建信鑫利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: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	建信鑫利灵活配置混合
基金主代码	001858
交易代码	001858
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年11月4日
报告期末基金份额总额	389,540,523.85份
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,谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上,动态调整大类资产配置比例,同时将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,运用自上而下和自下而上相结合的个股、个券投资策略,在大类资产配置和证券选择两个层面上实现投资组合的双重优化。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:65%×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	本基金为混合型基金,其预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
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	-26,869,558.96
2.本期利润	-14,763,048.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0367
4.期末基金资产净值	349,615,185.98
5.期末基金份额净值	0.8975

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。

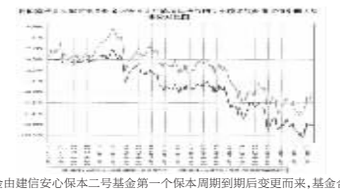
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-3.87%	0.75%	-0.86%	0.88%	-3.01%	-0.13%

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、本基金由建信安心保本二号基金第一个保本周期到期后变更而来,基金合同于2017年11月4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

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	2017年11月4日	2018年8月10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29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1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《建信鑫利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

2018第三季度,市场的运行总体上震荡趋弱。各板块之间分化较大,以大盘蓝筹为代表的上证50取得5%左右的正收益,而以中小股票为主的创业板指数同期下跌12%。从行业角度来看,石油石化、银行、钢铁、军工、非银涨幅居前,而服装、家电、轻工、医药等大消费板块调整较大。在若干负面事件的催发下,大消费板块整体经历了一轮“补跌”行情。

回顾三季度整体的运行态势,宏观政策取向从“去杠杆”到“稳杠杆”。央行期间实施降准操作,守住不发生系统性金融风险的底线。同时,地方政府在财政纪律上受到更严格的约束,基建投资下行趋势依然明显,但中央政府的基建项目获得增量支持,无论从特高压,还是铁路投资上都得到印证。

在3季度,本基金整体上保持较低的仓位,同时减持家电、电子等行业,加仓保险、银行,契合三季度市场风格,在组合的持续优化过程中,我们将在股息、ROE、估值三因素占优的行业和个股中寻求机会,为持有人争取相对超额回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-3.87%,波动率0.75%,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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	181,720,609.72	51.40
	其中:股票	181,720,609.72	51.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	60,513,040.00	17.12
	其中:债券	60,513,040.00	17.12
	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	106,896,448.63	30.23
8	其他资产	4,432,599.12	1.25
9	合计	353,562,697.47	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	23,612,635.20	6.75
C	制造业	87,635,447.39	25.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,096,573.05	1.17
E	建筑业	-	-
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	7,473,001.00	2.14
J	金融业	30,039,638.32	8.59
K	房地产业	21,507,768.00	6.15
L	租赁和商务服务业	7,355,546.76	2.10
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	181,720,609.72	51.98

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。

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	000968	蓝焰控股	1,696,310	23,612,635.20	6.75
2	000002	万科A	581,900	14,140,170.00	4.04
3	600872	中炬高新	372,915	12,157,029.00	3.48
4	603228	景旺电子	206,800	11,245,784.00	3.22
5	600271	航天信息	388,913	10,823,448.79	3.10
6	601318	中国平安	137,900	9,446,150.00	2.70
7	601336	新华保险	185,684	9,373,328.32	2.68
8	002262	恩华药业	589,200	8,219,340.00	2.35
9	001979	招商蛇口	394,200	7,367,598.00	2.11
10	601888	中国国旅	108,138	7,355,546.76	2.10

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	60,106,000.00	17.19
	其中:政策性金融债	60,106,000.00	17.19
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)	407,040.00	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	60,513,040.00	17.31

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	150216	15国开16	400,000	40,080,000.00	11.46
2	150317	15进出17	200,000	20,026,000.00	5.73
3	132010	17桐昆EB	2,560	407,040.00	0.12

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

本报告期本基金未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	266,025.19
2	应收证券清算款	3,266,751.49
3	应收股利	-
4	应收利息	898,910.45
5	应收申购款	911.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,432,599.12

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132010	17桐昆EB	407,040.00	0.12

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

报告期期初基金份额总额	425,173,378.07
报告期期间基金总申购份额	293,578.59
减:报告期期间基金总赎回份额	35,926,432.81
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	389,540,523.85

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

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鑫利灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信鑫利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

建信鑫安回报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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	建信鑫安回报灵活配置混合
基金主代码	001304
交易代码	001304
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月14日
报告期末基金份额总额	685,994,723.88份
投资目标	力争每年获得较高的绝对回报。
投资策略	本基金以自上而下的投资策略,灵活配置大类资产,动态控制组合风险,力争长期、稳定的绝对回报。
业绩比较基准	6%/年。
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,属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§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	-8,042,913.82
2.本期利润	3,814,987.17
3.加权平均基金份额本期利润	0.0055
4.期末基金资产净值	700,585,294.32
5.期末基金份额净值	1.021

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	0.59%	0.34%	1.54%	0.01%	-0.95%	0.33%

