建信鑫安回报灵活配置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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	建信鑫安回报灵活配置混合
基金主代码	001304
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5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	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	886,219,422.69份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	力争每年获得较高的绝对回报。
投资策略	本基金以自上而下的投资策略,灵活配置大类资产,动态控制组合风险,力争长期、稳定的绝对回报。
业绩比较基准	6%/年。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	罗菲菲
	联系电话	010-66228888	010-58560666
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95568
传真		010-66228001	010-58560798

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5月14日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	93,506,562.11	80,292,337.16
本期利润	15,240,831.73	151,193,286.84
加权平均基金份额本期利润	0.0110	0.0549
本期基金份额净值增长率	1.21%	7.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0834	0.0328
期末基金资产净值	960,157,268.98	2,459,774,869.37
期末基金份额净值	1.083	1.070

注: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);

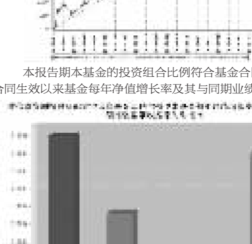
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

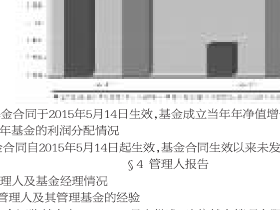
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.09%	0.13%	1.54%	0.02%	-1.63%	0.11%
过去六个月	1.21%	0.14%	3.11%	0.02%	-1.90%	0.12%
过去一年	1.21%	0.14%	6.29%	0.02%	-5.08%	0.12%
自基金合同生效起至今	8.30%	0.14%	10.48%	0.02%	-2.18%	0.12%

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 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



本基金基金合同于2015年5月14日生效,基金成立当年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

本基金基金合同自2015年5月14日起生效,基金合同生效以来未发生利润分配。

§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、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"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、建信恒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、建信嘉薪宝货币市场基金、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、建信恒丰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		
牛兴华	本基金的基金经理	2015年5月14日	–	6	硕士。曾任神州数码中国有限公司投资专员;2010年9月加入中诚信国际信用评级有限责任公司,历任分析师、分析师/项目经理、高级分析师/项目经理。2013年4月加入我公司,历任研究部债券研究员、固定收益投资部基金经理助理。2014年12月2日起任建信稳定得利债券型基金基金经理;2015年4月17日起任建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年5月13日起任建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年5月14日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年6月16日起任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年7月2日至2015年11月25日任建信鑫裕回报灵活配置混合型证券投资基金;2015年10月29日起任建信安心保本二号混合型证券投资基金基金经理;2016年2月22日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金基金经理;2016年10月25日起任建信瑞添利混合型证券投资基金基金经理;2016年12月2日起任建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年12月23日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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》、《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。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对溢价金额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对溢价金额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对溢价金额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

2016年,中国宏观经济整体保持平稳运行态势,全年预计完成GDP增速6.7%。从需求上看,虽然固定资产投资增速持续下滑,但火热的房地产市场销售带动地产投资增速快速回升至6.9%的水平。"930新政"短期内从销售端到投资端的传导尚未充分显现,2016当年房地产投资未见明显收缩,全年房地产投资累计增速仍然维持在较高水平。基建投资方面,虽然下半年有所放缓,但全年来看仍然是托底经济最主要的因素之一,累计增速维持在15.7%。受供给侧改革影响,二季度以来工业产出表现平稳,工业增加值单月同比维持在6%以上。工业企业利润显著改善并带动制造业投资在2016年8月份触底反弹,全年录得4.20%的同比增速。

物价方面,受到供给侧改革、低库存以及国内外市场需求企稳等因素影响,2016年PPI连续下跌53个月后于2016年8月翻正,并与CPI缺口完全收敛。CPI物价除一季度和四季度因蔬菜价格涨幅较大受到扰动外,总体表现平稳,全年CPI同比稳定在2%的水平,但工业领域产品价格上涨对消费端的传导已然显现。

