

信息披露

disclosure

建信睿富纯债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

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7月17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7月15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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	建信睿富纯债债券型证券投资基金
基金代码	000900
基金运作方式	契约封闭式
基金合同生效日	2016年11月26日
报告期末基金份额总额	7,017,284,976.23

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期已实现收益	70,223,486.64
2.本期利润	46,133,043.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0067
4.期末基金资产净值	7,581,726,026.61
5.期末基金份额净值	1.0894

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名: 魏少敏
性别: 男
国籍: 中国
学历: 硕士研究生
证券从业年限: 15年

4.2 报告期内基金投资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《证券投资基金法》及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》、《防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管理制度。公司使用的交易系统设置了公平交易模块，一旦出现不同时间同买同卖同一证券时，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多的单边交易超过该证券当日成交量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

今年2季度以来，全球贸易、投资、工业生产等活动放缓态势更加明显，保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大，主要经济体都面临程度不同的经济下行压力。从目前形势看，中美经贸摩擦、美国脱欧推迟、美国经济放缓、英镑贬值等因素都对今年世界经济走势构成不利影响产生较大影响。美国经济依旧保持强劲，但非农业增速放缓，长期国债期限利差出现抬升，经济复苏趋势明显，美联储已停止加息，并将9月暂停缩表。发达国家的货币政策宽松，部分新兴经济体出现金融动荡，世界经济处于长期调整回落期，下行风险加大。

国内方面，整体而言，2季度经济增速相比1季度增速放缓。2季度消费增速有所下行，特别是4月份社会消费品零售总额同比出现大幅下降，制造业投资也有所乏力，在消费与投资均有回落的情况下，6月制造业投资缺乏动力。综合起来，预计6月固定资产投资增速从5.6%下行至5.4%。此外，4-5月工业增加值同比数据继续回落，显示工业生产依然疲弱。5月份工业增加值增速继续回落至5%，PMI生产指数也出现小幅回落，6月份PMI生产指数进一步下行至51.3，显示工业生产依然疲弱。5月工业企业利润有所反弹，可能是减税政策显现，但利润改善之间存在传导时滞，年内制造业投资仍将维持低位。工业生产可能有好转，但是地产开工需求出现进一步走弱迹象，下游制造需求仍然不佳，两大权重旺季承压。地产销售增速持续探底，汽车产销数据恶化，6月出口数据仍呈下降，随着制造业投资、房地产投资、消费、出口数据的恶化，基本面下行压力较大。

§ 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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	0.00
2	其中:股票	-	0.00
3	基金投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	7,482,247,400.00	98.39
5	其中:质押式回购	7,482,247,400.00	98.39
6	银行存款	-	0.00
7	买入金融资产	-	0.00
8	应收利息	52,516,726.61	0.69
9	其他资产	79,546,700.79	1.03
10	合计	7,634,810,826.23	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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

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	190309	19国债09	8,000,000	814,000.00	10.74
2	091901002	19央行票据02	7,000,000	709,210,000.00	9.23
3	100411	10国债11	7,000,000	706,250,000.00	9.13
4	100302	10国债02	6,700,000	678,200,000.00	8.87
5	130226	13国债26	6,000,000	621,420,000.00	8.14

5.4 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资产支持证券投资明细

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贵金属投资明细

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权证投资明细

5.7 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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

§ 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

投资者类别	持有基金份额比例达到或超过20%的投资者	期初	期末	期初	期末	期初	期末	持有份额	占比(%)
机构	1	2019年04月01日-2019年6月30日	7,017,282,470.00	-	-	-	-	7,017,282,470.00	98.99

8.2 产品持有人结构

8.3 其他重要事项

§ 9 备查文件目录

- 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;
- 《建信睿富纯债债券型证券投资基金基金合同》;
- 《建信睿富纯债债券型证券投资基金招募说明书》;
- 《建信睿富纯债债券型证券投资基金托管协议》;
- 基金管理人业务资格批件和营业执照;
- 基金托管人业务资格批件和营业执照;
- 报告期内基金管理人指定报刊上披露的各项公告;
- 报告期内基金管理人指定报刊上披露的各项公告;
- 投资者可在营业时间内免费查阅，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7月17日

