# 建信健康民生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:中国光大银行股份有限公司
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 | 建信健康民生混合 |
| 基金主代码 | 000547 |
| 交易代码 | 000547 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年3月21日 |
| 报告期末基金份额总额 | 33,491,718.22份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于有利于提升居民健康水平和促进国计民生的行业及公司,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金的股票投资包含健康和民生这两大主题,本基金将精选有利于提升居民健康水平和促进国计民生的公司进行投资。<br>在债券组合的构造和调整上,本基金综合运用久期管理、期限配置策略、类属配置管理、套利策略等组合管理手段进行日常管理,获取稳健增值的机会。 |
| 业绩比较基准 | 70%×沪深300指数收益率+30%×中债综合全价(总值)指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金,其风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。 |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 |

§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 | -5,091,662.70 |
| 2.本期利润 | -4,314,333.32 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1285 |
| 4.期末基金资产净值 | 64,364,851.82 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.922 |

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。

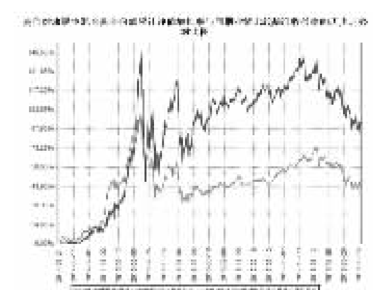
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | -6.24% | 1.08% | -1.15% | 0.95% | -5.09% | 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



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 | | |
| 姜锋 | 权益投资部执行投资官、本基金的基金经理 | 2014年3月21日 | - | 11 | 硕士,权益投资部执行投资官。2007年7月加入本公司,历任研究员、基金经理、资深基金经理、权益投资部执行投资官。2011年7月11日起任建信优势动力股票型证券投资基金的基金经理,该基金于2013年3月19日起转型为建信优势动力混合型证券投资基金(LOF),姜锋继续担任该基金的基金经理;2014年3月21日起任建信健康民生混合型证券投资基金的基金经理;2015年4月22日起任建信环保产业股票型证券投资基金的基金经理。 |
| 孙晟 | 本基金的基金经理 | 2016年3月30日 | 2018年9月12日 | 6 | 2011年7月至2013年6月就职于华夏基金管理公司,任研究员;2013年6月加入我公司,历任研究员、研究主管、基金经理等职务;2016年3月30日至2018年9月12日任建信健康民生混合型证券投资基金的基金经理;2017年3月8日起任建信中国制造2025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《建信健康民生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3季度国内外经济形势错综复杂。国际方面,贸易摩擦此起彼伏,美国先后开启与贸易伙伴新协议的谈判与签署,全球贸易格局步入重塑进程。中国政府也同美国开启了一系列的谈判,截止目前取得的共识相对有限。经济层面上,美国经济一枝独秀,持续强劲增长,尽管面临贸易摩擦影响但中国出口依然取得较快增长。国内方面,随着经济的缓慢下滑,政府也相继出台了各种政策措施进行对冲,提出了稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、稳投资、稳预期的总体应对方针。金融政策方面,配合资管新规的出台,央行连续下调了存款准备金率,为金融机构创造宽松的货币环境;财政政策方面,国务院调整企业社保缴费政策,提高个人所得税标准,研究进一步降低企业税费政策。考虑到上半年基建增速的回落,发改委开始批复和储备大型项目来对冲固定资产投资的下降。上市公司层面,中期业绩显示企业利润增速开始缓慢回落,结合宏观数据预期,预计业绩增速将呈现逐季回落态势。分行业来看,上游原材料行业业绩依然靓丽,三季度随着原油价格的持续上涨,预计相关公司经营也将受益。股票市场三季度呈现整体宽幅震荡格局,受益于油价上涨的石油行业领涨,大消费板块则大幅调整。

本基金3季度在控制系统性风险的前提下,主要配置低估值的地产,均衡配置了消费股和科技股,自上而下选择天然气作为战略配置方向。7月和8月本基金坚持低仓位操作,适当参与科技股的反弹,为基金取得一定的超额收益;9月份组合布局地产和军工反弹,受制于相关政策的扰动总体表现一般。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-6.24%,波动率1.08%,业绩比较基准收益率-1.15%,波动率0.95%。

