建信健康民生混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 9 月 30 日

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 10 月 25 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信健康民生混合
基金主代码	000547
交易代码	000547
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年 3 月 21 日
报告期末基金份额总额	40,741,677.22 份
投资目标	本基金主要投资于有利于提升居民健康水平和促进国计民生的行业及公司,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	本基金的股票投资包含健康和民生这两大主题, 本基金将精选有利于提升居民健康水平和促进国计民生的公司进行投资。 在债券组合的构造和调整上,本基金综合运用久期管理、期限配置策略、类属配置管理、套利策略等组合管理手段进行日常管理,获取稳健增值的机会。
业绩比较基准	70%× 沪深 300 指数收益率 +30%× 中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型基金, 其风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,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	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 7 月 1 日 - 2017 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	3,204,461.75
2.本期利润	5,949,871.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.1396
4.期末基金资产净值	94,550,172.41
5.期末基金份额净值	2.321

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	6.57%	0.52%	3.20%	0.41%	3.37%	0.11%

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		
姜锋	权益投资部执行投资官、本基金的基金经理	2014年 3 月 21 日	-	10	硕士。2007 年 7 月加入本公司,从事行业研究,历任研究员、基金经理、资深基金经理、权益投资部执行投资官。2011 年 7 月 11 日至 2013 年 3 月 18 日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理,该基金于 2013 年 3 月 19 日起转换为开放式基金建信优势动力混合型证券投资基金(LOF),姜锋继续担任该基金基金经理;2014 年 3 月 21 日起任建信健康民生混合型证券投资基金基金经理;2015 年 4 月 22 日起任建信环保产业股票基金基金经理。
孙晨	本基金的基金经理	2016年 3 月 30 日	-	6	硕士。2011 年 7 月起任华夏基金管理公司研究员,2013 年 6 月加入建信基金,历任研究员、研究主管、基金经理。2016 年 3 月 30 日起任建信健康民生混合基金的基金经理,2017 年 3 月 8 日起任建信中国制造 2025 股票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《建信健康民生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

2017 年 3 季度市场呈现全面上涨走势,中小板指数领涨市场。随着供给侧改革的持续推进,上游原材料产品价格大幅上涨,钢铁和煤炭行业的盈利大幅增长,相关上市公司股价也大幅上涨;受益于新能源汽车产业需求爆发,产能存在瓶颈的上游锂矿和钴矿价格也大幅上涨,相关上市公司盈利爆发,股价走势大幅领先;经济复苏带来的资产质量改善带来了大型银行的良好表现,消费升级背景下的白酒和食品也取得不错表现。

经济方面,国内经济继续保持复苏态势,中上游行业需求改善明显,美国经济持续温和上升;政策方面,美国开始讨论缩表,国内房地产调控政策继续加码;上市公司方面,上游原材料行业盈利继续改善,跟踪的高频数据显示,部分上游行业的盈利三季度呈现加速态势,创业板盈利增速持续下降;在供给侧改革和环保核查的大背景下,上游行业盈利有望维持。

本基金 3 季度在控制系统性风险的前提下,对行业进行了均衡配置,适度参与了周期性和新能源板块,季度中期增配银行股,季度末增配了消费股,总体业绩表现中规中矩。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 6.57%,波动率 0.52%,业绩比较基准收益率 3.2%,波动率 0.41%。

§ 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	80,746,384.45	80.84
	其中:股票	80,746,384.45	80.84
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	18,923,313.02	18.94
8	其他资产	219,583.18	0.22
9	合计	99,889,280.65	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	49,438,766.45	52.29
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	16,877,828.00	17.85
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,849,790.00	9.36
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	5,580,000.00	5.90
S	综合	-	-
	合计	80,746,384.45	85.40

以上行业分类以 2017 年 09 月 30 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港股通投资股票投资组合

