

建信瑞福添利混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

持有人的根本利益,严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定和《建信瑞福添利混合型证券投资基金合同》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
为了公平对待投资者人,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风险控制指导意见》、《证券投资基金公平交易制度指导意见》、《基金管理人特定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,系统自动切换至不同投资组合进行执行,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁通过不正当的关联交易损害不同投资组合之间的利益。

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。本报告期内,未发生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
三季度宏观经济保持平稳运行,随着“供给侧改革”的深入以及大宗商品价格的持续走高,PPI数据反弹至同比6.3%,新增信贷数据在7月份大幅回落,8月份重新回到1.09万亿,显示出通胀粘性犹存,通胀预期,随着通胀重新回到55美分以上,8月份1.8%的CPI同比增速推动市场预期,基本面的变化以及相对稳定的低通胀下,央行仍保持中性偏紧的货币政策,三季度通过公开市场操作及MLF的投放,向市场传递稳健的货币政策,债券市场利率有所走低,股市方面,欧元区经济受出口拉动走势较好,PMI继续小幅回升,美国三季度经济数据小幅波动,整体走势平稳。季末美联储保持维稳,但受于较强的通胀水平,四季度有加息进行年内第二次加息或成定局。

在此背景下,三季度债券收益率维持窄幅震荡,由曲线将“哑平”形态,整个季度期限收益率小幅上行10bp,期限利差二季度变化不大,信用利差有所走平。股票市场方面,传媒板块的强势表现,上证指数在8月反弹3300点,季末末在3400点末果有所回落。

回顾三季度的基金运作,组合在建仓期内采用流动性管理为主,追求对收益的投资策略,配置上优先采用分散交易策略,随后在市场调整过程中稳步建仓,建仓期间,个别组合带来了较好的投资回报。

4.5 报告期内基金的投资业绩
本报告期内瑞福添利A净值增长1.16%,波动率0.03%,建信瑞福添利C净值增长0.7%,波动率0.03%;业绩比较基准收益率为1.28%,波动率0.17%。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	12,870,515.00	7.85
2	其中:股票	12,870,515.00	7.85
3	固定收益投资	70,979,314.50	42.18
4	其中:债券	70,979,314.50	42.18
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	70,000,000.00	41.80
8	银行存款和其他金融资产	13,712,963.74	8.15
9	其他资产	701,084.98	0.42
10	合计	168,263,880.23	100.00

5.2 报告期内按行业分布的股票投资组合
5.2.1 报告期内按行业分布的境内股票投资组合

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	医药、医药、医药	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,194,580.00	6.70
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
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	1,675,920.00	1.00
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	12,870,515.00	7.71

5.3 报告期内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	600807	伊泰煤炭	78,400	2,101,000.00	1.28
2	600009	中信证券	34,800	1,915,740.00	1.15
3	600685	海康威视	72,800	1,817,816.00	1.09
4	002475	佳禾智能	86,600	1,788,150.00	1.07
5	601033	长电科技	141,100	1,728,880.00	1.04
6	600004	华邦地产	84,600	1,675,520.00	1.00
7	600266	京东方A	36,200	822,780.00	0.55
8	600762	国电南瑞	23,300	918,615.00	0.55

5.4 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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	国债期货	-	-	-	-
2	央行票据	-	-	-	-
3	金融债券	9,935,000.00	5.95	-	-
4	其中:政策性金融债	9,935,000.00	5.95	-	-
5	企业债券	267,000.00	1.22	-	-
6	中期票据	20,014,000.00	11.98	-	-
7	资产支持证券	10,997,314.50	6.59	-	-
8	同业存单	-	-	-	-
9	其他	-	-	-	-
10	合计	70,979,314.50	42.50	-	-

5.5 报告期内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

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	011700373	17国债03	100,000	10,059,000.00	6.02
2	101752014	17MTN01	100,000	10,028,000.00	6.01
3	011703321	17国债32	100,000	10,008,000.00	5.99
4	011753012	17MTN01	100,000	9,986,000.00	5.97
5	112546	17资产01	100,000	9,986,000.00	5.97

5.6 报告期内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

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(%)
A	国债期货	-	-	-	-
B	央行票据	-	-	-	-
C	金融债券	39,793.00	0.67	-	-
D	其中:政策性金融债	39,793.00	0.67	-	-
E	企业债券	-	-	-	-
F	中期票据	-	-	-	-
G	资产支持证券	-	-	-	-
H	同业存单	-	-	-	-
I	其他	-	-	-	-
10	合计	39,793.00	0.67	-	-

5.7 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-
8	银行存款和其他金融资产	-	-	-	-
9	其他资产	-	-	-	-
10	合计	-	-	-	-

5.8 报告期内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

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(%)
A	国债期货	-	-	-	-
B	央行票据	-	-	-	-
C	金融债券	39,793.00	0.67	-	-
D	其中:政策性金融债	39,793.00	0.67	-	-
E	企业债券	-	-	-	-
F	中期票据	-	-	-	-
G	资产支持证券	-	-	-	-
H	同业存单	-	-	-	-
I	其他	-	-	-	-
10	合计	39,793.00	0.67	-	-

5.9 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-
8	银行存款和其他金融资产	-	-	-	-
9	其他资产	-	-	-	-
10	合计	-	-	-	-

5.10 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-
8	银行存款和其他金融资产	-	-	-	-
9	其他资产	-	-	-	-
10	合计	-	-	-	-

5.11 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-
8	银行存款和其他金融资产	-	-	-	-
9	其他资产	-	-	-	-
10	合计	-	-	-	-

5.12 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-
8	银行存款和其他金融资产	-	-	-	-
9	其他资产	-	-	-	-
10	合计	-	-	-	-

5.13 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-
8	银行存款和其他金融资产	-	-	-	-
9	其他资产	-	-	-	-
10	合计	-	-	-	-

5.14 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-
8	银行存款和其他金融资产	-	-	-	-
9	其他资产	-	-	-	-
10	合计	-	-	-	-

5.15 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-
8	银行存款和其他金融资产	-	-	-	-
9	其他资产	-	-	-	-
10	合计	-	-	-	-

5.16 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-
8	银行存款和其他金融资产	-	-	-	-
9	其他资产	-	-	-	-
10	合计	-	-	-	-

5.17 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-
8	银行存款和其他金融资产	-	-	-	-
9	其他资产	-	-	-	-
10	合计	-	-	-	-

5.18 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-
8	银行存款和其他金融资产	-	-	-	-
9	其他资产	-	-	-	-
10	合计	-	-	-	-

5.19 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券	-	-	-	-
6	贵金属投资	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-
8	银行存款和其他金融资产	-	-	-	-
9	其他资产	-	-	-	-
10	合计	-	-	-	-

5.20 报告期内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

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	权益投资	-	-	-	-
2	其中:股票	-	-	-	-
3	固定收益投资	-	-	-	-
4	其中:债券	-	-	-	-
5	资产支持证券				