§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 | 50,033,502.68 | 76.45 |
| | 其中:股票 | 50,033,502.68 | 76.45 |
| 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 | 15,297,941.63 | 23.37 |
| 8 | 其他资产 | 114,318.30 | 0.17 |
| 9 | 合计 | 65,445,762.61 | 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 | 5,090,080.00 | 7.91 |
| C | 制造业 | 23,948,937.68 | 37.21 |
| 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 | 9,099,578.00 | 14.14 |
| J | 金融业 | 1,986,782.00 | 3.09 |
| K | 房地产业 | 7,268,949.00 | 11.29 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,639,176.00 | 4.10 |
| 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 | 50,033,502.68 | 77.73 |

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 | 320,000 | 4,454,400.00 | 6.92 |
| 2 | 001979 | 招商蛇口 | 212,100 | 3,964,149.00 | 6.16 |
| 3 | 002262 | 恩华药业 | 251,000 | 3,501,450.00 | 5.44 |
| 4 | 000002 | 万科A | 136,000 | 3,304,800.00 | 5.13 |
| 5 | 600872 | 中炬高新 | 90,000 | 2,934,000.00 | 4.56 |
| 6 | 601888 | 中国国旅 | 38,800 | 2,639,176.00 | 4.10 |
| 7 | 300170 | 汉得信息 | 211,000 | 2,333,660.00 | 3.63 |
| 8 | 300383 | 光环新网 | 154,400 | 2,220,272.00 | 3.45 |
| 9 | 002179 | 中航光电 | 45,300 | 1,993,200.00 | 3.10 |
| 10 | 300253 | 卫宁健康 | 137,700 | 1,985,634.00 | 3.08 |

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 | 82,951.36 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,302.24 |
| 5 | 应收申购款 | 28,064.70 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 114,318.30 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300383 | 光环新网 | 2,220,272.00 | 3.45 | 重大事项 |

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 | 33,593,288.61 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,480,040.20 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 1,581,610.59 |
| 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 | 33,491,718.22 |

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

本基金本报告期末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健康民生混合型证券投资基金设立的文件;
2、《建信健康民生混合型证券投资基金基金合同》;
3、《建信健康民生混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信健康民生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

# 建信全球机遇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

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 建信全球机遇混合(QDII) |
| 基金主代码 | 539001 |
| 交易代码 | 539001 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年9月14日 |
| 报告期末基金份额总额 | 44,578,317.24份 |
| 投资目标 | 本基金通过全球化的资产配置和组合管理,在分散和控制投资风险的同时追求基金资产长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金采取"自上而下"的资产配置与"自下而上"的证券选择相结合、定量研究与定性研究相结合、组合构建与风险控制相结合的投资策略进行投资组合的构建。 |
| 业绩比较基准 | 标准普尔全球BMI市场指数总收益率(S&P Global BMI)×70%+标准普尔BMI中国(除A、B股)指数总收益率(S&P BMI China ex-A-B-Shares)×30% |
| 风险收益特征 | 本基金为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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 境外投资顾问 | 英文名称:Principal Global Investors, LLC |
| | 中文名称:信安环球投资有限公司 |
| 境外资产托管人 | 英文名称:Brown Brothers Harriman & Co. |
| | 中文名称:布朗兄弟哈里曼银行 |

§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 | 2,477,509.24 |
| 2.本期利润 | 1,381,540.90 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0321 |
| 4.期末基金资产净值 | 66,613,415.21 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.494 |

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。

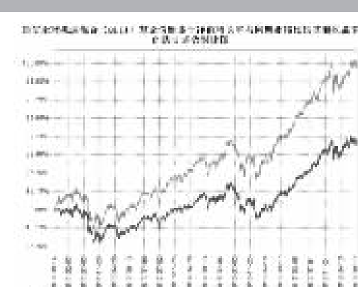
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 2.33% | 0.61% | 4.74% | 0.50% | -2.41% | 0.11% |

