建信收益增强债券型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。

§2 基金产品概况

基金简称	建信收益增强债券	
基金主代码	530009	
交易代码	530009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年6月2日	
报告期末基金份额总额	419,548,492.84份	
投资目标	在保持资产流动性的基础上,发挥投研团队在固定收益、股票及金融衍生产品方面的综合研究实力,在有效控制风险的前提下追求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建信用类债券投资组合,运用基本面研究择机介入上市公司股票及参与新股申购,以实现基金资产的长期稳健增值。	
业绩比较基准	30%×中债企业债总指数+70%×中债国债总指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,但高于货币市场基金以及不涉及股票二级市场投资的债券型基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
下属分级基金的交易代码	530009	531009
报告期末下属分级基金的份额总额	328,709,148.84份	90,839,344.00份

§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)	
	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
1. 本期已实现收益	8,504,926.78	1,619,271.90
2. 本期利润	13,967,613.04	2,967,622.15
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0369	0.0323
4. 期末基金资产净值	526,279,496.01	140,654,924.48
5. 期末基金份额净值	1.601	1.548

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

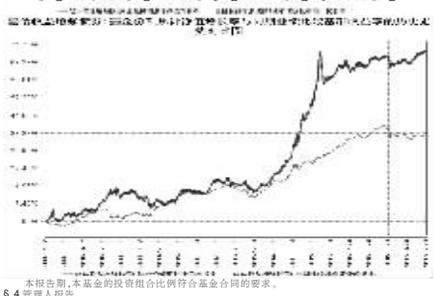
建信收益增强债券A

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	2.23%	0.13%	0.38%	0.05%	1.85%	0.08%

建信收益增强债券C

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	2.11%	0.14%	0.38%	0.05%	1.73%	0.09%

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		
李菁	固定收益投资部总经理、本基金的基金经理	2009年6月2日	-	11	硕士。2002年7月进入中国建设银行股份有限公司基金托管部工作,从事基金托管业务,任主任科员。2005年9月进入建信基金管理有限责任公司,历任债券研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、投资管理部副总监、固定收益投资部总监。2007年11月1日至2012年2月17日任建信货币市场基金基金经理;2009年6月2日起任本基金的基金经理;2011年6月16日起任建信信用增强债券型证券投资基金基金经理;2016年2月4日起任建信安心保本五号混合型证券投资基金;2016年6月8日起任建信安心保本七号证券投资基金基金经理;2016年11月16日起任建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金经理;2017年5月25日起任建信瑞福沛利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《建信收益增强债券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

三季度宏观经济继续平稳运行,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%,而新增贷款数据在7月份小幅回落后,8月份重新回到1.09万亿,显示出经济韧性犹在;通胀层面,随着油价重新回到55美元以上,8月份1.8%的CPI同比增速超出市场预期,基本面的变化及其可持续性将成为市场未来关注的焦点。政策方面,随着金融去杠杆的推进及相关政策的逐步落实,结合超储率及M2增速的低位下行,央行仍坚持中性偏紧的货币政策,三季度通过公开市场操作及MLF的续做,向市场净投放资金仅495亿,资金面的易紧难松成为常态。国际方面,欧元区经济受益于出口拉动走势较好,PMI继续小幅回升;美国方面三季度经济小幅波动,整体走势平稳。季度末美联储开启缩表,但受累于较低的通胀水平,四季度的是否进行年内第二次加息尚无法确认。

在此背景下,三季度债券收益率继续窄幅震荡,曲线维持"熊平"形态。整个季度各期限收益率小幅上行10bp,期限利差较二季度变化不大,但信用利差有所走扩。股票市场方面,伴随周期股的强势表现,上证指数在8月突破3300点,季度末在冲击3400点未果后有所回调。

回顾三季度的基金管理工作,组合维持较低的久期与杠杆,在债市收益率调整过程中体现了较好的抗跌性。权益配置方面,积极跟随周期、消费以及环保限产等市场热点,精选个股并及时兑现收益,带来了较好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期收益增强A净值增长率2.23%,波动率0.13%,收益增强C净值增长率2.11%,波动率0.14%;业绩比较基准收益率0.38%,波动率0.05%。

