

基金管理人：信建基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
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，并对其中内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人和代销机构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，并对其中内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担个别及连带责任。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

本报告期内基金财务会计报告未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

基金代码 162599

基金类型 股票型开放式基金

上市交易场所 上市契约型开放式基金(LOF)

基金管理人 国泰君安证券股份有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期 2017年7月1日至2017年9月30日

1.本期已实现收益 9,764,0216

2.本期利润 27,870,98616

3.期初至报告期末基金累计净值增长率 0.0637

4.期末基金资产净值 499,777,6941

5.期末基金份额净值 1.0759

6.本期基金份额变动 -1,1759

7.本期已实现收益占基金净值的比例(%) -0.0948

8.本期利润占基金净值的比例(%) 0.0567

9.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

10.期末基金份额净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

11.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

12.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

13.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

14.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

15.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

16.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

17.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

18.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

19.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

20.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

21.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

22.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

23.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

24.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

25.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

26.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

27.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

28.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

29.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

30.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

31.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

32.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

33.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

34.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

35.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

36.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

37.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

38.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

39.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

40.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

41.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

42.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

43.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

44.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

45.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

46.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

47.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

48.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

49.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

50.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

51.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

52.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

53.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

54.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

55.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

56.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

57.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

58.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

59.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

60.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

61.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

62.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

63.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

64.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

65.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

66.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

67.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

68.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

69.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

70.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

71.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

72.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

73.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

74.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

75.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

76.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

77.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

78.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

79.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

80.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

81.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

82.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

83.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

84.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

85.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

86.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

87.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

88.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

89.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

90.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

91.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

92.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

93.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

94.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

95.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

96.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

97.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

98.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

99.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

100.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

101.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

102.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

103.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

104.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

105.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

106.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

107.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

108.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

109.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

110.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

111.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

112.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

113.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

114.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

115.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

116.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

117.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

118.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

119.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

120.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

121.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

122.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759

123.本期基金份额变动占基金净资产的比例(%) -0.01759

124.本期已实现收益占基金净资产的比例(%) -0.00948

125.本期利润占基金净资产的比例(%) 0.00567

126.期末基金资产净值占基金净资产的比例(%) 1.0759