建信瑞盛添利混合型证券投资基金 2016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:2017年3月29日

§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,并由董事长签发。

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2017年3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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2016年9月13日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信瑞盛添利混合	
基金主代码	003057	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年9月13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	1,008,248,318.46份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	建信瑞盛添利混合A	建信瑞盛添利混合C
下属分级基金的交易代码:	003057	003058
报告期末下属分级基金的份额总额	3,708,807.44份	1,004,539,511.02份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过灵活的资产配置,在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会,力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和金融衍生品投资策略四部分组成。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中债综合指数(全价)收益率×60%
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低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。

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	吴剛明	方舞
	联系电话	010-66228888	4008800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	fangwu4@citicbank.com.cn
客户服务电话?		400-81-95533 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.ccbfund.cn
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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年9月13日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	建信瑞盛添利混合A	建信瑞盛添利混合C
本期已实现收益	33,950.99	5,297,118.16
本期利润	9,699.16	-943,815.63
加权平均基金份额本期利润	0.0020	-0.0009
本期基金份额净值增长率	0.13%	-0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0013	-0.0010
期末基金资产净值	3,713,453.69	1,003,582,698.26
期末基金份额净值	1.0013	0.9990

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数,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数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣抵未实现部分)。

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。

4、本基金合同于2016年9月13日生效,截至报告期末仍处于建仓期。

3.2 基金净值表现

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

建信瑞盛添利混合A

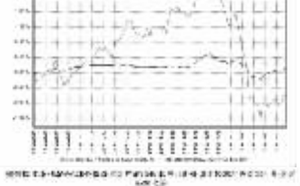
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.02%	0.06%	-0.68%	0.32%	0.66%	-0.26%
自基金合同生效起至今	0.13%	0.06%	-0.69%	0.31%	0.82%	-0.25%

建信瑞盛添利混合C

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	-0.23%	0.06%	-0.68%	0.32%	0.45%	-0.26%
自基金合同生效起至今	-0.10%	0.06%	-0.69%	0.31%	0.59%	-0.25%

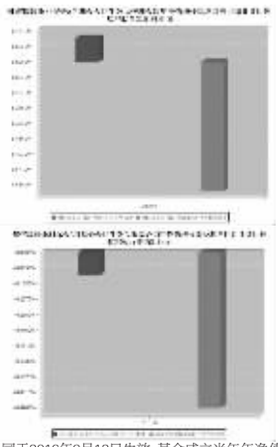
本基金投资业绩比较基准为:沪深300指数收益率×40%+中债综合指数(全价)收益率×60%。沪深300指数选样科学客观,流动性高,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中债综合指数具广泛市场代表性,旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。基于本基金的特征,使用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

3.2.2 自基金合同生效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



本基金合同于2016年09月13日生效,截至报告期末仍处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本基金基金合同于2016年9月13日生效,基金成立当年年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同自2016年9月13日起生效,基金合同生效以来未发生利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19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、信安金融服务公司、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出资额占注册资本的65%,信安金融服务公司出资额占注册资本的25%,中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、量化衍生品及海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部,以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北两个营销中心,并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观,恪守“持有人利益重于泰山”的原则,以“建设财富生活”为崇高使命,坚持规范运作,致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至2016年12月31日,公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信双周期安心理财债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信中证500指数增强型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信嘉新宝货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信瑞盛添利混合型证券投资基金、建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒丰纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金共82只开放式基金,管理的公募基金资产规模共计为3770.62亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
牛兴华	本基金的基金经理	2016年10月25日	-	6	硕士,曾任神州数码(中国)有限公司投资专员;2010年9月加入中诚信国际信用评级有限责任公司,历任分析师、分析师/项目经理、高级分析师/研究经理、信用评级部负责人兼研究员、固定收益投资部基金经理。2014年12月21日起任建信稳定增利债券基金基金经理;2015年4月17日起任建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年5月13日起任建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年5月14日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年6月16日起任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年7月2日至2016年11月25日任建信鑫裕回报灵活配置混合型证券投资基金;2016年10月25日起任建信安心保本一号混合型证券投资基金基金经理;2016年2月22日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金基金经理;2016年10月25日起任建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金经理;2016年12月23日起任建信鑫裕回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年12月23日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
陈建良	固定收益投资部基金经理、基金管理部总监助理	2016年9月13日	-	9	2006年6月加入中国建设银行厦门分行,任客户经理;2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部,任债券交易员;2013年9月加入我公司,历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总助理。2013年12月10日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信月盈安心理财基金基金经理;2014年4月17日起任建信嘉新宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币基金的基金经理;2016年3月14日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金基金经理;2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金基金经理;2016年9月21日起任建信现金添益交易型货币市场基金基金经理;2016年9月13日起任建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金经理;2016年10月18日起任建信基金天添益货币市场基金基金经理。