本基金本报告期未投资港股通股票。

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	15,000	7,764,600.00	8.21
2	600872	中炬高新	272,800	6,446,264.00	6.82
3	601988	中国银行	1,510,000	6,221,200.00	6.58
4	601288	农业银行	1,600,000	6,112,000.00	6.46
5	300426	唐德影视	200,000	5,580,000.00	5.90
6	601888	中国国旅	150,000	5,173,500.00	5.47
7	601398	工商银行	757,438	4,544,628.00	4.81
8	002322	理工环科	200,000	4,494,000.00	4.75
9	002027	分众传媒	365,800	3,676,290.00	3.89
10	000895	双汇发展	145,845	3,631,540.50	3.84

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	147,541.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,435.28
5	应收申购款	67,606.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	219,583.18

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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	44,749,326.35
报告期期间基金总申购份额	2,886,495.22
减:报告期期间基金总赎回份额	6,894,144.35
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	40,741,677.22

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健康民生混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信健康民生混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信健康民生混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信健康民生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 10 月 25 日

建信精工制造指数增强型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 9 月 30 日

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 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信精工制造指数增强
基金主代码	001397
交易代码	001397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年 8 月 26 日
报告期末基金份额总额	194,772,533.05 份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对中证精工制造指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略,以中证精工制造指数作为基金投资组合的标的指数,结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术,在指数化投资基础上优化调整投资组合,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年跟踪误差不超过 8%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	90%× 中证精工制造指数收益率 +10%× 商业银行活期存款利率(税前)
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。
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 7 月 1 日 - 2017 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	10,496,536.81
2.本期利润	12,947,383.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0643
4.期末基金资产净值	232,045,909.66
5.期末基金份额净值	1.1914

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	5.64%	0.71%	3.69%	0.66%	1.95%	0.05%

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		
叶乐天	金融工程及指数投资部总经理助理、本基金的基金经理	2015 年 8 月 26 日	-	9	硕士。2008 年 5 月至 2011 年 9 月就职于中国国际金融有限公司,历任市场风险管理分析员、量化分析经理,从事风险模型、量化研究与投资。2011 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司,历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理,2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理;2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金基金经理;2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理;2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金基金经理;2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金基金经理;2017 年 4 月 18 日起任建信民丰回报定期开放混合基金的基金经理;2017 年 5 月 22 日起任建信鑫荣回报混合基金的基金经理。

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》、其他有关法律法规的规定和《建信精工制造指数增强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

2017 年 3 季度市场呈现全面上涨走势,中小板指数领涨市场。随着供给侧改革的持续推进,上游原材料产品价格大幅上涨,钢铁和煤炭行业的盈利大幅增长,相关上市公司股价也大幅上涨;受益于新能源汽车产业需求爆发,产能存在瓶颈的上游锂矿和钴矿价格也大幅上涨,相关上市公司盈利爆发,股价走势大幅领先;经济复苏带来的资产质量改善带来了大型银行的良好表现,消费升级背景下的白酒和食品也取得不错表现。

经济方面,国内经济继续保持复苏态势,中上游行业需求改善明显,美国经济持续温和上升;政策方面,美国开始讨论缩表,国内房地产调控政策继续加码;上市公司方面,上游原材料行业盈利继续改善,跟踪的高频数据显示,部分上游行业的盈利三季度呈现加速态势,创业板盈利增速持续下降;在供给侧改革和环保核查的大背景下,上游行业盈利有望维持。

本基金 3 季度在控制系统性风险的前提下,对行业进行了均衡配置,适度参与了周期性和新能源板块,季度中期增配银行股,季度末增配了消费股,总体业绩表现中规中矩。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 5.64%,波动率 0.71%,业绩比较基准收益率 3.69%,波动率 0.66%。

