建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信恒远一年定期开放债券
基金主代码	003427
交易代码	003427
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月17日
报告期末基金份额总额	16,000,002,793.14份
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过积极主动的组合管理,力争获得高于业绩比较基准的投资收益,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	封闭期运作期内,本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。开放运作期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于较低风险基金产品,其长期平均风险和预期收益率低于股票型及混合型基金,高于货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)
1.本期已实现收益	178,105,802.56
2.本期利润	222,305,062.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0139
4.期末基金资产净值	16,733,003,983.17
5.期末基金份额净值	1.0458

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(不含公允价值变动损益)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损益。

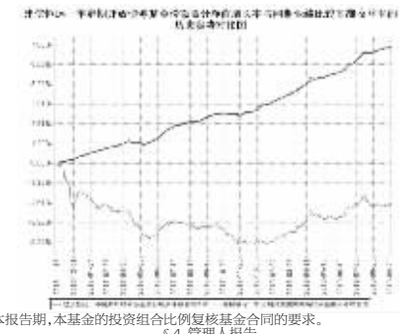
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	1.35%	0.02%	0.57%	0.07%	0.78%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



本报告期,本基金的投资组合比例复核基金合同的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱虹	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2016年11月17日	-	11	硕士,2007年1月至2009年4月任长城人寿保险公司债券投资助理;2009年4月至2011年12月任天弘基金管理公司固定收益部总监助理;2012年1月至2014年5月任万家基金管理公司固定收益部总监;2015年8月至今历任我公司投资管理部副总监、固定收益投资部副总监、副总经理,2015年10月20日起任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2017年11月4日转型为建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金,朱虹自2017年11月4日至2018年8月10日继续担任该基金的基金经理;2016年11月4日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,朱虹自2018年1月5日至2018年8月10日继续担任该基金的基金经理;2016年6月1日起任建信双债增强债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月17日起任建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2018年4月20日起任建信双息红利债券型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

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

本报告期内未出现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。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度,中国经济总体平稳,但结构性矛盾突出。供给侧改革的成功使周期性行业的盈利处于持续恢复状态。三季度美元兑人民币升值5.95%,客观上影响了进口价格水平。中国作为全球原油需求的重要增长点,进口原油价格已经连续上升20个月以上。在币值水平波动、原油价格上涨、环保等多重因素的共同作用下,部分化工品出场价格水平有所攀升。

央行在4月、6月宣布降低存款准备金率、10月初继续降低准备金。基本保持了联储加息,央行即降低准备金对冲的节奏。此举不断降低市场短期利率水平,系统性金融风险也有所降低。当前银行间短期流动性是两年来最宽裕的时期,我们观察到,2018年6月、7月两月的信贷水平与季节性水平有所脱离,并判断今后半年的商业银行资金运用有较高概率偏好贷款等表内扩张性资产,目前看来这一预期正在兑现。受到上半年民企融资的各种条件限制,商业银行资产行为风险偏好较低。当前信贷资产的偏好仍旧是规模较大的企业,因此货币政策宽松对降低民企违约的作用较小,至本季度末民企和伪国企违约呈现二次爆发趋势。

受到这一影响,社会融资总量并未有效上升。三季度的较大的金融监管变化是理财新规的落地,这是对融资环境有较大正面影响。从货币传导机制看,理财资金的资产配置多以非标资产、较低等级的信用债为主。理财业务的恢复可以从实质上有效缓解融资的风险偏好较低问题。

本基金运作期剩余时间为三个月,将主要采用久期匹配的操作。主要资产都是上半年短期利率较高时期配置,目前到期收益水平较好。我们将维持以上配置,以适度参与市场波动为辅助收益来源,严控信用风险,提供确定收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率1.35%,波动率0.02%,业绩比较基准收益率0.57%,波动率0.07%。

§5 投资组合报告

5.1 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	13,959,653,938.80	83.39
	其中:债券	13,959,653,938.80	83.39
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	900,000,000.00	5.38
	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	1,505,644,898.90	8.99
8	其他资产	375,210,121.12	2.24
9	合计	16,740,508,958.82	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

5.3 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。

5.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,610,197,000.00	9.62
	其中:政策性金融债	1,365,261,000.00	8.16
4	企业债券	489,551,000.00	2.93
5	企业短期融资券	6,405,445,000.00	38.28
6	中期票据	5,110,213,500.00	30.54
7	可转债(可交换债)	105,727,438.80	0.63
8	同业存单	238,520,000.00	1.43
9	其他	-	-
10	合计	13,959,653,938.80	83.43

5.5 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

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	180407	18农发07	4,000,000	401,760,000.00	2.40
2	101553007	15中建MTN001	2,000,000	202,600,000.00	1.21
3	018005	国开1701	2,000,000	201,200,000.00	1.20
4	160208	16国开08	2,000,000	199,800,000.00	1.19
5	150317	15进出17	1,800,000	180,234,000.00	1.08

