建信创新中国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	建信创新中国混合
基金主代码	000308
交易代码	000308
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月24日
报告期末基金份额总额	41,668,572.59份
投资目标	在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略,本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势,判断当前所处的经济周期,进而对未来做出科学预测。在此基础上,结合对流动性及资金流向的分析,综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,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	-10,408,141.87
2.本期利润	-5,265,716.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1250
4.期末基金资产净值	85,914,447.87
5.期末基金份额净值	2.062

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。

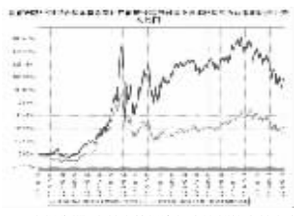
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-5.67%	1.32%	-1.19%	1.02%	-4.48%	0.30%

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		
邵卓	权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官、本基金的基金经理	2015年5月22日	-	8	硕士,权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官。2006年4月至2006年12月任明基(西门子)移动通信研发中心软件工程师;2007年2月至2010年7月任IBM中国软件实验室软件工程师;2010年7月加入广发证券公司,任计算机行业研究员。邵卓于2011年9月加入我公司研究部,历任研究员、研究主管,2015年3月24日起任建信信息产业股票型证券投资基金的基金经理;2015年5月22日起任建信创新中国混合型证券投资基金的基金经理;2017年12月19日起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,邵卓继续担任该基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信创新中国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、建筑等周期性板块也有正收益。

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争取实现超额收益。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-5.67%,波动率1.32%,业绩比较基准收益率-1.19%,波动率1.02%。

§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	53,979,586.28	60.86
	其中:股票	53,979,586.28	60.86
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	-	-
	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	32,007,430.44	36.09
8	其他资产	2,710,728.09	3.06
9	合计	88,697,744.81	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	2,186,154.08	2.54
B	采矿业	10,041,695.00	11.69
C	制造业	31,527,404.20	36.70
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	3,012,855.00	3.51
J	金融业	2,973,832.00	3.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,237,646.00	4.93
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	53,979,586.28	62.83

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沪港通股票。

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	600519	贵州茅台	6,818	4,977,140.00	5.79
2	601888	中国国旅	62,300	4,237,646.00	4.93
3	601088	中国神华	195,700	3,990,323.00	4.64
4	600566	济川药业	100,500	3,958,695.00	4.61
5	600312	平高电气	500,900	3,596,462.00	4.19
6	000968	蓝焰控股	221,100	3,077,712.00	3.58
7	600406	国电南瑞	170,700	3,012,855.00	3.51
8	601225	陕西煤业	341,800	2,973,660.00	3.46
9	300107	建新股份	175,000	2,418,500.00	2.82
10	002299	圣农发展	133,628	2,186,154.08	2.54

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于国债期货。

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于国债期货。

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	148,336.22
2	应收证券清算款	2,512,943.60
3	应收股利	-
4	应收利息	4,124.23
5	应收申购款	45,324.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,710,728.09

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

报告期期初基金份额总额	42,455,746.90
报告期期间基金总申购份额	2,131,728.67
减:报告期期间基金总赎回份额	2,918,902.98
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	41,668,572.59

总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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创新中国混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信创新中国混合型证券投资基金合同》;

3、《建信创新中国混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信创新中国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

建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

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:招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。

基金托管人招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	建信双利分级股票
场内简称	建信双利
基金主代码	165310
交易代码	165310
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月6日
报告期末基金份额总额	81,219,990.38份
投资目标	本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过自上而下的方式,通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析,深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题,在前述主题筛选和主题配置的基础上,本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具,采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。 从本基金所分离的两类基金份额来看,建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额;建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	建信双利分级股票	建信稳健	建信进取
下属分级基金的场内简称	建信双利	建信稳健	建信进取
下属分级基金的交易代码	165310	150036	150037
报告期末下属分级基金的份额总额	78,702,068.38份	1,007,168.00份	1,510,754.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。	建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额。	建信进取份额将表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。

§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	-10,916,603.54
2.本期利润	-2,057,410.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0236
4.期末基金资产净值	115,970,596.15
5.期末基金份额净值	1.428

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	-2.12%	1.27%	-1.92%	1.29%	-0.20%	-0.02%

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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理、本基金的基金经理	2015年3月25日	-	15	梁洪昀先生,金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师(CFA),博士。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司,历任金融工程部研究员,规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金(LOF)的基金经理;2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2011年9月8日至2016年7月20日任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金(ETF)及其联接基金的基金经理;2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金的基金经理;2015年3月25日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理;2015年7月31日至2018年7月31日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理;2015年8月6日至2016年10月25日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理;2018年2月6日起任建信创业板交易型开放式指数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19日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2018年5月16日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;2018年6月13日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

