建信中国制造 2025 股票型证券投资基金基金

2017年第三季度报告

2017年 9 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大银行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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1日起至 9 月 30 日止。

§ 2基金产品概况

基金简称	建信中国制造 2025 股票型
基金主代码	001825
交易代码	001825
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年 3 月 8 日
报告期末基金份额总额	325, 796, 646.81 份
投资目标	在中国经济增长、结构转型的大背景下，把握国内制造业产业升级过程中的投资机会，力争获取超越业绩比较基准的收益，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法，对符合中国制造 2025 战略方向的领域进行深入研究，挖掘该领域内上市公司的投资价值，力争获得实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：80%× 沪深 300 指数收益率 +20%× 中证综合债券指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于高收益 / 风险特征的基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§ 3主要财务指标和基金净值表现

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	20, 366, 069.42
2.本期利润	27, 050, 535.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.0772
4.期末基金资产净值	330, 233, 434.54
5.期末基金份额净值	1.0136

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（不含公允价值变动损益）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损益。

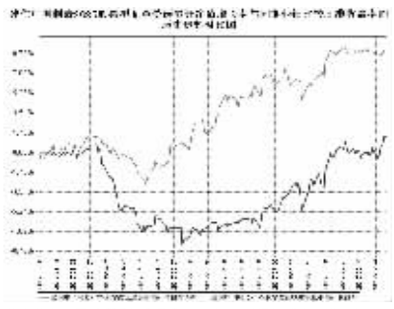
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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	8.27%	0.61%	3.84%	0.47%	4.43%	0.14%

3.2.2自基金合同生效以来基金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



1.本基金基金合同于 2017 年 3 月 8 日生效，截至报告期末未满一年。

2.本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§ 4管理人报告

4.1基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙晟	本基金的基金经理	2017年 3 月 8 日	-	6	硕士，2011 年 7 月起任华夏基金管理公司研究员，2013 年 6 月加入建信基金，历任研究员、研究主管、基金经理，2016 年 3 月 30 日起任建信健康民生混合基金的基金经理，2017 年 3 月 8 日起任建信中国制造 2025 股票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，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信中国制造 2025 股票型基金基金合同》的规定。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4报告期内基金投资策略和运作分析

随着供给侧改革的推进，以钢铁为代表的周期品价格在三季度出现了较大上涨，使得相关企业盈利同比环比均大幅增长，以单季度或单月利润年化的估值变得很有吸引力，周期股也在前期调整的基础上迎来了一波行情，本基金较好的把握了这波机会，净值恢复到面值以上。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 8.27%，波动率 0.61%，业绩比较基准收益率 3.84%，波动率 0.47%。

§ 5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	280, 322, 004.25	82.64
	其中：股票	280, 322, 004.25	82.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	35, 000, 000.00	10.32
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23, 368, 535.16	6.89
8	其他资产	518, 065.69	0.15
9	合计	339, 208, 605.10	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6, 508, 152.00	1.97
C	制造业	158, 020, 092.62	47.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31, 636, 568.44	9.58
E	建筑业	26, 436, 317.20	8.01
F	批发和零售业	-	-
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	12, 226, 060.60	3.70
J	金融业	26, 481, 280.00	8.02
K	房地产业	15, 278, 758.24	4.63
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3, 562, 678.80	1.08
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	115, 299.99	0.03
R	文化、体育和娱乐业	31, 224.45	0.01
S	综合	-	-
	合计	280, 322, 004.25	84.89

以上行业分类以 2017 年 09 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

5.3报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603757	大元泵业	418, 000	24, 122, 780.00	7.30
2	300335	迪森股份	1, 000, 000	19, 040, 000.00	5.77
3	600068	葛洲坝	1, 570, 000	16, 296, 600.00	4.93
4	601398	工商银行	2, 310, 000	13, 860, 000.00	4.20
5	002833	弘亚数控	200, 000	12, 940, 000.00	3.92
6	601288	农业银行	3, 304, 000	12, 621, 280.00	3.82
7	600681	百川能源	840, 500	12, 565, 475.00	3.81
8	000786	北新建材	618, 500	10, 632, 015.00	3.22
9	002519	银河电子	1, 200, 651	10, 445, 663.70	3.16
10	601877	正泰电器	448, 294	9, 589, 008.66	2.90

