建信创新中国混合型证券投资基金 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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	建信创新中国混合
基金主代码	000308
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月24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
报告期末基金份额总额	46,354,412.12份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略,本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势,判断当前所处的经济周期,进而对未来做出科学预测。在此基础上,结合对流动性及资金流向的分析,综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。
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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴剑明	李修宸
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024

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	11,358,527.36	4,201,756.10	35,112,987.62
本期利润	13,608,842.77	-538,240.78	31,665,016.70
加权平均基金份额本期利润	0.2974	-0.0152	0.9758
本期基金份额净值增长率	13.60%	-0.95%	72.63%
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	1.4983	1.1988	1.2196
期末基金资产净值	115,808,822.32	95,878,544.51	61,645,531.17
期末基金份额净值	2.498	2.199	2.220

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(已实现部分和未实现部分)。

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

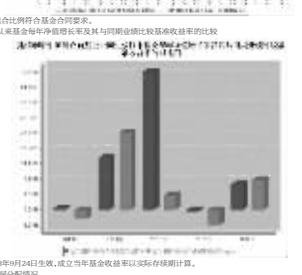
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.34%	0.98%	3.59%	0.60%	-4.93%	0.38%
过去六个月	5.98%	0.91%	7.28%	0.52%	-1.30%	0.39%
过去一年	13.60%	0.82%	15.69%	0.48%	-2.09%	0.34%
过去三年	94.25%	1.80%	14.82%	1.26%	79.43%	0.54%
自基金合同生效起至今	149.80%	1.59%	53.91%	1.17%	95.89%	0.42%

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,本基金为股票型证券投资基金,投资范围主要包括A股、债券类资产、货币市场投资品种以及现金等金融工具。其中投资于股票的基金资产占基金资产比例为60%-95%,在实际投资运作中,本基金股票投资比例均值约为75%,故本基金采取75%作为复合业绩比较基准中衡量股票投资部分业绩表现的权重,相应将25%作为衡量债券投资部分业绩表现的权重。

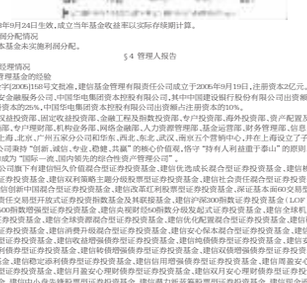
沪深300指数是由中证指数公司编制的,从上海和深圳股票市场中选取的300只A股作为样本编制而成的成份股指数。该指数样本覆盖了沪深市场七成左右的流通市值和超过四分之三的总市值,是具有良好的市场代表性、能够反映A股市场整体走势的指数。沪深300指数中的很多成份股本身即为业绩优良的蓝筹品种,以其为标的的指数期货也已经推出,从而会为本基金带来新的投资机会和风险管理手段。因此,基金管理人选择沪深300指数作为本基金股票部分的比较基准。中国债券总指数的发布主体是中央国债登记结算有限责任公司。中央国债登记结算公司是全国债券市场类品种登记、托管、结算、交易结算等服务的国有独资金融机构,是财政部唯一授权主持建立、运营全国国债托管系统的机构,是中国人民银行指定的全国银行间债券市场债券登记、托管、结算机构和商业银行柜台记账式国债交易的一级托管人,同时中国债券总指数是目前国内涵盖范围最广的债券指数之一,具有良好的市场代表性。由此可见,上述两个指数的发布主体在证券市场上具有较高的市场代表性,权威性和中立性,适合作本基金的业绩比较基准。

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



本报告期本基金投资组合比例符合基金合同要求。

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2013年9月24日生效,成立当年基金收益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[2006]158号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于2006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,安全金融服务公司,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、金融工程及新数投资部、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、广州五家分公司和控股、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。目成立以来,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”为宗高使命,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、建信点睛时代300指数分级股起式证券投资基金、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、建信和睦配置混合型证券投资基金、建信稳健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、建信双双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、建信月月金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、建信嘉新宝贵市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信趋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、建信稳定纯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、建信稳健积极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、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳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、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信恒益一年定期开放债券型证券投资基金、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、建信丰和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、建信恒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、建信瑞顺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5-10年指数证券投资基金(LOF)基金、建信中证政策性金融债5-10年指数证券投资基金(LOF)基金、建信睿赢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、建信睿球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96只开放式基金,管理的基金净资产规模共计为3,609.02亿元。