建信睿享纯债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

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7月17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7月15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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	建信睿享纯债债券型证券投资基金
基金代码	000901
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2016年11月26日
报告期末基金份额总额	7,017,284,976.23

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期已实现收益	70,223,486.64
2.本期利润	46,133,043.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0067
4.期末基金资产净值	7,581,726,026.61
5.期末基金份额净值	1.0894

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名: 魏少敏
性别: 男
国籍: 中国
学历: 硕士研究生
证券从业年限: 15年

4.2 报告期内基金投资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《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定和《建信睿享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》、《防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管理制度。公司使用的交易系统设置了公平交易模块，一旦出现不同时间同买同卖同一证券时，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多的单边交易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

今年2季度以来，全球贸易、投资、工业生产等活动放缓态势更加明显，保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大，主要经济体都面临程度不同的经济下行压力。从目前形势看，中美经贸摩擦、美国脱欧推迟、美国经济放缓、英镑贬值等因素都对今年世界经济走势构成不利影响产生较大影响。美国经济依旧保持强劲，但非农业增速放缓，长期国债期限利差出现抬升，经济复苏趋势明显，美联储已停止加息，并将9月暂停缩表。发达国家的货币政策宽松，部分新兴经济体出现金融动荡，世界经济处于长期调整回落期，下行风险加大。

国内方面，整体而言，2季度经济增速相比1季度增速放缓。2季度消费增速有所下行，特别是4月份社会消费品零售总额同比出现大幅下降，制造业投资也有所乏力，在消费与投资均有回落的情况下，6月制造业投资缺乏动力。综合起来，预计6月固定资产投资增速从5.6%下行至5.4%。此外，4-5月工业增加值同比数据继续回落，显示工业生产依然疲弱。5月份工业增加值增速继续回落至5%，PMI生产指数也出现小幅回落，6月份PMI生产指数进一步下行至51.3，显示工业生产依然疲弱。5月工业企业利润有所反弹，可能是减税政策显现，但利润改善之间存在传导时滞，年内制造业投资仍将维持低位。工业生产可能有好转，但是地产开工需求出现进一步走弱迹象，下游制造需求仍然不佳，两大权重旺季承压。地产销售增速持续探底，汽车产销数据恶化，6月出口数据仍呈下降，随着制造业投资、房地产投资、消费、出口数据的恶化，基本面下行压力较大。

§ 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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	0.00
2	其中:股票	-	0.00
3	基金投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	7,482,247,400.00	98.39
5	其中:质押式回购	7,482,247,400.00	98.39
6	银行存款	-	0.00
7	买入金融资产	-	0.00
8	应收利息	52,516,726.61	0.69
9	其他资产	79,546,700.79	1.03
10	合计	7,634,810,826.23	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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

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	190309	19国债09	8,000,000	814,000.00	10.74
2	091901002	19央行票据02	7,000,000	709,210,000.00	9.23
3	100411	10国债11	7,000,000	706,250,000.00	9.13
4	100302	10国债02	6,700,000	678,200,000.00	8.87
5	130226	13国债26	6,000,000	621,420,000.00	8.14

5.4 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资产支持证券投资明细

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贵金属投资明细

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权证投资明细

5.7 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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

§ 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

投资者类别	持有基金份额比例达到或超过20%的投资者	期初	期末	期初	期末	期初	期末	持有份额	占比(%)
机构	1	2019年04月01日-2019年6月30日	7,017,282,470.00	-	-	-	-	7,017,282,470.00	98.99

8.2 产品持有人结构

8.3 其他重要事项

§ 9 备查文件目录

- 中国证监会批准建信睿享纯债债券型证券投资基金设立的文件;
- 《建信睿享纯债债券型证券投资基金基金合同》;
- 《建信睿享纯债债券型证券投资基金招募说明书》;
- 《建信睿享纯债债券型证券投资基金托管协议》;
- 基金管理人业务资格批件和营业执照;
- 基金托管人业务资格批件和营业执照;
- 报告期内基金管理人指定报刊上披露的各项公告;
- 报告期内基金管理人指定报刊上披露的各项公告;
- 投资者可在营业时间内免费查阅，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7月17日

