建信核心精选混合型证券投资基金 2017年年度报告摘要

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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018 年 3 月 28 日

§ 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司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及其更新。

本报告中的财务资料经审计,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。

本报告期自 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,应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信核心精选混合
基金主代码	530006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年 11 月 25 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	296, 377, 028.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对宏观经济环境、市场环境、行业特征和公司基本面的深入研究,精选具有良好成长性和价值性的上市公司股票,在有效控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人对经济环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析,作出投资决策。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为:75%× 沪深 300 指数 +25%× 中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中高收益 / 风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴晓明	郭明
	联系电话	010- 66228888	(010) 66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@cbc.com.cn
客户服务电话		400- 81- 95533 010- 66228000	95588
传真		010- 66228001	(010) 66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 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

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	5, 263, 893.02	- 134, 934, 031.54	880, 512, 699.17
本期利润	61, 653, 670.14	- 242, 354, 886.00	843, 407, 304.96
加权平均基金份额本期利润	0.1844	- 0.4779	0.8258
本期基金份额净值增长率	13.08%	- 18.77%	49.62%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.6336	0.4454	0.7795
期末基金资产净值	484, 149, 376.98	549, 777, 620.36	1, 347, 984, 385.90
期末基金份额净值	1.634	1.445	1.779

注: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入本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分)。

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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

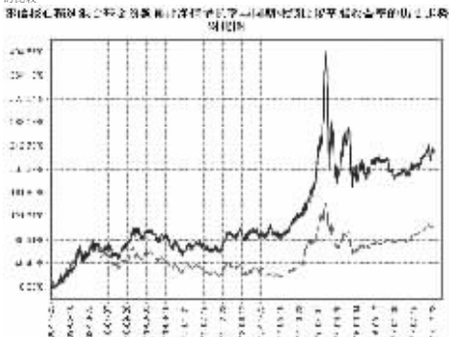
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	3.68%	0.97%	3.59%	0.60%	0.09%	0.37%
过去六个月	7.15%	0.80%	7.28%	0.52%	- 0.13%	0.28%
过去一年	13.08%	0.75%	15.69%	0.48%	- 2.61%	0.27%
过去三年	37.43%	1.70%	14.82%	1.26%	22.61%	0.44%
过去五年	87.93%	1.47%	52.19%	1.16%	35.74%	0.31%
自基金合同生效起至今	236.46%	1.36%	103.38%	1.18%	133.08%	0.18%

本基金投资业绩比较基准为:75%× 沪深 300 指数收益率 +25%× 中国债券总指数收益率。其中:沪深 300 指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准,中国债券总指数收益率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。

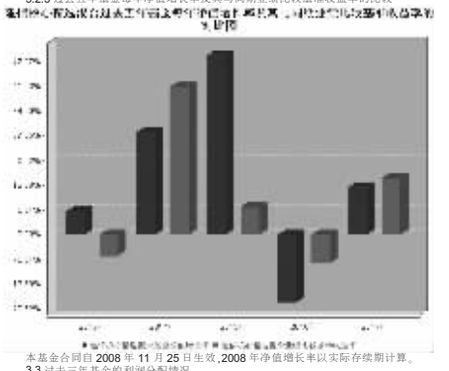
沪深 300 指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数,它是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。指数样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值。成份股为市场中市场代表性好,流动性高,交易活跃的主流投资股票,能够反映市场主流投资的收益情况。中债系列指数由一个总指数(即中国债券总指数),若干个分指数构成。中国债券总指数是全样本债券指数,包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券(如交易所和银行间债券,银行间金融债券等),理论上能客观反映中国债券总体情况。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本基金合同自 2008 年 11 月 25 日生效,2008 年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	0.186	5, 245, 913.92	0.00	5, 245, 913.92	
合计	0.186	5, 245, 913.92	0.00	5, 245, 913.92	

注:本基金的基金管理人于 2018 年 1 月 18 日宣告 2017 年度第 1 次分红,同赎金 2018 年 1 月 19 日止在本基金注册登记人建信基金管理有限责任公司登记在册的全体持有人,按每 10 份基金份额派发红利 0.186 元,收益分配基准日为 2017 年 12 月 31 日,共发放红利人民币 5,245,913.92 元。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日,注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资产管理有限公司,其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%,信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%,中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部,以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心,并在上海设立了子公司—建信资本管理有限责任公司,自成立以来,公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观,恪守“持有人利益重于事业”的原则,以“建设财富生活”为崇高使命,坚持规范运作,致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2017 年 12 月 31 日,公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网 + 产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网 + 产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票