

# 建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资 基金

## 2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 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。本半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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                |                  |                 |                 |
|----------------|------------------|-----------------|-----------------|
| 基金简称           | 建信央视 50          |                 |                 |
| 场内简称           | 建信 50            |                 |                 |
| 基金主代码          | 165312           |                 |                 |
| 基金运作方式         | 契约型开放式           |                 |                 |
| 基金合同生效日        | 2013 年 3 月 28 日  |                 |                 |
| 基金管理人          | 建信基金管理有限责任公司     |                 |                 |
| 基金托管人          | 交通银行股份有限公司       |                 |                 |
| 报告期末基金份额总额     | 174,370,715.11 份 |                 |                 |
| 基金合同存续期        | 不定期              |                 |                 |
| 基金份额上市的证券交易所   | 深圳证券交易所          |                 |                 |
| 上市日期           | 2013 年 5 月 20 日  |                 |                 |
| 下属分级基金的基金简称    | 建信央视 50          | 建信央视 50A        | 建信央视 50B        |
| 下属分级基金场内简称:    | 建信 50            | 建信 50A          | 建信 50B          |
| 下属分级基金的交易代码    | 165312           | 150123          | 150124          |
| 报告期末下属分级基金份额总额 | 97,031,489.11 份  | 38,669,613.00 份 | 38,669,613.00 份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                        |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化，实现对央视财经 50 指数的有效跟踪。                                               |
| 投资策略 | 本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。<br>本基金对标的指数的跟踪目标：力争使得日均跟踪偏离度的绝对值 |

|               |                                                                                                                                                                                                                |                                                       |                                                      |
|---------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|
|               | 不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。                                                                                                                        |                                                       |                                                      |
| 业绩比较基准        | 本基金的业绩比较基准： $95\% \times \text{央视 50 价格指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。                                                                                                                              |                                                       |                                                      |
| 风险收益特征        | <p>本基金属于采用指数化操作的股票型基金，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，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。</p> <p>从本基金所分离的两类基金份额来看，建信央视 50A 份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；建信央视 50B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。</p> |                                                       |                                                      |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 本基金属于采用指数化操作的股票型基金，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，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。                                                                                                                                          | 建信央视 50A 份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额。 | 建信央视 50B 份额将表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。 |

## 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         | 交通银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 吴曙明                  | 陆志俊               |
|         | 联系电话 | 010-66228888         | 95559             |
|         | 电子邮箱 | xinzipilu@ccbfund.cn | luzj@bankcomm.com |

|        |                              |              |
|--------|------------------------------|--------------|
| 客户服务电话 | 400-81-95533<br>010-66228000 | 95559        |
| 传真     | 010-66228001                 | 021-62701216 |

## 2.4 信息披露方式

|                          |                                                           |
|--------------------------|-----------------------------------------------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网<br>网址 | <a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a> |
| 基金半年度报告备置地点              | 基金管理人和基金托管人的住所                                            |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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 | 报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|----------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 11,663,800.97                          |
| 本期利润          | 51,366,783.69                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.3775                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 28.05%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )                |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.5700                                 |
| 期末基金资产净值      | 286,246,545.82                         |
| 期末基金份额净值      | 1.6416                                 |

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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|-------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 10.03%       | 0.93%               | 9.09%              | 0.96%                 | 0.94% | -0.03% |
| 过去三个月 | 16.20%       | 0.77%               | 14.26%             | 0.78%                 | 1.94% | -0.01% |

