建信互联网+产业升级股票型证券投资基金 2017年年度报告摘要

基金管理人：建信基金管理有限责任公司
基金托管人：华夏银行股份有限公司
送出日期：2018年3月28日

§1 重要提示

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。

基金托管人华夏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	建信互联网+产业升级股票
基金主代码	001396
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月23日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,832,890,049.49份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型基金，在有效控制风险前提下，精选优质的互联网公司和应用新一代互联网技术实现产业升级的上市公司，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%＋中债综合指数收益率（全价）×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴晓明	邓鹏
	联系电话	010-66228888	010-85238667
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	zhengpeng@hxb.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95577
传真		010-66228001	010-85238419

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6月23日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	22,623,607.80	-322,684,291.51	-430,965,452.21
本期利润	146,750,078.67	-598,231,472.93	-204,671,096.83
加权平均基金份额本期利润	0.0719	-0.2538	-0.0760
本期基金份额净值增长率	10.26%	-26.62%	-5.70%
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	-0.2690	-0.3084	-0.1487
期末基金资产净值	1,399,397,124.44	1,534,544,867.14	2,290,884,646.44
期末基金份额净值	0.763	0.692	0.943

1、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上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

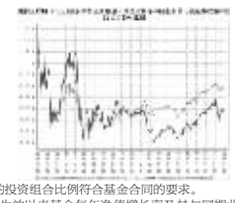
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.26%	1.01%	1.49%	0.61%	-1.23%	0.40%
过去六个月	6.42%	0.86%	5.87%	0.55%	0.55%	0.31%
过去一年	10.26%	0.80%	11.28%	0.52%	-1.02%	0.28%
自基金合同生效起至今	-23.70%	1.59%	-16.31%	1.34%	-7.39%	0.25%

中证800指数收益率×80%＋中债综合指数收益率（全价）×20%

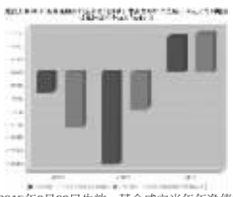
中证800指数是由中证指数有限公司编制的综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数。中证800指数的成份股由中证500指数和沪深300指数成份股一起构成。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金股票投资部分的风险收益特征。中债综合指数具广泛市场代表性，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。基于本基金的特征，使用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

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 自基金合同生效以来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



本基金基金合同于2015年6月23日生效，基金成立当年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

自基金合同生效以来，本基金未实施利润分配。

§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，中国华电集团资本控股有限公司，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“持有人利益重于泰山”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其联接基金、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、建信恒稳价值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、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、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、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈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、建信安心保本七号混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信信安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造2025股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债1-3年指数证券投资基金（LOF）基金、建信中证政策性金融债3-5年指数证券投资基金（LOF）基金、建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金（LOF）基金、建信中证政策性金融债5-8年指数证券投资基金（LOF）基金、建信睿源纯债债券型证券投资基金、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证50交易型开放式指数证券投资基金，共计95只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为3,609.83亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何坤华	本基金的基金经理	2015年6月23日	-	7	何坤华先生，硕士，2010年5月加入建信基金管理公司，历任助理研究员、初级研究员、研究员、研究主管、基金经理等职务。2015年4月17日至2017年6月30日任建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015年6月23日起任建信互联网+产业升级股票型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《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》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活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旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下（日内、3日内、5日内）管理的不同投资组合（包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等）同向交易的交易价差从T检验（置信度为95%）、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下：

