

(上接 841 版)

747关联方关系

关联企业名称	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、证券登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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、基金销售机构
美国安永会计师事务所	基金管理人、的税务、基金销售机构
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人、的股东
建信资产管理有限责任公司	基金管理人、的子公司
布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)	境外资产托管人
伦敦环球投资有限公司(Principal Global Investors, LLC(“伦敦环球”))	境外投资顾问

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

748本报告期及上年度可比期间的关联方交易

748.1通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期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。

748.2关联方报酬

748.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 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	1,338,349.7	1,127,726.86
其中:支付销售机构的客户维护费	379,449.37	311,265.2

注:支付基金管理人建信基金的基金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**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**X0.35%**/当年天数。

748.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付托管费	258,288.15	219,280.24

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。

748.2.3销售服务费

无。

748.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

748.4各关联方投资本基金的情况

748.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
基金合同生效日(2011年6月21日) 持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	9,999,138.9	9,999,138.9
期间申购/买入总额	-	-
期间赎回/卖出总额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,138.9	9,999,138.9
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	14.31%	11.85%

748.4.2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。

748.5由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	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
期末余额		期末余额
中国工商银行 - 活期存款	2,635,040.73	17,109.59
中国工商银行 - 定期存款	4,452,778.56	24,823.14
利息收入		
定期存款利息收入		
活期存款利息收入		
合计		

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朗兄弟哈里曼银行保管,按约定利率计息。

748.6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。

748.7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期末未售正回购交易作为质押的债券

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

无。

749.3.3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

(2)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。

(3)持续的以公允价值计量的金融工具

(4)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 61726.7594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:60528.9547元,无第二层次或第三层次)。

(5)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。

(6)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(7)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)。

(8)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。

(9)减值税

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%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,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

8.1期末基金资产组合情况

单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	54,884,224.05	79.65
其中:普通股		44,380,203.33	64.40
优先股		10,504,020.72	15.24
投资性房地产		-	-
持有至到期投资		-	-
基金投资		6,842,488.89	9.93
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:买入返售的货币资金		-	-
6	其他金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,087,828.29	10.29
8	其他负债	95,534.69	0.14
9	合计	68,910,075.91	100.00

8.2期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

单位:人民币元

国家(地区)	金额	占基金资产净值比例(%)
中国	54,884,224.05	79.65
美国	44,380,203.33	64.40
英国	10,504,020.72	15.24
其他	-	-
合计	68,910,075.91	100.00

8.3期末按行业分类的权益投资组合

单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
非必需消费品	4,933,324.65	7.16
必需消费品	3,917,876.32	5.68
能源	4,708,281.80	6.83
金融	9,457,376.06	13.72
医疗保健	1,538,997.36	2.23
工业	1,488,737.57	2.15
信息技术	19,164,530.91	27.80
材料	2,573,393.73	3.73
电信服务	1,598,766.06	2.31
公用事业	1,963,013.79	2.85
合计	54,884,224.05	79.65

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。

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	15,452,297.91	22.36
美国	12,271,626.60	17.81
韩国	10,797,417.03	15.59
南非	4,714,788.77	6.85
泰国	3,275,717.70	4.78
印度	2,510,215.57	3.63
巴西	2,177,108.82	3.18
英国	1,570,288.62	2.26
意大利	1,240,288.38	1.81
马来西亚	874,446.65	1.26
合计	54,884,224.05	79.65

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
非必需消费品	4,933,324.65	7.16
必需消费品	3,917,876.32	5.68
能源	4,708,281.80	6.83
金融	9,457,376.06	13.72
医疗保健	1,538,997.36	2.23
工业	1,488,737.57	2.15
信息技术	19,164,530.91	27.80
材料	2,573,393.73	3.73
电信服务	1,598,766.06	2.31
公用事业	1,963,013.79	2.85
合计	54,884,224.05	79.65

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

单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	所在证券市场	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	TENKENT HOLDINGS LTD	KY687521	香港证券交易所	12,100	4,106,491.47	6.13
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR SPADR	US8740391	美国证券交易所	11,839	3,067,260.31	4.58
3	ALIBABA GROUP HOLDING SPADR	US81698V1	美国证券交易所	2,663	3,000,381.08	4.48
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	KR7088930	韩国证券交易所	183	2,854,272.25	4.26
5	KB FINANCIAL GROUP INC	KR7106500	韩国证券交易所	4,810	1,866,720.15	2.79
6	POSCO	KR7056490	韩国证券交易所	784	1,554,988.20	2.32
7	HON HAI PRECISION CORP REG S	US8389020	美国国际交易所	32,614	1,348,983.59	2.01
8	BANK OF CHINA LTD-H	CNE10000125	香港证券交易所	419,000	1,344,945.75	2.01
9	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGSLT	KY377781032	香港证券交易所	59,000	1,338,538.59	1.99
10	QUALICORP SA	BRLJUALC10N6	巴西证券交易所	21,500	1,314,492.26	1.96

1. 所用证券代码采用 ISIN 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.ccbund.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

