建信中小盘先锋股票型证券投资基金 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:招商证券股份有限公司
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。

基金托管人招商证券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	建信中小盘先锋股票
基金主代码	000729
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月20日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	208,676,668.61份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势,判断当前所处的经济周期,进而对未来做出科学预测。在此基础上,结合对流动性及资金流向的分析,综合股市和债市的估值及风险分析进行词活的大类资产配置。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	85%×中证500指数收益率+15%×中债综合全价(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金,混合型基金,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴晓明	郭杰
	联系电话	010-66228888	0755-82943666
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95565
传真		010-66228001	0755-82960794

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8月20日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	-36,006,593.49	-2,076,839.48	1,133,861.91
本期利润	-77,582,441.00	48,858,727.19	-18,294,446.84
加权平均基金份额本期利润	-0.3198	0.1849	-0.0267
本期基金份额净值增长率	-19.68%	82.70%	-4.60%
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	0.1042	0.2517	-0.0464
期末基金资产净值	292,237,124.61	416,361,948.68	458,313,102.22
期末基金份额净值	1.400	1.743	0.954

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。

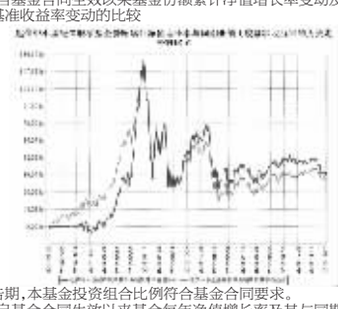
3.2 基金净值表现

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	-5.60%	0.73%	-1.19%	0.71%	-4.41%	0.02%
过去六个月	-1.62%	0.79%	1.79%	0.79%	-3.41%	0.00%
过去一年	-19.68%	1.58%	-15.04%	1.62%	-4.64%	-0.04%
自基金合同生效起至今	40.00%	2.07%	36.16%	1.93%	3.84%	0.14%

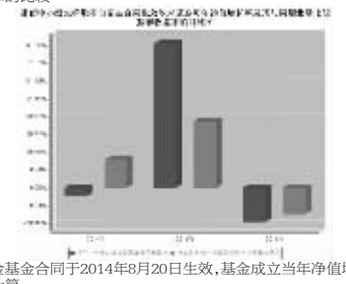
本基金投资业绩比较基准为:85%×中证500指数收益率+15%×中债综合全价(总值)指数收益率。本基金为股票型证券投资基金,投资范围主要包括A股、债券类资产、货币市场投资品种以及现金等金融工具。其中投资于股票的基金资产占基金资产比例为80%-95%,在实际投资运作中,本基金股票投资比例均值约为85%,故本基金采取85%作为复合业绩比较基准中衡量股票投资部分业绩表现的权重,相应将15%作为衡量债券投资部分业绩表现的权重。中证500指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场,其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的中小盘股票,综合反映了沪深证券市场内中小市值公司的整体情况。因此,基金管理人选择中证500指数作为本基金股票部分的比较基准。中债综合全价(总值)指数由中央国债登记结算公司编制,该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场,成份券种包括除资产支持债券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。由此可见,上述两个指数的发布主体在证券市场上具有较高的市场代表性、权威性和中立性,适合作本基金的业绩比较基准。

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



本基金基金合同于2014年8月20日生效,基金成立当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2014年8月20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		
顾中汉	权益投资部总经理、本基金的基金经理	2014年8月20日	-	12	硕士。曾任北京市房管局科员,2004年4月起就职于易方达基金管理公司,历任交易员、研究员、基金经理助理、投资经理,2010年1月至2011年5月任壮保109组合的投资经理。顾中汉于2011年6月加入本公司,历任基金经理、研究部副总监、权益投资部副总监、副总经理、总经理,2011年10月11日起任建信恒久价值混合型证券投资基金基金经理;2011年12月13日至2013年5月3日任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理;2014年8月20日起任建信中小盘先锋股票基金的基金经理;2015年5月22日起任建信核心精选混合基金经理。

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A股市场整体下跌,1月份指数回调叠加熔断的政策变化,市场急速下跌,上证综指下跌22.64%,创业板下跌26.52%。2、3月份市场整体反弹,4月份以后市场开始分化。2月到12月份上证综指上涨13.37%,创业板下跌1.6%。

2016年宏观经济触底反弹,并保持稳定。在供给侧改革的基础上带来煤炭、钢铁价格大幅上涨,上游企业毛利改善。G20会议为时间点开始的环保去产能,带来化工产业链产品价格上涨,6月份以后叠加原油价格触底反弹,进一步加剧上游资源品价格和中游化工品价格上涨。由于原材料价格上涨,工业企业开始从去库存变成补库存。16年在PPP项目的带动下,基建投资增速大幅回升;一、二线城市房价上涨也带来房地产新开工的回暖。

货币政策维持紧平衡,收短放长提高资金价格。宽松的货币政策,企业取得低成本资金,但缺少投资机会。资金多被用于金融投资,带来多种资产价格轮番上涨,金融系统里加杠杆套利的规模也迅速增加。政治局会议以后政府工作重心转移到“去杠杆+防风险”。