当时间窗为1日时，配了31458对投资组合，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率占优频率小于55%，其它3415对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中，2509对平均溢价率低于2%，其它906对平均溢价率超过2%的投资组合中，有20对投资组合的贡献率超过5%，但因为其溢价金额占平均净值的比例较低，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为3日时，配了34512对投资组合，有8794对投资组合未通过T检验，其中3914对投资组合的溢价率占优频率均小于55%，其它4880对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中，4523对平均溢价率低于5%，其它357对平均溢价率超过5%的投资组合，有5对投资组合贡献率超过5%，但因为其溢价金额占平均净值的比例较低，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为5日时，配了35964对投资组合，有10419对投资组合未通过T检验，其中4515对投资组合的溢价率占优频率均小于55%，其它5904对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中，5809对平均溢价率低于10%，其它95对平均溢价率超过10%的投资组合，有3对投资组合贡献率超过5%，但因为其溢价金额占平均净值的比例较低，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少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业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年A股整体上涨，大小盘分化非常明显，大部分中小市值公司全年下跌，而各行业的大市值龙头公司上涨明显。反映到指数上，全年沪深300指数上涨21.78%，上证综指上涨6.56%，深圳成指上涨8.48%，中小板指上涨16.72%，创业板指下跌10.67%。从时间来看，大盘在1月份经历大跌，春节后至3月底快速反弹，4月份以后由于对经济增速的担忧出现快速下跌；下半年市场随经济的强劲增长而持续复苏，直到12月份出现明显的调整。全年的大小盘风格都非常一致，小盘股持续弱于大盘股，市值是影响股价走势最重要的因素。行业排名也是如此，中小盘股占比较大的的纺织服装、传媒和计算机行业跌幅最大，分别下跌23.02%、21.65%和18.81%；代表稳定类大盘蓝筹的食品饮料、家电、煤炭和非银金融位居涨幅榜前列，分别上涨54.57%、44.94%和19.31%。

本基金在报告期内按照基金合同一直保持在80%以上的仓位水平。行业配置上主要分布在互联网+、TMT、消费等中长期前景良好的板块上。个股方面，采取自下而上精选个股的投资策略，重点配置企业盈利增长较快、估值安全边际相对较高的个股。17年全年基金净值上涨10.26%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率10.26%，波动率0.8%，业绩比较基准收益率11.28%，波动率0.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年，国内经济有望继续稳定增长。从5-7年的资本开支周期角度，中国经济仍处于上一轮周期尾部的企稳阶段，也正是下一轮周期的左侧位置。12年至今企业部门资产负债表修复已经相对充分，盈利的持续性和高位的ROE将驱动资本开支的回升。从过去三个季度表现来看，企业经营的韧性更强，对利率的敏感性降低。制造业投资底部基本确认，向后看是温和回升走势；地产投资由于实际施工延后叠加棚改规模支撑，全年地产投资增速可能会有一定温和下滑；基建方面中央可动用的手段仍然非常多，如区域性施行盘活财政专项账户、拓展城市群建设等，需要关注的是时点节奏问题。

未来经济压力更应关注通胀，目前看油价是通胀最直接的压力来源，可能会导致货币与信用条件的收缩。此外中美利差在持续缩小：目前美国长债已经接近3%，中美利差在90BP附近。就可比经验来看，中美利差70BP是中国长债跟随性上行的压力位置，50BP则是利差的绝对低位。利差收窄主要原因是美债过快上行。而美债的上行，是对其本身通胀压力和需求景气的充分反应，目前来看3%很可能不是美债的终点，因此中国的资金成本可能因此被动抬升。

从盈利来看，A股的盈利全年走势有可能前高后低，再次回升可能需要第二库存周期启动并伴随价格中枢再次抬升，在此过程中业绩的确定性最为重要。估值角度，大盘蓝筹股持续回升，目前处于历史中枢55%分位；创业板和中小板估值从底部回升，中小板和创业板的估值在30-40倍区间。从估值比较的角度，大盘蓝筹仍有改善空间，但弹性幅度会显著趋缓；而中小盘中盈利改善的中证500由于流动性折价被持续压制，其估值已经无法充分反应盈利的同步改善，有上修空间。

风格方面，18年成长龙头的个股配置机会可能更加明显。以互联网、电子、通信类龙头白马为代表的优质成长股估值和盈利增长均具备较强的吸引力；同时政策层面对引导BATJ回归、引导硬科技类公司上市、引导先进制造和创新引领的产业发展等各类舆情基调，有望带动市场对龙头成长股的风险偏好逐步提升。整体成长股风格未来必定走向显著的分化，大批绩差股、“流动性陷阱”股将被市场抛弃，而类似“创蓝筹”、硬科技、国际龙头类的成长公司将成为中国真正新经济动能的代表者，并走出独立的行情趋势。

