建信兴利灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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:2019年1月19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2019年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信兴利灵活配置混合
基金主代码	002585
交易代码	002585
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月15日
报告期末基金份额总额	126,393,090.65份
投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理,在严格控制风险和保证本金安全的基础上,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金的资产包括风险资产和安全资产,本基金投资策略分为两个层次:一层为基金在风险资产和安全资产两大类资产上的配置策略;另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。
业绩比较基准	2年期银行定期存款收益率(税前)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属于证券投资基金中的中低风险品种。
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10月1日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-2,289,879.03
2.本期利润	-1,989,929.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0143
4.期末基金资产净值	132,171,831.51
5.期末基金份额净值	1.0457

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。

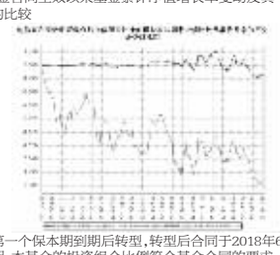
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-1.50%	0.37%	-7.47%	1.06%	5.97%	-0.69%

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的比较



1、本基金第一个保本期到期后转型,转型后合同于2018年6月15日起生效。

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		
李菁	固定收益投资部总经理、本基金的基金经理	2018年6月15日	-	12	李菁女士,固定收益投资部总经理,硕士。2002年7月进入中国建设银行股份有限公司基金托管部工作,从事基金托管业务,任主任科员。2005年9月进入建信基金管理有限责任公司,历任债券研究员、基金经理助理、基金经理、投资管理部副总监、固定收益投资部总监。2007年11月1日至2012年2月17日任建信货币市场基金的基金经理;2009年6月2日起任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理;2011年6月16日至2018年8月10日任建信信用增强债券型证券投资基金的基金经理;2016年2月4日起任建信安心保本五号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2018年2月6日起转型为建信弘利灵活配置混合型证券投资基金,李菁自2018年2月6日至2018年8月10日继续担任该基金的基金经理;2016年6月8日起任建信安心保本七号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2018年6月15日起转型为建信兴利灵活配置混合型证券投资基金,李菁继续担任该基金的基金经理;2016年11月16日起任建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2017年5月25日起任建信瑞福添利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,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《建信兴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,本基金管理人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%的情况有2次,原因是投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度随着国内需求的持续走弱,盈利不断下滑导致工业企业扩产意愿不足,而表外融资的低迷也印证了资金依然未能有效的向实体经济传导,宏观经济仍处于筑底阶段,宏观经济增长放缓成为市场的普遍预期。物价水平方面,猪瘟疫情对猪价影响逐步趋缓,原油价格也从10月开始大幅下跌,四季度CPI由2.5%高位回落至2.2%的水平。政策层面,央行继续实施宽松的货币政策,通过逆回购以及MLF等工具投放流动性,并引导资金价格维持低位。因需求不足而导致的信用扩张受阻依旧存在,但城投平台以及民营企业的融资问题,以及由此引发的违约事件,随着政策的转向有所缓解。国际方面,随着美国经济的见顶以及联储加息预期的放缓,美股的波动率也开始加大,受此影响美元指数逐步走弱,人民币对美元汇率从11月6.978的高位回落至年末的6.873.

在此背景下,四季度债券市场表现良好,各期限收益率下行明显。其中1年期国开债收益率下行32bp,10年期收益率下行超过50bp,曲线形态趋于平坦化。信用债方面,随着无风险收益率下行以及市场情绪的好转,信用利差有所收窄。权益市场方面,上证指数震荡下行,仅农林牧渔、地产以及电力设备等板块表现较好。

回顾四季度的基金管理工作,组合适度拉长债券久期,在后续收益率下行过程中获取了较好的投资回报。权益方面,季度内整体维持低仓位,但在股市的大幅调整中并没有取得正收益回报,影响了基金净值表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-1.5%,波动率0.37%,业绩比较基准收益率-7.47%,波动率1.06%。

§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	9,169,430.00	6.88
	其中:股票	9,169,430.00	6.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	79,750,503.80	59.82
	其中:债券	79,750,503.80	59.82
	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	38,000,000.00	28.50
	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	2,779,018.29	2.08
8	其他资产	3,627,383.61	2.72
9	合计	133,326,335.70	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	1,259,776.00	0.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,705,498.00	2.80
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	1,754,016.00	1.33
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,450,140.00	1.85
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	9,169,430.00	6.94