建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

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7月17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7月15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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金
基金代码	000902
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2016年11月26日
报告期末基金份额总额	7,017,284,976.23

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期已实现收益	70,223,486.64
2.本期利润	46,133,043.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0067
4.期末基金资产净值	7,581,726,026.61
5.期末基金份额净值	1.0894

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名: 魏少敏
性别: 男
国籍: 中国
学历: 硕士研究生
证券从业年限: 15年

4.2 报告期内基金投资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《证券投资基金法》及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发起式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》、《防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管理制度。公司使用的交易系统设置了公平交易模块，一旦出现不同时间同买同卖同一证券时，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多的单边交易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

今年2季度以来，全球贸易、投资、工业生产等活动放缓态势更加明显，保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大，主要经济体都面临程度不同的经济下行压力。从目前形势看，中美经贸摩擦、美国脱欧推迟、美国经济放缓、英镑贬值等因素都对今年世界经济走势构成不利影响产生较大影响。美国经济依旧保持强劲，但非农业增速放缓，长期国债期限利差出现抬升，经济复苏趋势明显，美联储已停止加息，并将9月暂停缩表。发达国家的货币政策宽松，部分新兴经济体出现金融动荡，世界经济处于长期调整回落期，下行风险加大。

国内方面，整体而言，2季度经济增速相比1季度增速放缓。2季度消费增速有所下行，特别是4月份社会消费品零售总额同比出现大幅下降，制造业投资也有所乏力，在消费与投资均有回落的情况下，6月制造业投资缺乏动力。综合起来，预计6月固定资产投资增速从5.6%下行至5.4%。此外，4-5月工业增加值同比数据继续回落，显示工业生产依然疲弱。5月份工业增加值增速继续回落至5%，PMI生产指数也出现小幅回落，6月份PMI生产指数进一步下行至51.3，显示工业生产依然疲弱。5月工业企业利润有所反弹，可能是减税政策显现，但利润改善之间存在传导时滞，年内制造业投资仍将维持低位。工业生产可能有好转，但是地产开工需求出现进一步走弱迹象，下游制造需求仍然不佳，两大权重旺季承压。地产销售增速持续探底，汽车产销数据恶化，6月出口数据仍呈下降，随着制造业投资、房地产投资、消费、出口数据的恶化，基本面下行压力较大。

§ 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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	0.00
2	其中:股票	-	0.00
3	基金投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	7,482,247,400.00	98.39
5	其中:质押式回购	7,482,247,400.00	98.39
6	银行存款	-	0.00
7	买入金融资产	-	0.00
8	应收利息	52,516,726.61	0.69
9	其他资产	79,546,700.79	1.03
10	合计	7,634,810,826.23	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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股股票投资组合

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	190309	19国债09	8,000,000	814,000.00	10.74
2	091901002	19央行票据02	7,000,000	709,210,000.00	9.23
3	100411	10国债11	7,000,000	706,250,000.00	9.13
4	100302	10国债02	6,700,000	678,200,000.00	8.87
5	130226	13国债26	6,000,000	621,420,000.00	8.14

5.4 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资产支持证券投资明细

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贵金属投资明细

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权证投资明细

5.7 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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

§ 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

投资者类别	持有基金份额比例达到或超过20%的投资者	期初	期末	期初	期末	期初	期末	持有份额	占比(%)
机构	1	2019年04月01日-2019年6月30日	7,017,282,470.00	-	-	-	-	7,017,282,470.00	98.99

8.2 产品持有人结构

8.3 其他重要事项

§ 9 备查文件目录

- 中国证监会批准建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件;
- 《建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》;
- 《建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》;
- 《建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》;
- 基金管理人业务资格批件和营业执照;
- 基金托管人业务资格批件和营业执照;
- 报告期内基金管理人指定报刊上披露的各项公告;
- 报告期内基金管理人指定报刊上披露的各项公告;
- 投资者可在营业时间内免费查阅，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7月17日

建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

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7月17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7月15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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金
基金代码	000902
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2016年11月26日
报告期末基金份额总额	7,017,284,976.23

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期已实现收益	70,223,486.64
2.本期利润	46,133,043.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0067
4.期末基金资产净值	7,581,726,026.61