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、本基金业绩比较基准计价货币为人民币。

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 | | |
| 李博涵 | 本基金的基金经理 | 2017年11月13日 | - | 13 | 李博涵先生,海外投资部副总经理,硕士,加拿大籍华人。曾就职于美国联邦快递北京分公司、美国联合航空公司北京分公司和美国万事达卡国际组织北京分公司。2005年2月起加入加拿大蒙特利尔银行,任全球资本市场投资助理;2006年8月起加入加拿大帝国商业银行,任全球资本市场投资顾问;2008年8月加入我公司海外投资部,历任高级研究员兼基金经理助理、基金经理,2018年5月起兼任部门副总经理;2013年8月5日起任建信全球资源混合型证券投资基金的基金经理;2017年11月13日起任建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金的基金经理。 |

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

| 姓名 | 在境外投资顾问所任职务 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|
| Mustafa Sagun | 首席投资官 | 22 | Mustafa Sagun是信安环球股票的首席投资官。他负责监督所有国际、国内和全球股票策略的投资组合管理和研究。Mustafa在2000年加入公司。他从2002年开始就担任全球股票组合的主管基金经理,而在2006年开始担任首席投资官。他之前也担任公司资产配置策略团队的成员。Mustafa的职业生涯开始于1991年,曾担任过投资管理,研究和风险管理的职位。在加入信安之前,他是PNC金融服务集团的副总裁和分析师和 Salomon Brothers 的股票衍生品专家。Mustafa从University of South Florida取得金融学Ph.D.学位和国际经济学MA学位。他从土耳其的Bogazici University取得电子和工程的学士学位。Mustafa获得了使用特许金融分析师称号的权利。他是CFA Institute和CFA Society of Iowa的成员。 |
| Christopher Ibach | 投资组合经理 | 19 | Christopher Ibach负责监督支持所有股票策略的全球研究&发展,包括全球量化研究、股票选择模型发展、投资组合构建和风险管理。他作为共同基金经理,专精于主动核心、机会型的和专业全球组合。Chris也监督公司的系统策略团队,负责被动增强和被动股票组合。他在2000年作为股票研究分析师加入公司,专精于分析国际科技公司并在2002年成为基金经理。在此之前,Chris在Motorola, Inc取得了6年的相关行业经验。Chris从University of Iowa获得了金融学MBA学位和电子工程学士学位。Chris获得了使用特许金融分析师称号的权利并且是CFA Institute的成员。 |
| 王曦 | 投资组合经理 | 13 | 王曦在信安担任香港和中国投资组合的基金经理,他也是我们的高级投资分析师和大中华区研究团队负责人。王曦的金融职业生涯开始于中国银行总行,担任财务总监执行助理超过3年时间,也为该行IPO准备工作提供支持。王曦在2003年加入信安,担任香港和中国股票市场的基金经理以及亚洲和新兴市场策略的助理基金经理。作为全球研发团队的资深成员,王曦也负责我们全球研究平台(GRP)的模型搭建,特别是亚洲和大中华选股模型。他也曾在建设银行和信安的中国合资公司成立之初时任高级顾问。王曦在2008年离开信安,曾在中国平安资产管理公司(香港)担任股票投资总监,也曾任贝莱德亚洲的基金经理。王曦持有爱荷华大学Tippie管理学院的MBA学位,中国人民大学经济学和国际金融学学士学位。他执有特许金融分析师(CFA)资格。 |

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《建信全球机遇混合型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

美国债利率快速上行,美国经济基本面表现超预期,新兴市场货币大幅贬值,全球股票市场美国一枝独秀构成了3季度的市场格局。

全球股市3季度几乎悉数下跌。美国工业PMI持续处于高位,失业率较低,薪资水平上涨超预期,CPI稳健上涨;美国标普指数上涨7.2%,9月,美国联邦储备委员决定将基准利率上调25个基点至2.00%-2.25%区间,符合市场广泛预期,年内预期仍将加息4次。欧洲工业PMI继续回调;经济增长不及预期,量宽体量的减少对市场构成进一步压力。