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《建信双利策略主题分级股票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

报告期内,投资者对于宏观经济形势的担忧有所缓解,但并未消散。相应地,股市没有像之前一个季度一样,出现单边快速下跌走势,但波动性依然较高,反弹与下跌互现,总体仍处于弱势中。

本基金受基金合同约束,股票投资比例不得低于90%,因此无法通过仓位调整规避市场下跌风险。管理人通过吸收投研团队的研究成果,以个股选择为主,进行大致均衡的行业配置和适度分散的组合持股策略,并辅以新股申购等其他手段,努力控制净值回撤,并力争超越业绩比较基准。总体看,这一策略在报告期内取得了预期的效果,但在报告期中期,遇到一定波折,出现回撤。基金管理人通过对组合的适当调整,使组合表现在报告期后期得以修复。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-2.12%,波动率1.27%,业绩比较基准收益率-1.92%,波动率1.29%。

§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	107,956,662.08	91.04
	其中:股票	107,956,662.08	91.04
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	-	-
	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	10,590,377.87	8.93
8	其他资产	31,258.59	0.03
9	合计	118,578,298.54	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	7,051,870.00	6.08
C	制造业	40,519,204.44	34.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	309,970.00	0.27
E	建筑业	3,961,214.20	3.42
F	批发和零售业	3,815,233.60	3.29
G	交通运输、仓储和邮政业	1,675,043.00	1.44
H	住宿和餐饮业	559,680.00	0.48
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,791,452.00	1.54
J	金融业	39,444,157.92	34.01
K	房地产业	5,892,961.88	5.08
L	租赁和商务服务业	2,248,918.00	1.94
M	科学研究和技术服务业	309,159.04	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	377,798.00	0.33
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	107,956,662.08	93.09

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	601318	中国平安	115,934	7,941,479.00	6.85
2	601166	兴业银行	349,500	5,574,525.00	4.81
3	600016	民生银行	845,340	5,359,455.60	4.62
4	601288	农业银行	1,296,200	5,042,218.00	4.35
5	601988	中国银行	1,149,300	4,275,396.00	3.69
6	600028	中国石化	582,000	4,143,840.00	3.57
7	601628	中国人寿	171,100	3,880,548.00	3.35
8	601229	上海银行	244,300	2,980,460.00	2.57
9	600104	上汽集团	81,901	2,725,665.28	2.35
10	601398	工商银行	409,700	2,363,969.00	2.04

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于国债期货。

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于国债期货。

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	18,323.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,042.89
5	应收申购款	10,892.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,258.59

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

报告期期初基金份额总额	94,977,826.76
报告期期间基金总申购份额	731,313.81
减:报告期期间基金总赎回份额	17,007,072.19
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	78,702,068.38

1、上述总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额;

2、拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§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双利策略主题分级股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信双利策略主题分级股票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MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年第3季度报告
2018年9月30日
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国国际金融股份有限公司
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。

基金托管人中国国际金融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MSCI中国A股国际通ETF
场内简称	建信MSCI
基金主代码	512180
交易代码	512180
基金运作方式	契约型开放式(ETF)
基金合同生效日	2018年4月19日
报告期末基金份额总额	1,434,048,000.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,采用完全复制法,即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况(比如流动性不足等)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代,或者对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,本基金的标的指数为MSCI中国A股国际通指数(英文:MSCI China A Inclusion RMB Index)。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高风险/高收益的开放式基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国国际金融股份有限公司

§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	-55,551,653.78
2.本期利润	-310,066.21
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0002
4.期末基金资产净值	1,313,025,662.23
5.期末基金份额净值	0.9156

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。

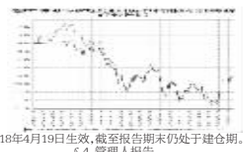
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.32%	1.31%	-1.78%	1.36%	1.46%	-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



本基金基金合同于2018年4月19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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理、本基金的基金经理	2018年4月19日	-	15	梁洪昀先生,金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师(CFA),博士。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司,历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金(LOF)的基金经理;2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2011年9月8日至2016年7月20日任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金(ETF)及其联接基金的基金经理;2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金的基金经理;2015年3月25日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理;2015年7月31日至2018年7月31日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理;2015年8月6日至2016年10月25日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理;2018年2月6日起任建信创业板交易型开放式指数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19日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2018年5月16日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;2018年6月13日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

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MSCI中国A股国际通交易型开放式指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