

建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书 (更新)摘要

【本基金不向个人投资者销售】2018年1号

值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,动态调整大类金融资产比例,自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略,在严谨深入的分析基础上,综合考虑各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,深入挖掘价值被低估的标的物种。

1、大类资产配置

本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上,通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合,形成对大类资产的预测和判断,在基金合同约定的范围内确定债券类资产和现金类资产的配置比例,并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整大类资产的投资比例,以规避市场风险,提高基金收益率。

2、债券投资策略

（1）久期管理策略

在全球经济的框架下,本基金管理人密切关注货币信贷、利率、汇率、采购经理人指数等宏观经济运行关键指标,运用数量化工具对宏观经济运行及货币财政政策变化跟踪与分析,对未来市场利率趋势进行分析预测,据此确定合理的债券组合目标久期。

基金管理人通过以下方面的分析来确定债券组合的目标久期：

- 宏观经济环境分析。通过跟踪分析货币信贷、采购经理人指数等宏观经济先行性经济指标,拉动经济增长的三大引擎进出口、消费以及投资等指标,判断当前经济运行在经济周期中所处的阶段,预期中央政府的货币与财政政策取向。
- 利率变动趋势分析。在宏观经济环境分析的基础上,密切关注月度CPI、PPI等物价指数、货币信贷、汇率等金融运行数据,预测未来利率的变动趋势。
- 目标久期分析。根据宏观经济环境分析与市场利率变动趋势分析,结合当期债券收益率估值水平,确定投资组合的目标久期。原则上,在利率上行通道中,通过缩短目标久期规避利率风险;在利率下行通道中,通过延长目标久期分享债券价格上涨的收益。在利率持平阶段,采用骑乘策略与持有策略,获得稳定的当前回报。
- 动态调整目标久期。通过对国内外宏观经济数据、金融市场运行、货币政策以及国内债券市场运行跟踪分析,评估未来利率水平变化趋势,结合债券市场收益率变动与基金投资目标,动态调整组合目标久期。
- 期限结构配置策略

通过预期收益率曲线形态变化来调整投资组合的期限结构配置策略。根据债券收益率曲线形态、各期限品种收益率变动、结合短期资金利率水平与变动趋势,分析预测收益率曲线的变化,测算子弹、哑铃或梯形等不同期限结构配置策略的风险收益,形成具体的期限结构配置策略。
- 债券的类别配置策略

对不同类别债券的信用风险、赋税水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,综合评估相同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,通过不同类别资产的风险调整后收益比较,确定组合的类别资产配置。
- 骑乘策略

骑乘策略，通过对债券收益率曲线形状变动的预期为依据来建立和调整组合。当债券收益率曲线比较陡峭时,买入位于收益率曲线陡峭处的债券,持有一段时间后,伴随债券剩余期限的缩短与收益率水平的下降,获得一定的资本利得收益。
- 杠杆放大策略

当回购利率低于债券收益率时，本基金将实施正回购融入资金并投资于信用债券等可投资标的,从而获取收益率超出回购资金成本(即回购利率)的套利价值。

（6）信用债券投资策略

本基金信用债券的投资遵循以下流程：

1）信用债券研究

信用分析师通过系统的案头研究、走访发行主体、咨询发行中介等各种形式,“自上而下”地分析宏观经济运行趋势、行业（或产业）经济前景,“自下而上”地分析发行主体的发展前景、偿债能力、国家信用支撑等。通过建信基金的信用评级信用评级指标体系,对信用债发行主体信用评级,并在信用评级的基础上,建立本基金的信用债券库。

2）信用债券投资

本基金构建和管理信用债券投资组合时主要考虑以下因素：
①信用债券信用评级的变化。
②不同信用等级信用债的信用资质，以及同一信用等级不同标的债券之间的信用利差变化。

