

2017年9月30日  
基金管理人：中信基金管理有限责任公司  
基金托管人：中信证券股份有限公司  
报告送出日期：2017年10月25日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资者有风险，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。

本报告公告日期为2017年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称：建信大安全战略精选股票型证券投资基金

基金代码：001473

交易代码：001473

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015年7月29日

报告期末基金份额总额：240,486,748,008份

投资目标：本基金主要投资于国内大安全主题相关的优质股票，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值和稳定回报。

本基金结合宏观环境、行业景气度、个股基本面等因素分析，通过深入研究，挖掘具有成长性、估值合理的新能源汽车、光伏等板块的投资机会，力争取得超越基准收益。

投资策略：本基金在3季度始终保持中等仓位，集中持仓了优质成长股和价值成长股，并适度增加了新能源车、光伏等板块的配置，跑赢业绩基准，取得了一定的相对收益和绝对收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期净值增长率94.2%，波动率0.6%，业绩比较基准收益率3.99%，波动率0.5%。

§ 3 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 287,852,309.14 85.91

2 固定收益投资 - -

3 货币市场工具 - -

4 其他资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 534,700 14.91%

6 股票 560,300 13.58%

7 其他资产 344,291 10.40%

8 货币市场基金 76,100 2.17%

9 合计 784,810.29 100.00%

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号 行业类别 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 矿采、水利、电、燃气、油、气及水生产、供应业 11,310,794.60 34.0%

C 制造业 173,922,588.70 52.27%

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 31,093.44 0.01%

E 建筑业 - -

F 批发和零售业 26,385.45 0.01%

G 交通运输、仓储和邮政业 25,571.91 0.01%

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 6,783,494.03 2.04%

J 钢铁业 45,975,360.68 13.62%

K 非银金融 7,446,172.22 2.24%

L 道路货物运输服务业 6,841,705.00 2.06%

M 科学研究、技术服务与地质勘查业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 7,200,540.00 2.16%

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 医疗卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 28,289,635.11 8.93%

S 合计 - -

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通股票投资组合

序号 行业类别 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

A 银行 8,000,000.00 6.02%

5.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号 行业类别 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 1,954,211.85 1.49%

B 矿采业 6,644,438.60 5.08%

C 制造业 56,719,349.37 44.46%

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 3,168,885.44 2.42%

E 建筑业 3,794,798.00 2.90%

F 批发和零售业 6,975,081.87 5.33%

G 交通运输、仓储和邮政业 2,403,890.66 1.84%

H 生活和维修业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 6,450,855.27 4.93%

J 金融业 9,373,058.40 7.16%

K 地产业 8,087,758.46 6.18%

L 食品饮料商务服务业 2,442,831.30 1.87%

M 科学研究、技术服务与地质勘查业 88,833.92 0.07%

N 水利、环境和公共设施管理业 758,993.00 0.58%

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 115,299.99 0.09%

R 文化、体育和娱乐业 1,074,074.60 0.82%

S 合计 - -

5.3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标 报告期：2017年7月1日—2017年9月30日

1本期已实现收益 23,032,309.52

2本期利润 25,566,806.18

3加权平均基金份额本期利润 0.1987

4期末基金份额净值 332,731,052.08

5期末可供分配基金份额净值 1.8606

6本期末基金资产净值 13,586,848.00

7本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

8本期末基金份额净值 1.0000

9本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

10本期末基金资产总值 13,586,848.00

11本期末基金份额总额 13,586,848.00

12本期末基金资产净值 13,586,848.00

13本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

14本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

15本期末基金资产总值 13,586,848.00

16本期末基金份额净值 1.0000

17本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

18本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

19本期末基金资产总值 13,586,848.00

20本期末基金份额净值 1.0000

21本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

22本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

23本期末基金资产总值 13,586,848.00

24本期末基金份额净值 1.0000

25本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

26本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

27本期末基金资产总值 13,586,848.00

28本期末基金份额净值 1.0000

29本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

30本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

31本期末基金资产总值 13,586,848.00

32本期末基金份额净值 1.0000

33本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

34本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

35本期末基金资产总值 13,586,848.00

36本期末基金份额净值 1.0000

37本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

38本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

39本期末基金资产总值 13,586,848.00

40本期末基金份额净值 1.0000

41本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

42本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

43本期末基金资产总值 13,586,848.00

44本期末基金份额净值 1.0000

45本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

46本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

47本期末基金资产总值 13,586,848.00

48本期末基金份额净值 1.0000

49本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

50本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

51本期末基金资产总值 13,586,848.00

52本期末基金份额净值 1.0000

53本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

54本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

55本期末基金资产总值 13,586,848.00

56本期末基金份额净值 1.0000

57本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

58本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

59本期末基金资产总值 13,586,848.00

60本期末基金份额净值 1.0000

61本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00

62本期末可供分配基金利润 13,586,848.00

63本期末基金资产总值 13,586,848.00

64本期末基金份额净值 1.0000

65本期末可供分配基金份额总额 13,586,848.00