建信睿富纯债债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信睿富纯债债券
基金主代码	003590
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月25日
报告期末基金份额总额	7,017,284,916.23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	兴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(2019年1月1日－2019年3月31日)
1.本期已实现收益	61,350,727.49
2.本期利润	76,347,257.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0109
4.期末基金资产净值	7,535,590,989.32
5.期末基金份额净值	1.0739

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。

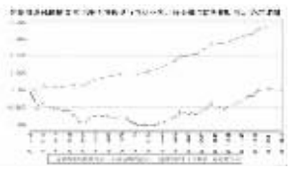
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.03%	0.03%	0.47%	0.05%	0.56%	－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



注:本报告期,本基金投资组合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		
刘思	本基金的基金经理	2016年11月25日	－	9年	刘思女士,硕士。2009年5月加入建信基金管理公司,历任助理交易员、初级交易员、交易员、交易主管、基金经理助理、基金经理。2016年7月19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;2016年11月8日至2018年1月15日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22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;2016年11月25日起任建信睿富纯债债券型证券投资基金的基金经理;2017年8月9日起任建信中证政策性金融债1-3年指数证券投资基金(LOF)、建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金(LOF)的基金经理;2017年8月9日至2018年4月11日任建信中证政策性金融债3-5年指数证券投资基金(LOF)基金经理;2017年8月16日至2018年4月11日任建信中证政策性金融债5-8年指数证券投资基金(LOF);2017年8月16日至2018年5月31日任建信睿源纯债债券型证券投资基金的基金经理;2018年3月26日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2019年3月25日起任建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。

注:本报告期,本基金投资组合比例符合基金合同要求。

§4 管理人报告

4.2 管理人对报告期内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《建信睿富纯债债券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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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1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

2019年以来,全球经济增速步伐继续放缓。2月美国非农就业数据爆冷,建筑业等行业就业数据低迷,但薪资增速大幅增长,CPI和PMI数据也继续走弱。随后3月美联储议息会议正式确认货币政策转鸽,并计划9月结束缩表。欧央行对欧元区经济放缓的担忧也不断加剧,欧元区通胀率表现仍然较弱,制造业PMI下滑至荣枯线以下,但服务业PMI小幅回升。

一季度全国固定资产投资三大项中基建与地产反弹,但制造业投资增速却出现回落。分项来看,今年一季度总体地方债发行量也远超去年同期,发行的地方债以新增债为主,新增专项债用于土地储备、棚户区改造、公路铁路等交通设施、水利环保、学校医院等基础设施项目和重点民生项目,对基建形成强力的拉动作用。1-2月的基础设施投资(不含电力)增长4.3%相比于上年末回升0.5个百分点,基建投资增速有所反弹。房地产方面,随着房贷利率高位回落,一线和强二线城市商品房销售略有转暖,但市场整体冷热不均,区域分化进一步加大,1-2月份的房地产投资名义增长11.6%,增速水平相比于上年末提高了2.1个百分点,维持较高增速水平。制造业投资增速有所回落,2月末累计增速5.9%比上年末回落了3.6个百分点。当前工业企业整体面临利润率和利润总额增速同时下滑,考虑到新兴制造业和信息技术行业等在固定资产投资中的占比不高,与盈利能力背离的投资反弹可能难以持续,投资增速仍将向利润增速的走势靠拢。

出口方面,尽管欧元区PMI及日韩出口等外需指示指标仍然疲软,但由于去年基数较低、美国暂时取消2000亿美元商品清单加征关税计划等,出口的下降速度已经放缓。进口方面,受节后复工全面开启、原油等大宗商品价格上涨等因素影响,预计3月份进口也将有所回升,PMI进口、新出口订单均有所回升也一定程度反映了这种情况。从人民币汇率上看,今年一季度人民币汇率升值较多,3月末人民币兑美元汇率升值2.1%以及人民币兑CFETS篮子货币汇率指数升值2.0%

一季度债市收益波动较大,开年中美贸易摩擦谈判结果向好,基建补短板托底经济仍无法动摇市场对经济的悲观预期,10年期国债收益率继续下行,但随着1月社融和贷款数据的改善,债市开始在底部震荡。2月的社融数据和PMI数据下滑,加之春节停工、雨雪频繁等多重因素的干扰,收益短时间平稳。但股市快速回升导致股债行情转换,收益率继续进入上行通道。3月末时点,10年国开债收益率相比于去年末3.64%的位置下行6BP到3.58%,而10年国债收益率则下行16BP到3.07%。