§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	95,773,777.32	14.11
	其中:股票	95,773,777.32	14.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	569,965,018.50	83.97
	其中:债券	569,965,018.50	83.97
	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	735,455.36	0.11
8	其他资产	12,261,225.26	1.81
9	合计	678,735,476.44	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	81,776,852.35	12.26
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	6,926,566.50	1.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	7,070,358.47	1.06
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	95,773,777.32	14.36

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	600887	伊利股份	515,900	14,187,250.00	2.13
2	002475	立讯精密	459,850	9,500,501.00	1.42
3	000858	五粮液	161,350	9,242,128.00	1.39
4	000651	格力电器	243,700	9,236,230.00	1.38
5	600409	三友化工	732,291	8,567,804.70	1.28
6	000402	金融街	580,013	7,070,358.47	1.06
7	600809	山西汾酒	127,585	7,023,554.25	1.05
8	600804	鹏博士	349,650	6,926,566.50	1.04
9	600581	八一钢铁	435,600	5,723,784.00	0.86
10	002496	辉丰股份	854,100	4,603,599.00	0.69

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	57,941,754.70	8.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	136,965,971.70	20.54
	其中:政策性金融债	97,013,971.70	14.55
4	企业债券	75,234,209.10	11.28
5	企业短期融资券	35,168,000.00	5.27
6	中期票据	173,295,000.00	25.98
7	可转债(可交换债)	42,110,083.00	6.31
8	同业存单	-	-
9	其他	49,250,000.00	7.38
10	合计	569,965,018.50	85.46

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	160208	16国开08	800,000	78,392,000.00	11.75
2	101554011	15临博城运MTN001	500,000	51,240,000.00	7.68
3	1542002	15天津债02	500,000	49,250,000.00	7.38
4	1522006	15交银租赁债	400,000	39,952,000.00	5.99
5	101462009	14丽山港口MTN001	300,000	30,846,000.00	4.63

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

本基金本报告期未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未未投资国债期货。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	111,269.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,924,072.52
5	应收申购款	225,883.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,261,225.26

5.10.4 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	113009	广汽转债	24,074,900.00	3.61
2	132005	15国资EB	6,147,900.00	0.92
3	113010	江南转债	2,191,803.20	0.33
4	132003	15清控EB	2,048,000.00	0.31
5	120001	16凤岭EB	1,514,270.40	0.23

5.10.5 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	600581	八一钢铁	5,723,784.00	0.86	重大事项

5.10.6 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

项目	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
报告期期初基金份额总额	480,882,993.18	94,106,570.13
报告期期间基金总申购份额	10,777,571.24	1,628,461.43
减:报告期期间基金总赎回份额	162,951,415.58	4,895,687.56
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	328,709,148.84	90,839,344.00

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收益增强债券型证券投资基金设立的文件;

2.《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》;

3.《建信收益增强债券型证券投资基金招募说明书》;

4.《建信收益增强债券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

建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

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:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	建信双利分级股票		
场内简称	建信双利		
基金主代码	165310		
交易代码	165310		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年5月6日		
报告期末基金份额总额	89,955,607.67份		
投资目标	本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	本基金将通过自上而下的方式,通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析,深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及避在的投资主题,在前述主题筛选和主题配置的基础上,本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具,采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。		
风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。 从本基金所分离的两类基金份额来看,建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额;建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	建信双利分级股票	建信稳健	建信进取
下属分级基金的场内简称	建信双利	建信稳健	建信进取
下属分级基金的交易代码	165310	150036	150037
报告期末下属分级基金的份额总额	87,028,545.67份	1,170,824.00份	1,756,238.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。	建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额。	建信进取份额将表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。

§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	15,163,182.96
2.本期利润	10,587,742.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.1097
4.期末基金资产净值	140,001,168.81
5.期末基金份额净值	1.556

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	7.38%	0.54%	4.40%	0.56%	2.98%	-0.02%

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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理、本基金的基金经理	2015年3月25日	-	14	特许金融分析师(CFA)、2003年1月获清华大学经济学博士学位。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司,历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理;2010年5月28日至2012年5月28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的基金经理;2011年9月8日至2016年7月20日任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2012年3月16日起任建信沪深证100指数增强型证券投资基金基金经理;2015年3月25日起任建信双利分级股票基金的基金经理;2015年7月31日起任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金基金经理;2015年8月6日至2016年10月25日任建信中证申万有色金属指数分级发起式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《建信双利策略主题分级股票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

