华融证券、太平洋证券各一个交易单元,剔除安信证券一个交易单元。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
广发证券	–	–	–	–	–	–
民族证券	2,831,096.50	5.02%	360,000,000.00	12.85%	–	–
信达证券	–	–	320,000,000.00	11.42%	–	–
中信建投	23,780,428.58	42.20%	842,000,000.00	30.05%	–	–
国泰君安	152,554.15	0.27%	920,000,000.00	32.83%	–	–
天风证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	110,000,000.00	3.93%	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
民生证券	222,513.00	0.39%	–	–	–	–
中投证券	22,558,731.08	40.04%	50,000,000.00	1.78%	–	–
招商证券	6,801,168.50	12.07%	200,000,000.00	7.14%	–	–
华融证券	–	–	–	–	–	–
太平洋证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
广证恒生	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
渤海证券	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–

建信基金管理有限责任公司

2019年3月26日