建信现代服务业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:兴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。

基金托管人兴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日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信现代服务业股票
基金主代码	001781
交易代码	001781
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月23日
报告期末基金份额总额	41,536,826.97份
投资目标	本基金主要投资于同现代服务业相关的行业的上市公司股票,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,力争创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势等因素对各个行业及上市公司的影响以及核心股票资产的估值水平,综合分析证券市场的走势,主动判断市场时机,通过稳健的资产配置,合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险,提高收益。
业绩比较基准	85%×中证服务业指数收益率+15%×中债总财富(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§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	4,276,073.58
2.本期利润	5,668,564.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.1251
4.期末基金资产净值	50,550,120.39
5.期末基金份额净值	1.217

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	11.45%	1.12%	1.34%	0.53%	10.11%	0.59%

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		
梅灿	权益投资部总经理助理兼研究部投资策略官、本基金的基金经理	2016年2月23日	-	10	硕士。2007年7月加入本公司,从事行业研究,历任研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、权益投资部总经理助理兼研究部投资策略官。2011年7月11日至2016年4月22日任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理;2014年5月14日起任建信改革红利股票型证券投资基金基金经理,2016年2月23日起任建信现代服务业股票型证券投资基金基金经理,2017年3月22日起任建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年3月22日起任建信恒利优势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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信安心保本五号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年三季度以来,市场总体上呈现上涨格局,以有色、钢铁、煤炭为代表的周期行业表现抢眼,而传媒、公用事业、医药、建筑为代表的服务行业表现则相对较差。

从基本面看,2017年三季度以来,宏观经济层面数据依旧表现出较强的韧性。在经历短暂的金融去杠杆扰动后,短期内流动性边际改善,市场对流动性以及经济增长的预期发生较大的改观。在叠加周期行业去产能等供给侧改革后,周期行业受到市场资金青睐。而表现较差的行业,普遍地反映出当季业绩上的不足。

在2017年三季度,本基金积极参与了周期行业的投资机会,同时在食品饮料、新能源车等行业上保持较大的配置权重。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率11.45%,波动率1.12%,业绩比较基准收益率1.34%,波动率0.53%。

§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	45,904,923.74	88.30
	其中:股票	45,904,923.74	88.30
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	5,900,522.36	11.35
8	其他资产	179,815.35	0.35
9	合计	51,985,261.45	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	2,522,156.00	4.99
B	采矿业	1,099,161.00	2.17
C	制造业	29,311,711.92	57.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,461,856.92	2.89
F	批发和零售业	1,380,808.00	2.73
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	525,565.00	1.04
J	金融业	5,584,628.00	11.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,141,619.00	2.26
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	2,877,417.90	5.69
S	综合	-	-
	合计	45,904,923.74	90.81

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

本基金本报告期末投资港股通股票。

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	000998	隆平高科	97,006	2,522,156.00	4.99
2	002635	安洁科技	59,250	2,409,105.00	4.77
3	601398	工商银行	401,274	2,407,644.00	4.76
4	000858	五粮液	38,086	2,181,566.08	4.32
5	601988	中国银行	521,700	2,149,404.00	4.25
6	000651	格力电器	54,800	2,076,920.00	4.11
7	000807	云铝股份	132,200	1,833,614.00	3.63
8	603799	华友钴业	19,700	1,801,959.00	3.56
9	600388	龙净环保	103,400	1,749,528.00	3.46
10	600872	中炬高新	72,800	1,720,264.00	3.40

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	63,135.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,118.12
5	应收申购款	113,562.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	179,815.35

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	52,797,782.06
报告期期间基金总申购份额	10,698,800.28
减:报告期期间基金总赎回份额	21,959,755.37
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	41,536,826.97

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现代服务业股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信现代服务业股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信现代服务业股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信现代服务业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

建信稳健回报灵活配置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:华夏银行股份有限公司
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。

基金托管人华夏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	建信稳健回报灵活配置混合
基金主代码	001205
交易代码	001205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月17日
报告期末基金份额总额	812,170,313.72份
投资目标	力争每年获得较高的绝对回报。
投资策略	本基金以日上而下的投资策略,灵活配置大类资产,动态控制组合风险,力争长期、稳定的绝对回报。 本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、个券精选。其体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略、股指期货投资策略和权证投资策略四部分组成。
业绩比较基准	6%/年
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于较收益/风险特征的基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司