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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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引意见》、《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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下(日内、3日内、5日内)管理的不同投资组合(包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下:

当时间窗为1日时,配了19338对投资组合,有4101对投资组合未通过T检验,其中1329对投资组合的正溢价率占优频率小于55%,其它2772对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,其中1807对平均溢价率低于2%,其它965对平均溢价率超过2%的投资组合中,其中920对贡献率均未超过5%,另外45对溢价率组合组合净资产比例很小,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为3日时,配了20730对投资组合,有4694对投资组合未通过T检验,但其中822对投资组合的溢价率占优频率均小于55%,其它3872对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,其中3601对平均溢价率低于5%,其它271对平均溢价率超过5%的投资组合中,有235对贡献率未超过5%,另外36对溢价金额占组合净资产比例很小,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为5日时,配了21350对投资组合,有5960对投资组合未通过T检验,但其中1162对投资组合的溢价率占优频率均小于55%,其它4798对正溢价率占优频率大于55%的投资组合,其中4709对平均溢价率低于10%,其它89对平均溢价率超过10%的投资组合中,有80对贡献率均未超过5%,另外9对溢价金额占组合净资产比例很小,同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年,中国宏观经济整体保持平稳运行态势,全年预计完成GDP增速6.7%。从需求上看,虽然固定资产投资增速持续下滑,但火热的房地产市场销售带动地产投资增速快速回升至6.9%的水平。“930新政”短期内从销售端到投资端的传导尚未充分显现,2016当年房地产投资未见明显收缩,全年房地产投资累计增速仍然维持在较高水平。基建投资方面,虽然下半年有所放缓,但全年来看仍然是托底经济最主要的因素之一,累计增速维持在15.7%。受供给侧改革影响,二季度以来工业产出表现平稳,工业增加值单月同比维持在6%以上。工业企业利润显著改善并带动制造业投资在2016年8月份触底反弹,全年录得4.20%的同比增速。

物价方面,受到供给侧改革、低库存以及国内外市场需求企稳等因素影响,2016年PPI连续下跌53个月后于2016年8月翻正,并与CPI缺口完全收敛。CPI物价除一季度和四季度因蔬菜价格涨幅较大受到扰动外,总体表现平稳,全年CPI同比稳定在2%的水平,但工业领域产品价格上涨对消费端的传导已然显现。

货币政策方面,2016年央行保持稳健的政策基调。上半年在稳增长的目标下,央行一直维持市场短期利率的量价稳定,并在3月初降低存款准备金利率0.5个百分点,以引导货币信贷规模平稳增长。此后,一直采用“逆回购+MLF”滚动续作的方式进行货币投放和政策引导。下半年经济下行压力缓解,政策目标向抑制资产泡沫和金融机构去杠杆切换,先后在8月和9月重启14天和28天逆回购,拉长政策工具久期,抬升资金供给成本,引发了市场预期的短暂混乱。11月受海外市场动荡、机构间信任危机等因素叠加影响,银行间市场出现流动性阶段性紧张。汇率方面,受美国加息预期引导以及特朗普上台等因素影响,人民币兑美元汇率先后在二季度和四季度经历两次急贬,中间价从年初的6.5032上涨至年底的6.9370,全年贬值幅度达到6.67%。

债券市场方面,年初在强劲的配置力量的带动下,收益率出现一波快速下行,10年国开债短暂下探至3%下方的年内低点。3月份起MPA对银行资产端的约束开始显现,资金面迎来年内首次大幅波动。4月份一系列的信用风险事件集中爆发,叠加“营改增”等不确定性因素的影响,收益率开始震荡上行,10年国债收益率回到3%上方,机构风险偏好降低,信用利差明显扩大。此后央行货币政策转向温和,债券市场逐步消化信用冲击带来的收益率上行,收益率开始小幅回落并保持相对稳定较长时间。特朗普上台叠加美联储加息引发全球无风险利率上,国内债券市场在11月开始了一波迅猛的深幅调整,10年国债及10年国开收益分别上限70BP和90BP。尽管在12月末收益率出现恢复性下行,但从全年看,10年国债收益率年末报收3.0115%,较年初上行超过19BP。