在报告期内,本基金综合考虑市场特征,采取比较均衡的配置策略,适当控制组合的波动率,以适应市场风格切换较为频繁的特征。本基金属于高仓位运作的股票型基金,基金主要通过个股选择,力争取得相对于业绩比较基准的超额收益,在报告期内基本实现了预定目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率7.38%,波动率0.54%,业绩比较基准收益率4.4%,波动率0.56%。

§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	130,760,099.53	90.61
	其中:股票	130,760,099.53	90.61
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	11,504,328.37	7.97
8	其他资产	2,050,387.76	1.42
9	合计	144,314,815.66	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	1,228,292.00	0.88
B	采矿业	7,150,817.40	5.11
C	制造业	49,523,659.50	35.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	389,483.00	0.28
E	建筑业	7,206,709.00	5.15
F	批发和零售业	4,511,613.65	3.22
G	交通运输、仓储和邮政业	4,193,958.99	3.00
H	住宿和餐饮业	100,168.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,425,850.23	2.45
J	金融业	42,031,637.12	30.02
K	房地产业	7,896,246.70	5.64
L	租赁和商务服务业	2,207.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,816,906.00	1.30
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	0.08
R	文化、体育和娱乐业	278,326.65	0.20
S	综合	888,924.30	0.63
	合计	130,760,099.53	93.40

注: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	601318	中国平安	184,234	9,978,113.44	7.13
2	601166	兴业银行	313,200	5,415,228.00	3.87
3	600016	民生银行	638,000	5,116,760.00	3.65
4	000651	格力电器	132,200	5,010,380.00	3.58
5	601328	交通银行	665,900	4,208,488.00	3.01
6	601169	北京银行	556,408	4,150,803.68	2.96
7	000725	京东方A	911,600	4,011,040.00	2.87
8	600104	上汽集团	114,301	3,450,747.19	2.46
9	600519	贵州茅台	6,000	3,105,840.00	2.22
10	000528	柳工	317,200	2,823,080.00	2.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期未未持有债券。

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

本基金本报告期未未持有债券。

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

本基金本报告期未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

本基金本报告期未未持有贵金属。

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

本基金本报告期未未持有权证。

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

本基金本报告期未未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未未持有股指期货。

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

本基金本报告期未未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未未投资国债期货。

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	37,959.39
2	应收证券清算款	1,952,095.83
3	应收股利	-
4	应收利息	2,415.00
5	应收申购款	57,917.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,050,387.76

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期未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不存在流通受限情况。

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

项目	建信双利分级股票	建信稳健	建信进取
报告期期初基金份额总额	96,970,119.51	3,313,028.00	4,969,544.00
报告期期间基金总申购份额	3,154,444.32	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	18,451,528.16	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	5,355,510.00	-2,142,204.00	-3,213,306.00
报告期期末基金份额总额	87,028,545.67	1,170,824.00	1,756,238.00

1.上述总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额;

2.拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§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双利策略主题分级股票型证券投资基金设立的文件;

2.《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》;

3.《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金招募说明书》;

4.《建信双利策略主题分级股票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

建信双息红利债券型证券投资基金

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	建信双息红利债券		
基金主代码	530017		
交易代码	530017		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年12月13日		
报告期末基金份额总额	1,764,502,384.78份		
投资目标	通过主动管理债券组合,力争在追求基金资产稳定增长基础上为投资者取得高于投资业绩比较基准的回报。		
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。同时在固定收益资产所提供的稳健收益基础上,适当进行股票投资,本基金的股票投资作为债券投资的辅助和补充,以本金安全为最重要因素。		
业绩比较基准	90%×中国债券总指数收益率+10%×中证红利指数收益率。		
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、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	中信银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	建信双息红利债券A	建信双息红利债券C	建信双息红利债券H
下属分级基金的交易代码	530017	531017	960029
报告期末下属分级基金的份额总额	1,584,777,730.16份	172,329,314.44份	7,395,340.18份

§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)		
	建信双息红利债券A	建信双息红利债券C	建信双息红利债券H
1. 本期已实现收益	42,070,817.95	3,046,436.49	218,262.68
2. 本期利润	26,665,136.28	1,860,117.70	145,380.29
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0149	0.0130	0.0157
4. 期末基金资产净值	1,823,668,904.16	191,003,780.51	8,508,865.28
5. 期末基金份额净值	1.151	1.108	1.151

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。