

(上接 837 版)

7481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。

7482关联方报酬

7482.1基金管理费

单位:人民币元

项目	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	814,376.84	445,656.28
其中:支付销售机构的客户维护费	240,091.88	124,719.07

支付基金管理人建信基金的管理人报酬按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值**180%**的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的管理人报酬,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=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值×**180%**÷当年天数。

7482.2基金托管费

单位:人民币元

项目	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	158,330.95	86,655.40

支付基金托管人中国工商银行的托管费按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值**0.35%**的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的托管费,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值**X0.35%**÷当年天数。

7482.3销售服务费

无。

7483与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

7484各关联方投资本基金的情况

7484.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况无。

7484.2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

无。

7485与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	2017年1月1日至2017年12月31日 期末余额	2017年1月1日至2017年12月31日 当期利息收入	2016年1月1日至2016年12月31日 期末余额	2016年1月1日至2016年12月31日 当期利息收入
中国工商银行-定期存款	5,999,825.00	43,090.60	734,645.17	4,541.27
南京证券股份有限公司-定期存款	2,022,641.58	10,838.91	2,558,061.91	2,103.68

本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布列兄弟哈里曼银行保管,按约定利率计息。

7486本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7487其他关联交易事项的说明

无。

749期末(2017年2月31日)本基金持有的流通受限证券

749.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

749.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

749.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

749.3.1银行间市场债券正回购

无。

749.3.2交易所市场债券正回购

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

740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**2017年2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**46,099,555.93**元,无属于第二层次或第三层次的余额(**2016年2月31日**:第一层次**23,368,155.00**元,无第二层次或第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第二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**2017年2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(**2016年2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)增值稅

根据财政部、国家税务总局于**2016年2月21日**颁布的财税[2016]40号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于**2017年6月30日**颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照**3%**的征收率缴纳增值税。对资管产品在**2018年1月1日**前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已缴纳金额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外,财政部、国家税务总局于**2017年2月25日**颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自**2018年1月1日**起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金**2017年2月31日**财务状况和**2017年度**经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值稅外,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

8.1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	45,562,767.08	79.81	
	其中:普通股	42,095,246.87	79.87	
	存托凭证	3,503,540.21	6.14	
	优先股	-	-	
	房地产信托凭证	-	-	
2	基金投资	3,136,768.85	5.49	
3	固定收益投资	-	-	
	其中:债券	-	-	
	资产支持证券	-	-	
4	金融衍生品投资	-	-	
	其中:远期	-	-	
	期货	-	-	
	期权	-	-	
	权证	-	-	
5	买入返售金融资产	-	-	
	其中:买断式回购买入返售金融资产	-	-	
6	货币市场工具	-	-	
7	银行承兑贴现和质押贷款合计	8,022,466.58	14.05	
8	其他各项资产	369,863.98	0.65	
9	合计	57,091,686.43	100.00	

8.2期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元		
国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	20,091,020.08	35.91
中国香港	15,509,062.36	27.72
英国	1,955,681.19	3.50
日本	1,862,559.17	3.33
德国	1,238,153.09	2.21
韩国	1,154,777.91	2.06
澳大利亚	1,018,954.62	1.82
意大利	926,825.15	1.66
瑞士	793,743.08	1.42
加拿大	447,159.33	0.80
瑞典	331,928.42	0.59
法国	231,863.68	0.41
合计	45,562,767.08	81.43

8.3期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元		
行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
信息技术	11,275,170.08	20.15
必需消费品	2,035,283.53	3.64
电信服务	836,223.47	1.49
工业	4,783,666.06	8.55
医疗保健	3,702,127.52	6.62
必需消费品	6,774,066.09	12.00
金融	10,681,655.22	19.45
能源	1,971,737.17	3.52
公用事业	613,940.74	1.10
材料	2,748,679.20	4.91
合计	45,562,767.08	81.43

注以上分类采用全球行业分类标准(GICS)

8.4期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属地区(国)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	KYG875721634	香港证券交易所	中国香港	7,700	2,613,221.84	4.67
2	ALIBABA GROUP HOLDING INC-SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	US918091W1027	纽约证券交易所	美国	1,417	1,596,522.71	2.85
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	三星电子有限公司	KR7009930003	韩国交易所	韩国	62	967,021.20	1.73
4	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	US468025H1005	纽约证券交易所	美国	1,269	886,735.76	1.58
5	BAKERTER INTERNATIONAL INC	百特	US9718131099	纽约证券交易所	美国	2,087	881,487.63	1.58
6	WALMART STORES INC	沃尔玛百货	US9311421039	纽约证券交易所	美国	1,350	871,090.54	1.56
7	AMGEN INC	安进	US9311621009	纳斯达克交易所	美国	760	863,596.01	1.54
8	SIEMENS AG-REG	西门子	DE0007236101	柏林证券交易所	德国	927	840,081.83	1.50
9	PARKER HANAU CORP	派克汉尼汾	US97101941042	纽约证券交易所	美国	638	832,013.02	1.49
10	GEELY AUTO-MOBILE HOLDINGSLTD	吉利汽车	KYG377761032	香港证券交易所	中国香港	36,000	815,513.80	1.46

