基金管理人;建信基金管理有限责任公司 基金托管人;中国工商银行股份有限公司 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 、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 个别称:在进事任

载、误导性陈述或重大遗漏,升对其内谷的具头性、准卿性和元詮性本 担个别及连带责任。 基金托管人中国工商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格 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

基金百理八条中心 NA 不同 D. NA 不可 D. NA T. NA 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

基金简称	责任ETF
场内简称	责任ETF
基金主代码	510090
交易代码	510090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年6月28日
报告期末基金份额总额	62,081,114.00份
投资目标	緊密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,实现 与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	上证社会责任指数
风险收益特征	本基金属于股票指数型基金,其风险和预期收益高于货币市场 基金。债券基金、混合基金。本基金为指数型基金,具有和标价 指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基 金中较高风险,收高预期收益的品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

0.1 <u>1</u> 2/1/1/16/10	单位:人民市
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	2,084,038.91
2.本期利润	6,073,327.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0976
4.期末基金资产净值	98,501,337.02
c 細士甘本仏教教徒	1 5967

[編集基金館辦館] 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,

2、所述基金业绩指标不包括持有人认 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

阶段

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。

版日送出日納:2016年10万20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。 基金托管人中国光大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

§ 2 基金产品概况

主要财务指标和基金净值表现

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

1、年期已实现收益信益率年期利息収入、仅页收益、其地收入、个 合公允价值变动损益)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,

业绩比较基准 收益率(3)

建信绌债债

业绩比较基准 收益率③

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

基金采取自上而下的方法确定投资组合久期。 可上的个券选择方法构建债券投资组合。通过 并形势、经济周期所处阶段、利率变化趋势和(

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

单位:人民币元

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

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。

§3.3.1 主要财务指标

## 上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

## 2018年第三季度报告



4.2 管理人对报告期内本基金运作遭规守信情况的说明本报告期内,基金管理人不存在销声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来和法师各遗守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《上证社会责任交易型开放式捐数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的报告意见》、《证券投资基金公司公平交易等接指受规则》《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等接指关规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司的范内幕交易管理办法》、《对益冲突管理办法》、《与常交易管理办法》、《公司的范内幕交易管理办法》、《对益冲突管理办法》、《公司的范内幕交易管理办法》、《公司的范内幕交易管理办法》、《对益冲突管理办法》、《公司的范内幕交易管理办法》、《对益冲突管理办法》、《与常交易行为的专项说明本报告由时实实同一证券时,系统自动切换至公平交易模块,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作不同投资组合之间进行利益输送。

本报告期仍本出现所有投资组合参与的父易所公开竞订的日及问交易成交较少的单边交易是超过该证券当日成交量的6%的情况。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。 44 报告期内基金投资策略和运作分析 在报告期内,本基金根据基金后同规定,采取了对指数的被动复制 策略,将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范

[内。 报告期内,本基金跟踪误差主要来自于所持股票组合与所跟踪标 报告期内,本基金跟踪误差王要来自于所持股票组合与所跟踪标 的指数在权理结构上的差异。权直结构上的差异主要源自以下四个部 分:第一,股票数量的舍入取整;第二,适当提高小权重股票便于提高基 金可供申赎的篮子个数;第三,参与新股申购;第四,部分股票停牌导致 无法交易。本基金管理人在量化分析基础上,采取了适当的组合调整策 略,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。 4.5 报告期内基金的心绩表现

本报告期基金净值增长率6.55%,波动率1.46%,业绩比较基准收益

§ 5 投资组合报告

ĺ	5.1 报告期末基金资产	<sup>2</sup> 组合情况		5.3.2 报告期
5	项目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)	序的前五名股票抗
	权益投资	97,820,905.47	08.80	本基金本报告
	其中:股票	97,820,905.47	98.80	5.4 报告期末
	基金投资	1	-	本基金本报告
	固定收益投资	-	-	5.5 报告期末
	其中:债券	1	-	
	资产支持证券	-	-	债券投资明细
	贵金属投资	_	_	木其全木拐台