货币政策方面,2016年央行保持稳健的政策基调。上半年在稳增长的目标下,央行一直维持市场短期利率的量价稳定,并在3月初降低存款准备金利率0.5个百分点,以引导货币信贷规模平稳增长。此后,一直采用"逆回购+MLF"滚动续作的方式进行货币投放和政策引导。下半年经济下行压力缓解,政策目标向抑制资产泡沫和金融机构去杠杆切换,先后在8月和9月重启14天和28天逆回购,拉长政策工具久期,抬升资金供给成本,引发了市场预期的短暂混乱。11月受海外市场动荡、机构间信任危机事件等因素叠加影响,银行间市场出现流动性阶段性紧张。汇率方面,受美国加息预期引导以及特朗普上台等因素影响,人民币兑美元汇率先后在二季度和四季度经历两次急贬,中间价从年初的6.5032上涨至年底的6.9370,全年贬值幅度达到6.67%。

债券市场方面,年初在强劲的配置力量的带动下,收益率出现一波快速下行,10年国开债短暂下探至3%下方的年内低点。3月份起MPA对银行资产端的约束开始显现,资金面迎来年内首次大幅波动。4月份一系列的信用风险事件集中爆发,叠加"营改增"等不确定性因素的影响,收益率开始震荡上行,10年国债收益率回到3%上方,机构风险偏好降低,信用利差明显扩大。此后央行货币政策转向温和,债券市场逐步消化信用冲击带来的收益率上行,收益率开始小幅回落并保持相对稳定较长时间。特朗普上台叠加美联储加息引发全球无风险利率上,国内债券市场在11月开始了一波迅猛的深幅调整,10年国债及10年国开收益分别上限70BP和90BP。尽管在12月末收益率出现恢复性下行,但从全年看,10年国债收益率年末报收3.0115%,较年初上行超过19BP。

回顾全年的基金管理工作,债券配置方面全年保持相对谨慎的投资策略,严控信用风险,保持较低的组合久。由于连续两年的债券牛市使得各期限收益率水平均处在历史低位,同时在供给侧改革的背景下信用事件爆发概率显著增加,信用利差保护不足,组合配置以高等级信用债为主。四季度进一步降低长久期利率品,缩短组合久期,因此受债券调整影响相对减小。权益方面,年初的熔断使得基金年初净值有明显回撤,随后均处在缓慢的爬坡状态,期间择机参与了包括股票和转债在内的权益产品的波段操作,并积极参与新股申购以增厚收益。

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1.21%,波动率0.14%,业绩比较基准收益率6.29%,波动率0.02%。

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,我们认受益于供给侧改革以及全球经济弱复苏,经济基本面将有所改善。上半年经济复苏动能依旧强劲,虽然房地产市场受政策调控影响面临较大的下行压力,但基建、制造业投资、出口等方面改善能够对经济起到积极的对冲作用。货币政策方面,央行再提流动性总阀门以及引导去杠杆的意图明确。在货币政策整体稳健偏紧的政策基调下,整体流动性较上年会有所收紧。考虑到国内PPI持续创新高以及联储加息等影响,下半年通胀因素或将制约货币政策转向宽松。股票市场方面,我们仍然认为在经济持续改善的过程中,相对低估值的蓝筹板块及周期股将会有较好的投资机会。本基金将本着稳健运营的理念,适度参与二级市场股票的投资,增加现金类和债券类资产的配置,积极参与一级市场股票申购增厚组合收益。

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[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部控制程序。

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、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追踪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校验;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

本报告期内,本基金托管人在对建信鑫安回报灵活配置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、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,不存在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,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金管理人一建信基金管理有限责任公司在建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有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,建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

由建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金管理人一建信基金管理有限责任公司编制,并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了后附的建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"建信鑫安回报灵活配置混合基金")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21897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:建信鑫安回报灵活配置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		20,402,629.88	388,007,018.61
结算备付金		2,493,927.70	594,615.02
存出保证金		345,879.60	237,314.84
交易性金融资产		722,740,815.59	1,572,111,761.41
其中:股票投资		155,288,181.99	91,335,610.21
基金投资		–	–
债券投资		567,452,633.60	1,480,776,151.20
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		208,700,468.05	461,701,092.55
应收证券清算款		16,658.33	1,051,213.61
应收利息		11,990,709.25	38,922,452.72
应收股利		–	–
应收申购款		–	–
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		966,691,088.40	2,462,625,468.76
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		2,781,419.18	–
应付赎回款		–	–
应付管理人报酬		651,025.80	1,714,677.32
应付托管费		162,756.46	428,669.31
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		2,630,617.98	543,864.78
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		308,000.00	163,387.98
负债合计		6,533,819.42	2,850,599.39
所有者权益:			
实收基金		886,219,422.69	2,299,180,801.79
未分配利润		73,937,846.29	160,594,067.58
所有者权益合计		960,157,268.98	2,459,774,869.37
负债和所有者权益总计		966,691,088.40	2,462,625,468.76

