

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10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监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基金合同规定,于2017年10月20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基金的招募说明书。

本报告部分财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信安心保本二号混合
基金代码	000100
交易代码	000100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年10月12日
报告期末基金份额总额	3,373,824,262.00份

投资目标 本基金通过风险控制和全资产配置的策略来有效的组合管理,严控风险,确保在保本的前提下,力争实现基金资产的增值。

投资策略 本基金的资产配置策略:根据宏观经济、政策、市场环境、资金面、利率、信用等多方面的因素,综合分析判断,动态调整资产配置比例,在保证本金安全的前提下,力争实现基金资产的增值。

业绩比较基准 2年期定期存款利率(税前)+1%。

风险特征 本基金为混合型基金,风险收益介于债券型基金和股票型基金之间。

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

基金代销人 重庆三峡银行股份有限公司

§ 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7月1日 - 2017年9月30日)

1.本期已实现收益 23,471,796.50

2.本期利润 21,367,443.37

3.加权平均基金份额本期利润 0.0061

4.期末基金份额净值 3,491,506,737.00

5.期末基金资产净值 1,008

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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2 本基金报告期内发生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

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% 0.03% -0.70% 0.01% -0.12% 0.02%

3.2.2 本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

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% 0.03% -0.70% 0.01% -0.12% 0.02%

注: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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内发生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

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 1.13% 0.05% -1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

3.2.2 本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

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 1.13% 0.05% -1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

注: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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内发生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

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 -1.13% 0.05% 1.07% 0.05% 0.04% 0.00%

3.2.2 本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

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 1.13% 0.05% -1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

注: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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内发生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

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 -1.13% 0.05% 1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

3.2.2 本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

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 1.13% 0.05% -1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

注: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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内发生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

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 -1.13% 0.05% 1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

3.2.2 本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

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 1.13% 0.05% -1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

注: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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内发生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

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 -1.13% 0.05% 1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

3.2.2 本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

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 1.13% 0.05% -1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

注: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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内发生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

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 -1.13% 0.05% 1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

3.2.2 本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

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 1.13% 0.05% -1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

注: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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内发生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

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 -1.13% 0.05% 1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

3.2.2 本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

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 1.13% 0.05% -1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

注: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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内发生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

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 -1.13% 0.05% 1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

3.2.2 本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

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 1.13% 0.05% -1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

注: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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内发生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

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 -1.13% 0.05% 1.07% 0.05% -0.94% 0.00%

3.2.2 本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

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