建信优选成长混合型证券投资基金

【2017】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:2017年4月22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2017年4月19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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信优选成长混合
基金主代码	530003
交易代码	530003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月8日
报告期末基金份额总额	1,279,104,238.01份
投资目标	通过投资于具有良好业绩成长性和投资价值的上市公司,实现基金资产长期增值。
投资策略	本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例,调整原则和调整范围,定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数+20%×中国债券总指数+5%×1年定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信优选成长混合A / 建信优选成长混合H
下属分级基金的交易代码	530003 / 960028
报告期末下属分级基金的份额总额	1,276,265,796.38份 / 2,838,441.63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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	建信优选成长混合A	建信优选成长混合H
1. 本期已实现收益	37,842,694.18	87,044.00
2. 本期利润	14,813,774.29	108,616.29
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0113	0.0367
4. 期末基金资产净值	2,183,825,035.68	4,869,661.22
5. 期末基金份额净值	1.7111	1.7156

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入本期公允价值变动收益。

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、本基金自2016年4月7日起新增H类份额,并于2016年6月22日开始在香港特别行政区发售。

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

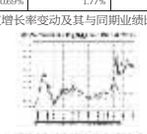
建信优选成长混合A

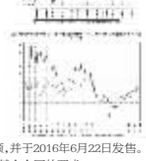
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.56%	0.69%	1.77%	0.44%	-1.21%	0.25%

建信优选成长混合H

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	0.69%	0.69%	1.77%	0.44%	-1.08%	0.25%

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





1.本基金于2016年4月7日起新增H类份额,并于2016年6月22日发售。
2.本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§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		
姚锦	权益投资部总经理,本基金的基金经理	2012年2月17日	-	12	博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师,天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职,2009年3月17日至2011年2月8日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理;2009年12月17日至2011年5月5日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理。历任我公司研究部首席策略分析师、权益投资部副总监兼研究部首席策略分析师、权益投资部总经理,2012年2月17日起任建信优选成长混合型证券投资基金基金经理,2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理;2014年1月20日起任建信保本基金的基金经理,该基金于1月23日起转型为建信积极配置混合型证券投资基金基金,姚锦继续担任该基金的基金经理。

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,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》、《证券投资基金法》、《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少的单边交易量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

2017年以来美国政策预期仍旧是全球最关注的事件之一。美国和欧洲部分经济先行数据转好,美联储加息确认宽松货币政策结束。大宗商品价格和美国国债价格波动加大,美国股票指数在创历史新高后呈现震荡走势。以三四线地产为代表,国内增长稳定,对未来经济影响最大的关注点在地方政府基建项目的落实。以CPI为代表的通胀平稳,综合考虑PPI和房价等的广义通胀处于较高水平。

2017年一季度,受较好增长预期的影响,股票市场整体上表现较好。结构上来看,以水泥和钢铁为代表的基建品超额收益明显,以一带一路为代表的主题板块表现突出,兼具消费属性和投资属性的白酒行业表现较好。本基金在一季度对经济的判断未能及时契合到市场预期,配置的重点偏向于消费和成长,因此结构上与市场出现一定的偏离。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期优选成长A净值增长率0.56%,波动率0.69%,优选成长H净值增长率0.69%,波动率0.69%;业绩比较基准收益率1.77%,波动率0.44%。

§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	1,661,867,749.62	75.49
	其中:股票	1,661,867,749.62	75.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	491,692,048.42	22.34
8	其他资产	47,877,634.50	2.17
9	合计	2,201,437,432.54	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	56,759,604.04	2.59
B	采矿业	-	-
C	制造业	400,585,453.49	18.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	212,404.44	0.01
F	批发和零售业	279,083,944.00	12.75
G	交通运输、仓储和邮政业	444,345,234.52	20.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	146,787,379.20	6.71
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	172,265,493.68	7.87
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
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	19,427,097.89	0.89
R	文化、体育和娱乐业	142,384,208.20	6.51
S	综合	-	-
	合计	1,661,867,749.62	75.93

以上行业分类以2017年3月31日的中国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沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期未投资沪港通股票。

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	300081	恒信移动	10,822,262	152,593,894.20	6.97
2	300356	光一科技	4,467,574	134,920,734.80	6.16
3	601111	中国国航	12,559,743	104,120,269.47	4.76
4	600029	南方航空	12,895,317	103,936,255.02	4.75
5	002624	完美世界	3,438,336	101,396,528.64	4.63
6	000429	粤高速A	11,781,833	88,717,202.49	4.05
7	002127	南极电商	7,370,738	86,974,708.40	3.97
8	600153	建发股份	7,869,840	86,332,144.80	3.94
9	601888	中国国旅	1,504,512	85,290,785.28	3.90
10	600897	厦门空港	3,274,837	84,490,794.60	3.86

