建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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

2.1 基金基本情况

基金简称	建信责任
基金主代码	530010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月28日
报告期末基金份额总额	57,354,644.17份
投资目标	通过将绝大部分基金财产投资于上证社会责任ETF,密切跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为上证社会责任ETF的联接基金,主要通过投资于上证社会责任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上证社会责任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,基金经理会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×上证社会责任指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率
风险收益特征	本基金为上证社会责任ETF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、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	中国工商银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年5月28日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年8月9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	中国工商银行股份有限公司

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,因按照标的指数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	上证社会责任指数
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(2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	3,086,351.45
2.本期利润	20,823,811.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.3511
4.期末基金资产净值	108,827,787.96
5.期末基金份额净值	1.8975

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	22.59%	1.49%	22.79%	1.51%	-0.20%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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		
薛玲	本基金的基金经理	2016年7月4日	-	5年	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月在路通世纪公司亚洲数据收集部门工作,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月加入我公司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5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20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25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国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《建信上证社会责任交易型开放式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》、《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

本基金绝大部分资产投资于上证社会责任ETF,因此基金的跟踪误差和偏离度主要取决于上证责任ETF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

本报告期基金净值增长率22.59%,波动率1.49%,业绩比较基准收益率22.79%,波动率1.51%。

§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	2,628,448.66	2.41
	其中:股票	2,628,448.66	2.41
2	基金投资	100,427,000.00	92.12
3	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	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	5,906,339.73	5.42
8	其他资产	59,348.24	0.05
9	合计	109,021,136.63	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	-	0.00
B	采矿业	34,722.00	0.03
C	制造业	524,944.84	0.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,410.00	0.02
E	建筑业	216,293.76	0.20
F	批发和零售业	79,492.60	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	54,405.70	0.05
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,342.00	0.09
J	金融业	1,422,662.12	1.31
K	房地产业	156,531.60	0.14
L	租赁和商务服务业	5,046.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	5,041.04	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	4,557.00	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	2,628,448.66	2.42

注:以上行业分类以2019年3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

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

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	7,200	556,120.00	0.51
2	600036	招商银行	6,900	234,048.00	0.22
3	601166	兴业银行	8,100	147,177.00	0.14
4	601328	交通银行	18,000	112,320.00	0.10
5	600000	浦发银行	7,764	87,577.92	0.08
6	601668	中国建筑	13,760	84,211.20	0.08
7	601601	中国太保	2,100	71,484.00	0.07
8	600048	保利地产	4,800	68,352.00	0.06
9	600104	上汽集团	2,400	62,568.00	0.06
10	600019	宝钢股份	6,000	43,380.00	0.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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十名权证投资明细

无。

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	责任ETF	股票型指数基金	交易型开放式	建信基金管理有限责任公司	100,427,000.00	92.28

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

无。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

无。

5.11.2 报告期末国债期货投资评价

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

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。

5.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,909.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,403.59
5	应收申购款	56,035.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,348.24

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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

报告期期初基金份额总额	60,258,241.20
报告期期间基金总申购份额	2,291,634.29
减:报告期期间基金总赎回份额	5,195,231.32
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	57,354,644.17

注: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

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金设立的文件;

2、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同》;

3、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金招募说明书》;

4、《建信上证社会责任交易型开放式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4月19日

建信稳定添利债券型证券投资基金2019年

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:中国农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。

基金托管人中国农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	建信稳定添利债券
基金主代码	000435
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年12月10日
报告期末基金份额总额	76,264,426.43份
投资目标	通过积极主动的投资组合管理为投资人创造较高的当期收入和总回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要通过采取自上而下的定性分析和定量分析确定大类属配置策略,结合久期管理和信用风险管理的投资策略构建债券投资组合。 同时在固定收益资产所提供的稳健收益基础上,适当进行股票投资,本基金的股票投资作为债券投资的辅助和补充,以本金安全为最重要因素。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数
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	中国农业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信稳定添利债券A / 建信稳定添利债券C
下属分级基金的交易代码	000435 / 000723
报告期末下属分级基金的份额总额	21,522,196.15份 / 54,742,230.28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(2019年1月1日-2019年3月31日)	报告期(2019年1月1日-2019年3月31日)
	建信稳定添利债券A	建信稳定添利债券C
1.本期已实现收益	1,724,194.38	3,806,826.25
2.本期利润	2,001,192.64	4,356,425.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0857	0.0804
4.期末基金资产净值	24,941,281.40	59,276,837.99
5.期末基金份额净值	1.159	1.083

