建信睿享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: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	建信睿享纯债债券
基金主代码	003681
交易代码	003681
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月8日
报告期末基金份额总额	5,600,000,997.94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	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	66,271,522.31
2.本期利润	91,053,042.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0163
4.期末基金资产净值	6,069,527,117.73
5.期末基金份额净值	1.0838

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。

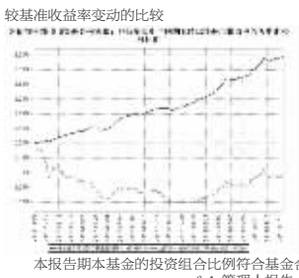
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.52%	0.04%	0.57%	0.07%	0.95%	-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		
黎颖芳	本基金的基金经理	2016年11月8日	-	17	硕士。2000年7月毕业于湖南大学金融保险学院,同年进入大成基金管理公司,在金融工程部、规划发展部任职。2005年11月加入本公司,历任研究员、高级研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理。2009年2月19日至2011年5月11日任建信稳定增利债券型证券投资基金的基金经理;2011年1月18日至2014年1月22日任建信保本混合型证券投资基金的基金经理;2012年11月15日起任建信纯债债券型证券投资基金的基金经理;2014年12月2日起任建信稳定增利债券型证券投资基金的基金经理;2015年12月8日起任建信稳定丰利债券型证券投资基金的基金经理;2016年6月1日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月8日起任建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月8日起任建信睿享纯债债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月15日至2017年8月3日任建信恒丰纯债债券型证券投资基金的基金经理;2017年1月6日起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。

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《建信睿享纯债债券型证券投资基金合同》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于临界点,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势。

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%。

三季度资本市场整体维持区间震荡态势,贸易战发酵下7月收益率小幅下行,但随后在政策向稳增长倾斜、通胀预期逐步加强以及地方债供给等因素下,8、9月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到4.20%,而10年国债收益率则上行13BP到3.61%。三季度转债市场前期受到股市下跌影响较大,但9月股市有所反弹转债市场有所回暖,总体看单季度中证转债指数实现了2.68%的正收益。

本基金3季度固定收益资产部分以中短久期、高票息及资质较好品种为主,波段操作了中长久期利率债,转债品种保持了低仓位。受益于中短端债券品种的上涨行情,前三季度组合年化收益率超过6%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率1.52%,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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,550,948,774.40	91.25
	其中:债券	5,550,948,774.40	91.25
	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	220,000,000.00	3.62
	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	200,139,911.38	3.29
8	其他资产	111,891,808.50	1.84
9	合计	6,082,980,494.28	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	89,242,000.00	1.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,028,395,000.00	16.94
	其中:政策性金融债	1,028,395,000.00	16.94
4	企业债券	1,083,210,000.00	17.85
5	企业短期融资券	2,628,988,000.00	43.31
6	中期票据	677,435,000.00	11.16
7	可转债(可交换债)	43,678,774.40	0.72
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,550,948,774.40	91.46

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	018005	国开1701	1,925,000	193,655,000.00	3.19
2	180208	18国开08	1,500,000	151,545,000.00	2.50
3	011800810	18重汽SCP002	1,500,000	151,230,000.00	2.49
4	011800744	18中铝集SCP006	1,500,000	150,660,000.00	2.48
5	180201	18国开01	1,300,000	130,572,000.00	2.15

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	14,540.11
2	应收证券清算款	10,519,177.57
3	应收股利	-
4	应收利息	101,358,090.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	111,891,808.50

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	5,600,001,007.88
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	9.94
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	5,600,000,997.94

§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	5,599,999,000.00	0.00	0.00	5,599,999,000.00	99.99%	
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睿享纯债债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信睿享纯债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信睿享纯债债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信睿享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。

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

建信社会责任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	建信社会责任混合
基金主代码	530019
交易代码	530019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月14日
报告期末基金份额总额	13,684,584.62份
投资目标	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	采用自上而下的资产配置和自下而上的股票选择相结合的投资策略,本基金在长期价值投资理念的基础上,坚持社会责任投资,重点考察企业社会责任的履行,立足企业基本面,努力实现本基金的投资目标。
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	中国农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	-2,689,883.41
2.本期利润	-2,301,339.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1694
4.期末基金资产净值	24,257,367.05
5.期末基金份额净值	1.773

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(不含公允价值变动收益)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收益。

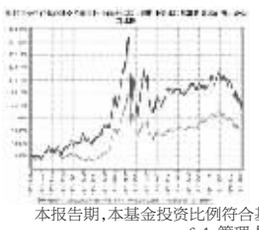
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-8.70%	1.24%	-1.19%	1.02%	-7.51%	0.22%

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,本基金投资比例符合基金合同要求。

§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		
许杰	权益投资部副总经理、本基金的基金经理	2012年8月14日	-	16	权益投资部副总经理,硕士,特许金融分析师(CFA)。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员,2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司,历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职,2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理;2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理;2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011年10月加入我公司,2012年3月21日至2017年1月24日任建信恒稳价值混合型证券投资基金的基金经理;2012年8月14日起任建信社会责任混合型证券投资基金的基金经理;2014年9月10日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的基金经理;2015年2月3日起任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年5月26日起任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年3月22日起任建信中小盘先锋股票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《建信社会责任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