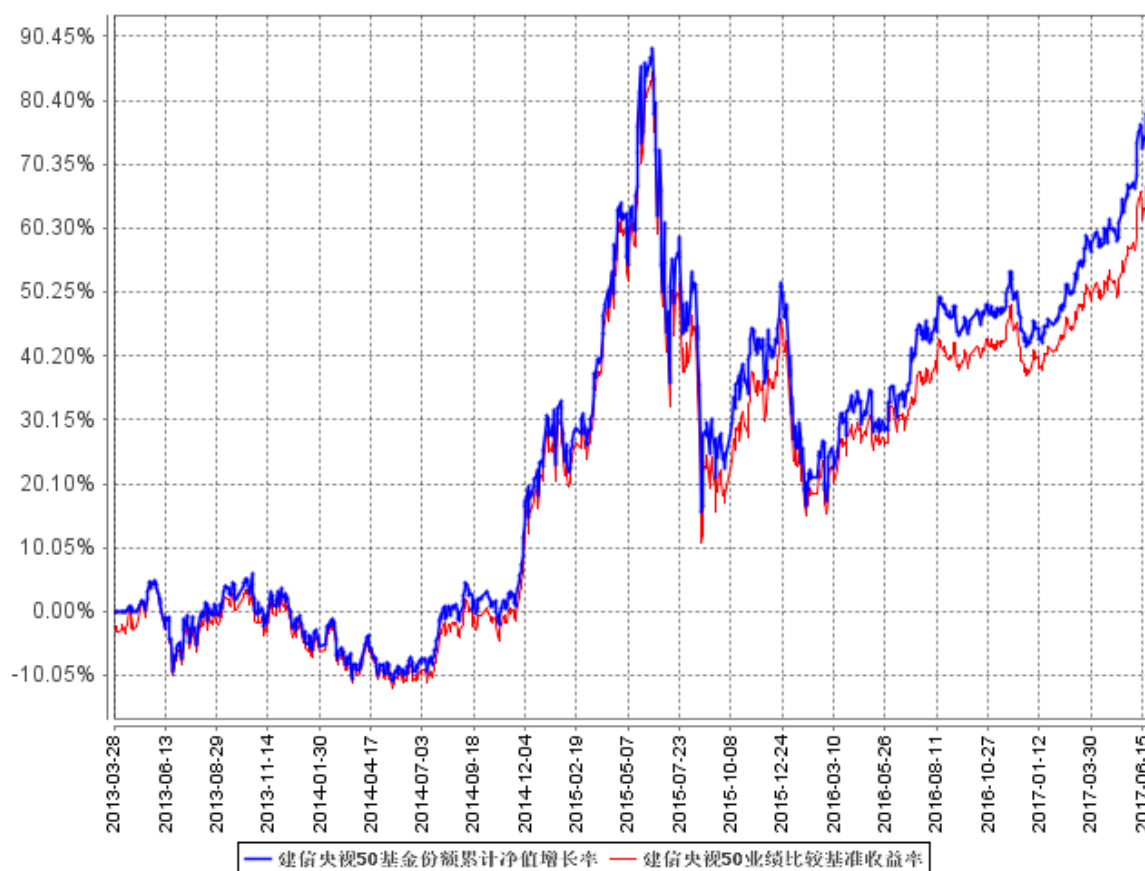
|                |        |       |        |       |        |        |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月          | 28.05% | 0.66% | 23.78% | 0.67% | 4.27%  | -0.01% |
| 过去一年           | 35.25% | 0.75% | 30.37% | 0.71% | 4.88%  | 0.04%  |
| 过去三年           | 98.99% | 1.65% | 89.59% | 1.60% | 9.40%  | 0.05%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 83.43% | 1.50% | 71.51% | 1.48% | 11.92% | 0.02%  |

本基金的业绩比较基准： $95\% \times \text{央视财经 50 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

本基金以央视财经 50 指数为标的指数，但由于相关法规的要求，本基金投资股票的资产不超过基金资产净值的 95%，且现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，因此，选用“ $95\% \times \text{央视财经 50 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ ”作为业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

### 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

建信央视50基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

## § 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 6 月 30 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、建信安心保本二号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、建信瑞盛添利混合型证券投资基金、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、建信恒丰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，共计 87 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 3,439.09 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） | 证券从业年 | 说明 |
|----|----|---------------|-------|----|
|----|----|---------------|-------|----|

|     |                          | 期限              |      | 限 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|--------------------------|-----------------|------|---|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                          | 任职日期            | 离任日期 |   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 叶乐天 | 金融工程及指数投资部总经理助理、本基金的基金经理 | 2013 年 3 月 28 日 | —    | 9 | <p>硕士。2008 年 5 月至 2011 年 9 月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。2011 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理，2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金基金经理；2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金基</p> |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                        |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金基金经理；2017 年 4 月 18 日起任建信民丰回报定期开放混合基金的基金经理；2017 年 5 月 22 日起任建信鑫荣回报混合基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

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 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 1 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

在报告期内，本基金根据基金合同规定，采取了对指数的被动复制策略，尽力控制年化跟踪误差和日均跟踪偏离度。

本基金管理人在量化分析基础上，采取了适当的组合调整与优化策略，尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

### 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 28.05%，波动率 0.66%，业绩比较基准收益率 23.78%，波动率 0.67%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回首 2017 年上半年，个股分化极为严重，沪深 300 指数和创业板指数几乎走出了完全不同的走势，“一九分化”特别大，少数白马股大幅上涨，同时大部分中小市值股票回撤非常明显，“只涨指数不涨个股”的现象比较明显。展望 2017 年下半年，预计个股分化仍会非常明显，业绩较好的前期错杀个股会迎来反弹，但缺乏基本面支撑的个股仍将补跌，总体来说，投资者更加关注上市公司的基本面因素，回避事件驱动以及讲故事为主的个股。从量化模型角度来看，基本面因子的有效性将会加强，技术面因子的有效性将会有所减弱。

本基金管理人将根据基金合同，以量化分析研究为基础，克服各种因素的不利影响，不断优化和改进量化模型，将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

## 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[2008]38 号文《关于进一步规范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。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值

政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总裁、督察长、投资总经理、研究总经理、风险管理总经理、运营总经理及内控合规总经理组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、内控合规人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，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。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，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）。

自 2015 年 3 月 26 日起，公司按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值价格，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）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

根据本基金基金合同的相关规定，本基金不进行收益分配，也不单独对建信央视 50A 份额与建信央视 50B 份额进行收益分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

