

建信安心保本七号混合型证券投资基金

2017年度报告摘要

2017年12月31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

送出日期：2018年3月28日

S 1 基金简介

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。

本基金年度报告未经三分之二以上独立董事签字表决，并由董事长签发。

基金管理人和托管人根据本基金合同规定，于2018年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。投资人投资有风险，在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期内的财务数据经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告书于2017年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

S 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称：建信安心保本七号混合型证券投资基金

基金主代码：002958

基金简称：建信安心保本七号

基金合同生效日：2016年6月8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

报告期截至基金资产总值：3,085,296,933.05元

基金资产净值：不定期

2.2 基金产品说明

投资目标：本基金通过资产配置与严格的风险控制，在严格控制风险的前提下，力争为持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

4.3.1 公平交易制度执行情况

为了公平对待所有客户，保护投资人利益，避免出现不当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金管理法》、《证券投资基金销售管理办法》、《基金管理合同》和其他法律法规，制定并实施了《公平交易管理制度》、《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》、《风险管理制度》。公司内部的交易系统中设置了公平交易模块，一旦发现不同基金同时买卖同一股票时，系统自动启动公平交易模块进行操作，确保在投资组合行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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待所有基金的组合，制定并严格遵守相应的制度流程，通过系统和人工等方式在各环节严格执行公平交易公平原则，报告期内，公司严格按照《证券投资基金托管人公司公平交易制度指导意见》和《基金管理人对管理的公司公平交易制度的规定》。

4.3.3 管理人对报告期内基金的投资策略和投资运作轨道的说明

本基金管理人对报告期内基金的投资策略和投资运作轨道的说明如下：

当报告期内为1月1日至3145日对本基金组合，有6807对投资组合未通过T检验，其中3392对投资组合的正溢价占比小于55%，其它3415对投资组合的正溢价占比均大于等于55%的基金组合中，2509对平均溢价率为2%，其它908对平均溢价率超平均2%的基金组合中，有20对投资组合的溢价率超过5%，但因为溢价率占平均溢价率的比较低，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

当报告期内为3月1日至3452日对本基金组合，有8794对投资组合未通过T检验，其中4912对投资组合的溢价率占比小于55%，其它357对平均溢价率超平均5%的基金组合中，有5对投资组合的溢价率超过5%，但因为溢价率占平均溢价率的比较低，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.4 异常交易行为的专项说明

本基金管理人所有对投资组合与交易所公开竞价同日反向交易或交趾的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有3次，原因是投资者组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和行业表现的说明

4.4.1 报告期内基金的证券投资策略和行业表现的说明

4.4.2 报告期内基金的证券投资策略和行业表现的说明

4.5 本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）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收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

基金经理：任军

基金托管人：中信银行股份有限公司

基金名称：建信安心保本七号混合型证券投资基金

基金简称：建信安心保本七号

基金合同生效日：2016年6月8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

报告期截至基金资产总值：3,085,296,933.05元

基金资产净值：不定期

2.4 信息披露方式

基金管理人和基金托管人披露网址

http://www.ccbfund.com

基金管理人和基金托管人披露时间

每半年度报告披露后2个工作日内

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

	2017年6月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日	2019年
年初已实现收益	126,335,277.68	44,590,913.70
末利得收益	144,576,543.01	30,655,867.39
本期利润	0.0358	0.0062
年初至报告期的累计损益总额	-3.38%	0.00%

3.2 基金产品说明

3.2.1 基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期各月期间基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

	2017年1月1日至2017年12月31日	2019年
基金净值增长率	4,901,294,889.00	-
同期业绩比较基准收益率	100.00	1,000
差额	4,901,294,889.00	-

3.1 本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）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收益。

2.9 期末可供分配利润的计算方法；如果期末未分配利润的金额为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分）。

3.2 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将低于所列示。

3.2.2 基金净值表现

3.2.1.1 基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期各月期间基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

	2017年1月1日至2017年12月31日	2019年
基金净值增长率	126,335,277.68	-
同期业绩比较基准收益率	144,576,543.01	-
差额	0.0358	-

3.2.2.1 基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期各月期间基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

	2017年1月1日至2017年12月31日	2019年
基金净值增长率	4,901,294,889.00	-
同期业绩比较基准收益率	100.00	1,000
差额	4,901,294,889.00	-

3.3 本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）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收益。

2.9 期末可供分配利润的计算方法；如果期末未分配利润的金额为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分）。

3.3.1 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将低于所列示。

3.3.2 基金净值表现

3.3.1.1 基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期各月期间基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

	2017年1月1日至2017年12月31日	2019年
基金净值增长率	126,335,277.68	-
同期业绩比较基准收益率	144,576,543.01	-
差额	0.0358	-

3.3.2.1 基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期各月期间基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

	2017年1月1日至2017年12月31日	2019年
基金净值增长率	4,901,294,889.00	-
同期业绩比较基准收益率	100.00	1,000
差额	4,901,294,889.00	-

3.3.3 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将低于所列示。

3.3.4 基金净值表现

3.3.3.1 基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期各月期间基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

	2017年1月1日至2017年12月31日	2019年
基金净值增长率	126,335,277.68	-
同期业绩比较基准收益率	144,576,543.01	-
差额	0.0358	-

3.3.3.2 基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

报告期各月期间基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元

	2017年1月1日至2017年12月31日	20