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期本基金未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露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。

5.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,512.28
2	应收证券清算款	17,783,544.64
3	应收股利	-
4	应收利息	357,421,064.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	375,210,121.12

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	16,000,002,793.14
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	16,000,002,793.14

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

单位:份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年07月01日-2018年09月30日	16,000,000,000.00	0.00	0.00	16,000,000,000.00	99.99%
产品持有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过20%的情况,可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险,敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制,持续做好基金流动性风险的管控工作,审慎评估大额申赎对基金运作的影响,采取有效措施切实保护持有人合法权益。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件和营业执照;

6、基金托管人业务资格批件和营业执照;

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
2018年10月26日

建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年10月24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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信战略精选	
基金主代码	005596	
交易代码	005596	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年4月4日	
报告期末基金份额总额	244,760,015.08份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,精选战略性看好的股票,追求超越业绩比较基准的投资回报,力求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取"自上而下"和"自下而上"相结合的投资策略,灵活配置大类资产,动态控制组合风险,力求实现基金资产的持续稳定增值。 本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略和权证投资策略七部分组成。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×10%+中证综合全债(总值)指数收益率×40%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高预期收益/风险特征的基金。本基金的基金资产如投资于港股,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	建信战略精选A	建信战略精选C
下属分级基金的交易代码	005596	005597
报告期末下属分级基金的份额总额	234,750,149.42份	10,009,865.66份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)	
	建信战略精选A	建信战略精选C
1. 本期已实现收益	-17,781,250.23	-765,248.20
2. 本期利润	-19,117,233.02	-823,367.25
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0801	-0.0812
4. 期末基金资产净值	207,908,393.22	8,839,342.67
5. 期末基金份额净值	0.8857	0.8831

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

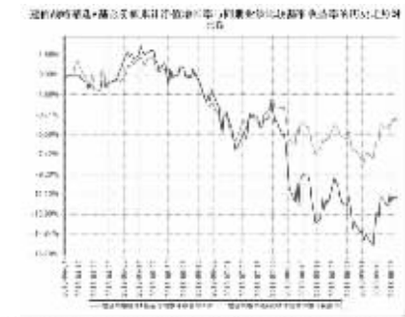
建信战略精选A

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
过去三个月	-8.23%	1.21%	-0.35%	0.75%	-7.88%	0.46%

建信战略精选C

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
过去三个月	-8.34%	1.21%	-0.35%	0.75%	-7.99%	0.46%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



本基金基金合同于2018年4月4日生效,截至报告期末仍处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王东杰	权益投资部联席投资官、本基金的基金经理	2018年4月4日	-	10	博士,权益投资部联席投资官,2008年7月至2012年5月在高盛高华证券公司从事销售交易工作;2012年5月至今在我公司工作,历任初级研究员、研究员、研究主管、基金经理、权益投资部联席投资官,2015年5月13日至2017年7月12日任建信回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年7月29日起任建信大安全战略精选股票型证券投资基金的基金经理;2016年6月3日至2017年6月9日任建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年8月28日起任建信核心精选混合型证券投资基金的基金经理;2017年12月20日起任建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年2月7日起任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年4月4日起任建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

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

本报告期内未出现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。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观层面,今年前三季度经济增长小幅回落,物价水平平稳运行。为了应对中美贸易摩擦和国内经济潜在下行的风险,政府出台了一系列稳内需政策,包括基建补短板、促消费和推动科技创新等系列指导意见。货币政策更加灵活,年初以来央行连续四次结构性或全面降准。财政方面也在积极推出减税控费等政策。

市场方面,上证综指小幅下跌0.92%,创业板指下跌12.16%。在经历了上半年的普遍下跌后,7月份市场窄幅震荡。8月份受到中美贸易摩擦加剧的负面影响,市场继续下挫。9月国内维稳政策陆续出台,股市有所企稳。

行业层面,石油石化(上涨15%)、银行(上涨12%)和钢铁(上涨4%)排名靠前。3季度海外油价震荡上行,刺激了石油石化行业的上涨。银行和钢铁上涨主要受益于国内稳增长和环保限产等政策。纺织服装(下跌17%)、家电(下跌17%)和电子(下跌14%)下跌较多。纺织服装和电子主要受贸易战和苹果产品周期的影响,家电销量低于预期,前期强势的家电板块3季度回调较多。

本基金在前三季度始终保持中性仓位。在宏观因素不确定性加大的背景下,持仓以稳定增长的消费类优质个股和稳增长政策相关的优质龙头为主。我们认为,以合理的价格买入优质公司并长期持有是持续获得超额回报的有效途径。

