

2017年年度报告摘要

上述买入金额为买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

1	601318	中国平安	3,262,010.00	2.97
2	600008	招商銀行	1,471,160.00	1.33
3	601166	兴业銀行	1,312,971.00	1.18
4	600016	民生银行	1,236,141.00	1.09
5	600000	交通銀行	1,241,160.00	1.12
6	601060	中信銀行	956,686.00	0.86
7	600000	浦发銀行	867,888.00	0.77
8	601601	中國人壽	760,680.00	0.69
9	600104	上汽集團	691,334.00	0.63
10	600048	保利地產	634,677.00	0.59
11	601330	中國鐵建	597,866.00	0.38
12	601198	中國鐵礦	366,969.00	0.32
13	600036	招商局	366,389.00	0.29
14	601078	中國人壽	302,800.00	0.27

15	601333	新华保险	253,519.00	0.26
16	600090	青岛海尔	256,890.00	0.23
17	601009	南京银行	254,795.00	0.23
18	600099	招商证券	254,569.00	0.23
19	601669	中国电建	211,758.00	0.19
20	600039	万华化学	203,190.00	0.18

上述卖出金额为卖出成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.43 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币

卖出股票收入（成交）总额	21,091,794.49
--------------	---------------

上述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（成交单价格以实际数量），不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,299,336.00	5.13
2	市政债券		

3	金融债券	239,340.00	0.24
	其中:政策性金融债	239,340.00	0.24
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债(可交换债)	--	--
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	6,599,676.00	5.27

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019663	17国信债09	53,000	5,292,050.00	4.31
2	019671	17国债17	10,000	997,300.00	0.81
3	106601	国开1703	3,000	299,340.00	0.24
4	019117	13国债17	100	9,866.00	0.01

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 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	上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金	股票型指数基金	交易型开放式指数基金	建信基金管理有限责任公司	113,271,750.00	92.19
---	----------------------	---------	------------	--------------	----------------	-------

8.11.1 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。

8.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

8.1.2 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.2.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.1.2.2 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。

8.1.2.3 本期国债期货投资评价
本报告期本基金未投资国债期货。
8.1.3 投资组合合规报告附注
8.1.3.1
本基金本报告期未按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中,民生证券股份有限公司2017年4月10日因批准转让上市公司股权、发回回购条件以及未按规定进行信息披露;违规转让不良贷款被中国证监会罚款70万元。
上海浦东发展银行股份有限公司(600000)2018年1月19日公告称其成都分行收到中国银行业监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书《川银监罚字〔2018〕1号》,因成都分行内部管理严重失效、授信管理混乱、违规办理信贷业务等严重违反

2017年12月28日,河南银监局《豫银监罚决字(2017)13号》对兴业银行股份有限公司郑州分行因违反国家规定从事投资业务的违法行为,没收违法所得6588.246万元,并处1倍罚款,罚没合计13176.492万元;对兴业银行股份有限公司郑州分行严重

及申购赎回规则的法律法规予以罚款50万元。

8.13.2 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。

8.13.3 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	5,415.15
2	应收证券清算款	-

4	应收利息	138,206.16
5	应收申购款	54,653.83
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	198,274.14

8.13.4 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

8.135 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。
8.136 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。
§9 基金份额持有人信息
9.1 期末基金份额持有人人数及持有人结构

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占基金份额总额的比例	持有份额	占基金份额总额的比例
7.935	8,376.16	4,881,822.51	7.35%	61,576,047.67	92.65%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人所有从业人员持有本基金	65.131	0.00%
------------------	--------	-------

该只基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：亿

基金合同生效日(2010年5月28日)基金份额总额	2,396,471,994.76
本报告期初基金份额总额	76,827,631.69
本报告期基金总申购份额	11,096,578.13
减:本报告期基金总赎回份额	20,467,339.64
本报告期基金份额变动(含红利再投资)	-

本报告期末基金份额总额	66,456,870.18
-------------	---------------

总申购份额含转换入份额, 总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
报告期内,本基金管理人未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金年度审计支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为人民币60,000.00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

本报告期未发生公司董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责、以及被处罚、外和刑事处罚等。除以上处罚情况外，报告期内公司董事、监事和高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付给券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

中国证监会	260.49	100.00%	22,100,000	100.00%
兴业证券	1	—	—	—

1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好，经营管理规范，内部管理制度健全，风险管理严格，能够满

基金管理人应当具备下列条件:

- (1) 具有具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- (2) 具备较强的研究能力,有固定的研究机构和专门的研究人员,能够对宏观经济、证券市场、行业、个股、个券等进行深入、全面的研究,能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人,能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究;

(4) 佣金费率合理。

2. 根据以上标准进行考察后,基金管理人确定券商,与被选择的券商签订委托协议,并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3. 本报告期末未发生变更交易单元的情况。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证	12,315,977.63	97.63%	13,900,100.00	100.00	-	-	-	-

兴业证券	299,300.00	2.37%	-	-	-	-	-	-
------	------------	-------	---	---	---	---	---	---

建信基金管理有限责任公司
2018年3月28日