新兴市场表现欠佳。由于美元升值,资金流出新兴市场,同时一些新兴市场国家货币也出现较大幅度的贬值,市场情绪受到一定打击。另外贸易战也对新兴市场国家造成较大影响。

本报告期基金净值增长率2.33%,波动率0.61%,业绩比较基准收益率4.74%,波动率0.5%。

§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(人民币元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 45,116,689.41 | 66.37 |
| | 其中:普通股 | 42,230,767.60 | 62.12 |
| | 优先股 | - | - |
| | 存托凭证 | 2,885,921.81 | 4.25 |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 6,264,311.98 | 9.22 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中:远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 16,191,687.01 | 23.82 |
| 8 | 其他资产 | 405,484.60 | 0.60 |
| 9 | 合计 | 67,978,173.00 | 100.00 |

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家(地区) | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 美国 | 24,178,868.19 | 36.30 |
| 中国香港 | 8,712,647.17 | 13.08 |
| 英国 | 2,737,000.03 | 4.11 |
| 德国 | 1,840,489.34 | 2.76 |
| 法国 | 1,802,182.50 | 2.71 |
| 日本 | 1,572,059.17 | 2.36 |
| 澳大利亚 | 1,423,484.04 | 2.14 |
| 加拿大 | 1,218,411.90 | 1.83 |
| 韩国 | 1,020,742.67 | 1.53 |
| 意大利 | 610,804.40 | 0.92 |
| 合计 | 45,116,689.41 | 67.73 |

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 信息技术 | 12,397,016.73 | 18.61 |
| 必需消费品 | 1,800,385.58 | 2.70 |
| 电信服务 | 649,658.29 | 0.98 |
| 工业 | 3,681,611.61 | 5.53 |
| 医疗保健 | 5,075,086.31 | 7.62 |
| 非必需消费品 | 6,606,470.67 | 9.92 |
| 金融 | 9,664,093.94 | 14.51 |
| 能源 | 2,436,897.49 | 3.66 |
| 公用事业 | 556,187.38 | 0.83 |
| 材料 | 2,249,281.41 | 3.38 |
| 合计 | 45,116,689.41 | 67.73 |

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | TENCENT HOLDINGS LTD | 腾讯控股 | KYG875721634 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 6,600 | 1,877,038.94 | 2.82 |
| 2 | ALIBABA GROUP HOLD-ING-SP ADR | 阿里巴巴集团控股有限公司 | US01609W1027 | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,169 | 1,324,964.46 | 1.99 |
| 3 | BAXTER INTERNA-TIONAL INC | 百特 | US0718131099 | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,283 | 1,210,714.92 | 1.82 |
| 4 | AMGEN INC | AM-GEN-T | US0311621009 | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 831 | 1,184,997.16 | 1.78 |
| 5 | VALERO ENERGY CORP | Valero 能源 | US91913Y1001 | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,455 | 1,138,550.60 | 1.71 |
| 6 | APPLE INC | 苹果公司 | US0378331005 | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 731 | 1,135,177.65 | 1.70 |
| 7 | JPMORGAN CHASE & CO | 摩根大通 | US46625H1005 | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,388 | 1,077,433.51 | 1.62 |
| 8 | SAMSUNG ELECTRON-ICS CO LTD | 三星电子有限公司 | KR7005930003 | 韩国证券交易所 | 韩国 | 3,543 | 1,020,742.67 | 1.53 |
| 9 | ALPHABET INC-CL C | Alphabet公司 | US02079K1079 | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 117 | 960,583.90 | 1.44 |
| 10 | WALMART INC | 沃尔玛股份有限公司 | US9311421039 | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,476 | 953,533.89 | 1.43 |

注:所有证券代码采用ISIN码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | ISHARES CORE S&P 500 ETF | ETF基金 | 交易型开放式指数 | BlackRock Fund Advisors | 6,041,244.65 | 9.07 |
| 2 | ISHARES MSCI CHINA INDEX ETF | ETF基金 | 交易型开放式指数 | BlackRock Asset Management North Asia Ltd | 223,067.33 | 0.33 |

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(人民币元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 65,395.10 |
| 4 | 应收利息 | 1,060.78 |
| 5 | 应收申购款 | 339,028.72 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 405,484.60 |

