建信内生动力混合型证券投资基金 2016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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2017年3月29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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月27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。

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2016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	建信内生动力混合
基金主代码	530011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	319,967,477.03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	本基金将采取积极、主动的资产配置策略,重点投资于消费性内生动力行业、投资性内生动力行业、服务性内生动力行业中具有持续竞争力优势的上市公司股票,力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	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。
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴晓明	郭明
	联系电话	010-66228888	(010)66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	(010)66105798

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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-58,453,086.09	610,904,055.59	214,910,789.46
本期利润	-86,042,687.53	323,886,170.81	397,406,854.73
加权平均基金份额本期利润	-0.2160	0.5691	0.2389
本期基金份额净值增长率	-11.27%	22.51%	34.97%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.2469	0.4382	0.1242
期末基金资产净值	398,969,079.71	681,193,550.34	1,161,741,476.21
期末基金份额净值	1.247	1.438	1.301

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负数,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

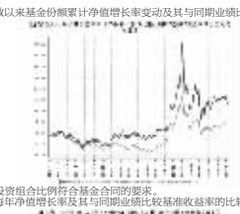
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.78%	0.76%	0.84%	0.55%	-4.62%	0.21%
过去六个月	-1.70%	0.76%	3.74%	0.58%	-5.44%	0.18%
过去一年	-11.27%	1.53%	-7.87%	1.05%	-3.40%	0.48%
过去三年	46.71%	1.65%	39.78%	1.34%	6.93%	0.31%
过去五年	72.29%	1.45%	40.34%	1.22%	31.95%	0.23%
自基金合同生效起至今	42.31%	1.36%	10.44%	1.18%	31.87%	0.18%

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。其中:沪深300指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准,中国债券总指数收益率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。

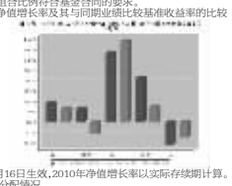
沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数,它是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。指数样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,成份股为市场中市场代表性好,流动性高,交易活跃的主流投资股票,能够反映市场主流投资的收益情况。中债系列指数由一个总指数(即中国债券总指数),若干个分指数构成。中国债券总指数是全样本债券指数,包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券(如交易所和银行间国债、银行间金融债券等),理论上能客观反映中国债券总体情况。

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2010年11月16日生效,2010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

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	0.290	10,155,322.35	849,143.89	11,004,466.24	—
2015	1.570	69,330,634.44	4,631,132.49	73,961,766.93	—
2014	0.080	6,518,329.85	659,598.90	7,177,928.75	—
合计	1.940	86,004,286.64	6,139,875.28	92,144,161.92	—

§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、量化衍生品及海外投资部、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、风险管理部和监察稽核部,以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北两个管理中心,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“持有人利益置于泰山”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2016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、建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金(LOF)、建信核心精选混合型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、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、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置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、建信信用增强债券型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、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、建信短稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债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、建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、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、建信中证500指数增强型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信嘉新宝货币市场基金、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、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号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、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号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、建信瑞盛添利混合型证券投资基金、建信丰裕定增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、建信恒丰纯债债券型证券投资基金、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、建信恒润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、建信睿嘉纯债债券型证券投资基金、建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金共82只开放式基金,管理的公募基金资产规模共计为3770.62亿元。

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		
吴尚伟	本基金的基金经理	2014年11月25日	-	8	硕士。2004年9月至2007年4月任长城伟业期货经纪有限公司深圳分公司投资顾问;2008年8月至2011年7月任银华基金管理公司研究员;2011年7月加入我公司,历任研究员、研究主管、研究部总监助理、基金经理。2014年11月25日起任建信内生动力混合基金经理,2016年9月29起任建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年1月24日起任建信稳价值混合型证券投资基金经理。

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》、《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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

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、特定客户资产管理组合等)同向交易价差从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。具体分析结果如下:

当时间窗为1日时,配了19338对投资组合,有4101对投资组合未通过T检验,其中1329对投资组合的正溢价率占优频率小于55%,其它2772对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,其中1807对平均溢价率低于2%,其它965对平均溢价率超过2%的投资组合中,其中920对贡献率均未超过5%,另外45对溢价率占组合净资产比例很小,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为3日时,配了20730对投资组合,有4694对投资组合未通过T检验,但其中822对投资组合的溢价率占优频率均小于55%,其它3872对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,其中3601对平均溢价率低于5%,其它271对平均溢价率超过5%的投资组合中,有235对贡献率未超过5%,另外36对溢价率占组合净资产比例很小,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为5日时,配了21350对投资组合,有5960对投资组合未通过T检验,但其中1162对投资组合的溢价率占优频率均小于55%,其它4798对正溢价率占优频率大于55%的投资组合,其中4709对平均溢价率低于10%,其它89对平均溢价率超过10%的投资组合中,有80对贡献率均未超过5%,另外9对溢价率占组合净资产比例很小,同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