2017 年上半年度，托管人在建信央视 50 指数分级发起式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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2017 年上半年度，建信基金管理有限责任公司在建信央视 50 指数分级发起式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。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本半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 年上半年度，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央视 50 指数分级发起式证券投资基金的半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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            |            | 15,749,268.00                  | 3,878,977.08                     |
| 结算备付金           |            | 4,048,895.00                   | 9,057,604.70                     |
| 存出保证金           |            | 63,898.63                      | 269,133.26                       |
| 交易性金融资产         |            | 271,979,268.30                 | 161,152,382.18                   |
| 其中：股票投资         |            | 266,998,768.30                 | 161,152,382.18                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 4,980,500.00                   | -                                |
| 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         |            | -                              | 2,141,524.52                     |
| 应收利息            |            | 58,213.48                      | 6,051.51                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 4,265,291.16                   | 29,819.38                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            |            | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 296,164,834.57                 | 176,535,492.63                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |

|               |  |                |                |
|---------------|--|----------------|----------------|
| <b>负 债：</b>   |  |                |                |
| 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       |  | 6,027,720.26   | -              |
| 应付赎回款         |  | 1,029,235.49   | 1,970,964.38   |
| 应付管理人报酬       |  | 198,377.42     | 181,111.71     |
| 应付托管费         |  | 1,713,449.35   | 1,504,284.93   |
| 应付销售服务费       |  | -              | -              |
| 应付交易费用        |  | 521,749.46     | 1,021,688.31   |
| 应交税费          |  | -              | -              |
| 应付利息          |  | -              | -              |
| 应付利润          |  | -              | -              |
| 递延所得税负债       |  | -              | -              |
| 其他负债          |  | 427,756.77     | 513,865.85     |
| 负债合计          |  | 9,918,288.75   | 5,191,915.18   |
| <b>所有者权益：</b> |  |                |                |
| 实收基金          |  | 156,050,459.32 | 119,610,580.96 |
| 未分配利润         |  | 130,196,086.50 | 51,732,996.49  |
| 所有者权益合计       |  | 286,246,545.82 | 171,343,577.45 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 296,164,834.57 | 176,535,492.63 |

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金之基础份额(简称“建信央视 50 份额”)份额净值 1.6416 元，建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金之央视 50A 份额(简称“建信央视 50A 份额”)份额净值 1.0298 元，建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金之央视 50B 份额(简称“建信央视 50B 份额”)份额净值 2.2534 元。基金份额总额为 174,370,715.11 份，其中建信央视 50 份额 97,031,489.11 份，建信央视 50A 份额 38,669,613.00 份，建信央视 50B 份额 38,669,613.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|-----|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、收入                  |     | 53,132,794.85                            | -63,877,077.37                                |
| 1.利息收入                |     | 102,490.06                               | 188,747.51                                    |
| 其中：存款利息收入             |     | 82,848.96                                | 188,747.51                                    |
| 债券利息收入                |     | 19,041.10                                | -                                             |
| 资产支持证券利息收入            |     | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            |     | 600.00                                   | -                                             |
| 其他利息收入                |     | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |     | 13,203,357.93                            | -9,015,116.00                                 |
| 其中：股票投资收益             |     | 10,780,242.07                            | -11,714,261.24                                |
| 基金投资收益                |     | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                |     | -                                        | -                                             |
| 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                  |     | 2,423,115.86                             | 2,699,145.24                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） |     | 39,702,982.72                            | -55,607,545.44                                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |     | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     |     | 123,964.14                               | 556,836.56                                    |
| 减：二、费用                |     | 1,766,011.16                             | 3,951,912.62                                  |

|                     |  |               |                |
|---------------------|--|---------------|----------------|
| 1. 管理人报酬            |  | 950,747.39    | 2,095,564.57   |
| 2. 托管费              |  | 209,164.42    | 461,024.17     |
| 3. 销售服务费            |  | -             | -              |
| 4. 交易费用             |  | 237,528.93    | 1,019,756.04   |
| 5. 利息支出             |  | -             | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |  | -             | -              |
| 6. 其他费用             |  | 368,570.42    | 375,567.84     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |  | 51,366,783.69 | -67,828,989.99 |
| 减：所得税费用             |  | -             | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |  | 51,366,783.69 | -67,828,989.99 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期                              |               |                |
|-----------------------------------|---------------------------------|---------------|----------------|
|                                   | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）                   | 119,610,580.96                  | 51,732,996.49 | 171,343,577.45 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                               | 51,366,783.69 | 51,366,783.69  |
| 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） | 36,439,878.36                   | 27,096,306.32 | 63,536,184.68  |