8	其任	其他资产		4,579.77		0.00	
9	合计			99,008,821.00		100.00	
	5.2 5.2	报告期末按行业分 .1 报告期末指数投				设票投资组合	
	代码	行业类别		公允价值(元)		占基金资产净值比例(	%)
	Α	农、林、牧、渔业			-		-
Ì	В	采矿业		1,526,	759.33		1.55
Ì	C	制造业		21,696,	840.61		22.03
Ì	D	电力、热力、燃气及水生产和供	应业	860,	981.76		0.87
Ì	E	建筑业	建筑业				7.95
	F	批发和零售业	批发和零售业		905.87		2.38
	G	交通运输、仓储和邮政业		1,815,	394.31		1.84
	Н	住宿和餐饮业			-		-
	I	信息传输、软件和信息技术服务业		3,495,	206.82		3.55
	J	金融业	金融业		105.29		53.41
	K	房地产业	房地产业		370.19		5.20
	L	租赁和商务服务业	租赁和商务服务业		383.14		0.25
	M	科学研究和技术服务业		107,	362.54		0.11
	N	水利、环境和公共设施管理业			-		-
	0	居民服务、修理和其他服务业	居民服务、修理和其他服务业		-		-
	P	教育			-		-
Ì	Ω	卫生和社会工作			-		-
1	- 13	also file. All observation pro-11.	100				

| 日本 | 197,820,906,47 | 198,31 | 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 报告期末积极投资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积极投资股票。

在企业中以后的水本等目标的区域及成果。 5.23 报告期末按行业分类的准股通股资 本基金本报告期末投资港股通股票。 6.3 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

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排

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	601318	中国平安	296,400	20,303,400.00	20.61
2	600036	招商银行	279,630	8,581,844.70	8.71
3	601166	兴业银行	334,975	5,342,851.25	5.42
4	601328	交通银行	766,353	4,417,101.52	4.48
5	600000	浦发银行	323,269	3,433,116.78	3.49
6	600104	上汽集团	96,468	3,210,455.04	3.26
7	601668	中国建筑	578,070	3,173,604.30	3.22
8	601601	中国太保	86,525	3,072,502.75	3.12
9	600048	保利地产	195,971	2,384,967.07	2.42
10	600019	宝钢股份	245,300	1,925,605.00	1.95

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排 投资明细 告期末未持有积极投资股票

末按债券品种分类的债券投资组合

告期末未持有债券。 末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名

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股指期货交易情况说明 5.9.1 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投资股指期货。 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资干国债期货 5.10.2 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。 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资干国债期货

5.11 投资组合报告附注

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

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 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说

本基金本报告期末未持有积极投资股票。 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人原因,分项之和与合计可能有尾差。 《6 开放式基金份额变动

	单位:6
报告期期初基金份额总额	62,581,114.00
报告期期问基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	500,000.00
报告期期问基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	62,081,114.00

67 其全管理人运用固有资金投资水基全情况 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

单位:份 期初 份额 赎回 份額

本基金由于存在单一投资者份额占比达到成超过20%的情况,可能会出现因集中赎回而引发的基金流动 风险、被调投资者注意。本基金管理上将不确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 作,推销评估大规申股对基金运行的影响。况即在做进场时产促起站在人。今年823

§ 9 备查文件目录 9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金 募集设立的文件;

2、《上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金合同》; 3、《上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》; 4、《上证社会责任交易型开放式指数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

# 建信纯债债券型证券投资基金

# 业绩比较基准收益率变动的比较 ilidentili ilida

本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

姓名	职务	任本基金的	的基金经理期限	证券从业年	说明
XEE	101.55	任职日期	离任日期	開	0093
<b>黎</b> 颖芳	本基金的基金经理	2012年11月 15日	-	17	世十二次00年7月年後 于海州 大学金融保险等,所用出入大人 运量管理公司,在金融工程 运量管理公司,在金融工程 与加入本公司,门行研究员,高 60年7月,基金经期的推 1901年201年201年11日日建 1901年201年201日日1日日建 1901年201日日201日日1日日建 1901年201日日1日日建 1901年201日日1日日建 1901年201日日1日日建 1901年201日日1日日建 1901年201日日1日日建 1901年201日日1日日建 1901年201日日1日日建 1901年201日日1日日建 1901年201日日1日日建 1901年201日日1日日建 1901年201日日1日日建 1901年201日日1日日1日 1901年201日日1日日1日 1901年201日日1日日1日 1901年201日日1日日1日 1901年201日日1日日1日日 1901年201日日1日日1日日 1901年201日日1日日1日日 1901年201日日1日日1日日1日日 1901年201日日1日日1日日1日日 1901年201日日1日日1日日1日日 1901年201日日1日日1日日1日日1日日1日日1日日1日日1日日1日日1日日1日日1日日