总体判断18年A股有可能在成长股领域出现较好的投资机会，今年本基金的股票仓位将按照基金合同的要求维持在80%以上，运作重点将放在精选个股上。行业配置方面本基金将继续重点布局互联网+、TMT、消费等中长期前景良好的板块中的优质个股，尽力为持有人创造超额回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2017]13号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、风险管理部和资产核算部门负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》，与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）；对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣，对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2017年度，托管人在建信互联网+产业升级股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2017年度，建信基金管理有限责任公司在建信互联网+产业升级股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017年度，由建信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关建信互联网+产业升级股票型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了建信互联网+产业升级股票型证券投资基金(以下简称“建信互联网+产业升级股票基金”)的财务报表，包括2017年12月31日的资产负债表，2017年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。并出具了普华永道中天审字(2018)第22726号标准无保留意见。投资者可通过年度报告正文查看审计报告正文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体：建信互联网+产业升级股票型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资 产：			
银行存款		250,562,905.28	269,414,245.33
结算备付金		4,170,514.68	7,682,100.48
存出保证金		1,451,130.49	2,423,911.92
交易性金融资产		1,153,229,212.83	1,334,405,334.21
其中：股票投资		1,153,229,212.83	1,334,405,334.21
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		58,236.29	55,042.75
应收股利		-	-
应收申购款		174,759.24	53,031.47
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,409,646,758.81	1,614,033,666.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	71,177,440.30
应付赎回款		1,582,724.77	819,765.05
应付管理人报酬		1,775,135.11	2,017,324.48
应付托管费		295,855.84	336,220.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		6,155,783.95	4,716,256.99
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		440,134.70	421,791.45
负债合计		10,249,634.37	79,488,799.02
所有者权益：			
实收基金		1,832,890,049.49	2,218,957,881.29
未分配利润		-433,492,925.05	-684,413,014.15
所有者权益合计		1,399,397,124.44	1,534,544,867.14
负债和所有者权益总计		1,409,646,758.81	1,614,033,666.16

报告截止日2017年12月31日，基金份额净值0.763元，基金份额总额1,832,890,049.49份。

7.2 利润表

会计主体：建信互联网+产业升级股票型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	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
一、收入		186,474,158.47	-545,343,510.58
1.利息收入		1,797,674.71	1,802,347.33
其中：存款利息收入		1,720,575.45	1,802,347.33
债券利息收入		65.402	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		76,445.24	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		60,419,326.98	-271,879,433.75
其中：股票投资收益		46,434,515.30	-276,225,475.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益		313,686.96	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		13,671,124.73	4,346,041.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		124,126,470.87	-275,547,181.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		130,685.91	280,757.26
减：二、费用		39,724,079.80	52,887,962.35
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	22,055,930.25	26,433,405.04
2. 托管费	7.4.8.2.2	3,675,988.35	4,405,567.58
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		13,474,161.20	21,530,989.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		518,000.00	518,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		146,750,078.67	-598,231,472.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		146,750,078.67	-598,231,472.93

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信互联网+产业升级股票型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,218,957,881.29	-684,413,014.15	1,534,544,867.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	146,750,078.67	146,750,078.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-386,067,831.80	104,170,010.43	-281,897,821.37
其中：1.基金申购款	33,815,896.25	-9,386,845.32	24,429,049.93
2.基金赎回款	-419,883,727.05	113,556,855.75	-306,326,871.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,832,890,049.49	-433,492,925.05	1,399,397,124.44
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,428,260,292.66	-137,375,646.22	2,290,884,646.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-598,231,472.93	-598,231,472.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-209,302,411.37	51,194,105.00	-158,108,306.37
其中：1.基金申购款	83,465,419.12	-20,586,934.42	62,878,484.70
2.基金赎回款	-292,767,830.49	71,781,039.42	-220,986,791.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,218,957,881.29	-684,413,014.15	1,534,544,867.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

孙志晨 吴晓明 丁颖

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信互联网+产业升级股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]930号《关于准予建信互联网+产业升级股票型证券投资基金注册的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信互联网+产业升级股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,907,670,901.70元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第765号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信互联网+产业升级股票型证券投资基金基金合同》于2015年6月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,908,449,505.42份基金份额，其中认购资金利息折合778,603.72份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信互联网+产业升级股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的80%－95%，投资于互联网+产业升级主题相关的上市公司发行的股票占非现金资产的比例不低于80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为80% X中证800指数收益率+20% X中债综合指数收益率(全价)。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于2018年3月21日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信互联网+产业升级股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	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、注册登记机构、基金销售机构
华夏银行股份有限公司(“华夏银行”)	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”)	基金管理人的股东、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的