|                                        |                      |                 |                 |
|----------------------------------------|----------------------|-----------------|-----------------|
| 其中：1.基金申购款                             | 100,543,373.40       | 67,249,983.13   | 167,793,356.53  |
| 2.基金赎回款                                | -64,103,495.04       | -40,153,676.81  | -104,257,171.85 |
| 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）                        | 156,050,459.32       | 130,196,086.50  | 286,246,545.82  |
| 项目                                     | 上年度可比期间              |                 |                 |
|                                        | 2016年1月1日至2016年6月30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）                        | 421,658,963.17       | 199,336,475.82  | 620,995,438.99  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                    | -67,828,989.99  | -67,828,989.99  |
| 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）      | -257,147,279.11      | -72,901,224.63  | -330,048,503.74 |
| 其中：1.基金申购款                             | 88,223,459.62        | 28,265,006.25   | 116,488,465.87  |
| 2.基金赎回款                                | -345,370,738.73      | -101,166,230.88 | -446,536,969.61 |
| 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）                        | 164,511,684.06       | 58,606,261.20   | 223,117,945.26  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|            |            |           |
|------------|------------|-----------|
| <u>孙志晨</u> | <u>吴曙明</u> | <u>丁颖</u> |
| 基金管理人负责人   | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人   |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金(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[2012]1650 号《关于核准建信央视财经 50 指数分级发起式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(以下简称“建信基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信央视财经 50 指数分级发起式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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,617,005,094.17 元(其中发起资金 20,049,000.00 元),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 176 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,617,473,376.90 份基金份额,其中认购资金利息折合 468,282.73 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金之基础份额(以下简称“建信央视 50 份额”)、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“建信央视 50A 份额”)及建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“建信央视 50B 份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售建信央视 50 份额。投资人场外认购所得的建信央视 50 份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的建信央视 50 份额,将按 1:1 的基金份额配比自动分离为建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额。建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额的数量保持 1:1 的比例不变。基金合同生效后,建信央视 50 份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回,但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下,建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内建信央视 50 份额与建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的

配对转换,包括包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内建信央视 50 份额按照 1:1 的份额配比转换成 1 份建信央视 50A 份额与 1 份建信央视 50B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份建信央视 50A 份额与 1 份建信央视 50B 份额按照 1:1 的基金份额配比转换成 2 份场内建信央视 50 份额的行为。

本基金为发起式基金,基金募集份额总额不少于 5,000 万份,基金募集金额不少于 5,000 万元,其中发起资金认购部分为本基金的基金管理人建信基金通过场内认购的 20,050,947.00 份基金份额(含利息折份额部分),该部分基金份额按照 1:1 的比例自动分离成建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额。根据中国证监会基金部通知[2012]22 号《关于增设发起式基金审核通道有关问题的通知》,建信基金承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

基金份额的净值按如下原则计算:建信央视 50 份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数,其中基金份额总数为建信央视 50 份额、建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额数量的总和。本基金每份央视 50A 份额与每份央视 50B 份额构成一对份额组合,该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份央视 50 份额的基金份额净值之和。建信央视 50A 份额的约定收益率为一年期同期银行定期存款利率(税后)+4.5%,建信央视 50A 份额的份额净值每日按该约定收益率逐日计算,计算出建信央视 50A 份额的基金份额参考净值后,根据建信央视 50 份额的基金份额净值与建信央视 50A 份额、建信央视 50B 份额之间的基金份额参考净值关系,可以计算出建信央视 50B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日,本基金将进行基金的定期份额折算:定期份额折算后建信央视 50A 份额的基金份额参考净值调整为 1.0000 元,基金份额折算基准日折算前建信央视 50A 份额的基金份额参考净值超出 1.0000 元的部分将折算为场内建信央视 50 份额分配给建信央视 50A 份额持有人。建信央视 50 份额持有人持有的每 2 份建信央视 50 份额将按 1 份建信央视 50A 份额获得新增建信央视 50 份额的分配。持有场外建信央视 50 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外建信央视 50 份额的分配;持有场内建信央视 50 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内建信央视 50 份额的分配。经过上述份额折算后,建信央视 50 份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后,建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。建信央视 50B 份额不参与定期份额折算,每次定期份额折算不改变建信央视 50B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外,当建信央视 50 份额的基金份额净值大于或等于 2.0000 元时,或当建信央视 50B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.2500 元时,本基金将以该日后的次一交易

日为本基金不定期折算基准日，进行不定期份额折算：份额折算后本基金将确保建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额的比例为 1:1，份额折算后建信央视 50A 份额的基金份额参考净值、建信央视 50B 份额的基金份额参考净值和建信央视 50 份额的基金份额净值均调整为 1.0000 元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2013]157 号核准，本基金建信央视 50A 份额 271,646,642.00 份基金份额与建信央视 50B 份额 271,646,642.00 份基金份额于 2013 年 5 月 20 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的建信央视 50 份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额即可上市流通；对于托管在场外的建信央视 50 份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为建信央视 50A 份额和建信央视 50B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要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(包括央视财经 50 指数成份股、备选成份股、一级市场初次发行或增发的新股)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等)、货币市场工具、股指期货、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票的资产不低于基金资产净值的 85%，其中投资于央视财经 50 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期一年以内的政府债券；权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为  $95\% \times \text{央视财经 50 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率(税后)}$ 。

#### 6.4.2 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》、《建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金 基金合同》和中国证监会、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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年半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 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 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**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 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。

##### **6.4.5.2 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。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期内未发生会计差错。

#### **6.4.6 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补充政策的通知》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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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、基金销售机构    |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”）   | 基金托管人、基金销售机构    |
| 中国建设银行股份有限公司         | 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       | 基金管理人的股东        |
| 建信资本管理有限责任公司         | 基金管理人的子公司       |

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.8.1 关联方报酬

#### 6.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|----|---------------------------------|---------------------------------|
|    | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |

|                 |            |              |
|-----------------|------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 950,747.39 | 2,095,564.57 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 80,856.71  | 59,983.21    |