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

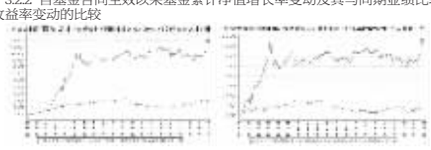
建信稳定添利债券A

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	8.22%	0.54%	0.47%	0.05%	7.75%	0.49%

建信稳定添利债券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	8.08%	0.54%	0.47%	0.05%	7.61%	0.49%

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		
朱建华	本基金的基金经理	2013年12月10日	-	11年	朱建华先生,硕士。曾任大连博达系统工程公司职员、中诚信国际信用评级公司项目组长,2007年10月起任中诚信证券评估有限公司公司评级部总经理助理,2008年8月起任国泰基金管理公司高级研究员、朱建华于2011年6月加入本公司,历任高级债券研究员、基金经理助理、基金经理。2012年8月28日至2015年8月11日任建信双周安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2012年11月15日至2014年3月6日任建信纯债债券型证券投资基金的基金经理;2012年12月20日至2014年3月27日任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2013年5月14日至2019年1月29日任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2013年12月10日起任建信稳定添利债券型证券投资基金的基金经理;2016年4月29日至2018年5月3日任建信安心保本六号混合型证券投资基金的基金经理,2016年6月1日任建信转债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年11月1日起任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理;2018年4月20日起任建信稳定增利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,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《建信稳定添利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

一季度,国内宏观经济整体依然处于筑底阶段,其中PMI数据在连续三个月低于荣枯线水平以下后三月份再次站上50,但仍低于过去两年同期水平。其中大型企业PMI保持在荣枯线上略有回落,中小企业PMI虽明显改善但仍在线下。另外前两个月全国规模以上工业企业利润总额同比下降14%,显示整体经济活力依然不强。一季度,地方债发行明显加速,额度超过1.4万亿,预计今年前三季度将发行完成全年额度,一季度如此大规模的地方债发行这在过去是从未有过的,中央政府通过财政刺激经济的效果将在未来逐步显现。投资看,制造业投资增速继续小幅回落,基建与地产增速在一季度均出现一定反弹,但地产投资的增量更多来自于房地产企业去年存量项目的建设,随着这一轮房地产企业补库存的步伐放缓,企业下一步的拿地热情将更多受到需求端的制约。基建方面,一季度基建增速呈现企稳回升,基础设施投资增长比上年末回升0.5个百分点,这种回升趋势将是对今年投资的重要支撑部分。从需求看,国内总需求的下降出现在17年四季度,虽然目前尚没有出现明显的转折但筑底的迹象逐步明显,特别是去年下半年国内政策由去杠杆变为稳杠杆后,实体经济的收缩在今年得到明显缓解,信用价格的信号在也今年初出现拐头向下,社融增速触底回升也将信用的进一步扩张,这种信用的传导将会带来企业盈利的增加以及经济的触底反弹。未来经济的不确定将更多来自于海外市场,特别是美国经济何时见顶所带来的总需求下降的影响,这些都将影响下阶段的资产配置。通胀方面,一季度居民消费价格温和上涨,工业生产者价格涨幅回落,通胀压力不大,但需要关注年内猪周期的拐点所带来通胀的超预期。货币政策方面,央行一直维持来去年以来的中性宽松的货币政策,银行间市场资金宽裕,回购价格一度接近2016年低点,由于短端价格已经很低,虽然未来不排除进一步的降准甚至降息的可能,但这些因素已经很大程度上包含在了市场的交易情绪中。

债券方面,虽然债券市场依然有基本面的支撑,但随着市场风险偏好的提升债券市场在经历了过去一年的大涨后整体呈现窄幅震荡,其中长端表现弱于短端,长端利率债收益率小幅下行,短融收益率呈现普降,信用息差也进一步缩窄,部分低等级高收益信用债表现尤为突出,特别是一些城投债被市场资金所追逐。转债方面,得益于权益市场的上涨以及对于转债过度悲观估值的修复,一季度转债市场呈现普涨格局,过去一年转债市场上新债破发的现象已经很久没有发生,随着转债市场的快速扩容,新发转债也受到市场的明显追捧,新债申购热情不减。权益市场方面,随着社融的企稳回升以及信用的扩张预期,权益市场出现了一波明显的反弹走势,市场的热情度也随之增加,成交量多日维持万亿水平,两融规模与北上资金净买入规模均呈现上升。从板块表现看,中小盘股票表现要优于大盘股,特别是一些超跌股反弹更甚,虽然从估值看以中证500为代表的中盘股估值依然相对不高,但随着市场进入前期资金密集成交区,短期的市场分歧也随之增加,这也增加了操作的难度。