通胀领域,一季度维持了CPI低位和PPI通缩的局面。春节后猪肉需求季节性回落,但近两月存栏量大幅下降制约出栏空间,供求格局逐步切换,猪肉价格环比微升。蔬菜价格经历高点后略有下行,但南方持续降雨或导致菜价下行偏缓。

货币政策方面,央行在1月份连续降准并开展TMLF操作,投放了1.3万亿元的流动性,货币市场利率快速下行至公开市场操作利率以下,春节后央行明显缩减了流动性投放规模,2月和3月分别实现流动性净回笼7505.5亿元和6925亿元,流动性净投放缩量直接推升了货币市场利率中枢,且波动性也明显提升。尤其是3月中旬缴税高峰期间,央行仅通过公开市场操作进行了少量的投放,带动3月中下旬资金面边际收紧,这也反映了央行在社融企稳、股市火爆的背景下更加重视控制股票市场潜在加杠杆的风险。

综上所述,本基金在2019年一季度保持了一贯稳健的投资风格,维持了中性的久期,重点配置的3年左右的品种。在收益高点配置了优质债券和存单。基金整体没有杠杆。截至季末时点,业绩表现良好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率1.03%,波动率0.03%,业绩比较基准收益率0.47%,波动率0.05%。

§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	－	0.00
	其中:股票	－	0.00
2	基金投资	－	0.00
3	固定收益投资	7,298,266,200.00	96.81
	其中:债券	7,298,266,200.00	96.81
	资产支持证券	－	0.00
4	贵金属投资	－	0.00
5	金融衍生品投资	－	0.00
6	买入返售金融资产	－	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	－	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	83,156,563.95	1.10
8	其他资产	157,292,736.16	2.09
9	合计	7,538,715,500.11	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

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

无。

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	－	0.00
2	央行票据	－	0.00
3	金融债券	5,031,957,200.00	66.78
	其中:政策性金融债	4,013,657,200.00	53.26
4	企业债券	414,080,000.00	5.49
5	企业短期融资券	－	0.00
6	中期票据	625,980,000.00	8.31
7	可转债(可交换债)	－	0.00
8	同业存单	1,226,249,000.00	16.27
9	其他	－	0.00
10	合计	7,298,266,200.00	96.85

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	180208	18国开08	8,000,000	817,120,000.00	10.84
2	091501002	15中国信达债02	7,000,000	713,860,000.00	9.47
3	100411	10农发11	7,000,000	708,190,000.00	9.40
4	100302	10进出02	6,700,000	677,839,000.00	9.00
5	1282205	12中船MTN1	6,000,000	625,980,000.00	8.31

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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

基金投资的前十名证券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	－
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	157,292,736.16
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	157,292,736.16

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	7,017,284,916.23
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	－
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	7,017,284,916.23

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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	2019年01月01日－2019年03月31日	7,017,282,470.99	－	－		7,017,282,470.99	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富纯债债券型证券投资基金设立的文件;
2、《建信睿富纯债债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信睿富纯债债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信睿富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
2019年4月19日

建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信睿和纯债定期开放债券
基金主代码	005375
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月2日
报告期末基金份额总额	4,929,560,994.58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	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	兴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(2019年1月1日－2019年3月31日)
1.本期已实现收益	86,519,588.06
2.本期利润	71,587,745.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0145
4.期末基金资产净值	5,080,078,593.71
5.期末基金份额净值	1.0305

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	1.41%	0.05%	0.47%	0.05%	0.94%	0.00%

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

注:本报告期,本基金投资组合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		
黎颖芳	本基金的基金经理	2018年2月2日	－	18年	黎颖芳女士,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;2014年12月2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日至2019年1月29日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日起任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。
李峰	本基金的基金经理	2018年2月2日	－	12年	李峰先生,硕士。曾任清华紫光股份有限公司财务会计助理,2007年4月至2012年9月任华夏基金管理公司基金会计业务经理、风控高级经理,2012年9月至2015年6月任建信基金管理公司交易员、交易主管,2015年7月至2016年6月任银华基金管理公司询价研究主管,2016年6月起任建信基金管理公司基金经理助理,2017年5月15日起任建信信用增强债券型证券投资基金和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;2019年3月8日起任建信中短债纯债债券型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内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《建信睿和纯债定期开放债券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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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1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

19年一季度最大亮点是地方国债提前放量发行,带动社会融资增速企稳回升。最新公布的3月PMI指数达到50.5%,结束连续三个月枯荣线之下的走势。社融增速恢复带动基建投资增速有所反弹,房地产投资维持高位,消费增速保持平稳,消费升级趋势较为明显。