原则上,购买信用（拟）增级的信用债券,减持信用（拟）降级的信用债券;购买信用利差扩大后存在收窄趋势的信用债券,减持信用利差缩小后存在放宽趋势的信用债券。

（7）可转换债券投资策略

本基金将着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究,对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的转债进行重点选择,并在对可转换债券估值合理的前提下集中投资,以分享正股上涨带来的收益。同时,本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况,从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面推测,并通过实地调研等方式确认上市公司对转股价的修正和转股意愿。

（8）分离交易可转换债券投资策略

本基金投资分离交易可转换债券主要是通过网下申购和网上申购的方式。在分离交易可转换债券的认股权证可上市交易后的10个交易日内全部卖出,分离后的公司债券作为普通的企业债券进行投资。

3、国债期货投资策略
国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建数学模型,对国债期货和现货债券、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告投资组合报告所载数据截至2018年6月30日,本报告所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况			
序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	--	--
	其中:股票	--	--
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	3,970,194,947.20	97.85
	其中:债券	3,970,194,947.20	97.85
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--
6	买入返售金融资产	--	--
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
7	银行存款和结算备付金合计	25,836,760.06	0.64
8	其他资产	61,221,823.63	1.51
9	合计	4,057,243,430.89	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合			
本基金本报告期末未持有股票。			
（2）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。			
3、报告期末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			
本基金本报告期末未持有股票。			
4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合			
序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	26,181,566.00	0.85
2	央行票据	--	--
3	金融债券	546,638,300.20	17.72
	其中:政策性金融债	546,638,300.20	17.72
4	企业债券	888,172,751.00	26.22
5	企业短期融资券	1,764,134,200.00	57.20
6	中期票据	776,718,000.00	25.19
7	可转换债（可交换债）	--	--
8	同业存单	47,740,000.00	1.55
9	其他	--	--
10	合计	3,970,194,947.20	128.73

5、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债券投资明细

吴曙明先生,副总裁,硕士。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作;1996年7月加入中国建设银行,先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务,历任科员、副主任科员、主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职;2006年3月加入建信基金管理公司,担任董事会秘书,并兼任综合管理部总经理。2015年8月6日起任我公司督察长,2016年12月23日起任我公司副总裁。

吴灵玲女士,副总裁,硕士。1996年7月至1998年9月在福建省东海经贸股份有限公司工作;2001年7月加入中国建设银行总行人力资源部,历任副主任科员、业务经理、高级经理助理;2005年9月加入建信基金管理公司,历任人力资源部总监助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016年12月23日起任我公司副总裁。

4、督察长

吴曙明先生,督察长（简历请参见公司高级管理人员）。

5、本基金基金经理

黎颖芳女士,硕士。2000年7月毕业于湖南大学金融保险学院,同年进入大成基金管理公司,在金融工程部、规划发展部任职。2005年11月加入本公司,历任研究员、高级研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理。2009年2月19日至2011年5月11日任建信稳定增利债券型证券投资基金的基金经理;2011年1月18日至2014年1月22日任建信睿享纯债债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月15日起任建信纯债债券型证券投资基金的基金经理;2014年12月2日起任建信稳定得利债券型证券投资基金的基金经理;2015年12月8日起任建信稳定丰利债券型证券投资基金的基金经理;2016年6月1日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月8日起任建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月8日起任建信睿享纯债债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月16日至2017年8月3日任建信恒丰纯债债券型证券投资基金的基金经理;2017年1月6日起任建信稳定鑫利发起式证券投资基金的基金经理;2018年2月2日起任建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。

李峰先生,硕士。曾任清华紫光股份有限公司财务会计助理,2007年9月至2012年9月任华夏基金管理公司基金会计业务经理、风控高级投资助理,2012年9月至2015年6月任建信基金管理公司交易员、交易主管,2015年7月至2016年6月任建华基金资产管理公司询价研究主管,2016年6月起任建信基金管理公司基金经理助理,2017年6月15日起任建信信用增强债券型证券投资基金和建信稳定鑫利债券型证券投资基金的基金经理;2018年2月2日起任建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;2018年3月14日起任建信睿享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。