操作层面,我国经济正在由高速增长阶段转向高质量发展阶段。在新旧动能转换的过程中,必然会有一批优秀公司脱颖而出。本基金会重点布局符合国家战略发展方向的、竞争优势明显、管理层优秀、估值相对合理的优质成长股和价值成长股,力求赢得长期稳定的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信战略精选A净值增长率-8.23%,波动率1.21%,建信战略精选C净值增长率-8.34%,波动率1.21%;业绩比较基准收益率-0.35%,波动率0.75%。

§5 投资组合报告

5.1 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	153,053,204.23	69.99
	其中:股票	153,053,204.23	69.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	50,000,000.00	22.86
	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	15,404,365.06	7.04
8	其他资产	232,807.92	0.11
9	合计	218,690,377.21	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	87,503,136.33	40.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,847,553.00	2.24
E	建筑业	6,994,396.00	3.23
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、软件和信息技术服务业	11,009,628.00	5.08
J	金融业	16,990,508.80	7.84
K	房地产业	17,015,831.10	7.85
L	租赁和商务服务业	4,162,152.00	1.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
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	148,523,204.23	68.52

以上行业分类以2018年9月30日的证监会行业分类标准为依据。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	4,530,000.00	2.09
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	4,530,000.00	2.09

5.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	28,733	20,975,090.00	9.68
2	000961	中南建设	1,509,195	9,326,825.10	4.30
3	600048	保利地产	631,800	7,689,006.00	3.55
4	600036	招商银行	242,000	7,426,980.00	3.43
5	601186	中国铁建	627,300	6,994,395.00	3.23
6	002410	广联达	252,700	6,767,306.00	3.12
7	000858	五粮液	97,500	6,625,125.00	3.06
8	600809	山西汾酒	137,834	6,518,169.86	3.01
9	600031	三一重工	639,800	5,681,424.00	2.62
10	600872	中炬高新	164,319	5,356,799.40	2.47

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期本基金未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露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。

5.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	139,655.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,897.29
5	应收申购款	65,255.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	232,807.92

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信战略精选A	建信战略精选C
报告期期初基金份额总额	243,096,490.59	10,596,010.11
报告期期间基金总申购份额	1,577,383.46	619,136.83
减:报告期期间基金总赎回份额	9,923,724.63	1,205,281.28
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	234,750,149.42	10,009,865.66

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件和营业执照;

6、基金托管人业务资格批件和营业执照;

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
2018年10月26日

建信收益增强债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月26日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年10月24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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信收益增强债券	
基金主代码	530009	
交易代码	530009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年6月2日	
报告期末基金份额总额	228,802,768.37份	
投资目标	在保持资产流动性的基础上,发挥投研团队在固定收益、股票及金融衍生产品方面的综合研究实力,在有效控制风险的前提下追求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建信用类债券投资组合,运用基本面研究择机介入上市公司股票及参与新股申购,以实现基金资产的长期稳健增值。	
业绩比较基准	30%×中债企业债总指数+70%×中债国债总指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,但高于货币市场基金以及不涉及股票二级市场投资的债券型基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
下属分级基金的交易代码	530009	531009
报告期末下属分级基金的份额总额	157,756,743.81份	71,046,024.56份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日 - 2018年9月30日)	
	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
1. 本期已实现收益	-5,012,113.85	-2,299,849.85
2. 本期利润	325,467.98	-16,477.57
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0020	-0.0002
4. 期末基金资产净值	247,787,963.04	107,483,119.56
5. 期末基金份额净值	1.571	1.513

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(不含公允价值变动损益)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损益。

2、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 本报告期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

建信收益增强债券A

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
过去三个月	0.13%	0.22%	0.84%	0.09%	-0.71%	0.13%

建信收益增强债券C

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
过去三个月	0.00%	0.21%	0.84%	0.09%	-0.84%	0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李菁	固定收益投资部总经理、本基金的基金经理	2009年6月2日	-	12	李菁女士,固定收益投资部总经理,硕士,2002年7月进入中国建设银行股份有限公司基金托管部工作,从事基金托管业务,任主任科员,2006年9月进入建信基金管理有限责任公司,历任债券研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、投资管理部副总监、固定收益投资部总监,2007年11月1日至2012年2月17日任建信货币市场基金的基金经理;2009年6月2日起任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理;2011年6月16日至2018年3月10日任建信信用增强债券型证券投资基金的基金经理;2016年2月4日起任建信安心保本五号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2018年2月6日起转型为建信弘利灵活配置混合型证券投资基金,李菁自2018年2月6日至2018年8月10日继续担任该基金的基金经理;2016年6月8日起任建信安心保本七号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2018年6月15日起转型为建信共利灵活配置混合型