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.083元,基金份额总额886,219,422.69份。

7.2 利润表

会计主体:建信鑫安回报灵活配置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5月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入		36,235,523.77	175,707,093.05
1.利息收入		46,224,813.25	57,400,083.33
其中:存款利息收入		772,841.78	6,595,321.32
债券利息收入		43,425,193.04	49,078,001.62
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		2,026,778.43	1,726,760.39
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		66,789,672.74	38,858,343.69
其中:股票投资收益		12,384,770.36	12,138,577.80
基金投资收益		–	–
债券投资收益		53,735,838.81	26,356,469.06
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		669,063.57	363,296.83
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-78,265,730.38	70,900,949.68
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,486,768.16	8,547,716.35
减:二、费用		20,994,692.04	24,513,806.21
1. 管理人报酬		11,959,756.10	14,492,797.98
2. 托管费		2,989,939.03	3,623,199.43
3. 销售服务费		–	–
4. 交易费用		4,324,275.27	1,759,600.32
5. 利息支出		1,289,937.77	4,326,777.48
其中:卖出回购金融资产支出		1,289,937.77	4,326,777.48
6. 其他费用		430,783.87	311,431.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		15,240,831.73	151,193,286.84
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		15,240,831.73	151,193,286.84

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信鑫安回报灵活配置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)	2,299,180,801.79	160,594,067.58	2,459,774,869.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	15,240,831.73	15,240,831.73
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)	-1,412,961,379.10	-101,897,053.02	-1,514,858,432.12
其中:1.基金申购款	–	–	–
2.基金赎回款	-1,412,961,379.10	-101,897,053.02	-1,514,858,432.12
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)	886,219,422.69	73,937,846.29	960,157,268.98
项目	上年度可比期间 2015年5月14日(基金合同生效日)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)	201,376,911.00	–	201,376,911.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	151,193,286.84	151,193,286.84
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)	2,097,803,890.79	9,400,780.74	2,107,204,671.53
其中:1.基金申购款	4,447,041,627.78	51,281,579.78	4,498,323,207.56
2.基金赎回款	-2,349,237,736.99	-41,880,799.04	-2,391,118,536.03
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)	2,299,180,801.79	160,594,067.58	2,459,774,869.37

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:

______孙志晨______ ______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

建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]790号《关于准予建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《建信鑫安回报灵活配置混合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201,376,891.08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(2015)第488号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为201,376,911.00份基金份额,其中认购资金利息折合19.92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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信鑫安回报灵活配置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较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、创业板及其他依法上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券)、股指期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证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:股票投资占基金资产的比例为0%-95%,投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或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%-100%,其中权证投资比例不得超过基金资产净值的3%,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,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为6%/年。

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》、《建信鑫安回报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。

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。比较财务报表的实际编制期间为2015年5月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

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。应收款项是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卖出回购金融资产款和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债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,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。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若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,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于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),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结果确定公允价值。

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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

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
中国民生银行股份有限公司("民生银行")	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
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

注: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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,959,756.10	14,492,797.98
其中:支付销售机构的客户维护费	–	–

注: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0.8%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 X 0.8% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,989,939.03	3,623,199.43

注:支付基金托管人中国民生银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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 0.2% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无销售服务费。

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

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行	89,923,704.79	–	–	–	100,000,000.00	46,297.40
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2015年5月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行	10,359,561.42	–	–	–	–	–

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

本报告期内及上年度可比期间本基金管理人未投资本基金。

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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年5月14日(基金合同生效日)至2015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
中国民生银行一活期存款	20,402,629.88	728,811.27	388,007,018.61	4,750,171.87
中国民生银行一定期存款	–	–	–	179,581.94

注:本基金的活期银行存款及部分定期存款由基金托管人中国民生银行保管,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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年12月8日(基金合同生效日)至2015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
光大银行:活期存款	1,241,120.27	354,954.30	61,520,511.26	105,845.08