6、投资决策委员会成员

张军红先生,总裁。

姚 锦女士,权益投资部总经理。

李 菁女士,固定收益投资部总经理。

乔 梁先生,研究部总经理。

许 杰先生,权益投资部副总经理。

朱 虹女士,固定收益投资部副总经理。

陶 灿先生,权益投资部总经理助理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况
名称:兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）
注册地址:福建省福州市湖东路154号
办公地址:上海市江宁路168号
法定代表人:高建平
成立日期:1988年8月22日
注册资本:207.74亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2005]74号
托管部门联系人:刘峰
电话:021-52629999
传真:021-62159217
（二）主要人员情况
兴业银行成立于1988年8月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市,2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码:601166），注册资本207.74亿元。

开业二十多年来,兴业银行始终坚持“真诚服务,相伴成长”的经营理念,致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2017年12月31日,兴业银行资产总额达6.42万亿元,实现营业收入1399.75亿元,全年实现归属于母公司股东的净利润57.20亿元。

（三）基金托管业务经营情况
兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、产品管理处、稽核监察处、运营管理处、养老金管理中心等处室,共有员工100余人,业务岗位人员均具有基金从业资格。
兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号:证监基金字[2005]74号。截至2018年6月30日,兴业银行已托管开放式基金239只,托管基金财产规模7959.6亿元

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构
1、直销机构
本基金直销机构为基金管理人直销柜台以及网上交易平台。
（1）直销柜台
名称:建信基金管理有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
法定代表人:孙志晨
联系人:郭雅莉
电话:010-66228880
（2）网上交易平台
投资者可以通过基金管理人网上交易平台办理基金的认购、申购、赎回、定期投资等业务,具体业务办理情况及业务规则请登录基金管理人网站查询。
基金管理人网址:www.ccbfund.cn。

2、其他销售机构

暂无

基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的其他机构销售本基金,并及时公告。

（二）基金份额登记机构
名称:建信基金管理有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
法定代表人:孙志晨
联系人:郑文丹
电话:010-66228888
（三）出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:陆奇
经办律师:黎明、陆奇
（四）审计基金资产的会计师事务所
普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号展业银行大厦507单元01室
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
电话:021-2323 8888
执行事务合伙人:李丹
经办注册会计师:许康华、沈兆杰
联系人:沈兆杰

四、基金的名称

建信睿和纯债债券型证券投资基金。
基金的类型
在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳健增值,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、银行存款、国债期货、同业存单、债券回购等金融工具,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（但须符合中国证监会相关规定）。
本基金不参与投资股票、权证,也不参与新股申购和新股增发。但持有因可转债转股所形成的股票或分离交易可转债分离交易的可权证等资产。因所持可转换债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证,在其可上市交易后不超过10个交易日的时间内卖出。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。但应开放流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放前10个交易日、开放日及开放期结束后10个交易日的期间内,基金投资不受上述比例限制。封闭期内,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;开放期内,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司

二〇一八年九月

【重要提示】
本基金经中国证券监督管理委员会2017年11月10日证监许可〔2017〕2035号文注册募集。本基金合同已于2018年2月2日生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理人风险,本基金的特定风险等。

本基金为债券型基金,其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

投资有风险,投资人在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。
基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本基金允许单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金份额的50%，且本基金不向个人投资者销售。

本招募说明书所载内容截止日为2018年8月1日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日（财务数据未经审计）。本招募说明书已经基金托管人复核。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况
名称:建信基金管理有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层
设立日期:2005年9月19日
法定代表人:孙志晨
联系人:郭雅莉
电话:010-66228888
注册资本:人民币2亿元
建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下:中国建设银行股份有限公司,65%;美国信安金融服务公司,25%;中国华电集团资本控股有限公司,10%。

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构,由全体股东组成,决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确规定股东通过股东会依法行使权利,不得以任何形式直接或间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。
董事会为公司的决策机构,对股东会负责,并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成,其中3名为独立董事。根据公司章程的规定,董事会履行《公司法》规定的有关重大事项的决策权,对公司基本制度的制定和对总裁等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会,由6名监事组成,其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责,主要负责检查公司财务并监督公司董事、高管履职情况。