整体上,2016年市场仍是下跌,其中创业板下跌27%,在流动性偏紧、投资者风险偏好下降的背景下,投资者的关注点集中在:(1)抗通胀消费品;(2)价格上涨的原材料;(3)国企改革和一带一路。

本基金在2016年采取自下而上精选个股的投资策略,重点配置企业盈利增长较快、估值安全边际相对较高的个股配置,券商、机械、公用事业、新能源汽车、大消费等业绩较为确定的板块,在市场风险偏好下降的过程中,安全边际明显。

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-19.68%,波动率1.58%,业绩比较基准收益率-15.04%,波动率1.62%。

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,中央经济工作会议确定经济重点在于“去杠杆+防风险”,在经济稳定的情况下推行国企改革。流动性偏紧带来资产价格下跌的压力,人民币贬值压力暂时缓解,资金流出减速。国企改革过程中资产整合和管理效率提升带来的投资机会。

密切关注几个方面:市场已经对人民币流动性紧平衡形成一致预期,如果逐渐放松会带来股市的投资机会;债券市场流动性风险逐步释放,投资者风险偏好维持低位;十九大期间提出经济政策和产业政策。特别曾执政策略对美国经济以及全球经济的影响。

本基金将延续一贯的风格,追求价值与高质量的成长,努力寻找投资机会,尽力为持有人获得良好的回报。

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,招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了后附的建信中小盘先锋股票型证券投资基金(以下简称“建信中小盘先锋股票基金”)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21924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:建信中小盘先锋股票型证券投资基金
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		49,240,010.43	74,729,837.65
结算备付金		1,620,047.96	1,273,861.23
存出保证金		567,724.36	1,303,110.74
交易性金融资产		245,069,675.31	347,549,724.61
其中:股票投资		245,069,675.31	347,549,724.61
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		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		25,394.62	40,042.34
应收股利		-	-
应收申购款		30,584.51	467,808.78
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		296,553,437.19	425,364,385.35
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		1,166,882.27	1,672,601.35
应付赎回款		216,341.03	2,390,013.49
应付管理人报酬		381,720.27	536,530.84
应付托管费		63,620.04	89,421.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,190,601.60	4,111,814.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		297,147.37	202,054.33
负债合计		4,316,312.58	9,002,436.67
所有者权益:			
实收基金		208,676,668.61	238,917,603.20
未分配利润		83,560,456.00	177,444,345.48
所有者权益合计		292,237,124.61	416,361,948.68
负债和所有者权益总计		296,553,437.19	425,364,385.35

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.400元,基金份额总额208,676,668.61份。

7.2 利润表

会计主体:建信中小盘先锋股票型证券投资基金
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		-66,824,621.78	61,791,011.49
1.利息收入		1,009,667.79	1,226,185.32
其中:存款利息收入		1,009,488.72	1,226,153.84
债券利息收入		179.07	31.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-26,728,979.27	-504,852.56
其中:股票投资收益		-29,145,952.27	-2,644,268.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益		414,369.03	190,939.52
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		2,002,603.97	1,948,476.58
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-41,575,847.51	50,935,566.67
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		470,537.21	10,134,112.06
减:二、费用		10,757,819.22	12,932,284.30
1. 管理人报酬		5,238,911.26	5,827,013.31
2. 托管费		873,151.84	971,168.94
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		4,267,756.12	5,761,314.03
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		378,000.00	372,788.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-77,582,441.00	48,858,727.19
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-77,582,441.00	48,858,727.19

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信中小盘先锋股票型证券投资基金
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)	238,917,603.20	177,444,345.48	416,361,948.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-77,582,441.00	-77,582,441.00
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)	-30,240,934.59	-16,301,448.48	-46,542,383.07
其中:1.基金申购款	87,015,825.09	37,325,473.45	124,341,298.54
2.基金赎回款	-117,256,759.68	-53,626,921.93	-170,883,681.61
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)	208,676,668.61	83,560,456.00	292,237,124.61
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)	480,592,278.79	-22,279,176.57	458,313,102.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	48,858,727.19	48,858,727.19
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)	-241,674,675.59	150,864,794.86	-90,809,880.73
其中:1.基金申购款	1,016,845,420.58	750,645,196.12	1,767,490,616.70
2.基金赎回款	-1,258,520,096.17	-599,780,401.26	-1,858,300,497.43
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)	238,917,603.20	177,444,345.48	416,361,948.68

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

建信中小盘先锋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[2014]495号《关于核准建信中小盘先锋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《建信中小盘先锋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759,552,595.20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464号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》于2014年8月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为759,776,341.92份基金份额,其中认购资金利息折合223,746.72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,基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》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A股股票(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、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:股票资产占基金资产的80%-95%,债券等固定收益类资产合计市值占基金资产净值的0-20%,权证投资合计市值占基金资产净值的0-3%,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%。本基金将不低于80%的非现金基金资产投资于具有较高成长性的中小盘股票。本基金的业绩比较基准为85%X中证500指数收益率+15%X中债综合全价(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》、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金 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业务操作编制。

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 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 会计差错更正说明

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
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	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

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1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,238,911.26	5,827,013.31
其中:支付销售机构的客户维护费	2,019,802.28	2,321,068.76

注:1、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X1.50%/当年天数。

2、客户维护费是指基金管