建信新经济灵活配置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	建信新经济灵活配置混合
基金主代码	001276
交易代码	001276
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月26日
报告期末基金份额总额	748,905,616.10份
投资目标	本基金的股票资产主要投资于同新经济相关的上市公司股票,并且通过股票与债券等资产的合理配置,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,力争创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势等因素对各个行业及上市公司的影响以及核心股票资产的估值水平,合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例。本基金在对新经济相关产业研究的基础上,根据各产业中子行业在不同时期受益于新经济的程度,从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局多个角度综合评估各个行业的投资价值。本基金坚持“自下而上”的个股选择策略,选择投资标的,多维度认可标的价值,重点研究具有竞争力比较优势、未来成长空间大、持续经营能力强的上市公司。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:65%×沪深300指数收益率+35%×中债总财富(总值)指数收益率。
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高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	2,212,248.56
2.本期利润	39,143,631.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0512
4.期末基金资产净值	608,642,513.57
5.期末基金份额净值	0.813

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	6.83%	0.58%	2.68%	0.34%	4.15%	0.24%

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

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		
许杰	权益投资部副总经理、本基金的基金经理	2015年5月26日	-	14	硕士,特许金融分析师(CFA)。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员、2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司,历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职,2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理,2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理,2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011年10月加入我公司,2012年3月21日至2017年1月24日任建信恒稳价值混合型证券投资基金基金经理,2012年8月14日起任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理;2014年9月10日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金经理;2015年2月3日起任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年5月26日起任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年3月22日起任建信中小盘先锋股票基金经理。

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》、其他有关法律法规的规定和《建信新经济灵活配置混合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》、《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 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

资产配置方面,本基金一季度维持了积极的股票仓位。

本基金年初判断中国经济目前处于小周期的高点,而流动性偏紧,因而今年股票市场可能只有结构性的机会。因此,本基金报告期内自下而上重点配置了竞争力突出、业绩确定性增长同时估值具有安全边际的公司,期望通过业绩的增长带动股价的上升。从行业分布上看,这些公司大部分集中于消费升级、电子、基建、环保等行业。这些公司大部分在一季度有良好的股价表现,由于其业绩增长的可持续性和确定性,预计全年也可能有较好的表现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率6.83%,波动率0.58%,业绩比较基准收益率2.68%,波动率0.34%。

§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	505,101,709.96	80.87
	其中:股票	505,101,709.96	80.87
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	118,681,450.55	19.00
8	其他资产	769,905.10	0.12
9	合计	624,553,065.61	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

序号	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	391,151,154.28	64.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	69,983,350.31	11.50
F	批发和零售业	74,088.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	107,682.12	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,131.20	0.01
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	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	40,650,484.05	6.68
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	3,038,889.84	0.50
S	综合	-	-
	合计	505,101,709.96	82.99

以上行业分类以2017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沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

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	600519	贵州茅台	143,086	56,282,706.96	9.08
2	000423	东阿阿胶	669,408	43,913,164.80	7.21
3	600068	葛洲坝	3,551,480	41,800,919.60	6.87
4	002185	华天科技	3,066,600	40,693,782.00	6.69
5	603588	高能环境	1,394,115	40,650,484.05	6.68
6	600089	特变电工	3,444,937	38,548,845.03	6.33
7	000568	泸州老窖	833,225	35,153,762.75	5.78
8	300068	南都电源	1,399,736	30,892,173.52	5.08
9	002426	胜利精密	3,521,368	28,487,867.12	4.68
10	600879	航天电子	1,189,412	21,064,495.52	3.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期未未持有债券。

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

本基金本报告期未未持有债券。

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

本基金本报告期未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

本基金本报告期未未持有贵金属。

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

本基金本报告期未未持有权证。

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

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

本报告期本基金未投资国债期货。

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	728,366.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,562.58
5	应收申购款	23,975.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	769,905.10

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300068	南都电源	30,892,173.52	5.08	重大事项
2	002426	胜利精密	28,487,867.12	4.68	重大事项

本基金截至2017年3月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	774,711,882.08
报告期期间基金总申购份额	8,245,504.29
减:报告期期间基金总赎回份额	34,051,770.27
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	748,905,616.10

总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

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新经济灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信新经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信新经济灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信新经济灵活配置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

建信鑫悦回报灵活配置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:兴业银行股份有限公司
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。

基金托管人兴业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	建信鑫悦回报灵活配置混合
基金主代码	003830
交易代码	003830
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月2日
报告期末基金份额总额	800,678,271.04份
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、债券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	本基金将结合定性与定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,选择具有长期持续增长能力的公司。具体从公司基本状况和股票估值两个方面进行筛选。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数(全价)收益率×50%
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。
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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	9,625,944.72
2.本期利润	14,039,035.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0181
4.期末基金资产净值	812,829,959.83
5.期末基金份额净值	1.0152

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。

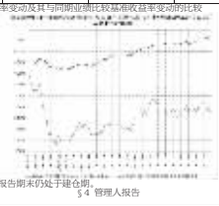
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.79%	0.05%	1.56%	0.27%	0.23%	-0.22%

