建信多因子量化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: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	建信多因子量化股票
基金主代码	002962
交易代码	002962
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月9日
报告期末基金份额总额	42,546,237.68份
投资目标	在有效控制风险的基础上,力争获取稳定、持续超越业绩比较基准的投资回报,实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用多因子量化型投资策略,综合技术、财务、情绪等多方面指标,精选股票进行投资,优化调整投资组合,力争实现高于业绩基准的投资收益和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:85%×中证800指数收益率+15%×商业银行活期存款利率(税前)。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	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	-7,489,745.86
2.本期利润	-3,791,888.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0881
4.期末基金资产净值	36,639,837.87
5.期末基金份额净值	0.8612

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。

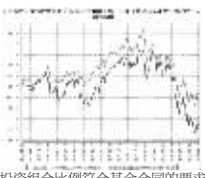
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-9.26%	1.20%	-2.93%	1.12%	-6.33%	0.08%

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		
叶乐天	金融工程及指数投资部副总经理、本基金的基金经理	2016年8月9日	-	10	叶乐天先生,金融工程及指数投资部副总经理,硕士。2008年5月至2011年9月就职于中国国际金融有限公司,历任市场风险管理分析员、量化分析经理,从事风险模型、量化研究与投资。2011年9月加入建信基金管理有限责任公司,历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理,2012年3月21日至2016年7月20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;2013年3月28日起任建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金的基金经理;2014年1月27日起任建信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理;2015年8月26日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理;2016年8月9日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理;2017年4月18日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理;2017年5月22日起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;2018年1月10日起任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年8月24日起任建信量化优享定期开放灵活配置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《建信多因子量化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

在报告期内,基金管理人以量化分析研究为基础,利用量化模型优选个股和风险管理,坚持量化策略,尽量控制回撤。受中美贸易战等多重因素影响,市场有较大幅度下跌,基金净值仍出现一定程度回调。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-9.26%,波动率1.2%,业绩比较基准收益率-2.93%,波动率1.12%。

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	30,310,217.03	81.15
	其中:股票	30,310,217.03	81.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,515,000.00	6.73
	其中:债券	2,515,000.00	6.73
	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	2,000,000.00	5.35
	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	2,451,782.29	6.56
8	其他资产	73,259.77	0.20
9	合计	37,350,259.09	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	146,738.36	0.40
B	采矿业	600,510.78	1.64
C	制造业	17,404,985.17	47.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	357,708.00	0.98
E	建筑业	1,017,779.76	2.78
F	批发和零售业	1,729,463.00	4.72
G	交通运输、仓储和邮政业	770,846.70	2.10
H	住宿和餐饮业	196,470.00	0.54
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,746,052.19	4.77
J	金融业	3,913,756.00	10.68
K	房地产业	1,165,094.73	3.18
L	租赁和商务服务业	293,437.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	190,019.00	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	441,874.60	1.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,812.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	315,293.74	0.86
S	综合	18,396.00	0.05
	合计	30,310,217.03	82.72

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	13,300	911,050.00	2.49
2	601166	兴业银行	49,700	792,715.00	2.16
3	601988	中国银行	121,000	450,120.00	1.23
4	600031	三一重工	46,700	414,696.00	1.13
5	002316	亚联发展	51,600	386,484.00	1.05
6	600018	上港集团	69,900	378,159.00	1.03
7	601390	中国中铁	48,300	375,291.00	1.02
8	000651	格力电器	9,100	365,820.00	1.00
9	300424	航新科技	17,300	326,105.00	0.89
10	600036	招商银行	10,500	322,245.00	0.88

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	2,515,000.00	6.86
	其中:政策性金融债	2,515,000.00	6.86
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,515,000.00	6.86

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	25,000	2,515,000.00	6.86

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	16,094.75
2	应收证券清算款	551.74
3	应收股利	-
4	应收利息	55,051.92
5	应收申购款	1,561.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	73,259.77

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	43,535,090.97
报告期期间基金总申购份额	551,519.11
减:报告期期间基金总赎回份额	1,540,372.40
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	42,546,237.68

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多因子量化股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信多因子量化股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信多因子量化股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信多因子量化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

建信天添益货币市场基金

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:江苏银行股份有限公司
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。