1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.00% / 当年天数；

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30<br>日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 209,164.42                               | 461,024.17                                    |

支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.22% / 当年天数。

#### 6.4.8.1.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

#### 6.4.8.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

#### 6.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                                   | 本期                              |          |          |
|--------------------------------------|---------------------------------|----------|----------|
|                                      | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |          |          |
|                                      | 建信央视 50                         | 建信央视 50A | 建信央视 50B |
| 基金合同生效日<br>(2013 年 3 月 28 日) 持有的基金份额 | -                               | -        | -        |
| 期初持有的基金份额                            | -                               | -        | -        |
| 期间申购/买入总份额                           | -                               | -        | -        |
| 期间因拆分变动份额                            | -                               | -        | -        |
| 减: 期间赎回/卖出总<br>份额                    | -                               | -        | -        |
| 期末持有的基金份额                            | -                               | -        | -        |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例                | -                               | -        | -        |

| 项目                                   | 上年度可比期间                         |               |               |
|--------------------------------------|---------------------------------|---------------|---------------|
|                                      | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |               |               |
|                                      | 建信央视 50                         | 建信央视 50A      | 建信央视 50B      |
| 基金合同生效日<br>(2013 年 3 月 28 日) 持有的基金份额 | -                               | -             | -             |
| 期初持有的基金份额                            | 1,230,323.00                    | 10,025,473.00 | 10,025,474.00 |
| 期间申购/买入总份额                           | -                               | -             | -             |
| 期间因拆分变动份额                            | 614,939.00                      | -             | -             |
| 减: 期间赎回/卖出总<br>份额                    | -                               | -             | -             |

|                       |              |               |               |
|-----------------------|--------------|---------------|---------------|
| 期末持有的基金份额             | 1,845,262.00 | 10,025,473.00 | 10,025,474.00 |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | 5.81%        | 13.56%        | 13.56%        |

分级基金持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

#### 6.4.8.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.8.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方<br>名称 | 本期                              |           | 上年度可比期间                         |           |
|-----------|---------------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
|           | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |           | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |           |
|           | 期末余额                            | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 交通银行      | 15,749,268.00                   | 18,858.54 | 7,194,262.97                    | 43,236.48 |

1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2017 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

#### 6.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.8.6 其他关联交易事项的说明

本报告期本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |          |           |          |            |          |            |                  |            |            |    |
|----------------------|----------|-----------|----------|------------|----------|------------|------------------|------------|------------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日 | 可流<br>通日 | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单位：<br>股) | 期末<br>成本总额 | 期末估值<br>总额 | 备注 |

|        |      |                 |                 |       |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|-----------------|-----------------|-------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 002879 | 长缆科技 | 2017 年 6 月 5 日  | 2017 年 7 月 7 日  | 新发未上市 | 18.02 | 18.02 | 1,313 | 23,660.26 | 23,660.26 | - |
| 002882 | 金龙羽  | 2017 年 6 月 15 日 | 2017 年 7 月 17 日 | 新发未上市 | 6.20  | 6.20  | 2,966 | 18,389.20 | 18,389.20 | - |
| 603933 | 睿能科技 | 2017 年 6 月 28 日 | 2017 年 7 月 6 日  | 新发未上市 | 20.20 | 20.20 | 857   | 17,311.40 | 17,311.40 | - |
| 603305 | 旭升股份 | 2017 年 6 月 30 日 | 2017 年 7 月 10 日 | 新发未上市 | 11.26 | 11.26 | 1,351 | 15,212.26 | 15,212.26 | - |
| 300670 | 大烨智能 | 2017 年 6 月 26 日 | 2017 年 7 月 3 日  | 新发未上市 | 10.93 | 10.93 | 1,259 | 13,760.87 | 13,760.87 | - |
| 300672 | 国科微  | 2017 年 6 月 30 日 | 2017 年 7 月 12 日 | 新发未上市 | 8.48  | 8.48  | 1,257 | 10,659.36 | 10,659.36 | - |
| 603331 | 百达精工 | 2017 年 6 月 27 日 | 2017 年 7 月 5 日  | 新发未上市 | 9.63  | 9.63  | 999   | 9,620.37  | 9,620.37  | - |

基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期            | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期           | 复牌开盘单价 | 数量（股）   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|-----------------|--------|--------|----------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 601727 | 上海电气 | 2017 年 6 月 22 日 | 重大资产重组 | 7.57   | 2017 年 7 月 3 日 | 7.54   | 577,175 | 5,167,098.75 | 4,369,214.75 | -  |
| 601088 | 中国神华 | 2017 年 6 月 5 日  | 重大事项   | 22.29  | -              | -      | 142,925 | 2,411,223.40 | 3,185,798.25 | -  |

本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 259,335,141.58 元，属于第二层次的余额为 12,644,126.72 元，无属于第三层次的余额(2016 年 6 月 30 日：属于第一层次的余额为 148,670,738.68 元，属于第二层次的余额为 56,044,055.90 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌及交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 6 月 30 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂

