建信安心保本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	建信安心保本混合
基金主代码	000270
交易代码	000270
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月3日
报告期末基金份额总额	3,636,471,737.49份
投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理,在严格控制风险和保证本金安全的基础上,寻求组合资产的稳定增长和保本周期收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略来实现保本和增值的目标。恒定比例投资组合保险策略不仅能从投资组合资产配置的水平上基本消除投资到期时基金净值低于本金的可能性,而且能在一定程度上使基金分享股市整体性上涨带来的收益。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税前)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的中低风险品种。
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
基金保证人	重庆市三峡担保集团有限公司

§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	21,251,678.90
2.本期利润	24,052,140.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0066
4.期末基金资产净值	3,662,949,915.52
5.期末基金份额净值	1.007

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。

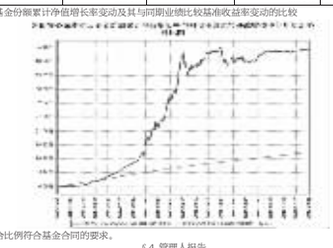
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.60%	0.04%	0.69%	0.01%	-0.09%	0.03%

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		
钟敬棣	固定收益部首席固定收益投资官、本基金的基金经理	2013年9月3日	-	11	特许金融分析师(CFA),硕士,加拿大籍华人。1995年7月毕业于南开大学金融系,获经济学学士学位,2004年5月毕业于加拿大不列颠哥伦比亚大学,获工商管理硕士学位。曾先后任职于广东发展银行珠海分行、深圳发展银行珠海分行、嘉实基金管理有限公司等,从事外汇交易、信贷、债券研究及投资组合管理等工作。2008年5月加入建信基金管理公司,2009年6月2日至2011年5月11日任建信收益增强债券型证券投资基金基金经理;2008年8月15日起任建信稳定增利债券型证券投资基金基金经理;2011年12月13日起任建信双息红利债券型证券投资基金基金经理;2013年9月3日起任建信安心保本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,本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《证券法》、《证券投资基金法》,其他有关法律法规的规定和《建信安心保本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,系统自动执行操作,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

宏观经济方面,一季度经济运行平稳,各项经济数据表现良好。1-2月全国固定资产投资同比增长8.9%,增速比去年全年有所加快。基建投资、房地产开发投资均呈现加速的迹象,制造业投资增速则小幅回升。但消费增速则有所回落,主要是受汽车销售增速回落的影响。

通胀方面,一季度工业品出厂价格同比涨幅进一步扩大,而消费者物价同比涨幅则有所回落。一方面,在供给侧改革、需求向好、海外大宗商品涨价等因素的影响下,PPI同比涨幅较大。另一方面,由于受到年初气温偏高的影响,主要食品项供应充足,消费者物价指数维持在低位。

货币政策方面,金融去杠杆是一季度的政策基调,货币政策坚质上偏紧。一季度央行公开市场操作总体维持净回笼,资金面持续紧张,人民银行在春节后2月31日和3月16日分别两次上调了公开市场逆回购和中期借贷便利利率各10BP,资金利率显著上行。此外,今年MPA考核将表外理财纳入广义信贷,部分银行类机构广义信贷考核压力增大,对季末资金面和流动性造成冲击,3月底银行同业拆借资金价格一度超过7%,季末资金面紧张程度有所加剧。

一季度债券收益率全面上行,金融债收益率延续去年年底的上行态势,10年活跃券160213的收益率一度超过4.2%,直到3月中下旬才有所回落。信用债收益率持续上行,收益率曲线平坦化。值得注意的是,同业存单发行规模在一季度呈现井喷态势。天量发行的存单对短债市场的需求形成了分流。债券市场整体表现良好,家电、建材和白酒板块等股票上涨较多。转债市场有所分化,歌尔、白云机场等低估值股票对应的转债表现良好,估值高的股票对应的转债则表现欠佳。

本基金在一季度操作相对谨慎,维持了低比例的股票配置,降低了债券的比例并增加了存款的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率0.6%,波动率0.04%,业绩比较基准收益率0.69%,波动率0.01%。

§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	54,695,049.89	1.48
	其中:股票	54,695,049.89	1.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,481,904,222.32	67.27
	其中:债券	2,481,904,222.32	67.27
	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	1,106,432,528.59	29.99
8	其他资产	46,413,990.66	1.26
9	合计	3,689,445,791.46	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	6,225,000.00	0.17
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,429,668.44	0.20
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	7,946,669.13	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	33,093,712.32	0.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
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	54,695,049.89	1.49