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 | 40,772,239.98 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 10,212,664.73 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 6,406,587.47 |
| 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 | 44,578,317.24 |

§7 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信全球机遇混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信全球机遇混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信全球机遇混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信全球机遇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

# 建信全球资源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

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 建信全球资源混合(QDII) |
| 基金主代码 | 539003 |
| 交易代码 | 539003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年6月26日 |
| 报告期末基金份额总额 | 32,816,836.16份 |
| 投资目标 | 通过全球化的资产配置和组合管理,优选资源类相关行业的股票进行投资,在控制风险的同时,追求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金在投资策略方面,将采取自上而下的资产配置与自下而上的证券选择相结合、定量研究与定性研究相结合、组合构建与风险控制相结合等多种方式进行投资组合的构建。 |
| 业绩比较基准 | 50%×MSCI全球能源行业净总收益指数收益率(MSCI ACWI Energy Net Total Return Index)+50%×MSCI全球原材料行业净总收益指数收益率(MSCI ACWI Material Net Total Return Index)。 |
| 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 | 中国银行股份有限公司 |
| 境外投资顾问 | 英文名称:Principal Global Investors, LLC. |
| | 中文名称:信安环球投资有限公司 |
| 境外资产托管人 | 英文名称:Deutsche Bank AG, Singapore Branch |
| | 中文名称:德意志银行新加坡分行 |

§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 | 27,409.80 |
| 2.本期利润 | 1,577,217.88 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0503 |
| 4.期末基金资产净值 | 31,464,453.49 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.959 |

注: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。

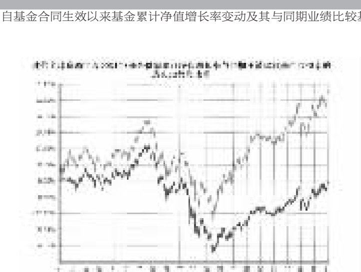
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 5.62% | 0.81% | 5.23% | 0.70% | 0.39% | 0.11% |

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、本基金业绩比较基准计价货币为人民币。

2、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 | | |
| 李博涵 | 本基金的基金经理 | 2013年8月5日 | - | 13 | 李博涵先生,海外投资部副总经理,硕士,加拿大籍华人。曾就职于美国联邦快递北京分公司、美国联合航空公司北京分公司和美国万事达卡国际组织北京分公司。2005年2月起加入加拿大蒙特利尔银行,任全球资本市场投资助理;2006年8月起加入加拿大帝国商业银行,任全球资本市场投资顾问;2008年8月加入我公司海外投资部,历任高级研究员兼基金经理助理、基金经理,2018年5月起兼任部门副总经理;2013年8月5日起任建信全球资源混合型证券投资基金的基金经理;2017年11月13日起任建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金的基金经理。 |

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

| 姓名 | 在境外投资顾问所任职务 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|
| Mo-hammed Zaidi | 投资组合经理 | 16 | Mohammed Zaidi是信安环球股票的基金经理。他在新加坡办公,担任全球新兴市场股票策略的共同基金经理及新兴亚洲股票策略负责人。Mohammed的职业生涯开始于1997年,在全球宏观对冲基金管理人 VZB Capital 担任新兴市场分析师及基金经理。他在2001年作为新兴市场股票分析师加入信安,专注于基础选股工作,并且是负责信安内部研发的全球研究平台(GRP)初始搭建的核心分析师之一。他专注于将GRP调整适用于新兴市场和亚洲股票。在2006年离开公司后,他曾经担任Martin Currie投资管理公司的新兴市场基金经理和分析师。在那之前服务于该团队的前任雇主Scottish Widows投资合伙公司。他持有麻省理工学院斯隆管理学院MBA学位,宾夕法尼亚大学沃顿学院经济学学士学位。 |

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《建信全球资源混合型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

原油价格在3季度震荡上扬,主要影响因素为美元指数回调。目前油价主要受制于美国与伊朗的关系。11月4日,美国将对伊朗启动第二轮全面制裁。短期油价已部分计入该因素,但OPEC产能短期难以填补伊朗原油出口的空缺,长期仍需观察原油需求。