基金托管人江苏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	建信天添益货币
基金主代码	003391
交易代码	003391
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月18日
报告期末基金份额总额	10,609,515,227.56份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现稳定的、超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取个券选择策略、利率策略等多种投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	建信天添益货币A	建信天添益货币B	建信天添益货币C
下属分级基金的交易代码	003391	003392	003393
报告期末下属分级基金的份额总额	276,118,593.42份	213,513,563.46份	10,119,883,080.68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)		
	建信天添益货币A	建信天添益货币B	建信天添益货币C
1. 本期已实现收益	2,968,113.12	2,887,574.91	111,134,017.05
2. 本期利润	2,968,113.12	2,887,574.91	111,134,017.05
3. 期末基金资产净值	276,118,593.42	213,513,563.46	10,119,883,080.68

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入本期公允价值变动收益,由于该基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信天添益货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8459%	0.0013%	0.3403%	0.0000%	0.5056%	0.0013%

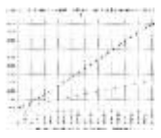
建信天添益货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7846%	0.0013%	0.3403%	0.0000%	0.4443%	0.0013%

建信天添益货币C

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8459%	0.0013%	0.3403%	0.0000%	0.5056%	0.0013%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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		
陈建良	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2016年10月18日	-	11	陈建良先生,双学士,固定收益投资部副总经理。2005年7月加入中国建设银行厦门分行,任客户经理;2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部,任债券交易员;2013年9月加入我公司投资管理部,历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总经理助理、副总经理,2013年12月10日起任建信货币市场基金的基金经理;2014年1月21日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2014年6月17日起任建信嘉新宝货币市场基金的基金经理;2014年9月17日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2014年9月17日起任建信嘉源宝货币市场基金的基金经理,该基金在2018年9月19日转型为建信睿怡纯债债券型证券投资基金,陈建良继续担任该基金的基金经理;2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金的基金经理;2016年9月2日起任建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理;2016年9月13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10月18日起任建信天添益货币市场基金的基金经理。
于倩倩	本基金的基金经理	2018年3月26日	-	10	硕士。2008年6月加入国泰人寿保险公司,任固定收益研究专员;2009年9月加入金元惠理基金管理公司(原金元比联基金管理公司),任债券研究员;2011年6月加入我公司,历任债券研究员、基金经理助理,2013年8月9日起任建信货币市场基金的基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2014年6月17日起任建信嘉新宝货币市场基金的基金经理;2014年9月17日起任建信嘉源宝货币市场基金的基金经理;2018年3月26日起任建信天添益货币市场基金的基金经理。

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《建信天添益货币市场基金基金合同》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

宏观层面,今年前三季度经济增长小幅回落,物价水平平稳运行。为了应对中美贸易摩擦和国内经济潜在下行的风险,政府出台了一系列稳内需政策,包括基建补短板、促消费和推动科技创新等系列指导意见。货币政策更加灵活,年初以来央行连续四次结构性或全面降准。财政方面也在积极推出减税控费等政策。

市场方面,上证综指小幅下跌0.92%,创业板指下跌12.16%。在经历了上半年的普遍下跌后,7月份市场窄幅震荡。8月份受到中美贸易摩擦加剧的负面影响,市场继续下挫。9月国内维稳政策陆续出台,股市有所企稳。

行业层面,石油石化(上涨15%)、银行(上涨12%)和钢铁(上涨4%)排名靠前。3季度海外油价震荡上行,刺激了石油石化行业的上涨。银行和钢铁上涨主要等违法违规行为,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

同顾2018年3季度,债券市场整体继续上涨,利率债曲线大幅陡峭化下行,金融债表现好于国债,短期品种下行40-60bp,中长期品种下行5-15bp,超长期品种下行15-20bp,信用品也有所回暖,但分化仍然明显,中短期高评级品种受到追捧,低评级、民企信用债则继续受违约事件的拖累。总体而言,政策转向后,流动性源头放开,降准、MLF奖励以及各种窗口引导作用下,短端利率中枢在3季度呈现大幅回落,同时宽信用速度明显弱于预期,使得利率债曲线整体呈现牛陡特征。

总量宏观数据表现疲软、滞胀预期升温。一方面,PMI指数维持在景气区间内,但增速已经放缓,企业生产经营活动总体延续平稳态势,但需求扩张步伐有所放慢,贸易战风波对出口预期带来负面影响,基建投资增速明显回落;另一方面,表内信贷扩张结构并不理想,表外非标收缩渐渐回稳,以社融表征的金融底仍在筑底过程中,整体宽信用速度慢于预期,同时随着贬值压力逐渐释放,叠加食品价格受供给端影响,滞胀预期有所升温。