§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	17,944,622.66
2.本期利润	25,476,592.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0309
4.期末基金资产净值	863,958,457.89
5.期末基金份额净值	1.064

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。

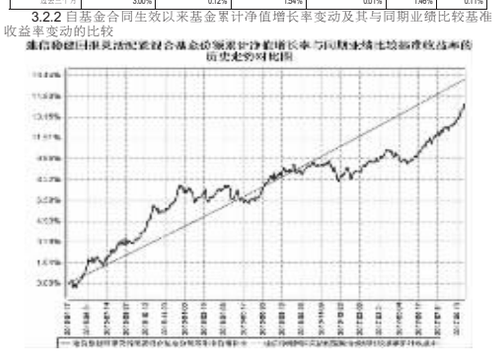
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	3.00%	0.12%	1.54%	0.01%	1.46%	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		
牛兵华	本基金的基金经理	2015年4月17日	-	6	硕士,2008年毕业于美国卡迪夫大学国际经济、银行与金融学专业,同年进入神州数码中国有限公司,任投资专员;2010年9月,加入中诚信国际信用评级有限责任公司,担任高级分析师;2013年4月加入本公司,任债券研究员;2014年12月2日至2017年6月30日任建信稳定增利债券型证券投资基金基金经理;2015年4月17日起任建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年5月13日起任建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年5月14日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年6月16日起任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年7月2日至2015年11月25日任建信鑫和回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年10月29日至2017年7月12日任建信安心保本二号混合型证券投资基金基金经理;2016年2月22日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金基金经理;2016年10月25日起任建信增益点利混合型证券投资基金基金经理;2016年12月2日起任建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年12月23日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2016年3月11日起任建信鑫瑞回报灵活配置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,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《建信稳健回报灵活配置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

三季度宏观经济保持平稳运行态势,但整体增速略有回落,其中8月固定资产投资及工业增加值分别同比增长7.8%和6.0%,较7月回落0.5%和0.4%。内需方面,受到地产调控政策的持续影响,三四线城市销售增速回落并拖累新增投资,进出口方面则持续受益于欧美经济复苏,保持较高的出口增速,其中7、8月进出口累计金额同比分别增长12.1%和11.6%。通胀方面,受到基数效应以及食品价格回升等因素影响,8月CPI同比增长1.8%,较7月有显著抬升。货币政策方面,央行继续贯彻金融去杠杆的政策基调,三季度公开市场操作净投放仅495亿元,流动性整体保持紧平衡态势。

在此背景下,三季度债券收益率维持窄幅震荡格局,各期限收益率小幅上行10bp。收益率走势与资金价格波动有较强相关性,对经济基本面及金融监管等存量信息反映平淡。权益市场方面,8月末伴随金融、周期等权重板块的上涨,上证指数突破3300点并带动市场风险偏好回升,权益市场整体出现较好的赚钱效应。

回顾三季度的基金管理工作,继续维持短久期、高票息的债券策略,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,跟随市场热点积极参与了包括金融、消费、成长等板块的交易性机会并及时兑现收益,为组合贡献较好的投资回报。另外,积极参与新股、转债等一级市场申购增厚组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率3%,波动率0.12%,业绩比较基准收益率1.54%,波动率0.01%。

§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	150,038,366.93	17.23
	其中:股票	150,038,366.93	17.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	661,206,000.00	75.95
	其中:债券	661,206,000.00	75.95
	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	34,000,000.00	3.91
	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	16,538,361.96	1.90
8	其他资产	8,833,051.55	1.01
9	合计	870,615,780.44	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	8,390,252.00	0.97
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	64,373,521.57	7.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,131,240.00	0.48
F	批发和零售业	4,754,883.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,396,052.40	1.09
J	金融业	41,501,246.00	4.80
K	房地产业	2,292,312.00	0.27
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	15,133,494.45	1.75
S	综合	-	-
	合计	150,038,366.93	17.37