以上行业分类以2018年12月31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	600011	华能国际	502,100	3,705,498.00	2.80
2	601888	中国国旅	40,700	2,450,140.00	1.85
3	300010	立思辰	241,600	1,754,016.00	1.33
4	002304	洋河股份	13,300	1,259,776.00	0.95

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	22,904,740.50	17.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	23,350,871.00	17.67
	其中:政策性金融债	23,350,871.00	17.67
4	企业债券	8,187,200.00	6.19
5	企业短期融资券	10,088,000.00	7.63
6	中期票据	10,208,000.00	7.72
7	可转债(可交换债)	5,011,692.30	3.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	79,750,503.80	60.34

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	010107	21国债(7)	150,000	15,442,500.00	11.68
2	180210	18国开10	100,000	10,313,000.00	7.80
3	101800771	18中极地产MTN002	100,000	10,208,000.00	7.72
4	041800250	18招银CP004	100,000	10,088,000.00	7.63
5	143082	18陕燃01	80,000	8,187,200.00	6.19

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	106,735.22
2	应收证券清算款	2,057,479.44
3	应收股利	-
4	应收利息	1,456,129.48
5	应收申购款	7,039.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,627,383.61

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	3,003,278.40	2.27
2	110032	三一转债	1,545,091.20	1.17
3	127005	长证转债	463,322.70	0.35

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	154,469,834.77
报告期期间基金总申购份额	714,067.82
减:报告期期间基金总赎回份额	28,790,811.94
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	126,393,090.65

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兴利灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信兴利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信兴利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信兴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
2019年1月19日

建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2018年第四季度报告

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:2019年1月19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2019年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信深证基本面60ETF联接
基金主代码	530015
交易代码	530015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月8日
报告期末基金份额总额	182,080,560.71份
投资目标	本基金将绝大部分基金资产投资于目标ETF,密切跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖目标ETF或本基金自身的申购赎回时本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金管理人将对投资组合进行适当调整,以降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×深证基本面60指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为深证基本面60ETF的联接基金,风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时,本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险收益的品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信深证基本面60ETF联接A / 建信深证基本面60ETF联接C
下属分级基金的交易代码	530015 / 006363
报告期末下属分级基金的份额总额	181,878,497.10份 / 202,063.61份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深F60ETF
基金主代码	159916
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月8日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年10月24日
基金管理人名称	建信基金管理有限责任公司
基金托管人名称	中国民生银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略,跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	深证基本面60指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

§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10月1日 - 2018年12月31日)	
	建信深证基本面60ETF联接A	建信深证基本面60ETF联接C
1. 本期已实现收益	-502,542.69	-225.50
2. 本期利润	-24,817,108.81	-7,572.48
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1406	-0.0702
4. 期末基金资产净值	279,469,169.89	310,681.74
5. 期末基金份额净值	1.5366	1.5375

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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

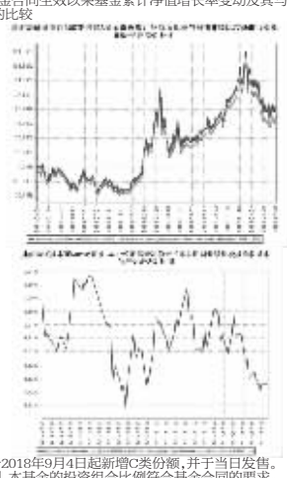
建信深证基本面60ETF联接A

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	-8.51%	1.60%	-8.70%	1.62%	0.19%	-0.02%

建信深证基本面60ETF联接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	-8.43%	1.60%	-8.70%	1.62%	0.27%	-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