适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 266,998,768.30 | 90.15         |
|    | 其中：股票             | 266,998,768.30 | 90.15         |
| 2  | 固定收益投资            | 4,980,500.00   | 1.68          |
|    | 其中：债券             | 4,980,500.00   | 1.68          |
|    | 资产支持证券            | —              | —             |
| 3  | 贵金属投资             | —              | —             |
| 4  | 金融衍生品投资           | —              | —             |
| 5  | 买入返售金融资产          | —              | —             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 19,798,163.00  | 6.68          |
| 7  | 其他各项资产            | 4,387,403.27   | 1.48          |
| 8  | 合计                | 296,164,834.57 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别          | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|---------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业      | —              | —             |
| B  | 采矿业           | 3,185,798.25   | 1.11          |
| C  | 制造业           | 156,483,118.84 | 54.67         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和 | —              | —             |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
|   | 供应业             |                |       |
| E | 建筑业             | -              | -     |
| F | 批发和零售业          | -              | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 753,434.27     | 0.26  |
| H | 住宿和餐饮业          | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 21,942,760.39  | 7.67  |
| J | 金融业             | 68,178,597.01  | 23.82 |
| K | 房地产业            | 7,240,475.99   | 2.53  |
| L | 租赁和商务服务业        | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 7,203,690.05   | 2.52  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -              | -     |
| P | 教育              | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | 695,266.00     | 0.24  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 986,955.73     | 0.34  |
| S | 综合              | -              | -     |
|   | 合计              | 266,670,096.53 | 93.16 |

以上行业分类以 2017 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -          | -            |
| B  | 采矿业              | -          | -            |
| C  | 制造业              | 325,912.92 | 0.11         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -            |
| E  | 建筑业              | 510.24     | 0.00         |

|   |                     |            |      |
|---|---------------------|------------|------|
| F | 批发和零售业              | -          | -    |
| G | 交通运输、仓储和邮政业         | -          | -    |
| H | 住宿和餐饮业              | -          | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术<br>服务业 | -          | -    |
| J | 金融业                 | 833.49     | 0.00 |
| K | 房地产业                | -          | -    |
| L | 租赁和商务服务业            | 1,415.12   | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业          | -          | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理<br>业   | -          | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务<br>业   | -          | -    |
| P | 教育                  | -          | -    |
| Q | 卫生和社会工作             | -          | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业           | -          | -    |
| S | 综合                  | -          | -    |
|   | 合计                  | 328,671.77 | 0.11 |

以上行业分类以 2017 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名（前五名）股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值          | 占基金资产净<br>值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|------------------|
| 1  | 002415 | 海康威视 | 617,664 | 19,950,547.20 | 6.97             |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 2  | 601318 | 中国平安 | 358,845   | 17,802,300.45 | 6.22 |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 36,220    | 17,090,407.00 | 5.97 |
| 4  | 600887 | 伊利股份 | 711,813   | 15,368,042.67 | 5.37 |
| 5  | 000651 | 格力电器 | 345,830   | 14,237,821.10 | 4.97 |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 323,579   | 13,926,840.16 | 4.87 |
| 7  | 601166 | 兴业银行 | 775,407   | 13,073,362.02 | 4.57 |
| 8  | 600016 | 民生银行 | 1,411,179 | 11,599,891.38 | 4.05 |
| 9  | 601398 | 工商银行 | 2,000,587 | 10,503,081.75 | 3.67 |
| 10 | 000423 | 东阿阿胶 | 126,841   | 9,118,599.49  | 3.19 |

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn) 的半年度报告正文。

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 603043 | 广州酒家 | 1,810 | 45,738.70 | 0.02         |
| 2  | 300666 | 江丰电子 | 2,276 | 43,448.84 | 0.02         |
| 3  | 603335 | 迪生力  | 2,230 | 24,864.50 | 0.01         |
| 4  | 002879 | 长缆科技 | 1,313 | 23,660.26 | 0.01         |
| 5  | 002881 | 美格智能 | 989   | 22,608.54 | 0.01         |

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn) 的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入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 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|----------|----------------|
|----|------|------|----------|----------------|

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 1  | 002415 | 海康威视  | 7,908,676.61 | 4.62 |
| 2  | 600519 | 贵州茅台  | 7,137,050.48 | 4.17 |
| 3  | 601318 | 中国平安  | 6,987,572.91 | 4.08 |
| 4  | 600887 | 伊利股份  | 6,303,272.00 | 3.68 |
| 5  | 000333 | 美的集团  | 5,766,741.80 | 3.37 |
| 6  | 601166 | 兴业银行  | 5,723,844.00 | 3.34 |
| 7  | 000651 | 格力电器  | 5,532,946.52 | 3.23 |
| 8  | 600016 | 民生银行  | 5,365,294.00 | 3.13 |
| 9  | 601398 | 工商银行  | 4,630,265.00 | 2.70 |
| 10 | 000423 | 东阿阿胶  | 4,158,642.20 | 2.43 |
| 11 | 002230 | 科大讯飞  | 3,493,721.47 | 2.04 |
| 12 | 601988 | 中国银行  | 3,473,328.00 | 2.03 |
| 13 | 601601 | 中国太保  | 3,201,783.73 | 1.87 |
| 14 | 002241 | 歌尔股份  | 3,195,456.00 | 1.86 |
| 15 | 300070 | 碧水源   | 3,171,687.00 | 1.85 |
| 16 | 600104 | 上汽集团  | 3,083,855.00 | 1.80 |
| 17 | 000895 | 双汇发展  | 2,819,072.00 | 1.65 |
| 18 | 000002 | 万 科 A | 2,736,347.00 | 1.60 |
| 19 | 002008 | 大族激光  | 2,711,181.60 | 1.58 |
| 20 | 300017 | 网宿科技  | 2,560,605.00 | 1.49 |