报告期内中国面临的外部环境仍然错综复杂。美国经济处于景气度高的阶段,美联储连续加息,资金回流美国,部分国家出现货币危机,其它部分新兴经济体仍然面临较高的风险。美国对中国进口的商品加征第二轮关税,为全球经济蒙上一层阴影。

为应对发生明显变化的外部环境,国家提出财政政策要在扩大内需和结构调整上发挥更大作用,加大基础设施等领域补短板的力度。7月份央行实施年内第二次定向降准,货币政策从中性偏紧转向稳健中性,资金面边际宽松,信用利差有所降低。三季度内股票市场出现震荡走势。

资产配置方面,本基金三季度维持了中性的股票资产配置。行业和股票配置方面,本基金报告期内继续围绕创新和消费这两个代表中国经济发展方向的领域,重点配置了相关行业中竞争力突出、业绩确定性增长、估值具有安全边际同时积极履行社会责任的公司。此外,本季度适度增加了对电网设备、铁路车辆等国家计划加大投资的先进行业的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-8.7%,波动率1.24%,业绩比较基准收益率-1.19%,波动率1.02%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,自2018年7月1日至2018年9月30日,本基金基金资产净值低于五千万元超过连续20个工作日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》(2014年8月8日生效)第四十一条的要求,现将该情况在本次报告中予以披露。

§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	19,571,497.41	74.54
	其中:股票	19,571,497.41	74.54
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	6,528,918.97	24.86
8	其他资产	157,504.48	0.60
9	合计	26,257,920.86	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	438,448.00	1.81
B	采矿业	2,491,207.88	10.27
C	制造业	11,495,135.03	47.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,221,426.00	5.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	514,694.00	2.12
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	2,264,199.00	9.33
J	金融业	1,146,387.50	4.73
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	19,571,497.41	80.68

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	300316	晶盛机电	111,583	1,254,192.92	5.17
2	000968	蓝焰控股	85,600	1,191,552.00	4.91
3	600519	贵州茅台	1,557	1,136,610.00	4.69
4	002812	创新股份	18,107	779,506.35	3.21
5	600900	长江电力	44,700	732,186.00	3.02
6	600406	国电南瑞	41,300	728,945.00	3.01
7	002624	完美世界	24,500	591,920.00	2.44
8	600312	平高电气	79,800	572,964.00	2.36
9	600339	中油工程	100,067	564,377.88	2.33
10	601318	中国平安	7,807	534,779.50	2.20

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	28,181.65
2	应收证券清算款	121,854.55
3	应收股利	-
4	应收利息	1,144.25
5	应收申购款	6,324.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	157,504.48

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	13,388,157.62
报告期期间基金总申购份额	813,758.19
减:报告期期间基金总赎回份额	517,331.19
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	13,684,584.62

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社会责任混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信社会责任混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信社会责任混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信社会责任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

建信睿盈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:广发证券股份有限公司
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。

基金托管人广发证券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	建信睿盈灵活配置混合	
基金主代码	000994	
交易代码	000994	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年2月3日	
报告期末基金份额总额	177,781,003.96份	
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置和主动的投资管理,在精选个股、个券的基础上适度集中投资,在严格控制风险的前提下,谋求基金资产的长期、稳定增值。	
投资策略	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、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率(全价)×35%	
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	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信睿盈灵活配置混合A	建信睿盈灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	000994	000995
报告期末下属分级基金的份额总额	109,818,494.54份	67,962,509.42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)	
	建信睿盈灵活配置混合A	建信睿盈灵活配置混合C
1. 本期已实现收益	-11,236,539.27	-6,813,144.88
2. 本期利润	-9,549,437.86	-5,774,563.25
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0863	-0.0848
4. 期末基金资产净值	97,946,426.39	58,481,738.65
5. 期末基金份额净值	0.892	0.860

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

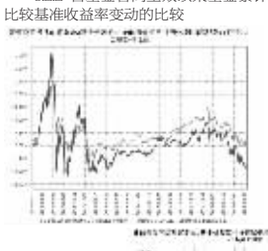
建信睿盈灵活配置混合A

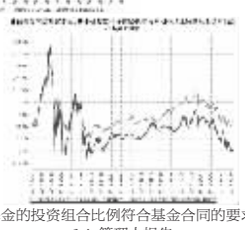
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.79%	1.19%	-1.01%	0.88%	-7.78%	0.31%

建信睿盈灵活配置混合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	-9.09%	1.19%	-1.01%	0.88%	-8.08%	0.31%

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		
许杰	权益投资部副总经理、本基金的基金经理	2015年2月3日	-	16	权益投资部副总经理,硕士,特许金融分析师(CFA)。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员,2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司,历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职,2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理;2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理;2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011年10月加入我公司,2012年3月21日至2017年1月24日任建信恒稳价值混合型证券投资基金的基金经理;2012年8月14日起任建信社会责任混合型证券投资基金的基金经理;2014年9月10日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的基金经理;2015年2月3日起任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年5月26日起任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年3月22日起任建信中小盘先锋股票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《建信睿盈灵活配置混合