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 在本报告期内,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

18年三季度经济运行整体保持平稳,制造业采购经理指数(PMI) 维持在景气区间内,生产指数和新订单指数高干临界点,但需求扩张步 伐有所放慢。从需求端上看,固定资产投资增速继续下滑,1-8月累计增 速5.3%较二季度末累计增速下降了0.7个百分点,消费增速保持平稳, 且保持转型升级态势,服务类消费维持快速增长;进出口方面虽有贸易 战风波进一步发酵,但经贸摩擦对于进出口贸易影响尚未体现。从生产 端上看,8月末全国规模以上工业增加值累计同比实际增长6.5%,增速 相比于二季度末回落0.2个百分点,其中高技术产业和战略性新兴产业 增速仍较快。总体看,18年三季度经济生产需求虽然有所放缓但总体保

三季度居民消费价格同比持续回升,而工业品同比增速维持平稳。 从消费者价格指数上看,8月份来看居民消费价格CPI同比上涨2.3%,涨 幅比6月末扩大0.4个百分点,其中受天气和疫情影响导致猪肉和蔬菜价格上涨比较多,对于消费者价格指数有较大拉升;而非食品项中服务 消费价格也呈现温和上涨态势。从工业品价格指数上看,1-8月全国工 业生产者出厂价格同比上涨4.0%,其中8月当月PPI当月同比增速4.1% 较6月4.7%的增速有所回落,原油价格受到海外国际因素影响上行较

持平稳,基础设施建设投资仍有一定下行压力,经济保持高质量发展态

大,对工业品价格有一定支撑。 三季度资金面整体维持合理适度水平, 央行在10月初宣布在中旬 进行置换降准操作,预计将额外释放资金7500亿元;此外9月下旬在美 联储如期上调联邦基金利率之后,人民银行并没有跟随进行公开市场 加息操作。从人民币汇率上看,三季度人民币汇率贬值程度较大,九月 末美元中间价收于6.8792,较二季度末贬值3.97%

债券市场方面,三季度债券市场整体维持区间震荡。贸易战发酵下 7月收益率小幅下行,随后在稳增长政策出台、通胀预期加强、地方债供 经增加 信田事件惺岩及羊债收益案础3笔田麦影响下 g g日债券收益 率有所反弹。10年国开债收益率相比于二季度末4.25%的位置下行5BP 本基金三季度基金规模有所增长, 在政策向稳增长倾斜后卖出了

长债,基于资金面持续宽松和信用环境改善的预期,本基金加仓了中短 久期 高票息及资质较好的信用品种 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信纯债A净值增长率1.88%,波动率0.07%,建信纯债C

净值增长率1.76%,波动率0.07%;业绩比较基准收益率0.57%,波动率 § 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	金額(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	398,726,299.10	97.21
	其中:债券	398,726,299.10	97.21
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买人返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买人返售金 融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,607,866.75	0.88
8	其他资产	7,849,888.75	1.91
9	合计	410,184,054.60	100.00
5.2	报告期末按行业分类		

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	19,716,000.00	6.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,443,085.60	15.70
	其中:政策性金融债	50,443,085.60	15.70
4	企业债券	62,031,713.50	19.30
- 5	企业短期融资券	200,593,000.00	62.42
6	中期票据	65,942,500.00	20.52
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	398,726,299.10	124.07

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	180205	18国开05	300,000	31,377,000.00	9.76
2	041800332	18建安投资 CP002	200,000	20,002,000.00	6.22
3	011801446	18路安 SCP005	200,000	19,982,000.00	6.22
4	018005	国开1701	149,000	14,989,400.00	4.66
5	101800163	18恒健 MTN001	100,000	10,294,000.00	3.20
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
Cr -1-4-1-	CT 944 AT 264 DE	LART			

本基金本报告期末未持有资产支持证券 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

本基金本报告期末未持有权证。

593 木期国债期货投资评价 本基金报告期内未投资于国债期货。 5.10 投资组合报告附注 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。 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

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。

5.10.4 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

由于四舍五人原因,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

上述总申购份额含转换转人份额,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 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

1、中国证监会批准建信纯债债券型证券投资基金设立的文件; 2、《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信纯债债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信纯债债券型证券投资基金托管协议》:

6、基金托管人业务资格批件和营业执照;

8.2 存放地点

本报告期本基金未投资国债期货. 5.11 投资组合报告附注

5.11.1

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

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

## 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

计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### §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

