建信兴利灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年3月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并报董事长签发。
基金管理人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。
本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。
本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	建信兴利灵活配置混合
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	126,393,090.65份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	建信安心保本七号混合
基金主代码	002585
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月14日
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
报告期末基金份额总额	342,360,172.86份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	本基金自上而下积极、动态地配置大类资产,同时通过合理的证券选择,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上,动态调整大类资产配置比例,同时结合严格、规范化的投权方法与积极主动的投资风格相结合,运用自上而下和自下而上相结合的个股、个券投资策略,在大类资产配置和证券选择两个层面上实现投资组合的双重优化。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合全价(总值)指数收益率×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高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

2.2 基金产品说明(转型前)

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间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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴晓明	李振宾
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfundcn	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		400-81-96533 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfundcn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日
本期已实现收益	-1,858,039.23
本期利润	-1,143,505.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0069
本期基金份额净值增长率	0.98%
3.1.2 期末数据和指标	2018年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0415
期末基金资产净值	132,171,831.61
期末基金份额净值	1.0497

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.期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正值,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负值,则期末可供分配利润为期末未分配利润(已实现部分)和期末未实现部分之和。
3.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。

转型前

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月1日至2018年6月14日	2017年	2016年
本期已实现收益	46,321,857.36	129,335,277.69	44,590,913.70
本期利润	45,267,609.63	144,576,544.91	30,655,887.29
加权平均基金份额本期利润	0.0159	0.0339	0.0062
本期基金份额净值增长率	1.54%	3.38%	0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月14日	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0669	0.0399	0.0062
期末基金资产净值	361,496,964.48	3,187,564,068.64	4,901,294,688.89
期末基金份额净值	1.056	1.040	1.006

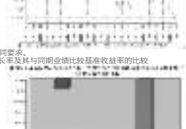
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正值,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负值,则期末可供分配利润为期末未分配利润(已实现部分)和期末未实现部分之和。
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现(转型后)
3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%
过去六个月	-0.89%	0.26%	-8.40%	0.97%	7.51%	-0.71%
自基金合同生效起至今	-0.98%	0.25%	-12.42%	0.97%	11.44%	-0.72%

本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×65%+中债综合全价(总值)指数收益率×35%。
沪深300指数是由中证指数有限公司编制的,从上海和深圳股票市场中选取的300只A股作为样本编制而成的成份股指数。该指数为具有良好的市场代表性、能够反映A股市场整体走势的指数。
中债综合全价(总值)指数由中央国债登记结算公司编制,该指数具有综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场,成份券种包括除资产支持债券和国分债之外的所有债券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的业绩比较基准。

3.2.2 自基金转型以来基金份额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。

3.2.3 自基金转型以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

3.2.3 自基金转型以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

3.2.3 过去三年基金每年份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及其主要经理情况
4.1.1 基金管理人及其主要经理情况
经中国证监会批准成立于2005年10月17日,注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司,后安金融服务公司,中国华电集团资本控股有限公司,其中中国建设银行股份有限公司持有公司55%股权,后安金融服务公司持有公司40%股权,中国华电集团资本控股有限公司持有公司5%股权。
公司下设投资决策委员会、风险控制委员会、薪酬委员会、审计委员会、内控委员会、海外投资委、资产配置及量化研究委、股权投资委、产品委员会、投资管理部、风险管理部、内控合规部、人力资源管理部、基金业务部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部,以及分别设立于北京、上海、深圳、成都、上海、北京、广州、长沙分公司和华东、西北、东北、武汉、南京六个管理中心,并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。公司现有员工近1000人,其中具有10年以上证券从业经验的人员近70人,在投资决策委员会、风险控制委员会、薪酬委员会、审计委员会、内控委员会、产品