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

本基金本报告期末投资港股通股票。

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	677,600	18,634,000.00	2.16
2	300426	唐德影视	541,300	15,102,270.00	1.75
3	601288	农业银行	3,537,100	13,511,722.00	1.56
4	601988	中国银行	3,202,100	13,192,652.00	1.53
5	601398	工商银行	1,773,800	10,642,800.00	1.23
6	000998	隆平高科	322,702	8,390,252.00	0.97
7	000858	五粮液	127,400	7,297,472.00	0.84
8	000895	双汇发展	221,900	5,525,310.00	0.64
9	000063	中兴通讯	186,000	5,263,800.00	0.61
10	601012	隆基股份	170,700	5,030,529.00	0.58

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,040,000.00	4.63
	其中:政策性金融债	40,040,000.00	4.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	541,023,000.00	62.62
6	中期票据	80,143,000.00	9.28
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	661,206,000.00	76.53

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	041658067	16梁中电CP001	500,000	50,200,000.00	5.81
2	101754065	17河钢集M TN009	500,000	50,185,000.00	5.81
3	011769023	17国开SCP004	500,000	50,035,000.00	5.79
4	041764013	17皖煤化CP001	500,000	50,005,000.00	5.79
5	011761046	17中铝SCP003	500,000	49,985,000.00	5.79
5	011765004	17苏交通SCP023	500,000	49,985,000.00	5.79

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	613,813.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,219,238.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,833,051.55

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	1,006,486,792.10
报告期期间基金总申购份额	7,727.08
减:报告期期间基金总赎回份额	194,324,205.46
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	812,170,313.72

上述总申购份额含红利再投、转换入份额,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稳健回报灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信稳健回报灵活配置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

建信现金添利货币市场基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	建信现金添利货币	
基金主代码	000693	
交易代码	000693	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年9月17日	
报告期末基金份额总额	190,294,546,267.22份	
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将采取个券选择策略、利率策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,实现能利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信现金添利货币A	建信现金添利货币B
下属分级基金的交易代码	000693	003164
报告期末下属分级基金的份额总额	154,061,008,947.11份	36,233,537,320.11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)		
	建信现金添利货币A	建信现金添利货币B	
1. 本期已实现收益	1,413,804,752.62	371,674,898.56	
2. 本期利润	1,413,804,752.62	371,674,898.56	
3. 期末基金资产净值	154,061,008,947.11	36,233,537,320.11	

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(不含公允价值变动收益)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收益,由于该基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

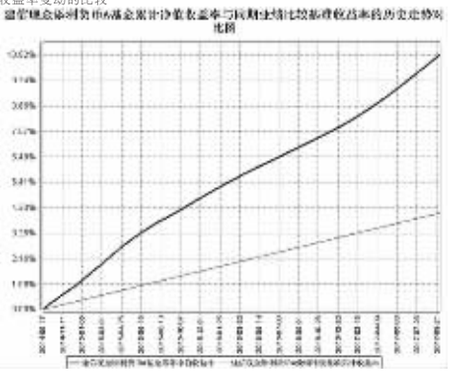
建信现金添利货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0193%	0.0001%	0.3403%	0.0000%	0.6790%	0.0001%

建信现金添利货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0547%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	0.7144%	0.0002%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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		
于倩倩	本基金的基金经理	2014年9月17日	-	9	于倩倩女士,硕士,2008年6月加入国泰人寿保险公司,任固定收益研究专员;2009年9月加入金元惠理基金管理公司(原金元比联基金管理公司),任债券研究员;2011年6月加入民生公司,历任债券研究员、基金经理助理,2013年8月5日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财债券基金的基金经理;2014年6月17日起任建信鑫新宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信鑫新宝货币市场基金基金经理;2015年4月17日起任建信现金添利货币基金的基金经理;2016年3月14日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金基金经理;2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金基金经理;2016年9月2日起任建信现金添益交易型货币市场基金基金经理;2016年9月13日起任建信福鑫农利混合型证券投资基金基金经理;2016年10月18日起任建信基金天添益货币市场基金基金经理。
高珊	本基金的基金经理	2015年8月25日	-	11	硕士,2006年7月至2007年6月期间在中信建投证券公司工作,任交易员。2007年6月加入建信基金管理公司,历任初级交易员、交易员。2009年7月起任建信货币市场基金的基金经理助理。2012年8月28日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年1月29日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金