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.7 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新发未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	–
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新发未上市	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	–
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新发未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	–
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新发未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	–
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新发未上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	–
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新发未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	–
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新发未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	–
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新发未上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	–
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新发未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	–
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新发未上市	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	–
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新发未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	–
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新发未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	–
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新发未上市	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	–
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新发未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	–

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.8 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
300323	华灿光电	2016年4月18日	重大资产重组	8.99	2017年1月9日	8.65	1,025,800	8,997,917.00	9,221,942.00	–
300213	佳讯飞鸿	2016年11月4日	重大资产重组	28.00	2017年2月17日	25.48	81,500	2,306,825.00	2,282,000.00	–

注:本基金截至2016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。

7.4.9.9 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.9.1 银行间市场债券正回购

至本报告期末,本基金银行间市场无债券正回购交易余额,故未存在作为抵押的债券。

7.4.9.9.2 交易所市场债券正回购

至本报告期末,本基金交易所市场无债券正回购交易余额,故未存在作为抵押的债券。

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2016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143,502,635.55元,属于第二层次的余额为579,238,180.04元,无属于第三层次的余额(2015年12月31日:第一层次86,180,401.41元,第二层次1,485,931,360.00元,无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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2016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(2015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

8.4 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	155,288,181.99	16.06
	其中:股票	155,288,181.99	16.06
2	固定收益投资	567,452,633.60	58.70
	其中:债券	567,452,633.60	58.70
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	208,700,468.05	21.59
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	22,896,557.58	2.37
7	其他各项资产	12,353,247.18	1.28
8	合计	966,691,088.40	100.00

8.5 期末按行业分类的股票投资组合

8.5.8 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	3,752,393.00	0.39
B	采矿业	–	–
C	制造业	89,634,793.66	9.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,721,977.66	0.39
E	建筑业	24,358,214.23	2.54
F	批发和零售业	7,346,719.00	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	12,417,340.00	1.29
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,971,977.44	0.62
J	金融业	5,516,179.00	0.57
K	房地产业	2,568,588.00	0.27
L	租赁和商务服务业	–	–
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	155,288,181.99	16.17

注:以上行业分类以2016年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.5.9 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.6 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	300323	华灿光电	1,025,800	9,221,942.00	0.96
2	002370	亚太药业	222,752	6,526,633.60	0.68
3	002366	台海核电	109,722	5,883,293.64	0.61
4	002624	完美世界	192,356	5,730,285.24	0.60
5	601998	中信银行	843,900	5,409,399.00	0.56
6	600068	葛洲坝	574,000	5,275,060.00	0.55
7	600104	上汽集团	221,922	5,204,070.90	0.54
8	300436	广生堂	91,187	4,927,745.48	0.51
9	002202	金风科技	278,000	4,756,580.00	0.50
10	601607	上海医药	238,400	4,663,104.00	0.49

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于公司网站www.ccbfund.cn的年度报告正文。

8.7 报告期内股票投资组合的重大变动

8.7.8 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	300081	恒信移动	21,355,152.41	0.87
2	000983	西山煤电	20,990,909.08	0.85
3	300202	聚龙股份	20,479,943.68	0.83
4	600452	涪陵电力	20,407,295.40	0.83
5	002236	大华股份	19,391,104.47	0.79
6	002458	益生股份	18,668,764.53	0.76
7	600409	三友化工	17,791,847.17	0.72
8	300356	光一科技	17,738,976.86	0.72
9	600068	葛洲坝	17,174,018.35	0.70
10	300156	神雾环保	17,041,033.75	0.69
11	600681	百川能源	15,980,957.04	0.65
12	300101	振芯科技	15,390,799.12	0.63
13	002092	中泰化学	14,996,282.61	0.61
14	603012	创力集团	13,989,542.50	0.57
15	600715	文投控股	13,836,290.28	0.56
16	002410	广联达	13,015,174.65	0.53
17	601607	上海医药	12,812,409.00	0.52
18	600978	宜华生活	12,484,472.49	0.51
19	002664	信质电机	11,986,701.00	0.49
20	002169	智光电气	11,984,360.94	0.49

