建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	建信睿丰纯债定期开放债券
基金主代码	005485
交易代码	005485
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年3月14日
报告期末基金份额总额	10,000,000.00份
投资目标	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。
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,综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,深入挖掘价值被低估的标的券种。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率。
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。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§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	1,521,086.23
2.本期利润	1,258,754.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0121
4.期末基金资产净值	10,248,379.22
5.期末基金份额净值	1.0248

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。

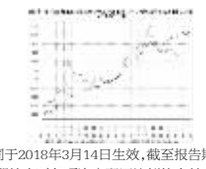
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.20%	0.03%	0.57%	0.07%	0.63%	-0.04%

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



1.本基金基金合同于2018年3月14日生效,截至报告期末未满一年。2.本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§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		
李静	本基金的基金经理	2018年3月14日	-	11	硕士,曾任清华紫光股份有限公司财务会计助理,2007年4月至2012年9月任华夏基金管理公司基金会计业务经理,风控高级经理,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月任银华基金管理公司海价研究主管,2016年6月起任建信基金管理公司基金经理助理,2017年5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日起任建信睿丰纯债定期开放债券型发起式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《建信睿丰纯债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

宏观经济方面,18年三季度经济运行整体保持平稳, 但经济动能略显不足。PMI增速从季度初的51.2%下滑至50.8%,三季度企业生产经营活动总体延续平稳态势,但需求扩张步伐有所放慢。需求方面,地产投资增速保持平稳,但基建投资的持续下滑拖累整个固定资产投资增速,1-8月累计增速较二季度末下滑0.7个百分点至5.3%。消费方面在三季度增速保持平稳,社会消费品零售总额8月末累计增速为9.3%,消费市场保持转型升级态势,其中服务类消费维持快速增长。进出口方面,三季度企业面对未来关税的不确定性,存在提前出口的行为,进出口形势暂时平稳, 经贸摩擦对于进出口的影响尚未体现,8月末进出口总额累计同比增长16.1%,增速相比于二季度末小幅增加0.2个百分点。

通胀层面,受到南方暴雨以及猪瘟疫情的影响,食品价格的大幅上涨推升CPI重回2%以上水平。随着9月份以来原油价格的再次攀升,叠加贸易摩擦对部分进口商品价格的影响,通胀压力持续凸显。政策层面,政治局会议强调了六“稳”政策,三季度央行维持偏宽松的资金面,资金价格在8月中旬见底回升后维持稳定,央行还在9月底通过定向降准熨平季度末冲击。信用层面,表外融资受阻导致民营企业资金链紧张,违约事件的连续爆发引发市场恐慌,中低等级信用债流动性堪忧。国际方面,美国经济继续一枝独秀,随着三季度美国就业、通胀数据的持续向好,美元指数以及美股再次走强。9月份美联储如期进行第三次加息,人民币对美元汇率一度突破6.9。

在此背景下,三季度债券收益率整体下行。由于短端收益率随着资金价格下行明显,曲线形态陡峭化,三季度1年期国开债收益率下行将近60bp,而长端10年期收益率仅下行5bp。信用债方面,随着无风险收益率下行,信用利差有所收窄。

回顾三季度的基金管理工作,本基金采用追求绝对收益的投资策略,配置上优先短期限高收益信用债。面对宽松的资金面,组合维持较高的杠杆水平,为组合带来稳定的收益回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率1.2%,波动率0.03%,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	9,507,552.80	90.40
	其中:债券	9,507,552.80	90.40
	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	-	-
	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	838,240.93	7.97
8	其他资产	170,907.05	1.63
9	合计	10,516,700.78	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	9,507,552.80	92.77
	其中:政策性金融债	9,507,552.80	92.77
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	9,507,552.80	92.77

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	108602	国开1704	54,672	5,502,736.80	53.69
2	018005	国开1701	29,860	3,003,916.00	29.31
3	018007	国开1801	10,000	1,000,900.00	9.77

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	6,240.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	164,666.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	170,907.05

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

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	109,999,000.00
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	99,999,000.00
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	10,000,000.00

上述总申购份额含转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	100.00

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	100.00	10,000,000.00	100.00	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	100.00	10,000,000.00	100.00	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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28日	99,999,000.00	0.00	99,999,000.00	0.00	0.00%
	2	2018年09月28日-2018年09月30日	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	100.00%
产品特有风险							
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。							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建建信睿丰纯债定期开放债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信睿丰纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信睿丰纯债定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信睿丰纯债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。

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

10.3 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

建信睿富纯债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:兴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。

基金托管人兴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	建信睿富纯债债券
基金主代码	003690
交易代码	003690
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月25日
报告期末基金份额总额	7,017,284,916.23份
投资目标	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。
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,综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,深入挖掘价值被低估的标的券种。
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。
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。
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

§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	39,611,035.04
2.本期利润	94,712,048.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0136
4.期末基金资产净值	7,369,935,438.31
5.期末基金份额净值	1.0498

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。

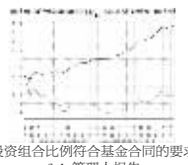
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.30%	0.04%	0.57%	0.07%	0.73%	-0.03%

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		
刘思	本基金的基金经理	2016年11月25日	-	9	硕士,2008年5月加入建信基金管理公司,历任助理交易员,初级交易员,交易员,交易主管,基金经理助理,基金经理,2016年7月19日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月8日至2018年1月15日任建信睿丰纯债债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月22日至2017年8月31日任建信恒丰纯债债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月25日起任建信睿富纯债债券型证券投资基金的基金经理;2017年8月9日起任建信中证政策性金融债1-3年指数证券投资基金(LOF)的基金经理;2017年8月9日至2018年4月11日任建信中证政策性金融债3-5年指数证券投资基金(LOF)基金经理;2017年8月16日至2018年4月11日任建信中证政策性金融债1-8年指数证券投资基金(LOF);2017年8月16日至2018年5月31日任建信睿鹏纯债债券型证券投资基金的基金经理;2018年3月26日起任建信双月安心理财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,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《建信睿富纯债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