1.本基金于2018年9月4日起新增C类份额,并于当日发售。

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		
薛玲	本基金的基金经理	2017年9月28日	-	5	薛玲女士,金融工程及指数投资部总经理助理,博士。2009年5月至2009年12月在国家电网公司研究院农电配电研究所工作,任项目经理;2010年1月至2013年4月在路透恒纪公司宜商数据化集团门工作,任高级软件工程师;2013年4月至2015年8月在中国中投证券公司工作,历任研究员、投资经理;2015年9月加入兴业证券金融工程及指数投资部,历任基金经理助理、基金经理,2018年5月起兼任部门总经理助理,2016年7月4日起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;2017年6月27日至2018年4月25日任建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年9月13日起任建信量化事件驱动股票型证券投资基金的基金经理;2017年9月28日起任深证基本面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;2017年12月26日起任建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年12月22日起任建信上证50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2018年3月5日起任建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金的基金经理;2018年10月26日起任建信上证50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12月13日起任建信港股通恒生中资企业交易型开放式指数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《建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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,本基金管理人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%的情况有2次,原因是投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金绝大部分资产投资于深证基本面60ETF,因此基金的跟踪误差和偏离度主要取决于深证基本面60ETF的表现。此外,由于申赎造成的基金份额变动以及成份股的集中分红也会对本基金的跟踪误差和偏离度造成一定影响。在报告期内,基金跟踪误差和日均偏离度均被控制在基金合同约定的范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期深60ETF联接A净值增长率-8.51%,波动率1.6%,深60ETF联接C净值增长率-8.43%,波动率1.6%;业绩比较基准收益率-8.7%,波动率1.62%。

§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	7,179,621.68	2.53
	其中:股票	7,179,621.68	2.53
2	基金投资	257,065,600.00	90.71
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	18,678,208.41	6.59
8	其他资产	457,470.05	0.16
9	合计	283,380,900.14	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	314,160.00	0.11
B	采矿业	74,080.00	0.03
C	制造业	4,033,859.30	1.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,485.00	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	168,525.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	28,420.00	0.01
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	1,214,900.48	0.43
K	房地产业	1,148,176.70	0.41
L	租赁和商务服务业	76,015.20	0.03
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	7,179,621.68	2.57

以上行业分类以2018年12月31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	000651	格力电器	21,500	767,335.00	0.27
2	000002	万科A	25,935	617,771.70	0.22
3	000001	平安银行	53,000	497,140.00	0.18
4	000333	美的集团	12,984	478,590.24	0.17
5	300498	温氏股份	12,000	314,160.00	0.11
6	000100	TCL集团	97,000	237,650.00	0.08
7	000338	潍柴动力	30,000	231,000.00	0.08
8	000776	广发证券	16,000	202,880.00	0.07
9	000725	京东方A	71,000	186,730.00	0.07
10	002142	宁波银行	10,984	178,160.48	0.06

5.4 报告期内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	深F60	股票型	交易型开放式指数基金	建信基金管理有限责任公司	257,065,600.00	91.88

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	15,629.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,517.69
5	应收申购款	437,322.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	457,470.05

5.12.4 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。

5.12.5 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。

5.12.6 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

项目	建信深证基本面60ETF联接A	建信深证基本面60ETF联接C
报告期期初基金份额总额	170,595,320.04	8,460.65
报告期期间基金总申购份额	22,411,088.34	269,757.35
减:报告期期间基金总赎回份额	11,127,911.28	76,154.39
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	181,878,497.10	202,063.61

上述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深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件;

2、《建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》;

3、《建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》;

4、《建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》;

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
2019年1月19日

建信月盈安心理财债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

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:2019年1月19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2019年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信月盈安心理财
基金主代码	530028
交易代码	530028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月20日
报告期末基金份额总额	15,750,343,060.49份
投资目标	严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报,并力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过积极主动的组合管理,充分运用各种短期投资工具,力争为持有人创造低风险基础上的投资收益。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过150天。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)
风险收益特征	本基金属于债券基金,长期风险收益水平低于股票基金、混合基金,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	中国民生银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信月盈安心理财A / 建信月盈安心理财B
下属分级基金的交易代码	530028 / 631028
报告期末下属分级基金的份额总额	750,632,811.23份 / 14,999,710,249.26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10月1日 - 2018年12月31日)	
	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
1. 本期已实现收益	4,372,292.15	150,940,233.50
2. 本期利润	4,372,292.15	150,940,233.50
3. 期末基金资产净值	750,632,811.23	14,999,710,249.26

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,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

建信月盈安心理财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	0.7396%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	0.3993%	0.0002%

建信月盈安心理财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