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2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

回顾2016年,人民币汇率贬值较快,外汇储备明显减少,并且市场对于宏观经济硬着陆有较大担忧,资本市场的熔断机制也有放大效应,A股市场出现恐慌性下跌。在快速下跌释放风险后,由于“供给侧”改革力度较大,阶段性经济增长有所起色,人民币汇率暂时稳定,全球风险资产整体反弹,市场的风险偏好逐渐回升,新能源汽车、智能驾驶、互联网金融等板块引领了市场反弹,食品饮料、家电等稳定类的行业表现也较好。反弹结束调整后,市场进入窄幅震荡区间。下半年在稳增长的大背景下,PPP项目快速推出带动建筑与建材板块在三季度领涨全行业;2016年上半年一线城市的房地产销售量价齐升,一线城市的商品房库存的快速下降释放了行业风险,并且价格的高企也有一定的外溢效应,逐步带动三四线城市的地产行业升温。地产行业的销售火爆带动了产业链的繁荣,如白酒、家电、家具等;也推动了可选消费品的行业复苏,如白酒、珠宝、中高端汽车、旅游等。同时,随着保险公司资产管理规模的大幅提升,部分低估值高股息优势突出的权益类资产吸引资金涌入,被频繁举牌,对市场带动较大。下半年,去产能持续推进带来盈利状况改善的钢铁煤炭板块均取得较大涨幅。下半年,计算机、传媒板块受重组监管趋严及高估值消化压力影响,走势一致较弱;前期涨幅过大的电子也出现明显下跌。

本基金由于年初主要配置在新兴产业如生物育种、环保、生物医药、消费电子等行业,在市场快速下跌中受损较大,复牌的重仓股也对净值有较大负面影响;后期经过调整,组合以食品饮料、轻工制造、汽车零配件等稳定类的行业为主要配置,并投资了一些增长与估值基本匹配的成长行业如电源、新材料、快递等板块,也阶段性参与了周期行业的复苏。回顾全年,板块间热速轮动,年初的熔断释放了风险,也为后续风险偏好的修复提供了空间;对经济形势的预期也成为一个的火爆和供给侧改革的推进中逐渐修正,权威人士的谈话等不了预期的大幅波动,市场在震荡中上行。由于年初熔断导致的跌幅较深,全年没能给投资者带来正贡献,我们深感遗憾和抱歉。

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:-11.27%,波动率1.53%,业绩比较基准收益率-7.87%,波动率1.05%。

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2017年,宏观经济可能呈“前高后低”的走势。2016年在房地产热销、基建规模提升、耐用消费品销售复苏的带动下,2016年下半年经济出现企稳回升,这个趋势在2017年上半年将得到延续。但是2016年三季度末房地产政策收紧对经济的负面效果将在17年发生体现,大规模的基建投资是否能对冲地产业萎靡的下滑还有较大不确定性,通胀预期的背景下中性的货币政策也边际收紧,这些因素的叠加可能导致经济在下半年再次步入调整阶段。

流动性方面,在经济短期趋稳、中心城市房地产价格大涨、上游原材料价格普遍上升等背景下,预计货币政策将维持中性偏紧的基调。IPO、再融资、大股东减持等行为对股票市场的资金需求仍然比较大,资本市场的流动性偏紧。

在经济震荡、流动性偏紧的背景下,2017年股票市场难以出现趋势性行情,股票选择的重要性显得更加突出。本基金计划对业绩确定性的消费白马蓝筹股维持一定底仓不变,并且择机加大对确定性高增长公司的配置比例,同期品种上适当做一些轮动。

我们将在新的一年,勤勉尽责,尽力为基金持有人创造回报。

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控机制程序。

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、运营总经理及监察稽核总经理组成。

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、监察稽核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估算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权验;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

本基金本报告期内于2016年12月24日发布了基金分红公告,于2016年12月27日向基金份额持有人每10份基金份额分配0.29元,收益分配基准日为2016年12月16日,共发放红利人民币11,004,466.24元,(包含现金和红利再投资形式),达到基金合同约定的利润分配要求。

§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

本报告期内,本基金托管人在对建信内生动力混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,建信内生动力混合型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信内生动力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,建信内生动力混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为11,004,466.24元。