今年全球经济复苏超出市场预期,但面临的不稳定性仍然突出,深层次的结构性矛盾尚未得到根本解决,金融市场的“黑天鹅”隐患和全球债务的“灰犀牛” 事件仍是拖累全球经济增长的风险源。此外,“逆全球化”和贸易保护主义、部分大宗商品价格中枢下移、跨国资本大规模无序流动以及地缘政治冲突威胁上升等问题继续给世界经济稳定带来不确定性。

从投资端看, 短期内固定资产投资增速面临着基建与房地产投资的对冲效应,但是新增意向投资增速回升,投资“三驾马车”均有改善,投资悲观预期或需修复。今年以来固定资产投资增速持续下行,其中融资收缩下包含水电热等能源投资的广义基建投资增速受影响最为明显,8月、9月财政政策的逐步发力预计对基建投资有所提振。此外,年内房地产投资面临一定下行压力。因此,虽然固定资产投资整体增速降幅收窄,但难以在短期内有明显拉升GDP增速的效果。

就消费端而言,收入增速乏力,消费难见起色。8月当月零售数据回升主要是由于暑期消费增加所致,汽车消费等拖累项目未见起色。国际贸易方面,人民币的币值波动是影响进出口的一项重要因素, 人民币贬值对进口不利而对出口有利,国内消费的大趋势仍在下行,因此进口仍将继续走低。近期美国正式对从中国进口的总额2000亿美元的商品加征10%的新关税,10%的新关税于9月24日生效,并将在2019年1月1日起上升至25%,出口数据将会进一步下滑。

3季度以来央行公开市场操作呈现出明显“锁短放长”的特点。MLF投放增加目的在于增加长期限资金投放量对冲地方政府债发行冲击。今年以来银行间市场流动性持续宽松,资金成交金额在7、8月份屡创新高,同时资金利率不断下行甚至多次低至逆回购利率之下。而在资金利率与政策利率倒挂之时,央行均暂停了公开市场逆回购操作。

8月社会融资规模增量虽略超预期, 但从细项上看, 贷款仍是增量的主要来源,8月社融新增量为1.5万亿,其中1.3万亿来自人民币贷款。但是房地产问题仍是监管底线,因此居民中长期贷款增速短期难以大幅提升。信贷监管政策7月以来有所放松,财政基建也开始积极发力。但是从数据上看,7月和8月的信贷并未持续增强,且投向结构不太理想,实体融资不振,银行风险偏好较低,信贷仍以票据冲量,央行通过提供长期限稳定性高的资金来提高银行放贷的积极性。

整个三季度的资金价格呈现由高到低再到高的波动趋势。以同业存款价格为例,三季度3M存款的最高价为3.80%,季度中旬出现最低价为2.05%,8月下旬价格有所回升,9月份就维持在2.8%到3.0%的区间内。美联储9月加息已被市场充分预期,但央行的没有相应操作,季末叠加国庆长假,资金价格中枢略上行。

综上所述,本基金在2018年三季度保持了一贯稳健的投资风格,适当配置了跨年资产,没有进行杠杆操作。8月和9月在收益高点配置了部分优质存单和高等级信用债,在资金紧张时点进行了少量逆回购操作。截至季末时点,业绩表现良好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率1.3%,波动率0.04%,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	7,181,723,000.00	97.54
	其中:债券	7,181,723,000.00	97.54
	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	-	-
	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	67,932,500.21	0.92
8	其他资产	113,231,922.12	1.54
9	合计	7,362,887,422.33	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	4,980,481,000.00	67.67
	其中:政策性金融债	3,261,541,000.00	45.67
4	企业债券	408,380,000.00	5.55
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	611,400,000.00	8.31
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	1,181,462,000.00	16.05
9	其他	-	-
10	合计	7,181,723,000.00	97.54

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	091501002	15中国信达债02	7,000,000	705,960,000.00	9.59
2	100411	10农发11	7,000,000	699,650,000.00	9.51
3	100302	10进出02	6,700,000	670,536,000.00	9.11
4	1282206	12中船MTN1	6,000,000	611,400,000.00	8.31
5	1312001	13中信银行债	6,000,000	607,020,000.00	8.25

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	113,231,922.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	113,231,922.12

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	7,017,284,916.23
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	7,017,284,916.23

§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

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期末发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,350.14	0.20	10,001,350.14	0.20	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,350.14	0.20	10,001,350.14	0.20	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2,999,999,000.00	1,919,016,503.55	0.00	4,919,015,503.55	99.93%
产品特有风险							
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。							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建建信睿富纯债债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信睿富纯债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信睿富纯债债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信睿富纯债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。

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

10.3 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

建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

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:兴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。

基金托管人兴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	建信睿和纯债定期开放债券
基金主代码	006375
交易代码	006375
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月2日
报告期末基金份额总额	4,929,016,183.69份
投资目标	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。
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,综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,深入挖掘价值被低估的标的券种。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率。
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。
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

§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	58,458,032.70
2.本期利润	69,252,996.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0165
4.期末基金资产净值	5,153,287,580.33
5.期末基金份额净值	1.0456

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。

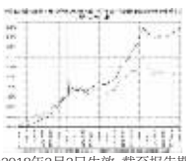
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.04%	0.06%	0.57%	0.07%	1.47%	-0.01%

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



1.本基金基金合同于2018年2月2日生效,截至报告期末未满一年。2.本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§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		
黎颖芳	本基金的基金经理	2018年2月2日	-