本季度,建信稳定添利债券型基金一方面做好流动性管理工作,另一方面在资产的配置方面降低了债券的整体久期并增配了转债与权益的持仓比例。特别是一月下旬增加风险敞口后在后面的净值表现中取得较好效果。目前本基金整体杠杆不高,在接下来的操作中本基金将维持当前的杠杆率水平和短久期策略,在市场没有形成明显的趋势前不打算进一步增加风险敞口,同时会密切关注市场交易风格的变化,在权益部分的操作中轻指数重个股尽量减少组合的净值波动。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期稳定添利A净值增长率8.22%,波动率0.54%,稳定添利C净值增长率8.08%,波动率0.54%;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	7,651,180.00	8.48
	其中:股票	7,651,180.00	8.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	77,799,810.44	86.21
	其中:债券	77,799,810.44	86.21
	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	2,104,961.72	2.33
8	其他资产	2,684,279.34	2.97
9	合计	90,240,231.50	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	5,405,000.00	6.42
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	1,806,180.00	2.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	440,000.00	0.52
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	7,651,180.00	9.08

注:以上行业分类以2019年3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

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

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	300059	东方财富	60,000	1,162,800.00	1.38
2	300232	洲明科技	80,000	1,142,400.00	1.36
3	300357	我武生物	20,000	953,600.00	1.13
4	002294	信立泰	35,000	951,650.00	1.13
5	300322	硕贝德	60,000	840,600.00	1.00
6	300012	华测检测	50,000	440,000.00	0.52
7	002327	富安娜	45,000	415,350.00	0.49
8	600570	恒生电子	3,500	306,460.00	0.36
9	002038	双鹭药业	10,000	276,000.00	0.33
10	601231	环旭电子	15,000	231,000.00	0.27

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	24,780,440.00	29.42
	其中:政策性金融债	24,780,440.00	29.42
4	企业债券	3,033,000.00	3.60
5	企业短期融资券	25,098,400.00	29.80
6	中期票据	-	0.00
7	可转债(可交换债)	24,887,970.44	29.55
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	77,799,810.44	92.38

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	150216	15国开16	200,000	20,380,000.00	24.20
2	011801759	18路安SCP006	70,000	7,046,200.00	8.37
3	011900067	19银棋SCP001	60,000	6,019,800.00	7.15
3	011900126	19唐山经发SCP001	60,000	6,019,800.00	7.15
5	041900013	19晋能CP001	60,000	6,012,600.00	7.14

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	24,195.83
2	应收证券清算款	1,498,553.46
3	应收股利	-
4	应收利息	1,079,427.74
5	应收申购款	82,102.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,684,279.34

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	123006	东财转债	4,246,750.00	5.04
2	132009	17中油EB	2,038,000.00	2.42
3	128021	兄弟转债	1,190,300.00	1.41
4	128015	久其转债	1,049,165.07	1.25
5	127004	模塑转债	482,829.34	0.57
6	128023	亚太转债	370,904.47	0.44
7	132012	17巨化EB	24,403.20	0.03

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

项目	建信稳定添利债券A	建信稳定添利债券C
报告期期初基金份额总额	27,738,263.12	53,991,523.21
报告期期间基金总申购份额	2,261,632.33	3,145,050.76
减:报告期期间基金总赎回份额	8,477,699.30	2,394,343.69
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	21,522,196.15	54,742,230.28

注: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

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信稳定添利债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信稳定添利债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信稳定添利债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信稳定添利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。

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4月19日

建信稳定鑫利债券型证券投资基金2019年

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	建信稳定鑫利债券
基金主代码	003583
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月6日
报告期末基金份额总额	4,716,793,350.84份
投资目标	通过主动的债券组合管理,本基金在严格控制风险和追求基金资产稳定增长的基础上,力争为投资者创造较高的当期收益和总回报。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。
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