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		
牛兴华	本基金的基金经理	2015年5月14日	-	8	硕士,2008年毕业于英国卡迪夫大学国际经济、银行与金融学专业,同年进入神州数码中国有限公司,任投资专员;2010年9月,加入中诚信国际信用评级有限责任公司,担任高级分析师;2013年4月加入本公司,历任债券研究员、基金经理,2014年12月21至2017年6月30日任建信稳定得利债券型证券投资基金的基金经理;2015年4月17日起任建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年5月13日起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5月14日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年6月16日至2018年1月23日任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年7月2日至2015年11月25日任建信鑫和回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年10月29日至2017年7月12日任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理;2016年2月22日至2018年1月22日任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理;2016年10月25日至2017年12月6日任建信瑞盛添利混合型证券投资基金的基金经理;2016年12月23日至2018年4月23日任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2016年12月23日至2017年12月29日任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年3月13日起任建信鑫顺回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年4月20日起任建信安心保本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,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《建信鑫安回报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

三季度宏观经济运行整体平稳,PMI指数仍然维持在景气区间内,但增速有所放缓。需求端方面,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。基础设施投资增长4.2%,增速相比于二季度末下降较多,回落3.1个百分点是拖累三季度固定资产投资增速的主要原因;三季度虽然社融数据有所企稳,但资金向实体经济传导路径依然不畅致使基建投资增速持续下滑,宏观经济筑底过程仍将持续。三季度贸易战风波进一步发酵,为应对多变的国际形势,国内宏观政策转向维稳,央行三季度整体实施较为宽松的货币政策,并在9月底再次定向降准。汇率方面,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%。

在此背景下,三季度债券市场整体维持区间震荡态势,10年期国开债收益率相比于二季度末4.25%的位置下行5BP到4.20%,而10年国债收益率则上行13BP到3.61%。短端收益率随着资金价格下行明显,其中1年期国开债收益率下行将近60bp。权益市场方面,市场因贸易战升级进一步下调了对宏观经济的悲观预期,受此影响大盘指数呈现窄幅震荡态势,创业板指数持续创出新低,仅银行、石油石化等板块表现相对较好。

回顾三季度的基金管理工作,组合延续二季度杠杆票息策略,保持中等久期和适度的杠杆比例。由于本期内债券到期资产不多,短端利率快速下行并未对组合造成较大的再投资压力。权益方面,三季度末组合增加了对权益品种的配置比例,择机参与了包括股票和转债在内的权益产品的波段操作,并在三季度末市场反弹的过程中取得了较好的效果。另外积极参与新股及转债的一级申购以增厚组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率0.59%,波动率0.34%,业绩比较基准收益率1.54%,波动率0.01%。

§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	133,803,240.25	18.50
	其中:股票	133,803,240.25	18.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	534,720,629.48	73.95
	其中:债券	534,720,629.48	73.95
	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	44,792,048.69	6.19
8	其他资产	9,750,279.80	1.35
9	合计	723,066,198.22	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	95,535,170.25	13.64
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	16,609,597.00	2.37
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	18,326,253.00	2.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,332,220.00	0.48
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	133,803,240.25	19.10

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。

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	300398	飞凯材料	885,147	15,888,388.65	2.27
2	600519	贵州茅台	15,600	11,388,000.00	1.63
3	002027	分众传媒	1,242,300	10,571,973.00	1.51
4	601888	中国国旅	114,000	7,754,280.00	1.11
5	601398	工商银行	1,295,400	7,474,458.00	1.07
6	600487	亨通光电	293,400	7,009,326.00	1.00
7	601138	工业富联	490,300	6,981,872.00	1.00
8	600507	方大特钢	621,433	6,748,762.38	0.96
9	600019	宝钢股份	857,800	6,733,730.00	0.96
10	000786	北新建材	383,604	6,363,990.36	0.91

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	90,791,000.00	12.96
	其中:政策性金融债	50,035,000.00	7.14
4	企业债券	15,468,000.00	2.21
5	企业短期融资券	181,494,000.00	25.91
6	中期票据	162,276,000.00	23.16
7	可转债(可交换债)	84,691,629.48	12.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	534,720,629.48	76.32

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	113011	光大转债	503,570	54,566,845.20	7.79
2	101754065	17河钢集MTN009	500,000	50,715,000.00	7.24
3	101753012	17陕煤化MTN001	500,000	50,705,000.00	7.24
4	170211	17国开11	500,000	50,035,000.00	7.14
5	143480	18海通01	400,000	40,756,000.00	5.82

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	579,689.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,170,589.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,750,279.80

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	54,566,845.20	7.79
2	128024	宁行转债	24,896,928.97	3.55
3	123006	东财转债	4,507,723.71	0.64
4	110032	三一转债	15,231.60	0.00

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

报告期期初基金份额总额	785,995,017.37
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	100,000,293.49
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	685,994,723.88

§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	591,132,019.70	0.00	0.00	591,132,019.70	86.17%
	2	2018年07月01日-2018年07月11日	194,694,499.02	0.00	100,000,000.00	94,694,499.02	13.80%
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。

§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建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信鑫安回报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。

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

建信鑫丰回报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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	建信鑫丰回报灵活配置混合
基金主代码	001408
交易代码	001408
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月16日
报告期末基金份额总额	1,050,542,873.34份
投资目标	力争每年获得较高的绝对回报。
投资策略	本基金以自上而下的投资策略,灵活配置大类资产,动态控制组合风险,力争长期、稳定的绝对回报。
业绩比较基准	6%/年。
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,属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信鑫丰回报灵活配置混合A / 建信鑫丰回报灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	001408 / 002141
报告期末下属分级基金的份额总额	25,389,643.61份 / 1,025,153,229.73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)	
	建信鑫丰回报灵活配置混合A	建信鑫丰回报灵活配置混合C
1. 本期已实现收益	-247,227.45	-8,769,873.42
2. 本期利润	-173,292.20	-9,420,782.40
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0061	-0.0092
4.