注: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。

8.7.9 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	600715	文投控股	23,744,302.00	0.97
2	002236	大华股份	23,073,041.48	0.94
3	000983	西山煤电	22,090,604.21	0.90
4	600452	涪陵电力	22,035,140.66	0.90
5	300202	聚龙股份	20,171,374.74	0.82
6	300081	恒信移动	19,487,621.76	0.79
7	600409	三友化工	18,327,919.33	0.75
8	300156	神雾环保	16,963,058.66	0.69
9	002458	益生股份	16,913,284.11	0.69
10	300356	光一科技	16,757,637.07	0.68
11	002092	中泰化学	16,227,514.25	0.66
12	600681	百川能源	15,537,867.72	0.63
13	002664	信质电机	13,499,753.51	0.55
14	603012	创力集团	13,453,141.70	0.55
15	600066	宇通客车	13,038,916.77	0.53
16	300101	振芯科技	13,022,383.13	0.53
17	000998	隆平高科	12,940,148.31	0.53
18	601688	华泰证券	12,787,596.48	0.52
19	002410	广联达	12,748,505.18	0.52
20	002169	智光电气	12,262,665.40	0.50

注: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。

8.7.10 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	1,469,572,189.04
卖出股票收入(成交)总额	1,402,968,124.54

注: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。

8.8 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	209,360,000.00	21.80
	其中:政策性金融债	209,360,000.00	21.80
4	企业债券	52,395,000.00	5.46
5	企业短期融资券	179,724,000.00	18.72
6	中期票据	125,775,000.00	13.10
7	可转债(可交换债)	198,633.60	0.02
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	567,452,633.60	59.10

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	150223	15国开23	800,000	79,160,000.00	8.24
2	101460003	14贵阳城发MTN001	600,000	63,600,000.00	6.62
3	1480247	14沪永业债	500,000	52,395,000.00	5.46
4	150201	15国开01	500,000	50,230,000.00	5.23
5	041653023	16巨化CP001	500,000	50,110,000.00	5.22

8.10 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。

8.11 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。

8.12 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。

8.13 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.13.8 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。

8.13.9 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。

8.14 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.14.8 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。

8.14.9 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。

8.14.10 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.15 投资组合报告附注

8.15.8

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中,中信银行股份有限公司(601998)于2016年1月29日发布公告:中信银行兰州分行发生票据业务风险事件。经核查,涉及风险金额为人民币9.69亿元,公安机关已立案侦查。

8.15.9

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。

8.15.10 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	345,879.60
2	应收证券清算款	16,658.33
3	应收股利	–
4	应收利息	11,990,709.25
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	12,353,247.18

8.15.11 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。

8.15.12 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	300323	华灿光电	9,221,942.00	0.96	重大资产重组

§9 基金份额持有人信息

9.4 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
347	2,553,946.46	885,826,518.72	99.96%	392,903.97	0.04%

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	628.68	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(2015年5月14日)基金份额总额	201,376,911.00
本报告期期初基金份额总额	2,299,180,801.79
本报告期基金总申购份额	–
减:本报告期基金总赎回份额	1,412,961,379.10
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	886,219,422.69

§11 重大事件揭示

11.2 基金份额持有人大会决议

基金合同生效日(2015年5月14日)基金份额总额

11.3 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

我公司于2016年11月22日第四届董事会第五次会议决定调整高管职务名称,曲寅军任首席投资官(副总裁)、张威威任首席市场官(副总裁)。2016年12月23日公司第四届董事会第十二次临时会议决定吴曙明任首席风险官(副总裁)、吴灵玲任首席财务官(副总裁),已按有关规定报中国基金业协会和北京证监局备案,并于12月27日对外公告。

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。

11.4 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。

11.5 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.6 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100,000.00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。

11.7 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。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	
光大证券	2	1,007,870,685.60	35.21%	935,009.84	35.36%	–
招商证券	1	819,890,864.12	28.64%	763,565.47	28.88%	–
东北证券	1	707,209,238.13	24.70%	644,475.82	24.37%	–
东兴证券	1	212,620,091.69	7.43%	193,759.44	7.33%	–
中信证券	1	115,195,004.54	4.02%	107,281.24	4.06%	–
天源证券	1	–	–	–	–	–

注: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、本基金本报告期新增光大证券和中信证券各一个交易单元,与同一托管行托管的基金共用原有交易单元。

11.8.2 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
光大证券	–	–	930,000,000.00	20.53%	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
东北证券	2,305,834.05	100.00%	1,310,000,000.00	28.92%	–	–
东兴证券	–	–	2,290,000,000.00	50.55%	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
天源证券	–	–	–	–	–	–

建信基金管理有限责任公司

2017年3月29日