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	ALIBABA GROUP HOLDING SPADR	US81698V1027	3,137,417.23	4.77
2	NA SPERS LTD-N SHS	ZA6E00015989	1,028,627.92	1.51
3	HANA FINANCIAL GROUP	KR7088930003	664,642.20	1.07
4	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGSLT	KY377781032	630,443.31	0.96
5	APPLE INC	US373831005	429,263.86	0.65
6	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	US8648701028	341,010.46	0.52
7	JPMORGAN CHASE & CO	US48625V1005	322,634.49	0.49
8	MICROSOFT CORP	US5949181045	284,724.63	0.43
9	COMCAST CORP-CLASS A	US0000101019	284,663.79	0.40
10	JOHNSON & JOHNSON	US4781601046	253,477.66	0.39
11	VERIZON COMMUNICATIONS INC	US92243V1044	193,679.71	0.29
12	GLEAD SCIENCES INC	US3755581036	170,667.81	0.26
13	LOCKHEED MARTIN CORP	US5838301004	164,741.41	0.25
14	ROCKWELL AUTOMATION INC	US7579031091	149,699.56	0.23
15	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	US1526572096	145,174.27	0.22
16	OVS HEALTH CORP	US1266501006	140,922.22	0.21
17	UNITEDHEALTH GROUP INC	US91324P0021	128,162.94	0.20
18	MCDONALDS CORP	US6801351012	127,515.07	0.19
19	ADORE SYSTEMS INC	US07241P1012	127,088.83	0.19
20	RAYTHEON COMPANY	US7551115071	114,993.42	0.17

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

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	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	KR7088930003	1,818,763.07	2.77
2	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	CNE10000443	1,267,932.89	1.91
3	SHIMADZU LTD	ZA6E00076860	1,192,746.38	1.83
4	TENKENT HOLDINGS LTD	KY687521634	1,153,716.36	1.76
5	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	CNE10000206	1,032,803.41	1.57
6	CHINA LONGUAN POWER GROUP-H	CNE10000H04	886,439.76	1.23
7	QA ENERGETICA DE SP-PRF B	BRC2591Q1P54	679,731.13	1.03
8	TAIWAN SEMICONDUCTOR SPADR	US8740391003	668,035.51	1.01
9	ALIBABA GROUP HOLDING SPADR	US81698V1027	610,804.61	0.93
10	NETEASE INC-ADR	US64110W1027	423,300.72	0.66
11	SASOL LTD	ZA6E00008986	412,147.77	0.63
12	NVIDIA CORP	US8738621040	406,748.20	0.62
13	AACT TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	KY626591149	381,730.03	0.58
14	KB FINANCIAL GROUP INC	KR7106500007	366,101.77	0.56
15	IAC INTERACTIVE CORP	US4819P58008	358,044.87	0.56
16	HON HAI PRECISION CORP REG S	US380002016	349,172.82	0.53
17	QUALICORP SA	BRLJUALC10N6	340,919.63	0.52
18	PRIMA BREAD COMPANY-CLASS A	US6840W1080	335,888.45	0.51
19	TIGER BRANDS LTD	ZA6E00071080	329,220.03	0.50
20	POSCO	KR7056490008	327,677.78	0.50

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(或)总额	卖出收入(或)总额
8,974,422.48	26,290,419.94

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。

8.10 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

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 MSCI EMERGING MARKET	ETF	交易型开放式指数	BlackRock Fund Advisors	3,078,915.04	4.59
2	HANG SENG H-SHARE INDEX ETF	ETF	交易型开放式指数	Hang Seng Investment Management Ltd	2,667,723.17	3.98
3	VANECK VECTORS RUSSIA ETF	ETF	交易型开放式指数	VanEck Vectors ETF Trust	831,542.29	1.24
4	ISHARES MSCI BRAZIL CAPITAL	ETF	交易型开放式指数	BlackRock Fund Advisors	264,308.38	0.39

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	65,159.92
4	应收利息	235.66
5	应收申购款	30,190.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	95,534.69

8.11.4 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。

8.11.5 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不存在流通受限情况。

8.9 基金份额持有人信息

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者	个人投资者
3,665	19,070.88	9,999,138.9	14.31%
		59,885,945.9	85.69%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

单位:份

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人、所有从属人员持有本基金	53,997.38	0.08%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

高级管理人员、基金投资和研究人员负责,该只基金的基金经理未持有该只基金。

9.4 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期基金总申购份额	19,234,832.00
减:本报告期基金总赎回份额	34,047,252.85
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期基金份额总额	69,504,784.48

9.5 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期,本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

报告期内,本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内,本基金托管人(专门基金托管部门)未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期涉及本基金基金管理人、基金财产及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告期内支付普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为人民币 54,000.00 元,该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期本基金公司和董事、监事和高级管理人员未受中国证监会、基金业协会、证券交易所或相关公开市场、以及被财政、外汇和审计等部门调查或处罚的情况。

本报告期托管人(专门基金托管部门)及其相关高级管理人员未受任何行政处罚或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资和佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	股票交易 成交金额占股票 成交总额比例	佣金	占当期佣金 总额比例	备注
------	--------	--------------	---------------------------	----	---------------	----

ITG EUROPE CSA	-	360,061.56	1.02%	418.
----------------	---	------------	-------	------