

建信中证500指数增强型证券投资基金 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

本报告期,本基金投资组合比例符合基金合同要求。
3.2.3 自基金合同生效以来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

§ 1 重要提示
基金管理人、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法律责任。

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

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (建信中证500指数增强, 000979, etc.)

2.2 基金产品说明

Table with 2 columns: Item (投资目标, 投资策略, etc.) and Description (本基金为股票型指数增强基金, 本基金采用指数增强投资策略, etc.)

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 3 columns: Item (姓名, 职务, 电话), Manager (吴昊明, 李修强), Custodian (李修强)

2.4 信息披露方式

基金年度报告正文的置人互联网网址: http://www.cbchina.com

§ 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

Table with 5 columns: Item (3.1.1 期间数据和指标, 2018年, 2017年, 2016年), Values (建信中证500, 建信中证500, etc.)

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

建信中证500指数增强A

Table with 5 columns: Period (最近三个月, 最近六个月, etc.), Values (净值增长率, 业绩比较基准收益率, etc.)

建信中证500指数增强C

Table with 5 columns: Period (最近三个月, 最近六个月, etc.), Values (净值增长率, 业绩比较基准收益率, etc.)

本基金的业绩比较基准为: 95% × 中证500指数收益率
+5% × 商业银行活期存款利率(税前)。

中证500指数由中证指数有限公司编制并发布,该指数本
选自沪深两个证券市场,其成份股包含了500只沪深300指
数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的小市值
股票,综合反映了沪深证券市场中小市值公司的整体情况。

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

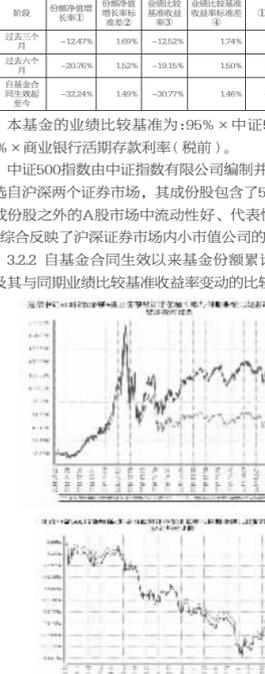


Table of fund management and supervision personnel: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明.

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和内部控制方法

本基金公平对待投资者,保护投资者利益,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。

4.3.2 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》,本基金管理人自过去四个季度不同时间窗口下(日、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)间向交易的公允价值差从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,报告期内未出现公司管理的不同投资组合间有同向交易差异异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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
报告期间,本基金管理人以量化分析研究为基础,利用量化模型进行市场增强和风险管理,坚持量化增强策略,在较为不利的环境下,获得了一定的超额收益。本基金管理人主要采用多因子选股模型,力争保持行业以及风格中性,在保持较低跟踪误差的同时争取尽可能高的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的投资组合报告
本报告期,本基金中证500A净值增长率-31.39%,波动率1.46%,业绩比较基准收益率-31.85%,波动率1.43%;建信中证500C净值增长率-32.24%,波动率1.49%,业绩比较基准收益率-30.77%,波动率1.46%。

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年一开年,市场延续2017年的上涨行情,指数有所上涨,但1季度末至2季度初中美贸易纠纷开始,投资者情绪显著下降,同时经济数据不佳也进一步打击了投资者信心,指数从2月份开始震荡下行,全年跌幅超过30%,投资者情绪较为恐慌。展望2019年,随着中美贸易局势逐步化解,以及减税等宽松政策刺激经济,投资者情绪有所恢复,MSCI扩大了A股在新兴市场指数的占比也吸引了大量外资涌入,指数预期会有相对较好的表现。同时市场的有效性在加强,选股的难度进一步加大,需要进行更为细致的个股研究。

本基金管理人将坚持量化分析研究,进一步改进指数增强策略,努力克服市场的波动,持续获取稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内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,及时与相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重新进行梳理后,制定和完善了一系列管理制度和业务流程,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。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,首要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,实施了涵盖各关业务线的稽核检查项目,重点控制了投资、销售、运营等关键环节,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,注重借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
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,继续加强与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、相关部门部门负责人作为投资产品价值研究的专业人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工作、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决策权。

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(适用非货币型基金)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
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约定,对建信中证500指数增强型证券投资基金2018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中证500指数增强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,不存在有损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中证500指数增强型证券投资基金2018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,未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了建信中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“建信中证500指数增强基金”)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22579号标准无保留意见。投资者可通过年度报告正文查看审计报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:建信中证500指数增强型证券投资基金
报告截止日:2018年12月31日
单位:人民币元

Table with 3 columns: Item (资产, 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.

报告截止日2018年12月31日,基金份额总额2,402,897.060552份,其中建信中证500指数增强型证券投资基金A基金份额净值1.6147元,建信中证500指数增强型证券投资基金A基金份额2,019,321,342.80份;建信中证500指数增强型证券投资基金C基金份额净值1.6080元,建信中证500指数增强型证券投资基金C基金份额383,575,717.72份。

7.2 利润表

会计主体:建信中证500指数增强型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日
单位:人民币元

Table with 4 columns: Item (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.

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信中证500指数增强型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日
单位:人民币元

Table with 3 columns: Item (项目), 本期 2018年1月1日至2018年12月31日, 上期可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日.

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 吴昊明
丁颖 基金管理人负责人 主管会计工作负责人
李修强 基金管理人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信中证500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[2013]615号《关于核准建信中证500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(以下简称“建信基金管理”)和《建信中证500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费,其募集规模为人民币308,106,805.84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(2014)第039号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于2014年1月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为308,165,342.91份基金份额,其中认购资金利息折合58,537.07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《建信中证500指数增强型证券投资基金新增C类基金份额及修改基金合同的公告》并报证监会备案,本基金于2018年3月16日起根据申购费、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将本基金基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费,赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为C类基金份额。由于基金份额的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。2018年3月16日前原有的基金份额在开始申购赎回后,全部转换为建信中证500指数增强A类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的上市股票(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、股指期货、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(须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为不低于90%,其中投资于中证500成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于80%;现金或到期日在一年以内的政府债券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。本基金的业绩比较基准为95%×中证500指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税前)。