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		
邵卓	权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官、本基金的基金经理	2015年5月22日	-	7	硕士,权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官。2006年4月至2006年12月任明基(西门子)移动通信研发中心软件工程师;2007年2月至2010年7月任IBM中国软件实验室软件工程师;2010年7月加入广发证券公司,任计算机行业研究员。即卓于2011年9月加入我公司研究部,历任研究员、研究主管,2015年3月24日起任建信信息产业股票型证券投资基金的基金经理;2015年5月22日起任建信创新中国混合型证券投资基金的基金经理;2017年12月19日起任建信安心保本三号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2018年1月5日起转型为建信裕利灵活配置混合型证券投资基金,邵卓继续担任该基金的基金经理。
邵豪	权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官、本基金的基金经理	2015年5月22日	-	7	硕士,权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官。2010年7月至2013年7月任中国证券监督管理委员会证券发行审核委员会专业委员,2013年7月至2014年7月任中国证券监督管理委员会上市公司并购重组委员会专业委员,2014年7月至2015年3月任中国证券监督管理委员会创业板发行审核委员会专业委员。邵豪于2015年3月加入我公司研究部,历任研究员、研究主管,2015年5月22日起任建信信息产业股票型证券投资基金的基金经理;2015年5月22日起任建信创新中国混合型证券投资基金的基金经理;2017年12月19日起任建信安心保本三号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2018年1月5日起转型为建信裕利灵活配置混合型证券投资基金,邵豪继续担任该基金的基金经理。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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

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》、《证券投资基金管理办法》、《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》、《公司的否内操作交易管理办法》、《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,系统自动实施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市场情(资料来源:证券市场行情)、同一证券成交量、证券市场流动性等方面进行了专项分析。具体分析如下:

当同向交易为1日,配了314848万股投组合,有6077万股投组合未通过下检验,其中93282万股投组合的正溢价率占比频率小于16%,其它3415万股投组合溢价率大于56%的投资组合中,250917万股投组合溢价率低于2%,其它3068万股投组合溢价率超过2%的投资组合中,有2017万股投组合溢价率超过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。

当同向交易为3日,配了345127万股投组合,有6794万股投组合未通过下检验,其中2914万股投组合的溢价率占优频率均小于16%,其它4880万股投组合溢价率大于56%的投资组合中,45233万平均溢价率低于5%,其它2837万平均溢价率超过5%的投资组合,有5472万股投组合贡献率超过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。

当同向交易为5日,配了36964万股投组合,有10419万股投组合未通过下检验,其中4615万股投组合的溢价率占优频率均小于16%,其它5804万股投组合溢价率大于56%的投资组合中,5800万平均溢价率低于10%,其它4万平均溢价率超过10%的投资组合,有3万股投组合贡献率超过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 特定客户资产的管理情况

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,期间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年是A股分化剧烈的一年,全年上证综指上涨6.56%,上证50上涨25.08%,而创业板指下跌10.67%,食品饮料、家电板块涨幅领先,分别上涨50.16%和43.36%,纺织服装和传媒下跌最多,分别下跌24.10%和21.56%。全年来看,市值大小成为个股分化最显著的因素,大市值蓝筹股表现较为稳定,而中小盘股则表现出较大的价值重复行情。

从价值的角度回顾,2011年—2015年的经济连续下行周期后,大市值蓝筹公司长期股价表现低迷,估值也处在历史低位;而创业板,中小板个股则在2014、2015年的并购高潮中快速上涨。尽管大、小市值股票在2016年下半年出现明显分化,大市值蓝筹股在16年下半年已经有明显涨幅,但基本面的改善迹象,因此2017年初来看,估值仍然处在低位。这为2017年大市值蓝筹贡献全年的超额收益表现提供了基础条件。

基本面上,2016年以来在供给侧改革推动下,大宗商品价格大幅上涨,2017年供给侧改革的持续起作用,同时,2017年中开始环保政策超预期从严执行,更是导致周期性行业小企业在环保和成本压力下加速退出,行业龙头公司的优势地位进一步加强;在经济好转和消费升级的共同作用下,食品饮料、家电等消费行业业绩表现展现,综合下来,2017年周期和消费行业在基本面上同步向好,股价表现实现了业绩和估值同步向上的属性断双击。

投资者担忧方面,2017年沪港通、深港通成为重要的边际增量资金,以及国家队的存在,共同推动了大市值蓝筹的估值修复。这种修复是和经济发展阶段、投资者结构转换相匹配的,也是A股向海外成熟市场接轨的应处性进程。

本基金的配置思路,主要是日下而上选股,通过寻找和筛选个股的基本面变化导致实现超额收益。在2017年大市值风格影响贯穿全年的情况下,日下而上个股选择的效果比历史平均年份要弱。部分持仓股票,尽管或处性和估值的匹配程度较好,但因为市值较小的原因,在2017年并没有实现预期中的收益表现,拉低了组合的综合收益率。但我们也要看到,2017年大市值风格的压倒性影响是基本面、估值、增量资金共同作用的结果,在历史上相对少见。日下而上的个股选择,在更长的时间跨度上是合理有效的。

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13.6%,波动率0.82%,业绩比较基准收益率15.69%,波动率0.48%。