一季度居民消费价格温和上涨,工业生产者价格涨幅回落。从消费者价格指数上看,居民消费价格累计同比上涨1.6%,涨幅比上年12月份回落0.3个百分点,其中食品项由于受节日效应和部分地区雨雪天气等综合影响涨幅较大,而猪肉价格收到供给收缩与猪瘟等因素影响一季度涨幅明显,通胀预期有所抬升。从工业品价格指数上看,1-2月全国工业生产者出厂价格同比上涨0.1%,涨幅比上年12月份回落0.8个百分点,原油价格收到海外国际因素影响2月份开始环比增速由降转升。

一季度资金面整体维持合理适度水平,临近季末时点出现阶段性紧张。央行1月份下调金融机构存款准备金率1个百分点,2019年一季度到期的中期借贷便利(MLF)不再续做,净释放长期资金约8000亿元;此外3月美联储加息操作暂停,人民银行利率操作保持稳定不变,人民币汇率升值较多,3月末美元中间价收于6.7335,较去年末升值1.89%。

债券市场方面,一季度债券市场流动性较为宽裕,但受社融增速企稳回升、贸易战阶段性缓和以及资本市场风险偏好回升等因素影响,收益率底部震荡,波动明显加大。季末10年国开债收益率相比于去年末3.64%的位置小幅上行6BP到3.58%,而10年国债收益率则下行16BP到3.07%。

一季度本基金根据市场趋势变化,减持了长期利率债和中长期超AAA信用债,适当降低了组合久期和杠杆水平,以期更好的投资机会出现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率1.41%,波动率0.05%,业绩比较基准收益率0.47%,波动率0.05%。

§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	－	0.00
	其中:股票	－	0.00
2	基金投资	－	0.00
3	固定收益投资	5,949,027,093.30	97.48
	其中:债券	5,949,027,093.30	97.48
	资产支持证券	－	0.00
4	贵金属投资	－	0.00
5	金融衍生品投资	－	0.00
6	买入返售金融资产	－	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	－	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	34,669,673.24	0.57
8	其他资产	119,095,212.36	1.95
9	合计	6,102,791,978.90	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

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

无。

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	－	0.00
2	央行票据	－	0.00
3	金融债券	106,499,457.90	2.10
	其中:政策性金融债	5,649,457.90	0.11
4	企业债券	1,202,563,635.40	23.67
5	企业短期融资券	1,449,600,000.00	28.53
6	中期票据	3,190,364,000.00	62.80
7	可转债(可交换债)	－	0.00
8	同业存单	－	0.00
9	其他	－	0.00
10	合计	5,949,027,093.30	117.11

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	101800789	18湘高速MTN001	2,400,000	244,368,000.00	4.81
2	101800830	18义乌国资MTN002	2,000,000	204,420,000.00	4.02
3	101763001	17晋煤MTN001	1,900,000	193,515,000.00	3.81
4	101764008	17吉林高速MTN001	1,700,000	174,505,000.00	3.44
5	143736	18远海02	1,600,000	162,784,000.00	3.20

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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

基金投资的前十名证券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	2,326.09
2	应收证券清算款	1,305,600.00
3	应收股利	－
4	应收利息	117,787,286.27
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	119,095,212.36

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	4,929,414,529.43
报告期期间基金总申购份额	146,465.15
减:报告期期间基金总赎回份额	－
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	4,929,560,994.58

注:上述总申购份额为红利再投资份额。

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,399,025.88
报告期期间买入/申购总份额	146,465.15
报告期期间卖出/赎回总份额	－
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,545,491.03
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.21

注:2019-3-27红利再投146,465.15计入申购买入份额内。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	分红	2019-03-27	146,465.15	150,785.87	0.00
合计			146,465.15	150,785.87	

注:2019-3-27红利再投146,465.15计入申购买入份额内。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,545,491.03	0.21	10,545,491.03	0.21	3年
基金管理人高级管理人员	－	－	－	－	－
基金经理等人员	－	－	－	－	－
基金管理人股东	－	－	－	－	－
其他	－	－	－	－	－
合计	10,545,491.03	0.21	10,545,491.03	0.21	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2019年01月01日－2019年03月31日	4,919,015,503.55	－	－		4,919,015,503.55	99.79
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。								

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信睿和纯债定期开放债券型证券投资基金设立的文件;
2、《建信睿和纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信睿和纯债定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信睿和纯债定期开放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。

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

10.3 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4月19日

建信睿享纯债债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:2019年4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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4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2019年1月1日起至3月31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
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	5,600,000,988.00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(2019年1月1日－2019年3月31日)
1.本期已实现收益	80,130,970.26
2.本期利润	61,176,773.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0109
4.期末基金资产净值	6,012,252,806.72
5.期末基金份额净值	1.0736

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