（二）主要人员情况
1、董事会成员
孙志晨先生,董事长,1985年获东北财经大学经济学学士学位,2006年获得长江商学院EMBA。历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长,中国建设银行总行筹资部、零售业务部证券处处长,北京分行西四支行副行长,北京分行朝阳支行行长,北京分行个人银行部总经理,中国建设银行个人存款与投资部总经理助理。

张军红先生,董事,现任建信基金公司总裁。毕业于中国人民银行行政管理专业,获博士学位。历任中国建设银行筹资部储蓄业务处科长,副主任科员,主任科员,零售业务部主任科员;个人银行业务部个人存款处副经理、高级副经理;行长办公室秘书一处高级副经理级秘书、秘书、高级经理;投资托管服务部总经理助理、副总经理;投资托管业务部副总经理、资产托管业务部副总经理。2017年3月出任公司监事会主席,2018年4月起任建信基金公司总裁。

曹伟先生,董事,现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1990年获北京师范大学中文硕士学位。历任中国建设银行北京分行储蓄证券部副总经理、北京分行安华支行行长、北京分行西四支行副行长,北京分行朝阳支行行长,北京分行个人银行部总经理、中国建设银行个人存款与投资部总经理助理。

张维义先生,董事,现任信安亚太地区总裁。1990年毕业于伦敦政治经济学院,获经济学学士学位,2012年获得华盛顿大学和复旦大学EMBA工商管理学硕士。历任新加坡公共服务委员会副处长,新加坡电信国际有限公司业务发展总监,信诚基金公司首席运营官和代总经,英国保诚集团（马来西亚）资产管理公司首席执行官,宏利金融全球副总裁,宏利资产管理公司（台湾）首席执行官和执行董事,信安亚太地区副总裁。

郑树明先生,董事,现任信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席运营官。1989年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道高级审计经理,新加坡兴达资产管理董事总经理,营运总监、执行长,爱德蒙得洛希尔亚洲有限公司市场营销总监。

华薇女士,董事,现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于吉林大学,获经济学博士学位。历任《长春日报》新闻中心农村工作部记者,湖南卫视《听我非常道》财经节目组运营总监,锦辉控股集团中国区副总裁,锦辉精细化工有限公司总经理,吉林省信托有限责任公司业务七部副总经理、理财中心总经理、财富管理总监兼理财中心总经理、副总监,光大证券财富管理中心总经理（MD）。

李全先生,独立董事,现任新华资产管理股份有限公司董事总经理。1985年毕业于中国人民大学财政金融学院,1988年毕业于中国人民银行研究生部。历任中国人民银行总行和中国农村信用社信托投资公司职员、正大国际财务有限公司总经理助理、资产部总经理,瀚时基金管理公司副总经理,新华资产管理股份有限公司总经理。

史亚辉女士,独立董事,现任中金资本跨境股权投资顾问。1994年毕业于对外经济贸易大学,获国际金融硕士;1996年毕业于耶鲁大学研究生院,获经济学硕士。先后在标准普尔国际评级公司、英国艾比国民银行、野村证券亚洲、雷曼兄弟亚洲、中国投资有限公司、美国威灵顿资产管理公司等多家金融机构担任管理职务。

邱靖女士,独立董事,现任天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)首席合伙人。毕业于湖南大学高级工商管理专业,获EMBA学位,全国会计领军人才,中国注册会计师,注册资产评估师,高级会计师,澳洲注册会计师。1999年10月加入天职国际会计师事务所,现任首席合伙人。

2、监事会成员
马美芹女士,监事会主席,高级经济师,1984毕业于中央财政金融学院,获学士学位,2009年获长江商学院高级管理人员工商管理硕士。1984年加入建设银行,历任总行筹资处储蓄部、零售业务部、个人银行部副处长、处长,资深客户经理（技术二级）,个人金融部副总经理,个人存款与投资部副总经理。2018年5月起任建信基金公司监事会主席。