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



本基金基金合同于2016年12月2日生效,截至报告期末仍处于建仓期。

§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		
牛兴华	本基金的基金经理	2016年12月2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/项目经理。2013年4月加入我公司,历任研究部债券研究员、固定收益投资部基金经理。2014年12月2日起任建信稳定得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;2015年7月2日至2015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;2015年10月29日起任建信安心保本二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27日起任建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年12月23日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年3月1日起任建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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》、其他有关法律法规的规定和《建信鑫悦回报灵活配置混合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》、《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 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

2016年一季度,A股市场在年初调整之后震荡上行,周期股和消费股先后有较好表现,对应的是市场对经济前景先后经历了乐观预期和随后的向下修正。结构上,A股市场呈现出明显的“大化于小”的特点,沪深300指数一季度上涨4.80%,创业板指数一季度下跌2.65%。市场偏好明显倾向于对确定性给予溢价,各个行业的蓝筹获得青睐,对应的逻辑是经济增速下降以及供给侧改革导致行业格局重塑,龙头公司的市占率和议价能力获得提升,从而导致盈利和资本回报率可能提升。

一季度根据市场变化,本基金适时调整配置思路和策略,适当提高家电、白酒等消费品的配置比例,增加了PEG低估的白马成长股的配置。总体上仍然是自下而上的个股选择为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率1.79%,波动率0.05%,业绩比较基准收益率1.56%,波动率0.27%。

§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	88,339,481.54	10.83
	其中:股票	88,339,481.54	10.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,171,000.00	12.28
	其中:债券	100,171,000.00	12.28
	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	40,000,000.00	4.90
	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	583,831,617.19	71.56
8	其他资产	3,671,387.25	0.45
9	合计	816,013,485.98	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	8,910,050.00	1.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,815,226.64	3.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,420,592.00	0.30
E	建筑业	1,657,562.86	0.20
F	批发和零售业	74,088.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	16,053,176.15	1.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,231,185.00	0.52
J	金融业	26,177,600.89	3.22
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	-	-
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	88,339,481.54	10.87

以上行业分类以2017年03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沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

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	600377	宁沪高速	1,257,960	11,761,926.00	1.45
2	600104	上汽集团	453,710	11,515,159.80	1.42
3	601398	工商银行	1,863,400	9,018,856.00	1.11
4	000998	隆平高科	429,400	8,910,050.00	1.10
5	601328	交通银行	1,416,143	8,822,570.89	1.09
6	601988	中国银行	2,253,020	8,336,174.00	1.03
7	600741	华域汽车	242,000	4,406,820.00	0.54
8	000997	新大陆	204,900	4,231,185.00	0.52
9	600029	南方航空	516,121	4,159,935.26	0.51
10	300232	洲明科技	268,100	3,954,475.00	0.49

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,088,000.00	4.93
	其中:政策性金融债	40,088,000.00	4.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	60,083,000.00	7.39
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	100,171,000.00	12.32

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	011754007	17鲁商SCP001	500,000	50,075,000.00	6.16
2	150201	15国开01	400,000	40,088,000.00	4.93
3	041756006	17孝感城投CP001	100,000	10,008,000.00	1.23

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

本基金本报告期未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

本基金本报告期未未持有贵金属。

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

本基金本报告期未未持有权证。

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

本基金本报告期未未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未未投资股指期货。

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未未投资国债期货。

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	129,104.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,542,282.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,671,387.25

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期未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

报告期期初基金份额总额	500,117,450.00
报告期期间基金总申购份额	300,560,931.04
减:报告期期间基金总赎回份额	110.00
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	800,678,271.04

§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

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

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 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	1月1日至3月31日	500,000,000.00	300,540,973.75	0.00	800,540,973.75	99.98	
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鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信鑫悦回报灵活配置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。

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

建信信息产业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:中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人光大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	建信信息产业股票
基金主代码	001070
交易代码	001070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月24日
报告期末基金份额总额	609,257,050.34份
投资目标	本基金主要投资于同信息产业相关的行业的上市公司股票,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,力争创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势等因素对各个行业及上市公司的影响以及核心股票资产的估值水平,综合分析证券市场的走势,主动判断市场时机,通过趋势的资产配置,合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险,提高收益。
业绩比较基准	85%×沪深300指数收益率+15%×中债总财富(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-20,992.34
2.本期利润	34,345,506.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0584
4.期末基金资产净值	710,989,251.96
5.期末基金份额净值	1.167

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。

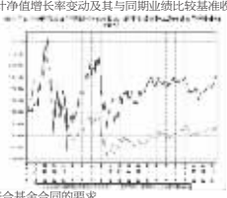
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	5.32%	0.75%	3.67%	0.44%	1.65%	0.31%

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



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		
邵卓	权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官,本基金的基金经理	2015年3月24日	-	8	硕士,2006年4月至2006年12月任明基(西门子)移动通信研发中心软件工程师;2007年2月至2010年7月任IBM中国软件实验室软件工程师;2010年7月加入广发证券公司,任计算机行业研究员。2011年9月加入我公司,历任研究员、研究主管、基金经理,权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官,2015年3月24日起任建信信息产业股票基金经理;2015年5月22日起任建信创新中国混合基金基金经理。

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》、其他有关法律法规的规定和《建信信息产业股票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》、《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