基金成立于三季度末,回顾四季度的基金管理工作,组合久期保持较短水平,小幅增加短久期信用债配置比例。权益方面,择机参与了包括股票和转债在内的权益产品的波段操作,并积极参与新股申购以增厚收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信瑞盛添利A净值增长率0.13%,波动率0.06%,建信瑞盛添利C净值增长率-0.1%,波动率0.06%;业绩比较基准收益率-0.69%,波动率0.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年,我们认受益于供给侧改革以及全球经济弱复苏,经济基本面将有所改善。上半年经济复苏动能依旧强劲,虽然房地产市场受政策调控影响面临较大的下行压力,但基建、制造业投资、出口等方面改善能够对经济起到积极的对冲作用。货币政策方面,央行再提流动性总阀门以及引导去杠杆的意图明确。在货币政策整体稳健偏紧的政策基调下,整体流动性较上年会有所收紧。考虑到国内PPI持续创新高以及联储加息等影响,下半年通胀因素或将制约货币政策转向宽松。股票市场方面,我们仍然认为在经济持续改善的过程中,相对低估值的蓝筹板块及周期股将会有较好的投资机会。本基金将本着稳健运营的理念,适度参与二级市场股票的投资,增加现金类和债券类资产的配置,积极参与一级市场股票申购增厚组合收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策;对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督;对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总裁、督察长、投资总经理、研究总经理、风险管理总经理、运营总经理及监察稽核总经理组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成(具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定)。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件,发现估值问题;提议基金估值调整的相关方案并进行校验;根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案,报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理,并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的,由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果,基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金)。

自2015年3月26日起,公司按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值价格,对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配,符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对建信瑞盛添利混合型证券投资基金2016年度基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司在建信瑞盛添利混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的建信瑞盛添利混合基金2016年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了后附的建信瑞盛添利混合型证券投资基金(以下简称“建信瑞盛添利混合基金”)的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016年9月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表,并出具了普华永道中天审字(2017)第21914号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:建信瑞盛添利混合型证券投资基金
报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年12月31日
资 产:		
银行存款		4,967,321.04
结算备付金		2,596,318.40
存出保证金		60,945.94
交易性金融资产		837,609,552.65
其中:股票投资		70,556,552.65
基金投资		-
债券投资		767,053,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		155,240,425.36
应收证券清算款		5,005,527.78
应收利息		5,235,147.83
应收股利		-
应收申购款		9.96
递延所得税资产		-
其他资产		0.02
资产总计		1,010,715,248.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		2,013,004.47
应付赎回款		33,940.89
应付管理人报酬		589,542.15
应付托管费		170,730.18
应付销售服务费		104,291.13
应付交易费用		297,381.71
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		210,218.56
负债合计		3,419,109.09
所有者权益:		
实收基金		1,008,248,318.46
未分配利润		-952,178.57
所有者权益合计		1,007,296,139.89
负债和所有者权益总计		1,010,715,248.98

1、报告截止日2016年12月31日,基金份额总额1,008,248,318.46份。其中建信瑞盛添利混合基金A类基金份额净值1.0013元,基金份额总额3,708,807.44份;建信瑞盛添利混合基金C类基金份额净值0.9990元,基金份额总额1,004,539,511.02份。

2、本财务报表的实际编制期间为2016年9月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:建信瑞盛添利混合型证券投资基金
本报告期:2016年9月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2016年9月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入		3,677,256.11
1.利息收入		8,510,206.31
其中:存款利息收入		3,730,356.12
债券利息收入		3,724,751.69
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,055,098.50
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,412,162.34
其中:股票投资收益		2,531,583.61
基金投资收益		-
债券投资收益		-1,221,967.27
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		102,546.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-6,265,185.62
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		20,074.08
减:二、费用		4,611,372.58
1. 管理人报酬		2,754,008.81
2. 托管费		603,623.52
3. 销售服务费		534,932.38
4. 交易费用		446,469.28
5. 利息支出		39,786.19
其中:卖出回购金融资产支出		39,786.19
6. 其他费用		232,552.40
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-934,116.47
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-934,116.47

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信瑞盛添利混合型证券投资基金
本报告期:2016年9月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年9月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,020,157,462.35	-	1,020,157,462.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-934,116.47	-934,116.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-11,909,143.89	-18,062.10	-11,927,205.99
其中:1.基金申购款	50,590.25	-125.46	50,464.79
2.基金赎回款	-11,959,734.14	-17,936.64	-11,977,670.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,008,248,318.46	-952,178.57	1,007,296,139.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

孙志晨 赵乐峰 丁颖
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信瑞盛添利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2424号《关于准予建信鑫和回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及证监许可[2016]1572号《关于准予建信鑫和回报灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,020,016,152.33元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1219号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,020,157,462.35份基金份额,其中认购资金利息折合141,310.02份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为A类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他依法上市的股票)、债券(包含国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、权证、股指期货、国债期货、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为:股票等权益类金融工具占基金资产的比例不超过40%,债券等固定收益类金融工具占基金资产的比例不低于60%,其中每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×40%+中债综合指数(全价)收益率×60%。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于2017年03月27日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年9月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年9月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2016年9月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本