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,国内经济在经历2016、2017稳定再年的回升后,可能面临库存周期向下调整的短期压力。政动性方面,2018年大部分时间预计处在货币新周导致的收紧通道中。从这个角度看,2018年A股市场极概率重现2017年周期、消费共同向好的景气格局,周期性行业短期面临挑战更大,行业间基本面的分化收紧加剧但,日下而上的个股选择极密加重要。

从更长的眼光来看,2011年以来的下行周期中受损的企业资产负债表在16、17两年得到了明显修复,因此短期库存周期的正常调整并不会影响企业新一轮资本开支的重新扩张,即经济长期的韧性仍然值得看好。

2018年本基金将继续延续勤奋的投资策略,精选符合科技创新方向中信银增速匹配的优质个股,努力为投资者实现收益。

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投资业务的高管、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业作、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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对建信创新中国混合型证券投资基金 2017年度基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司在建信创新中国混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的建信创新中国混合型证券投资基金2017年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了后附的建信创新中国混合型证券投资基金(以下简称“建信创新中国混合基金”)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,并出具了普华永道中天审字(2018)第23654号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:建信创新中国混合型证券投资基金

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		10,141,274.99	20,480,478.04
结算备付金		544,850.87	698,965.13
存出保证金		123,897.23	148,124.79
交易性金融资产		95,817,879.66	79,970,230.88
其中:股票投资		92,365,913.26	79,970,230.88
基金投资		-	-
债券投资		3,451,966.40	-
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		10,300,000.00	-
应收证券清算款		2,375,261.61	-
应收利息		456.07	4,706.89
应收股利		-	-
应收申购款		374,724.89	27,699.57
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		119,678,345.32	101,330,205.30
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		2,314,516.25	3,963,845.50
应付赎回款		316,680.84	410,735.66
应付管理人报酬		146,935.24	123,082.28
应付托管费		24,489.20	20,513.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		638,590.96	624,821.04
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		428,310.51	308,662.61
负债合计		3,869,523.00	5,451,660.79
所有者权益:			
实收基金		46,354,412.12	43,604,070.36
未分配利润		69,454,410.20	52,274,474.15
所有者权益合计		115,808,822.32	95,878,544.51
负债和所有者权益总计		119,678,345.32	101,330,205.30

报告截止日2017年12月31日,基金份额净值2.498元,基金份额总额46,354,412.12份。

7.2 利润表

会计主体:建信创新中国混合型证券投资基金

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		17,760,999.78	2,735,813.93
1.利息收入		233,286.57	147,231.91
其中:存款利息收入		204,059.55	147,231.91
债券利息收入		153.05	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		29,073.97	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		15,201,321.53	7,256,176.78
其中:股票投资收益		14,410,759.11	6,845,422.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益		28,583.72	-
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		761,978.70	410,754.16
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		2,250,315.41	-4,739,996.88
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		76,076.27	72,402.12
减:二、费用		4,152,157.01	3,274,054.71
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,621,818.10	1,134,622.85
2. 托管费	7.4.8.2.2	270,302.99	189,103.77
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		1,882,404.97	1,574,205.39
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		377,630.95	376,122.70
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		13,608,842.77	-538,240.78
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		13,608,842.77	-538,240.78

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信创新中国混合型证券投资基金

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)	43,604,070.36	52,274,474.15	95,878,544.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	13,608,842.77	13,608,842.77
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)	2,750,341.76	3,571,093.28	6,321,435.04
其中:1.基金申购款	33,521,689.10	47,098,783.51	80,620,472.61
2.基金赎回款	-30,771,347.34	-43,527,690.23	-74,299,037.57
四、本期向基金分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)	46,354,412.12	69,454,410.20	115,808,822.32

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)	27,772,826.50	33,872,704.67	61,645,531.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-538,240.78	-538,240.78
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)	15,831,243.86	18,940,010.26	34,771,254.12
其中:1.基金申购款	46,231,183.89	54,098,456.67	100,329,640.56
2.基金赎回款	-30,399,940.03	-35,158,446.41	-65,558,386.44
四、本期向基金分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)	43,604,070.36	52,274,474.15	95,878,544.51

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:

孙志颖_____ _____吴剑明_____ _____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

建信创新中国混合型证券投资基金(原名为建信创新中国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[2013]727号《关于核准建信创新中国股票型证券投资基金募集的批复》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《建信创新中国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[illegible]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(2013)第[illegible]号验资报告予以验证。经中国证监会核准,《建信创新中国股票型证券投资基金基金合同》于2013年9月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1038,476,234.90份基金份额,其中认购资金利息折合367,317.83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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,建信创新中国股票型证券投资基金于2015年8月8日公告后更名为建信创新中国混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信创新中国混合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具有良好流动性的金融工具,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核准上市的股票)、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合比例为:本基金持有的股票占基金资产的比例为60%-95%;债券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-40%,其中,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,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的金债比较基准为75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。

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(年度报告和中年度报告)》、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1》、《建信创新中国混合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证券操作,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发放该项利息时代扣代缴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。对基金持有上市公司限售股,解禁后取