流动性定位合理充裕,但纠偏大水漫灌式预期,资金利率中枢大幅回落后维持区间震荡。从政策基调来看,政治局会议以及货币政策执行报告都强调不搞大水漫灌式强刺激,货币政策操作除定向降准外,更多以宽信用为落脚点,多重措施缓解商业银行资本金压力。资金市场来看,7月份银行间市场融资利率陷入极度宽松局面,以存单为代表的短端资产收益率再度下行50bp,基本回到了2016年底去杠杆之前的水平,同时汇率市场也开始释放贬值压力,8月开始央行重启逆周期调节因子来稳定汇率,内部流动性更多以对冲季节波动为主,月底、季末资金有所反复。

本基金以流动性管理为第一要务。一方面,本基金持有人以机构客户为主,集中度偏高,季末时点负债端的稳定性略差,且在收益率下沉过程中,短期套利资金也带来一定扰动,需密切跟踪申赎资金动向,以保证流动性的充分应对;另一方面,我们始终依循流动性管理新规的指引,以负债端稳定性来选择资产端策略,我们在年内储备充足的流动性资产,以备季末、年底可能的规模波动压力,同时在9月跟随资金面节奏少量错配了部分跨年资产,类属上适当增配了高等级短期信用债,整体剩余期限保持在合规范围内。总体而言,在保证流动性充分应对的基础上,本基金努力捕捉资金面波动带来的配置机会,积极增厚组合的绝对收益,利用适度杠杆策略为投资者获得了稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期天添益A净值增长率0.8459%,波动率0.0013%,天添益B净值增长率0.7846%,波动率0.0013%,天添益C净值增长率0.8459%,波动率0.0013%;业绩比较基准收益率0.3403%,波动率0.0000%。

§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	固定收益投资	4,877,550,732.99	43.79
	其中:债券	4,877,550,732.99	43.79
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,180,281,600.42	37.53
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,027,624,366.46	18.20
4	其他资产	54,256,249.89	0.49
5	合计	11,139,712,949.76	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		2.19
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	526,998,809.50	4.97
	其中:买断式回购融资	-	-

报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	56
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	44.66	4.97
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	30.55	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	13.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	16.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.49	4.97

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	100,167,556.73	0.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	470,784,573.83	4.44
	其中:政策性金融债	470,784,573.83	4.44
4	企业债券	50,210,163.27	0.47
5	企业短期融资券	1,200,385,912.14	11.31
6	中期票据	362,299,921.37	3.41
7	同业存单	2,693,702,605.65	25.39
8	其他	-	-
9	合计	4,877,550,732.99	45.97
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	071800029	18中信CP007BC	4,000,000	400,012,212.35	3.77
2	111821313	18渤海银行CD313	3,000,000	295,326,637.67	2.78
3	111881489	18盛京银行CD304	2,500,000	249,429,865.12	2.35
4	101363003	13昆地铁MTN001	2,100,000	211,486,957.56	1.99
5	011801011	18陕延油SCP005	2,000,000	200,082,436.96	1.89
6	111884117	18天津银行CD245	2,000,000	199,019,768.89	1.88
7	111891852	18天津银行CD035	2,000,000	198,898,624.03	1.87
8	111891924	18宁波银行CD029	2,000,000	198,873,677.81	1.87
9	071800032	18国信证券CP001	1,500,000	150,000,000.00	1.41
10	111894227	18苏南银行CD112	1,500,000	149,043,144.38	1.40

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1240%
报告期内偏离度的最低值	0.0567%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0843%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	761,002.20
3	应收利息	53,387,419.69
4	应收申购款	107,828.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	54,256,249.89

5.9.4 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

项目	建信天添益货币A	建信天添益货币B	建信天添益货币C
报告期期初基金份额总额	399,476,874.57	351,794,263.61	12,077,058,816.96
报告期期间基金总申购份额	182,472,522.99	537,187,134.04	6,713,615,408.47
报告期期间基金总赎回份额	305,830,804.14	675,457,844.19	8,670,791,144.75
报告期期末基金份额总额	276,118,593.42	213,513,563.46	10,119,883,080.68

上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,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天添益货币市场基金设立的文件;

2、《建信天添益货币市场基金基金合同》;

3、《建信天添益货币市场基金招募说明书》;

4、《建信天添益货币市场基金托管协议》;

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

建信大安全战略精选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:中信证券股份有限公司
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。

基金托管人中信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	建信大安全战略精选股票
基金主代码	001473
交易代码	001473
基金运作方式