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

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信内生动力混合型证券投资基金2016年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

5.6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了后附的建信内生动力混合型证券投资基金(原建信内生动力股票型证券投资基金,以下简称“建信内生动力混合基金”)的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016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(2017)第21859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:建信内生动力混合型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:			
银行存款		189,683,001.23	48,359,236.54
结算备付金		2,530,465.55	4,879,730.33
存出保证金		374,477.42	1,335,344.93
交易性金融资产		277,914,460.97	629,457,935.42
其中:股票投资		277,914,460.97	629,457,935.42
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		100,000,000.00	-
应收证券清算款		18,384,205.55	20,472,980.77
应收利息		33,245.42	18,975.36
应收股利		-	-
应收申购款		6,937.49	43,905.69
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		588,926,793.63	704,568,109.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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		107,016,806.99	11,071,577.38
应付赎回款		74,763,219.17	204,422.93
应付管理人报酬		619,146.80	808,992.99
应付托管费		103,191.14	134,832.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		6,997,400.54	10,917,947.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		457,949.28	236,785.36
负债合计		189,957,713.92	23,374,558.70
所有者权益:			
实收基金		319,967,477.03	473,627,264.34
未分配利润		79,001,602.68	207,566,286.00
所有者权益合计		398,969,079.71	681,193,550.34
负债和所有者权益总计		588,926,793.63	704,568,109.04

报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.247元,基金份额总额319,967,477.03份。

7.2 利润表

会计主体:建信内生动力混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一.收入		-66,387,060.50	364,024,368.75
1.利息收入		919,261.80	1,143,675.26
其中:存款利息收入		866,600.26	1,135,714.50
债券利息收入		1,534.15	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		51,127.39	7,960.76
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-39,801,827.66	649,416,918.89
其中:股票投资收益		-43,268,922.20	642,522,449.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益		106,682.25	-
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		3,360,412.29	6,894,469.12
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-27,589,601.44	-287,017,884.78
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		85,106.80	481,659.38
减:二.费用		19,655,627.03	40,138,197.94
1. 管理人报酬		7,573,421.83	13,299,578.46
2. 托管费		1,262,236.98	2,216,596.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		10,433,653.46	24,186,197.12
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		386,314.76	435,826.03
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-86,042,687.53	323,886,170.81
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)		-86,042,687.53	323,886,170.81

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信内生动力混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	473,627,264.34	207,566,286.00	681,193,550.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-86,042,687.53	-86,042,687.53
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)	-153,659,787.31	-31,517,529.55	-185,177,316.86
其中:1.基金申购款	10,770,342.23	2,786,126.78	13,556,469.01
2.基金赎回款	-164,430,129.54	-34,303,656.33	-198,733,785.87
四、本期末所有者权益(基金净值)变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-11,004,466.24	-11,004,466.24
五.期末所有者权益(基金净值)	319,967,477.03	79,001,602.68	398,969,079.71

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	892,676,853.45	269,064,622.76	1,161,741,476.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	323,886,170.81	323,886,170.81
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)	-419,049,589.11	-311,422,740.64	-730,472,329.75
其中:1.基金申购款	244,208,520.73	129,159,505.94	373,368,026.67
2.基金赎回款	-663,258,109.84	-440,582,246.58	-1,103,840,356.42
四、本期末所有者权益(基金净值)变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-73,961,766.93	-73,961,766.93
五.期末所有者权益(基金净值)	473,627,264.34	207,566,286.00	681,193,550.34

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:

孙志晟 赵乐峰 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

建信内生动力混合型证券投资基金(原名为建信内生动力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[2010]1206号《关于核准建信内生动力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《建信内生动力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5,387,627,567.80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(2010)第209号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信内生动力股票型证券投资基金基金合同》于2010年11月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,388,220,664.00份基金份额,其中认购资金利息折合503,096.20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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。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》,建信内生动力股票型证券投资基金于2015年8月8日公告后更名为建信内生动力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《建信内生动力混合型证券投资基金合同》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,包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他证券品种。基金的投资组合比例为:投资于股票的基金资产占基金资产比例为60%-95%,其中投资于内生动力行业(包括消费性内生动力行业、投资性内生动力行业和服务性内生动力行业)的基金资产的比例不低于80%;现金、债券资产、权证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,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,资产支持证券占基金资产净值的比例为0%-20%,权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×75%+中国债券总指数收益率×25%。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2017年3月27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33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》、《建信内生动力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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表将符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的为持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的值得单独列示的应收款项,应单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确