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资于国债期货。

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均无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	1,212,690.53
2	应收证券清算款	45,021,536.06
3	应收股利	-
4	应收利息	86,412.96
5	应收申购款	1,556,994.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,877,634.50

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信优选成长混合A	建信优选成长混合H
报告期期初基金份额总额	1,357,049,418.71	5,176,612.01
报告期期间基金总申购份额	81,383,944.77	367,249.05
减:报告期期间基金总赎回份额	162,167,567.10	2,705,419.43
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期末基金份额总额	1,276,265,796.38	2,838,441.63

上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	2,965,973.76
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期末管理人持有的本基金份额	2,965,973.76
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.23

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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优选成长混合型证券投资基金设立的文件;
2、《建信优选成长混合型证券投资基金基金合同》;
3、《建信优选成长混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信优选成长混合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
2017年4月22日

建信月盈安心理财债券型证券投资基金

【2017】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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信月盈安心理财
基金主代码	530028
交易代码	530028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月20日
报告期末基金份额总额	2,034,617,130.04份
投资目标	严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报,并力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过积极主动的组合管理,充分运用各种短期投资工具,力争为持有人创造低风险基础上的投资收益。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过150天。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)
风险收益特征	本基金属于债券基金,长期风险收益水平低于股票基金、混合基金,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	中国民生银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信月盈安心理财A / 建信月盈安心理财B
下属分级基金的交易代码	530028 / 531028
报告期末下属分级基金的份额总额	246,530,185.65份 / 1,788,086,944.39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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
1. 本期已实现收益	1,874,034.83	15,028,560.95
2. 本期利润	1,874,034.83	15,028,560.95
3. 期末基金资产净值	246,530,185.65	1,788,086,944.39

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入本期公允价值变动收益,由于该基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

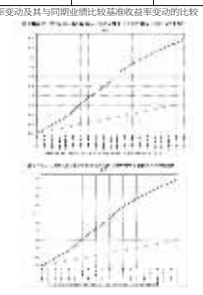
建信月盈安心理财A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6850%	0.0019%	0.3329%	0.0000%	0.3521%	0.0019%

建信月盈安心理财B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7572%	0.0019%	0.3329%	0.0000%	0.4243%	0.0019%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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。

§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7月19日	-	7	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,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日起任建信睿享纯债债券型证券投资基金基金经理,2016年11月22日起任建信恒丰纯债债券型证券投资基金基金经理,2016年11月25日起任建信睿富纯债债券型证券投资基金基金经理。
陈建良	固定收益投资部总经理、本基金的基金经理	2014年1月21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6月17日起任建信嘉御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市场基金的基金经理;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。
高珊	本基金的基金经理	2012年12月20日	-	10	硕士,2006年7月至2007年6月期间在中信建投证券公司工作,任交易员。2007年6月加入建信基金管理公司,历任初级交易员、交易员,2009年7月起任建信货币市场基金的基金经理助理。2012年8月20日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年1月29日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年9月17日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年12月20日起任建信货币市场基金基金经理;2015年8月25日起任建信现金添利货币市场基金基金经理;2016年6月3日起任建信鑫盛回报灵活配置基金的基金经理;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10月18日起任建信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,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》、《证券投资基金法》、《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少的单边交易量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

2017年一季度,美联储如加息之后国内债市大幅反弹,10年国债由3.41%回落至3.38%,最终下行至3.31%的位置,人民币汇率相对平稳。中国宏观经济运行总体平稳。1-2月工业企业利润同比猛增23个百分点,国企利润同比翻番;3月统计局PMI创近5年新高。具体到各项:基础设施建设有望加速至10%以上,虽然房地产投资增速略有下行但约是今年拉动投资的主力;地产只续投资面临可持续性和资金来源等问题,预计在二季度达到高点;制造业投资增速有限,同比下滑;消费数据方面,汽车消费下滑拖累明显,但与地产相关性较强的建筑装潢材料表现抢眼。随着高铁基建向二四线城市的深入,地方商业模式及收入水平提高带动消费方式发生变化,未来中国经济有可能转向消费驱动。

通胀方面,食品价格持续下跌,生产资料环比由正转负。根据最新的周度数据,食品价格周环比增速-0.2%,跌幅较上周收窄,猪肉和蔬菜仍在下降。生产资料价格环比增速为-0.2%,环比增速由正转负。从高频数据来看,3月CPI同比可能小幅回升;2月PPI 可能是年内高点。