§ 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	195,062,092.71	83.32
	其中:股票	195,062,092.71	83.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,898,680.00	4.66
	其中:债券	10,898,680.00	4.66
	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	9,000,000.00	3.84
	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	15,478,662.22	6.61
8	其他资产	3,659,261.88	1.56
9	合计	234,098,696.81	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,631,031.08	11.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	24,367,050.50	10.50
F	批发和零售业	169,305.54	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	14,371,755.51	6.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,148,140.00	0.49
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,443,557.00	1.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,485,825.00	0.64
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	71,616,664.63	30.86

以上行业分类以 2017 年 09 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

5.2.2 报告期末积极投资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	3,345,945.40	1.44
B	采掘业	10,699,477.80	4.61
C	制造业	69,519,272.41	29.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,602,431.00	1.55
E	建筑业	3,310,464.73	1.43
F	批发和零售业	6,312,839.74	2.72
G	交通运输、仓储和邮政业	4,055,193.30	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,959,413.96	2.14
J	金融业	8,694,242.00	3.75
K	房地产业	6,464,822.26	2.79
L	租赁和商务服务业	913,470.35	0.39
M	科学研究和技术服务业	72,538.04	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	945,269.00	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.05
R	文化、体育和娱乐业	434,748.10	0.19
S	综合	-	-
	合计	123,445,428.08	53.20

以上行业分类以 2017 年 09 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期未投资港股通股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601668	中国建筑	976,000	9,057,280.00	3.90
2	601006	大秦铁路	755,400	6,609,750.00	2.85
3	601800	中国交建	308,800	4,727,728.00	2.04
4	601186	中国铁建	373,895	4,434,394.70	1.91
5	601179	中国西电	656,894	3,586,641.24	1.55
6	300136	信维通信	73,500	3,087,000.00	1.33
7	600415	小商品城	430,700	3,027,821.00	1.30
8	601111	中国国航	314,900	2,745,928.00	1.18
9	600522	中天科技	189,600	2,709,384.00	1.17
10	600089	特变电工	272,772	2,689,531.92	1.16

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000725	京东方A	1,733,500	7,627,400.00	3.29
2	601225	陕西煤业	463,200	4,076,160.00	1.76
3	600325	华发股份	418,600	3,210,662.00	1.38
4	300393	中来股份	64,900	2,970,473.00	1.28
5	000813	德展健康	348,700	2,744,269.00	1.18

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	6,996,500.00	3.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,902,180.00	1.68
	其中:政策性金融债	3,902,180.00	1.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,898,680.00	4.70

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	019563	17国债 09	70,000	6,996,500.00	3.02
2	108601	国开 1703	39,100	3,902,180.00	1.68

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1710	IC1710	11	14,469,840.00	- 14,221.82	-
公允价值变动总额合计(元)					- 14,221.82
股指期货投资本期收益(元)					1,618,865.47
股指期货投资本期公允价值变动(元)					- 383,425.47

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,同时兼顾基差的变化,以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。

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	3,123,392.74
2	应收证券清算款	114,539.24
3	应收股利	-
4	应收利息	176,008.20
5	应收申购款	245,321.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,659,261.88

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存在流通受限情况的说明

5.11.6 报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.7 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

5.11.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	217,201,446.86
报告期期间基金总申购份额	13,850,741.42
减:报告期期间基金总赎回份额	36,279,655.23
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	194,772,533.05

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 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	2017年 07 月 01 日 - 2017 年 09 月 30 日	55,544,343.64	0.00	0.00	55,544,343.64	28.52%
产品持有风险							
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,求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精工制造指数增强型证券投资基金设立的文件;

2、《建信精工制造指数增强型证券投资基金合同》;

3、《建信精工制造指数增强型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信精工制造指数增强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 10 月 25 日

建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年 9 月 30 日

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 10 月 25 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 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信民丰回报定期开放混合
基金主代码	004413
交易代码	004413
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年 4 月 18 日
报告期末基金份额总额	866,367,017.17 份
投资目标	本基金在严格控制风险并保持资产流动性的前提下, 充分利用较低风险的量化投资策略,力争为投资者提供持续、稳定的回报。
投资策略	本基