

建信纯债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。
本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	建信纯债债券
基金代码	530001
交易代码	530001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月15日
报告期末基金份额总额	190,611,588.13份
投资目标	在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力求实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,综合考虑自上而下各个因素对利率和债券市场走势的影响,进行主动的资产配置,动态调整期限结构,利率变化的趋势和信用变化趋势的分析,比较中长期一定期限内不同债券品种和期限的相对投资价值,在基金资产配置比例范围内动态调整,不同期限的债券品种与基金之间进行动态调整。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数
风险收益特征	本基金为债券基金,其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金、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	中国光大银行股份有限公司
下属二级基金的名称	建信纯债债券C
下属二级基金的代码	530001
报告期末下属二级基金的份额总额	126,777,380.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	2,390,542.51	609,266.27
2.本期利润	2,010,742.78	339,706.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0004	0.0040
4.期末基金资产净值	152,331,402.47	76,397,966.76
5.期末基金份额净值	1.501	1.501

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.所述基金净值表现
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	0.05%	0.08%	-1.24%	0.07%	1.29%	-0.01%

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	0.43%	0.00%	-1.24%	0.07%	1.67%	-0.01%

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