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	600794	保税科技	6,083,403	33,093,712.32	0.90
2	000066	中国长城	729,903	7,372,020.30	0.20
3	000998	隆平高科	300,000	6,225,000.00	0.17
4	600713	南京医药	641,921	4,936,372.49	0.13
5	000028	国药一致	39,988	3,010,296.64	0.08
6	603385	惠达卫浴	2,750	36,492.50	0.00
7	603041	美思德	1,034	21,155.64	0.00

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	199,760,000.00	5.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	172,286,541.00	4.70
5	企业短期融资券	1,628,065,000.00	44.45
6	中期票据	70,387,000.00	1.92
7	可转债(可交换债)	17,245,681.32	0.47
8	同业存单	394,160,000.00	10.76
9	其他	-	-
10	合计	2,481,904,222.32	67.76

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	111610552	16兴业CD552	4,000,000	394,160,000.00	10.76
2	011698513	16陕交建SCP004	2,000,000	199,900,000.00	5.46
3	019546	16国债18	2,000,000	199,760,000.00	5.45
4	011698730	16中色SCP002	2,000,000	199,680,000.00	5.45
5	011698711	16兖州煤业SCP006	1,500,000	149,865,000.00	4.09

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	173,760.19
2	应收证券清算款	8,498,978.96
3	应收股利	-
4	应收利息	37,741,052.82
5	应收申购款	198.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,413,990.66

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	123001	蓝标转债	5,169,000.00	0.14

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	603385	惠达卫浴	36,492.50	0.00	新发未上市

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,691,567,462.79
报告期期间基金总申购份额	2,918,431.83
减:报告期期间基金总赎回份额	58,014,157.13
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	3,636,471,737.49

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安心保本混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信安心保本混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信安心保本混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信安心保本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

建信安心保本二号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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	建信安心保本二号混合
基金主代码	001858
交易代码	001858
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年10月29日
报告期末基金份额总额	3,838,750,105.51份
投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理,在严格控制风险和保证本金安全的基础上,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金的资产包括风险资产(即权益类资产)和安全资产(即固定收益类资产),本基金投资策略分为两个层次:一层为基金在风险资产和安全资产两大类资产上的配置策略;另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。
业绩比较基准	2年期银行定期存款收益率(税前)*1.3。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属于证券投资基金中的中低风险品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§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	32,699,768.22
2.本期利润	35,562,564.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0089
4.期末基金资产净值	3,909,873,512.56
5.期末基金份额净值	1.019

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。

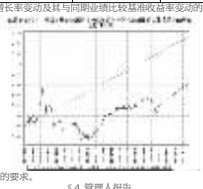
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.89%	0.05%	0.68%	0.01%	0.21%	0.04%

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		
朱虹	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2015年10月29日	-	9	硕士。2007年加入长城人寿保险股份有限公司,任债券投资助理。2009年4月加入天弘基金管理有限公司,任基金经理、固定收益投资总监助理。2012年1月,加入万家基金管理有限公司,任基金经理、固定收益总监。2014年8月加入我公司,历任投资管理部副总监、固定收益投资部副总经理,2015年10月29日任建信安心保本二号混合型证券投资基金基金经理,2016年1月4日起任建信安心保本三号混合型证券投资基金基金经理,2016年6月3日起任建信双债增强债券型证券投资基金基金经理,2016年11月17日起任建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。
牛兴华	本基金的基金经理	2015年10月29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2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《证券法》、《证券投资基金法》,其他有关法律法规的规定和《建信安心保本二号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,系统自动执行操作,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

按照2017年一季度可观测的地产去化速度,中国三四线城市库存较大这一主要长期风险有望逐步被化解。三四线城市高库存背后的地方财政举债风险、银行坏账风险都有望被化解。从一季度中央财政收入看,房地产对于税收项的拉动十分明显,中央政府收入增加。地方政府在2017年面临接近9万亿债务到期,目前仍需要发行地方政府债接续。3月作为年内第一个政府债务到期高峰,发行地方债力度低于预期。这与我们在去年的对政府债务的判断结果一致。

从以上基本面看,地产、基建(政府)、企业在开年以来显示出较强的风险抵御能力,整体没有观测到较大的债务敞口。而银行端由于供给侧改革、房地产去化、基建加速等带来的企业利润水平的上升,坏账率有所好转,预计报备计提对于利润的拖累有所下降。总体看来,我们仍然认为2017年中国经济系统性风险概率较低。