货币政策方面,央行货币政策总体基调稳健,维持中性偏紧且灵活适度的调控思路,运用逆回购、MLF等进行资金投放,在保证流动性适度的同时合理引导银行间市场资金供给期限结构。有利于人民币维稳,减轻资本流出压力。由于MPA考核纳入表外理财,不少银行的"广义信贷"额度十分紧张,只能被动赎回货币基金,资管业务扩张势头遭遇逆转,同时导致在途资金的链条被拉长,流动性风险管理难度上升,时点性的资金需求被放大,虽然3月末银行间市场顺利度过了新口径下MPA的首次考核,但跨季度未资金利率一度冲高至15%,预计未来维持紧张。

债券市场方面,信用债正在重塑定价,上最严重的发行高潮。由于中小银行理财和委外资金到期回流和赎回压力加剧,需求状况不容乐观。在这种供需两弱的格局下,信用债存供给的大幅收缩会造成低评级企业再融资风险增大,从而增加信用风险,给信用利差带来阶段性的压力。

建信月盈安心理财债券型证券投资基金在第一季度维持了一贯稳健的投资风格,维持了短久期和低杠杆,有效的根据申赎合理安排资金和配置债券,在李未的收益率高点配置了大量优质资产,为投资人带来了合理的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期月盈A净值收益率0.6850%,波动率0.0019%;月盈B净值收益率0.7572%,波动率0.0019%;业绩比较基准收益率0.3329%,波动率0.0000%。

§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	固定收益投资	887,859,612.08	38.51
	其中:债券	887,859,612.08	38.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	493,067,579.60	21.39
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	912,654,543.74	39.59
4	其他资产	11,658,490.09	0.51
5	合计	2,305,240,225.51	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.71	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	269,423,795.96	13.24
	其中:买断式回购融资	-	-

报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	57
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	78
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	40

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过150天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	36.49	13.24
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	23.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	28.82	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	12.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	11.57	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		112.73	13.24

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	110,452,587.43	5.43
	其中:政策性金融债	110,452,587.43	5.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	777,407,024.65	38.21
8	其他	-	-
9	合计	887,859,612.08	43.64
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本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	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111610181	16兴业CD181	1,000,000	100,000,000.00	4.91
2	111613104	16浙商CD104	1,000,000	99,988,459.53	4.91
3	111696601	16宁波银行CD177	950,000	94,999,747.08	4.67
4	140225	14国开25	600,000	60,385,256.80	2.97
5	150417	15农发17	500,000	50,067,330.63	2.46
6	111793703	17天津银行CD024	500,000	49,926,714.98	2.45
7	111696338	16华融湘江银行CD046	500,000	49,718,650.17	2.44
8	111793062	17广州银行CD020	500,000	49,592,614.61	2.44
9	111793210	17成都银行CD023	500,000	49,587,666.25	2.44
10	111692414	16广州农村商业银行CD049	400,000	39,969,194.72	1.96

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-0.0246%
报告期内偏离度的最低值	-0.1683%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0723%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1
本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.9.2
基金投资的前十名债券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

5.9.3 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	应收利息	11,487,880.09
4	应收申购款	170,610.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	11,658,490.09

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
报告期期初基金份额总额	311,191,160.69	2,409,190,446.82
报告期期间基金总申购份额	25,272,879.60	1,515,028,560.95
报告期期间基金总赎回份额	89,933,854.64	2,136,132,063.38
报告期期末基金份额总额	246,530,185.65	1,788,086,944.39

上述总申购份额含红利再投资份额。

§7 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	-	671,737.85	671,737.85	0.00%
合计			671,737.85	671,737.85	

§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	2月7日至3月1日	510,810,199.06	0.00	512,277,375.58	0.00	0.00
	2	3月2日至3月5日	310,331,515.12	0.00	207,724,001.99	103,991,180.54	5.11
	3	3月7日至3月31日	0.00	1,200,000,000.00	0.00	1,203,055,770.88	59.13
	4	3月6日	200,156,368.97	0.00	0.00	201,686,856.07	9.91
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月盈安心理财债券型证券投资基金设立的文件;
2、《建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信月盈安心理财债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信月盈安心理财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
2017年4月22日

建信中小盘先锋股票型证券投资基金

【2017】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:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信中小盘先锋股票
基金主代码	000729
交易代码	000729
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月20日
报告期末基金份额总额	201,921,485.70份
投资目标	本基金主要投资于具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势,判断当前所处的经济周期,进而对未来做出科学预测。在此基础上,结合对流动性及资金流向的分析,综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	85%×中证500指数收益率+15%×中债综合全价(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金,混合型基金,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	招商证券股份有限公司