

建信多因子量化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:中国民生银行股份有限公司
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、监事、高级管理人员、基金经理等人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并在其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金年度报告经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事签发。
本基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定,于2018年3月26日复核了本年度报告,并出具了复核报告。基金管理人和基金托管人对本年度报告复核无异议,但基金托管人承诺以诚实信用、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。
本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并认真考虑,基金在任何时间点都不能保证其投资价值会实现。基金管理人和基金托管人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。
本基金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。

2.2 基金简介

基金名称	建信多因子量化股票型证券投资基金
基金代码	000626
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年09月10日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金资产净值	00,000,000.00
基金合同的终止日期	不定期

2.3 基金产品说明

投资目标 在有效控制风险的基础上,力争超越业绩比较基准,实现基金资产的长期增值。

投资策略 本基金采用多因子量化选股策略,综合技术、财务、行业等多方面数据,结合量化模型,在遵循投资纪律、严控风险的前提下,精选个股,构建股票组合。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*15%+商业银行存款基准利率*85%。

风险收益特征 本基金为股票型基金,具有较高风险、较高收益的特征。

本基金投资于股票,其风险和收益高于债券型基金、货币市场基金和货币型基金。

基金管理人和基金托管人

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

基金合同全文阅读网址: http://www.ccbf.com

基金年度报告摘要阅读网址: http://www.ccbf.com

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

2011期间数据和指标	2010年度(报告期初至报告期末)	2010年度(报告期初至报告期末)	2015年度
本期实现收益	11,290,414.03	0,413,000.03	
本期利润	10,630,201.00	-2,196,971.53	
加权平均基金份额本期利润	0.1003	-0.0073	
本期基金份额净值增长率	10.81%	-1.79%	
2.12 期末基金份额总额	2017年末	2016年末	2015年末
2.13 期末基金份额净值	0.0883	-0.0179	
2.14 期末基金资产净值	107,994,480.04	240,098,205.64	
2.15 期末可供分配基金份额净值	1.0003		

1. 本期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,本期利润为本期实现收益扣除本期公允价值变动收益后的余额。

2. 期末可供分配利润的计算方法:期末可供分配利润的金额为已实现利润扣除期末可供分配利润的费用后,即期末未分配利润。

3. 期末可供分配利润,即期末可供分配利润减去期末未分配利润。

4. 期末可供分配利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计算公式为:

可供分配利润=基金本期利息收入+基金投资收益+其他收入-基金费用。

5. 期末可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

6. 本期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且基金利润为正数,则期末可供分配利润的金额为已实现利润扣除期末未分配利润后的金额;如果期末未分配利润的金额为负数,则期末可供分配利润的金额为零。

7. 期末可供分配利润,即期末可供分配利润减去期末未分配利润。

8. 期末可供分配利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计算公式为:

可供分配利润=基金本期利息收入+基金投资收益+其他收入-基金费用。

9. 期末可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

10. 本期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且基金利润为正数,则期末可供分配利润的金额为已实现利润扣除期末未分配利润后的金额;如果期末未分配利润的金额为负数,则期末可供分配利润的金额为零。

11. 期末可供分配利润,即期末可供分配利润减去期末未分配利润。

12. 期末可供分配利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计算公式为:

可供分配利润=基金本期利息收入+基金投资收益+其他收入-基金费用。

13. 期末可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

14. 本期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且基金利润为正数,则期末可供分配利润的金额为已实现利润扣除期末未分配利润后的金额;如果期末未分配利润的金额为负数,则期末可供分配利润的金额为零。

15. 期末可供分配利润,即期末可供分配利润减去期末未分配利润。

16. 期末可供分配利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计算公式为:

可供分配利润=基金本期利息收入+基金投资收益+其他收入-基金费用。

17. 期末可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

18. 本期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且基金利润为正数,则期末可供分配利润的金额为已实现利润扣除期末未分配利润后的金额;如果期末未分配利润的金额为负数,则期末可供分配利润的金额为零。

19. 期末可供分配利润,即期末可供分配利润减去期末未分配利润。

20. 期末可供分配利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计算公式为:

可供分配利润=基金本期利息收入+基金投资收益+其他收入-基金费用。

21. 期末可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

22. 本期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且基金利润为正数,则期末可供分配利润的金额为已实现利润扣除期末未分配利润后的金额;如果期末未分配利润的金额为负数,则期末可供分配利润的金额为零。

23. 期末可供分配利润,即期末可供分配利润减去期末未分配利润。

24. 期末可供分配利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计算公式为:

可供分配利润=基金本期利息收入+基金投资收益+其他收入-基金费用。

25. 期末可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

26. 本期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且基金利润为正数,则期末可供分配利润的金额为已实现利润扣除期末未分配利润后的金额;如果期末未分配利润的金额为负数,则期末可供分配利润的金额为零。

27. 期末可供分配利润,即期末可供分配利润减去期末未分配利润。

28. 期末可供分配利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计算公式为:

可供分配利润=基金本期利息收入+基金投资收益+其他收入-基金费用。

29. 期末可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

30. 本期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且基金利润为正数,则期末可供分配利润的金额为已实现利润扣除期末未分配利润后的金额;如果期末未分配利润的金额为负数,则期末可供分配利润的金额为零。

31. 期末可供分配利润,即期末可供分配利润减去期末未分配利润。

32. 期末可供分配利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用,计算公式为:

可供分配利润=基金本期利息收入+基金投资收益+其他收入-基金费用。

33. 期末可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

34. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

35. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

36. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

37. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

38. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

39. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

40. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

41. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

42. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

43. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

44. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

45. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

46. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

47. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

48. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

49. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

50. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

51. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

52. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

53. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

54. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

55. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

56. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

57. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

58. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

59. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

60. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

61. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

62. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

63. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

64. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

65. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

66. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

67. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

68. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

69. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

70. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

71. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

72. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

73. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

74. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

75. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

76. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

77. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

78. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

79. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

80. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

81. 本期可供分配利润的金额经本基金管理人计算并由基金托管人复核后确定。

<p