股票市场由于再融资制度的改革,无异于改变市场投融资结构,是对市场具有深远意义的举措。中国经济总量增速不再上升的情况下,企业利润水平将逐步代替GDP增速成为整个A股的晴之一。大盘蓝筹股的价值回归,在相当长的时间内仍是市场最大注的热点。但中国经济增长仍然强劲,在许多细分领域可以大有作为。许多大盘蓝筹股曾经在2001年是成长型股票,所以对于成长型龙头股票同样不应过于悲观。

年初我们认为债券市场的波动率在2017年可能产生超额的回报,但各主要央行目标之间的时差、联储缩表的进度,会极大影响债券资产整体回报率。从3月末的情况看,我们

综上所述,债券市场超额回报时期已过,但年内首次出现超额回报窗口。股票市场的波动性将会是主要收益来源,本基金重点配置的一带一路、雄安概念、消费升级等股票获得了较好回报。本基金将在CPI预期约束下,在本金安全的基础上追求稳定的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率0.89%,波动率0.06%,业绩比较基准收益率0.68%,波动率0.01%。

§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	175,326,507.70	4.47
	其中:股票	175,326,507.70	4.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,233,239,295.69	56.94
	其中:债券	2,233,239,295.69	56.94
	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	1,474,894,363.82	37.61
8	其他资产	38,548,345.65	0.98
9	合计	3,922,008,512.86	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	10,532,471.75	0.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,199,721.61	1.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,009,208.09	0.20
E	建筑业	22,069,410.74	0.56
F	批发和零售业	25,641.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	43,122,311.21	1.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,811.96	0.00
J	金融业	14,672,678.38	0.38
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	4,598,322.80	0.12
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	175,326,507.70	4.48

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	000089	深圳机场	2,029,326	17,898,655.32	0.46
2	000596	古井贡酒	305,805	15,565,474.50	0.40
3	601668	中国建筑	1,650,400	15,183,680.00	0.39
4	600352	浙江龙盛	1,596,700	15,008,980.00	0.38
5	000998	隆平高科	507,589	10,532,471.75	0.27
6	000401	冀东水泥	686,100	9,591,678.00	0.25
7	600567	山鹰纸业	2,484,700	8,721,297.00	0.22
8	600004	白云机场	546,000	8,703,240.00	0.22
9	000731	四川美丰	886,500	8,271,045.00	0.21
10	600029	南方航空	1,020,000	8,221,200.00	0.21

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	200,249,830.70	5.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	247,382,000.00	6.33
	其中:政策性金融债	247,382,000.00	6.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,577,847,500.00	40.36
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	62,859,964.99	1.61
8	同业存单	144,900,000.00	3.71
9	其他	-	-
10	合计	2,233,239,295.69	57.12

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	041654057	16船重CP001	3,900,000	388,791,000.00	9.94
2	150317	15进出17	2,000,000	197,620,000.00	5.05
3	020168	17贴债12	2,000,000	197,220,000.00	5.04
4	011698827	16TCL集SCP003	1,500,000	150,150,000.00	3.84
5	111693716	16西安银行CD019	1,500,000	144,900,000.00	3.71

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

本报告期本基金未投资国债期货。

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	242,644.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,305,483.18
5	应收申购款	217.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,548,345.65

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	132001	14宝钢EB	5,381,000.00	0.14
2	110035	白云转债	3,031,229.60	0.08
3	132005	15国资EB	1,849,034.40	0.05
4	110034	九州转债	1,465,662.20	0.04
5	128011	汽模转债	1,044,804.60	0.03
6	127003	海印转债	944,919.00	0.02
7	123001	蓝标转债	601,671.60	0.02
8	128013	洪涛转债	182,652.80	0.00
9	132004	15国盾EB	968.60	0.00

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	4,184,287,922.12
报告期期间基金总申购份额	424,318.93
减:报告期期间基金总赎回份额	345,962,135.54
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	3,838,750,105.51

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

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安心保本二号混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信安心保本二号混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信安心保本二号混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信安心保本二号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

建信安心保本六号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	建信安心保本六号混合
基金主代码	002573
交易代码	002573
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月28日
报告期末基金份额总额	4,426,286,934.50份
投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理,在严格控制风险和保证本金安全的基础上,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金的资产包括风险资产和安全资产,本基金投资策略分为两个层次:一层为基金在风险资产和安全资产两大类资产上的配置策略;另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。
业绩比较基准	2年期银行定期存款收益率(税前)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属于证券投资基金中的中低风险品种。
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
基金保证人	北京首创融资担保有限公司

§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)