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。

#### 7.4.2 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  | 600519 | 贵州茅台 | 3,841,210.00 | 2.24           |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 3,595,572.56 | 2.10           |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 3  | 601727 | 上海电气  | 3,144,661.07 | 1.84 |
| 4  | 000651 | 格力电器  | 3,036,950.00 | 1.77 |
| 5  | 601166 | 兴业银行  | 2,897,156.00 | 1.69 |
| 6  | 002415 | 海康威视  | 2,722,055.92 | 1.59 |
| 7  | 000002 | 万 科 A | 2,681,031.38 | 1.56 |
| 8  | 600887 | 伊利股份  | 2,475,820.00 | 1.44 |
| 9  | 600016 | 民生银行  | 2,125,453.00 | 1.24 |
| 10 | 000333 | 美的集团  | 2,039,516.00 | 1.19 |
| 11 | 601398 | 工商银行  | 1,759,911.00 | 1.03 |
| 12 | 000423 | 东阿阿胶  | 1,459,069.00 | 0.85 |
| 13 | 600104 | 上汽集团  | 1,457,837.00 | 0.85 |
| 14 | 601988 | 中国银行  | 1,276,068.00 | 0.74 |
| 15 | 601601 | 中国太保  | 1,172,799.00 | 0.68 |
| 16 | 002241 | 歌尔股份  | 1,134,575.10 | 0.66 |
| 17 | 002230 | 科大讯飞  | 1,093,035.85 | 0.64 |
| 18 | 300070 | 碧水源   | 1,083,370.00 | 0.63 |
| 19 | 002008 | 大族激光  | 948,595.00   | 0.55 |
| 20 | 000895 | 双汇发展  | 893,059.00   | 0.52 |

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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 116,612,313.74 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 61,252,152.41  |

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（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 7.5 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      | 4,980,500.00 | 1.74         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 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        | 4,980,500.00 | 1.74         |

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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  | 019557 | 17 国债 03 | 50,000 | 4,980,500.00 | 1.74         |

#### 7.7 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明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃、与标的指数相关性高的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低主要由申购赎回带来的股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，以达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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 | 63,898.63 |

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 2 | 应收证券清算款 | -            |
| 3 | 应收股利    | -            |
| 4 | 应收利息    | 58,213.48    |
| 5 | 应收申购款   | 4,265,291.16 |
| 6 | 其他应收款   | -            |
| 7 | 待摊费用    | -            |
| 8 | 其他      | -            |
| 9 | 合计      | 4,387,403.27 |

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|---------------|----------|
| 1  | 002879 | 长缆科技 | 23,660.26   | 0.01          | 新发未上市    |

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别     | 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          | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 建信央视 50  | 10,106   | 9,601.37   | 25,755,080.00 | 26.54% | 71,276,409.11  | 73.46% |
| 建信央视 50A | 210      | 184,141.01 | 29,912,889.00 | 77.36% | 8,756,724.00   | 22.64% |
| 建信央视 50B | 864      | 44,756.50  | 10,509,569.00 | 27.18% | 28,160,044.00  | 72.82% |
| 合计       | 11,180   | 15,596.67  | 66,177,538.00 | 37.95% | 108,193,177.11 | 62.05% |

分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

建信央视 50

| 序号 | 持有人名称                           | 持有份额（份）    | 占上市总份额比例 |
|----|---------------------------------|------------|----------|
| 1  | 中国人寿保险（集团）公司企业年金计划—中国农业银行股份有限公司 | 515,555.00 | 13.93%   |
| 2  | 中信证券股份有限公司                      | 400,000.00 | 10.81%   |
| 3  | 山西晋城无烟煤矿业集团有限责任公司企业年金计划—中国工商银行  | 354,515.00 | 9.58%    |
| 4  | 周海燕                             | 241,600.00 | 6.53%    |

|    |                          |            |       |
|----|--------------------------|------------|-------|
| 5  | 谢叶强                      | 208,200.00 | 5.63% |
| 6  | 王成群                      | 193,036.00 | 5.22% |
| 7  | 工银瑞信基金公司－工行－中国工商银行股份有限公司 | 190,025.00 | 5.13% |
| 8  | 梁鹏利                      | 116,412.00 | 3.15% |
| 9  | 谭长伍                      | 95,834.00  | 2.59% |
| 10 | 张晓熊                      | 84,583.00  | 2.29% |