1.所用证券代码采用**IS** 所用证券代码采用**ISIN**码。

2.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.ccfund.cn** 的年度报告正文。

8.5报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值**2%**或前**20**名的权益投资明细

金额单位:人民币元				
序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	US9378331005	757,334.04	2.90
2	TENCENT HOLDINGSLTD	KYG875721634	727,776.66	2.78
3	ALPHABET INC-CL C	US92079K1079	702,074.75	2.68
4	VALERO ENERGY CORP	US9191311001	583,439.96	2.23
5	HOMER DEPOT INC	US4370761029	561,284.61	2.15
6	COMCAST CORP-CLASS A	US20030N1019	536,454.31	2.05
7	BANK OF AMERICA CORP	US0605051046	533,051.45	2.04
8	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	US91809W1027	500,464.54	1.91
9	JOHNSON & JOHNSON	US4781601046	407,756.77	1.56
10	LINCOLN NATIONAL CORP	US9341871094	390,036.96	1.49
11	MICROSOFT CORP	US9949181045	388,557.37	1.48
12	INTERNATIONAL BAKTER	US9718131099	371,080.73	1.42
13	AMGEN INC	US9311621009	360,191.04	1.38
14	MERCK & CO. INC.	US6893311055	348,062.17	1.33
15	ELECTRONICS CO LTD	KR7009930003	339,576.27	1.30
16	SIEMENS-AG-REG	DE0007236101	329,009.68	1.26
17	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	US7443201022	309,045.63	1.18
18	TECHNOLOG HOLDINGSLTD	KYG2953R1065	299,059.57	1.14
19	3I GROUPPLC	G80081YW4409	282,464.76	1.08
20	ASHI GLASSCO LTD	JP311200009	281,784.78	1.08

注:1.买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

2.所用证券代码采用**ISIN**代码。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值**2%**或前**20**名的权益投资明细

金额单位:人民币元				
序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	PANHOME CORP	JP9650603004	639,801.94	2.45
2	KILLIAM APARTMENT REAL ESTATE	CA49410M1023	599,951.96	2.29
3	PRUDENTIAL	US9718011035	582,316.48	2.23
4	LIBERTY MEDIA CORP-CLASS A	US9312298541	562,562.42	2.15
5	DIME COMMUNITY BANCSHARES	US9259221083	523,440.70	2.00
6	MANTECH INTERNATIONAL CORP-A	US9549631046	442,277.65	1.69
7	HANOVER INSURANCE GROUP INC	US4108671052	386,968.68	1.48
8	ASTM SPA	IT0000084027	365,227.79	1.40
9	CISCO SYSTEMS INC	US17275R1023	357,977.18	1.37
10	TARGA RESOURCES CORP	US86712G1013	327,119.94	1.25
11	TYSON FOODS INC-CL A	DE0024941034	237,273.60	0.91
12	MACY'S INC	US95616P1049	215,673.96	0.82
13	ELECTRONICS CO LTD	KR7009930003	166,122.73	0.64
14	ENEL SPA	IT0003128367	163,827.78	0.63
15	INTERNATIONAL INC	US9718131099	151,878.83	0.58
16	NORTHROP GRUMMAN CORP	US6668071029	123,414.23	0.47
17	TENCENT HOLDINGSLTD	KYG875721634	119,908.01	0.46
18	WHEELLOCK & CO LTD	HK0020000177	106,625.49	0.41
19	SIEMENS-AG-REG	DE0007236101	102,689.78	0.39
20	CA INC	US12673P1057	98,142.70	0.38

注:1.卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

2.所用证券代码采用**ISIN**代码。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	20,968,907.46
卖出收入(成交)总额	8,349,768.81

注: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。

8.6期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7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。

8.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持

证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

8.0期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	ISHARES CORE S&P 500 ETF	ETF	交易所开放式指数	BlackRock Fund Advisors	2,459,407.54	4.40
2	ISHARES MSCI EMERGING MARKET	ETF	交易所开放式指数	BlackRock Fund Advisors	677,361.31	1.21

8.11投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 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。

8.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	31,892.57
4	应收利息	1,304.35
5	应收申购款	336,467.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	369,663.98

8.14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不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者持有份额占总额比例	个人投资者持有份额占总额比例
10,678	3,612.83	147,788.75	39,152,615.55

9.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

9.3期末基金管理人员的从业人员持有本基金开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究人员负责人、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

项目	持有份额总额(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	14.05	0.00%

基金合同生效日(2010年9月14日)基金份额总额	681,944,905.65
本报告期初基金份额总额	22,717,377.09
本报告期基金份额总额	41,697,449.72
减:本报告期基金总申购份额	25,114,422.51
本报告期基金份额变动份额(申购减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	39,300,404.30

§ 11 重大事件揭示