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

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。

基金简称	建信裕利灵活配置混合
基金主代码	002281
交易代码	002281
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年1月11日
报告期末基金份额总额	331,474,673.05(f)
投资目标	本基金自上而下积极、动态地配置大类资产,同时通过合理 的证券选择,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长 明稳健增值。
投资策略	本基金充分更联基金管理,於明开代优势。在分析和即期实现 经济周期和1班延期实化处物的基础。
业绩比较基准	66%×沪深300指数收益率+35%×中债总财富(总值)指数 收益率
风险收益特征	本基金为都合型基金,其預期收益及预期风险水平高于债券 型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收 益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司

收益加上本期公允价值变动损益。

3.1 土安财务指标	
	单位:人民币
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	-31,245,276.54
2.本期利润	-21,521,029.96
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0633
4.期末基金资产净值	290,118,199.52
5.期末基金份额净值	0.8752
	本期利息收入、投资收益、其他收入(2

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。

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 产,但不保证基金一定盈利。

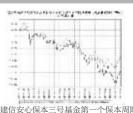
## §3 主要财务指标和基金净值表现

	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	-31,245,276.54
2.本期利润	-21,521,029.96
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0633
4.期末基金资产净值	290,118,199.52
5.期末基金份额净值	0.8752
	本期利息收入、投资收益、其他收入(不 会费用后的余额,本期利润为本期已实现

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 益室的比较

业绩比较基准收益率变动的比较

# 建信裕利灵活配置混合型证券投资基金



1、本基金由建信安心保本三号基金第一个保本周期到期后变更而 来,基金合同于2018年1月11日生效 2、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 部間は基本 信创新中国和 投资基金的基

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《建信稳定丰利 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 4.3.1 公平交易制度的执行情况 为了公平对待投资人,保产投资人利益,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》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《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》、《多管理办法》、《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,一旦出现了居其全局时式产品。证券社、条约司法世份高公区交易模块,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,受外部国际环境变化和国内"去杠杆"影响,除上 证50之外A股市场整体持续下跌。家电、纺织服装、电子元器件等板块

於爾思及八;飛行、石間石市、古事故並屬性二字及表现表於,的於、深及、建筑等周期性板块也有工收益。 从国内去杠杆进程的整体节奏判断,我们还没有进入出清结束的 底部阶段,在此之前应该还会见到债务风险问题的陆续暴露和处置,对股票市场的压力也将持续。在出清过程的后半段,如果能建立起地方政府债务的制度性约束机制,重塑民营资本投资的长期信心,那么本轮出

跌幅较大;银行、石油石化、非银金融在三季度表现较好,钢铁、煤炭、建

清反而可以奠定未来长期发展的稳定基础。 本基金的配置思路,主要是自下而上选股,通过寻找和筛选个股的 基本面变化全取实现超额收益。2018年三季度,配置方向相对均衡。未 来将继续聚焦在自下而上的个股选择,争取获得更好的超额收益。 45 报告期内基金的业绩表现 本报告期基金净值增长率-6.64%,波动率1.05%,业绩比较基准收 益率-0.86%,波动率0.88%。

《5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

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. 报告期未按公元分别,此处的准规通投资股票投资组合本基金本报告期未投资港股通股票。 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 太基金本报告期末未持有股票...

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

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

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本基金本报告期末投资港股通股票。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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债券

本基金本报告期末未持有债券

贵金属投资明细 本基金本报告期末未持有贵金属。

本基金本报告期末未持有权证。

本基金本报告期末未投资股指期货

本报告期本基金未投资股指期货

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

本基本本权百别术未行月顷分。 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 在支持证券投资明细 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

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

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

内取得上述文件的复印件。 建信其金管理有限责任公司 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 5.10.1 本期国债期货投资政策 本报告期本基金未投资国债期货 5.10.2 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。 5.10.3 本期国债期货投资评价

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。 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

9 合计 14,096,551.84 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 由于四舍五人原因,分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动 上述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 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

1、中国证监会批准建信裕利灵活配置混合型证券投资基金设立的 2、《建信裕利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》: 2、《建信裕利灵石配自飛行望址穿校页基金基本口刊》; 3、《建信裕利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》; 4、《建信裕利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

、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; 、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。

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

建信基金管理有限责任公司

8.3 查阅方式 内取得上述文件的复印件。

单位:份