9月,美国联邦储备委员决定将基准利率上调25个基点至2.00%-2.25%区间,符合市场广泛预期。美国通胀有所上扬,年内加息4次预期加强,但预计会在2019-20年更加陡峭地加息。

本报告期基金净值增长率5.62%,波动率0.81%,业绩比较基准收益率5.23%,波动率0.70%。

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(人民币元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 23,953,202.95 | 73.71 |
| | 其中:普通股 | 14,340,467.68 | 44.13 |
| | 优先股 | - | - |
| | 存托凭证 | 9,612,735.27 | 29.58 |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 1,943,281.13 | 5.98 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中:远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 6,270,814.56 | 19.30 |
| 8 | 其他资产 | 328,954.75 | 1.01 |
| 9 | 合计 | 32,496,253.39 | 100.00 |

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家(地区) | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 美国 | 21,231,746.37 | 67.48 |
| 中国香港 | 2,721,456.58 | 8.65 |
| 合计 | 23,953,202.95 | 76.13 |

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| 能源 | 13,082,561.13 | 41.58 |
| 原材料 | 10,870,641.82 | 34.55 |
| 合计 | 23,953,202.95 | 76.13 |

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量(股) | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | EXXON MOBIL CORP | 埃克森美孚石油 | US30231G1022 | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,820 | 1,649,332.23 | 5.24 |
| 2 | TOTAL SA-SPON ADR | 道达尔 | US89151E1091 | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,182 | 966,520.58 | 3.07 |
| 3 | BP PLC-SPONS ADR | 碧辟公司 | US0556221044 | 纽约证券交易所 | 美国 | 2,984 | 946,319.26 | 3.01 |
| 4 | ASIA CEMENT CHINA HOLDINGS | 亚洲水泥(中国) | KYG0539C1069 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 130,000 | 923,155.55 | 2.93 |
| 5 | CHEVRON CORP | 雪佛龙 | US1667641005 | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,050 | 883,248.00 | 2.81 |
| 6 | BASF SE-SPON ADR | 巴斯夫欧洲公司 | US0552625057 | 纽约证券交易所 | 美国 | 5,482 | 837,578.51 | 2.66 |
| 7 | ROYAL DUTCH SHELL-SPON ADR-B | 荷兰皇家壳牌 | US7802591070 | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,686 | 822,669.63 | 2.61 |
| 8 | VALERO ENERGY CORP | Valero能源 | US91913Y1001 | 纽约证券交易所 | 美国 | 924 | 723,038.32 | 2.30 |
| 9 | LYONDELL-BASELL INDU-CL A | 利安德巴塞尔工业公司 | NL0009434992 | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,010 | 712,238.66 | 2.26 |
| 10 | ROYAL DUTCH SHELL-SPON ADR-A | 荷兰皇家壳牌 | US7802592060 | 纽约证券交易所 | 美国 | 1,490 | 698,435.55 | 2.22 |

注:所有证券代码采用ISIN码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | ISHARES CORE S&P 500 ETF | ETF基金 | 交易型开放式指数 | BlackRock Fund Advisors | 1,308,936.34 | 4.16 |
| 2 | ISHARES MSCI CHINA ETF | ETF基金 | 交易型开放式指数 | BlackRock Fund Advisors | 411,995.29 | 1.31 |
| 3 | ISHARES GLOBAL ENERGY ETF | ETF基金 | 交易型开放式指数 | BlackRock Fund Advisors | 129,741.71 | 0.41 |
| 4 | ISHARES GLOBAL MATERIALS ETF | ETF基金 | 交易型开放式指数 | BlackRock Fund Advisors | 92,607.79 | 0.29 |

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(人民币元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 59,171.24 |
| 4 | 应收利息 | 819.94 |
| 5 | 应收申购款 | 268,963.57 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 328,954.75 |

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不存在流通受限情况。

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 | 30,445,205.35 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,821,085.30 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 2,449,454.49 |
| 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 | 32,816,836.16 |

§7 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 影响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 | 17,454,372.30 | 0.00 | 0.00 | 17,454,372.30 | 53.19% |
| 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全球资源混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信全球资源混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信全球资源混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信全球资源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