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告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。

5.7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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	498, 673.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	- 40, 640.85
5	应收申购款	60, 032.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	518, 065.69

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	369, 757, 055.96
报告期期间基金总申购份额	5, 911, 247.06
减：报告期期间基金总赎回份额	49, 871, 656.21
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	325, 796, 646.81

上述总申购份额含转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§ 7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会批准建信中国制造 2025 股票型证券投资基金设立的文件；

2.《建信中国制造 2025 股票型证券投资基金基金合同》；

3.《建信中国制造 2025 股票型证券投资基金招募说明书》；

4.《建信中国制造 2025 股票型证券投资基金托管协议》；

5.基金管理人业务资格批件和营业执照；

6.基金托管人业务资格批件和营业执照；

7.报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2017 年 10 月 25 日

建信中小盘先锋股票型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 9 月 30 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。

基金托管人招商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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1日起至 9 月 30 日止。

§ 2基金产品概况

基金简称	建信中小盘先锋股票
基金主代码	000729
交易代码	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
报告期末基金份额总额	197, 842, 889.13 份
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灵活的大类资产配置。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。
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

§ 3主要财务指标和基金净值表现

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	11, 490, 573.05
2.本期利润	5, 227, 901.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0256
4.期末基金资产净值	294, 384, 710.00
5.期末基金份额净值	1.488

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（不含公允价值变动损益）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损益。

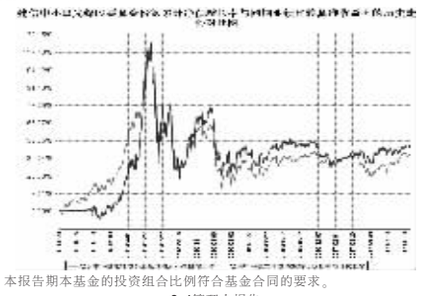
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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	1.92%	0.77%	6.42%	0.79%	- 4.50%	- 0.02%

3.2.2自基金合同生效以来基金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。

§ 4管理人报告

4.1基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许杰	权益投资部副总经理、本基金的基金经理	2017年 3 月 22 日	-	15	硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员，2002 年 3 月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职，2006 年 12 月 23 日至 2011 年 9 月 30 日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理，2010 年 2 月 8 日至 2011 年 9 月 30 日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理，2008 年 9 月 26 日至 2011 年 9 月 30 日任泰达宏利集利债券基金基金经理，2011 年 10 月加入秋公司，2012 年 3 月 21 日至 2017 年 1 月 24 日任信恒稳价值混合型证券投资基金基金经理，2012 年 8 月 14 日起任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理；2014 年 9 月 10 日起任建信鼎力新蓝筹股票型证券投资基金基金经理；2015 年 2 月 3 日起任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015 年 5 月 26 日起任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 3 月 22 日起任建信中小盘先锋股票基金经理。

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，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4报告期内基金投资策略和运作分析

本基金报告期内重点配置了食品饮料、医药等消费类行业以及电子、高端制造等创新类行业的龙头公司。中国经济未来增长的驱动力将主要来自于消费和创新，而从微观层面上市公司的经营情况来看，这两类企业也表现出良好的增长势头和长期潜力。由于本基金三季度对于周期类行业以及主题投资参与较少，而这类股票报告期内上涨较多，而消费和创新行业的龙头企业大多处于盘整状态，因此本基金在三季度的表现落后于市场。但本基金认为消费和创新的大方向不会发生变化，长期看坚定持有消费和创新的龙头企业将取得较好的投资收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 1.92%，波动率 0.77%，业绩比较基准收益率 6.42%，波动率 0.79%。