## 建信央视 50A

| 序号 | 持有人名称                     | 持有份额（份）       | 占上市总份额比例 |
|----|---------------------------|---------------|----------|
| 1  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品 | 14,982,403.00 | 38.74%   |
| 2  | 工银瑞信基金－农业银行－中油财务有限责任公司    | 8,425,822.00  | 21.79%   |
| 3  | 钱鸿玮                       | 4,464,286.00  | 11.54%   |
| 4  | 工银瑞信基金公司－工行－中国工商银行股份有限公司  | 3,554,100.00  | 9.19%    |
| 5  | 易方达基金－光大银行－东方汇智资产管理有限公司   | 2,450,000.00  | 6.34%    |
| 6  | 童建功                       | 1,083,310.00  | 2.80%    |
| 7  | 邹金平                       | 532,077.00    | 1.38%    |
| 8  | 冯守英                       | 300,430.00    | 0.78%    |
| 9  | 高林生                       | 300,000.00    | 0.78%    |
| 10 | 中信建投证券股份有限公司              | 166,190.00    | 0.43%    |

## 建信央视 50B

| 序号 | 持有人名称                   | 持有份额（份）      | 占上市总份额比例 |
|----|-------------------------|--------------|----------|
| 1  | 福建道冲投资管理有限公司－道冲补天1号私募基金 | 4,572,900.00 | 11.83%   |

|    |                                |              |       |
|----|--------------------------------|--------------|-------|
| 2  | 吉烈钧                            | 3,440,000.00 | 8.90% |
| 3  | 易方达基金—光大银行—东方汇智<br>资产管理有限公司    | 2,450,000.00 | 6.34% |
| 4  | 恒安标准人寿保险有限公司—投连<br>险 05        | 1,758,981.00 | 4.55% |
| 5  | 张少华                            | 1,258,753.00 | 3.26% |
| 6  | 陈娟养                            | 966,550.00   | 2.50% |
| 7  | 福建道冲投资管理有限公司—道冲<br>多策略轮动 5 号基金 | 721,100.00   | 1.86% |
| 8  | 邵利斌                            | 695,000.00   | 1.80% |
| 9  | 贺秋伟                            | 609,000.00   | 1.57% |
| 10 | 杜婷婷                            | 481,475.00   | 1.25% |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 份额级别     | 持有份额总数（份） | 占基金总份额<br>比例 |
|----------------------|----------|-----------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员<br>持有本基金 | 建信央视 50  | 32,495.11 | 0.03%        |
|                      | 建信央视 50A | —         | —            |
|                      | 建信央视 50B | —         | —            |
|                      | 合计       | 32,495.11 | 0.02%        |

分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

### 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金本报告期末无发起式基金发起资金持有份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                 | 建信央视 50          | 建信央视 50A       | 建信央视 50B       |
|------------------------------------|------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2013 年 3 月 28 日）<br>基金份额总额 | 1,074,180,092.90 | 271,646,642.00 | 271,646,642.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 34,482,569.46    | 48,068,073.00  | 48,068,073.00  |
| 本报告期基金总申购份额                        | 112,345,789.79   | -              | -              |
| 减:本报告期基金总赎回份额                      | 71,615,886.64    | -              | -              |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）           | 21,819,016.50    | -9,398,460.00  | -9,398,460.00  |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 97,031,489.11    | 38,669,613.00  | 38,669,613.00  |

1、总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

2、拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 10.6 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和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元<br>数量 | 股票交易          |                      | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|------------|---------------|----------------------|-----------|----------------|----|
|      |            | 成交金额          | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |
| 中泰证券 | 3          | 84,279,861.90 | 48.28%               | 78,490.55 | 48.82%         | —  |
| 长江证券 | 2          | 67,547,821.60 | 38.69%               | 61,555.23 | 38.28%         | —  |
| 华泰证券 | 4          | 15,192,710.18 | 8.70%                | 13,852.44 | 8.62%          | —  |
| 天风证券 | 1          | 7,557,371.63  | 4.33%                | 6,884.10  | 4.28%          | —  |
| 中银国际 | 1          | —             | —                    | —         | —              | —  |
| 安信证券 | 2          | —             | —                    | —         | —              | —  |
| 光大证券 | 1          | —             | —                    | —         | —              | —  |
| 东方证券 | 1          | —             | —                    | —         | —              | —  |
| 瑞银证券 | 1          | —             | —                    | —         | —              | —  |
| 华创证券 | 1          | —             | —                    | —         | —              | —  |
| 招商证券 | 1          | —             | —                    | —         | —              | —  |
| 国金证券 | 1          | —             | —                    | —         | —              | —  |
| 中投证券 | 3          | —             | —                    | —         | —              | —  |
| 高华证券 | 1          | —             | —                    | —         | —              | —  |
| 中信证券 | 2          | —             | —                    | —         | —              | —  |
| 海通证券 | 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，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

（2）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。

（3）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、个债等进行深入、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服务。

(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、本期本报告期内无新增或剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金公用交易单元。

### 10.7.2 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 |              |
|------|--------------|--------------|--------------|----------------|------|--------------|
|      | 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 |
| 中泰证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 长江证券 | 4,983,500.00 | 100.00%      | 3,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 华泰证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 天风证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 中银国际 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 安信证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 光大证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 东方证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 瑞银证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 华创证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 国金证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 中投证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 高华证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 中信证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |
| 海通证券 | -            | -            | -            | -              | -    | -            |

建信基金管理有限责任公司

2017 年 8 月 26 日