方敬敏女士,监事,现任信安国际（亚洲）有限公司亚洲区首席律师。曾任英国保诚集团新市场发展区域总监和美国国际集团全球意外及健康保险副总裁等职务。方女士1990年获新加坡国立大学法学学士学位,拥有新加坡、英格兰和威尔士以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士,监事,高级会计师,现任中国华电集团资本控股有限责任公司机构与战略研究部总经理。1992年获北京工业大学工业会计专业学士学位,2009年获中央财经大学会计专业硕士。历任北京北奥有限公司,中进会计师事务所,中瑞华信会计师事务所,中国华电集团财务有限公司计划财务部经理助理、副经理,中国华电集团资本控股（华电财务公司）计划财务部经理,中国华电集团财务有限公司财务部经理,中国华电集团资本控股有限公司企业融资部经理。

严冰女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司人力资源部总经理。2003年7月毕业于中国人民大学行政管理专业,获硕士学位。曾任安永明业会计师事务所人力资源部人力资源专员。2005年8月加入建信基金管理公司,历任人力资源管理专员、主管、部门总经理助理、副总经理、总经理。

刘颖女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司内控合规部副总经理兼内控合规审计部（二级部）总经理,英国特许公认会计师公会（ACCA）资深会员。1997年毕业于中国人民大学会计系,获学士学位;2010年毕业于香港中文大学,获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师、华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理。2006年12月至今任职于建信基金管理有限责任公司内控合规部。

安晓先生,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司信息技术总监兼信息技术部总经理。1995年毕业于北京工业大学计算机应用系,获得学士学位。历任中国建设银行北京分行信息技术部,中国建设银行信息技术管理部北京开发中心项目经理、代处长,建信基金管理公司基金运营部总经理助理、副总经理,信息技术部执行总经理、总经理。

3、公司高管人员
张军红先生,总裁（简历请参见董事会成员）。

曲亚军先生,副总裁,硕士。1999年7月加入中国建设银行总行,历任审计部科员、副主任科员、团委主任科员、重组改制办公室高级副经理、行长沙办公室高级副经理;2005年9月起就职于建信基金管理公司,历任董事会秘书兼综合管理部总监、投资管理部副总监、专户投资部总监和首席战略官;2013年8月至2015年7月,任我公司控股子公司建信资本管理有限责任公司董事、总经理,2015年8月6日起任我公司副总裁,2015年8月至2017年11月30日任建信资本管理有限责任公司董事、总经理,2017年11月30日起兼任建信资本管理公司董事长。
戚晓威先生,副总裁,硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行,从事个人零售业务,2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部,从事证券基金销售业务,任高级副经理;2005年9月加入建信基金管理公司,一直从事基金销售管理工作,历任市场营销部副总监（主持工作）、总监、公司首席市场官等职务,2015年8月6日起任我公司副总裁。

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180023	18国开03	2,700,000	274,077,000.00	8.89
2	101783001	17广煤MTN001	1,900,000	190,874,000.00	6.19
3	180294	18国开04	1,500,000	153,765,000.00	4.99
4	139449	16国债01	1,300,000	128,362,000.00	4.16
5	011800215	18国债23SR03A	1,000,000	100,640,000.00	3.26

6、报告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、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
（1）本期国债期货投资政策
本基金报告期内未投资于国债期货。
（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。
（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。
10、投资组合报告附注
（1）本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均未被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
（2）本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。
（3）其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	60,050.74
2	应收证券清算款	3,622,467.97
3	应收股利	--
4	应收利息	57,539,304.92
5	应收申购款	--
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	61,221,823.63

（4）报告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。
（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。
（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,分项之和合计可能有尾差。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2018年6月30日。

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。

阶段	净值增长率①	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
基金合同生效之日 =2018年6月30日	2.46%	0.06%	2.03%	0.08%	0.43%	-0.02%

十三、基金的费用概览</