§ 5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	246, 485, 740.25	81.51
	其中：股票	246, 485, 740.25	81.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	29, 100, 000.00	9.62
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26, 081, 633.16	8.62
8	其他资产	735, 862.81	0.24
9	合计	302, 403, 236.22	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	39, 793.60	0.01
C	制造业	180, 266, 773.79	61.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9, 836, 571.50	3.34
E	建筑业	9, 750, 307.68	3.31
F	批发和零售业	18, 028, 921.39	6.12
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	2, 847, 277.38	0.97
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6, 239, 948.68	2.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9, 074, 939.88	3.08
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	0.04
R	文化、体育和娱乐业	10, 260, 334.45	3.49
S	综合	-	-
	合计	246, 485, 740.25	83.73

以上行业分类以 2017 年 09 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

5.3报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000423	东阿阿胶	262, 714	17, 058, 020.02	5.79
2	000568	泸州老窖	241, 163	13, 529, 244.30	4.60
3	002050	三花智控	726, 400	11, 680, 512.00	3.97
4	002217	合力泰	991, 000	11, 148, 750.00	3.79
5	600872	中炬高新	436, 224	10, 307, 973.12	3.50
6	300426	唐德影视	367, 296	10, 247, 558.40	3.48
7	600525	长园集团	495, 180	9, 854, 082.00	3.35
8	600068	葛洲坝	939, 336	9, 750, 307.68	3.31
9	000963	华东医药	190, 242	9, 335, 174.94	3.17
10	002236	大华股份	386, 725	9, 308, 470.75	3.16

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告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。

5.7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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	658, 137.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37, 068.36
5	应收申购款	40, 657.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	735, 862.81

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	192, 153, 543.67
报告期期间基金总申购份额	23, 456, 765.98
减：报告期期间基金总赎回份额	17, 767, 420.52
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	197, 842, 889.13

上述总申购份额含转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§ 7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会批准建信中小盘先锋股票型证券投资基金设立的文件；

2.《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》；

3.《建信中小盘先锋股票型证券投资基金招募说明书》；

4.《建信中小盘先锋股票型证券投资基金托管协议》；

5.基金管理人业务资格批件和营业执照；

6.基金托管人业务资格批件和营业执照；

7.报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2017 年 10 月 25 日

建信中证 500 指数增强型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 9 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信银行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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1日起至 9 月 30 日止。

§ 2基金产品概况

基金简称	建信中证 500 指数增强
基金主代码	000478
交易代码	000478
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年 1 月 27 日
报告期末基金份额总额	566, 948, 768.52 份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。 在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	95%× 中证 500 指数收益率 +5%× 商业银行活期存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§ 3主要财务指标和基金净值表现

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	59, 053, 989.34
2.本期利润	100, 646, 729.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.1961
4.期末基金资产净值	1, 410, 922, 421.88
5.期末基金份额净值	2.4886

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（不含公允价值变动损益）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损益。

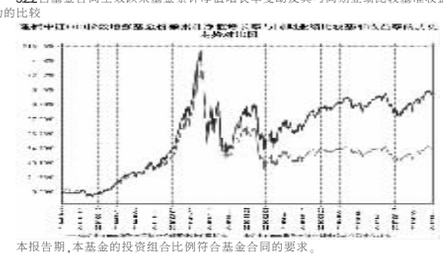
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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	9.05%	0.90%	7.20%	0.89%	1.85%	0.01%

3.2.2自基金合同生效以来基金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。

§ 4管理人报告

4.1基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶乐天	金融工程及指数投资部总经理助理、本基金的基金经理	2014年 1 月 27 日	-	9	硕士。2008 年 5 月至 2011 年 9 月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。2011 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理，2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金基金经理；2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金基金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金基金经理；2017 年 4 月 18 日起任建信民丰回报定期开放混合基金的基金经理；2017 年 5 月 22 日起任建信鑫荣回报混合基金的基金经理。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4报告期内基金投资策略和运作分析

本基金报告期内主要以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 9.05%，波动率 0.9%，业绩比较基准收益率 7.2%，波动率 0.89%。

§ 5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	1, 166, 270, 498.98	81.82
	其中：股票	1, 166, 270, 498.98	81.82
2