建信优化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:中国工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。

基金托管人中国工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	建信优化配置混合
基金主代码	530005
交易代码	530005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月1日
报告期末基金份额总额	1,666,154,095.84份
投资目标	通过合理的资产配置和积极的证券选择,在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。
投资策略	基金管理人对宏观经济、行业及上市公司、债券、货币市场工具等进行定性与定量相结合的研究,运用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在大类资产配置这一宏观层面与个股个券选择这一微观层面优化投资组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:60%×富时中国A600指数+40%×中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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	80,274,340.72
2.本期利润	129,385,930.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0760
4.期末基金资产净值	2,388,935,264.87
5.期末基金份额净值	1.4338

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;

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	5.60%	0.62%	2.92%	0.36%	2.68%	0.26%

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		
邵宇航	权益投资部总经理助理、本基金的基金经理	2015年5月20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、权益投资部总经理助理,2011年7月11日至2014年3月27日任建信恒久价值混合型证券投资基金基金经理;2013年6月14日起任建信消费升级混合型证券投资基金基金经理;2015年5月20日起任建信优化配置混合基金基金经理。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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《建信优化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

2017年3季度,随着供给侧改革向纵深发展,市场对于周期品的热情进一步提高,钢铁煤炭的比较

上市公司大幅攀升的利润支撑了股价的有力表现,但季末宏观数据的回落又对周期品的预期有所压制,此外,市场风险偏好仍维持较高水平,新能源和5G相关标的表现突出。

本基金3季度继续以优质消费龙头公司为主要配置,并增配了部分周期性行业。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率5.6%,波动率0.62%,业绩比较基准收益率2.92%,波动率0.36%。

§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	1,842,624,806.54	76.55
	其中:股票	1,842,624,806.54	76.55
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	563,190,494.40	23.40
8	其他资产	1,357,471.39	0.06
9	合计	2,407,172,772.33	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	48,436,935.14	2.03
B	采矿业	12,668,367.60	0.53
C	制造业	1,278,107,686.13	53.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,591,422.10	1.53
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	50,168,090.53	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	22,504,183.02	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,468,229.03	1.65
J	金融业	227,826,632.15	9.54
K	房地产业	51,910,380.00	2.17
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	74,796,356.40	3.13
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	0.00
R	文化、体育和娱乐业	31,224.45	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,842,624,806.54	77.13

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	002635	安洁科技	1,853,126	75,348,103.16	3.15
2	600030	中信证券	3,411,600	62,057,004.00	2.60
3	002241	歌尔股份	2,915,124	59,002,109.76	2.47
4	000568	泸州老窖	983,462	55,172,218.20	2.31
5	300296	利亚德	2,674,721	53,895,628.15	2.26
6	600266	北京城建	3,334,000	51,910,380.00	2.17
7	600525	长园集团	2,607,083	51,880,951.70	2.17
8	600519	贵州茅台	99,000	51,246,360.00	2.15
9	002415	海康威视	1,577,100	50,467,200.00	2.11
10	601555	东吴证券	4,016,800	49,045,128.00	2.05

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中,中信证券(600030)2017年5月25日公告,因违规开展业务违反《证券公司监督管理条例》第八十四条第(七)项的规定,被中国证监会责令改正,给予警告,没收违法所得人民币61655.849.78元,并处人民币308,279,248.90元罚款;。

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	982,470.38
2	应收证券清算款	19,739.11
3	应收股利	-
4	应收利息	116,056.22
5	应收申购款	239,205.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,357,471.39

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

报告期期初基金份额总额	1,723,443,853.02
报告期期间基金总申购份额	23,861,201.08
减:报告期期间基金总赎回份额	81,150,958.26
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	1,666,154,095.84

上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	3,354,285.54
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,354,285.54
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.20

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优化配置混合型证券投资基金设立的文件;

2.《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《建信优化配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4.《建信优化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

建信信用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: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	建信信用增强债券	
场内简称	建信信用	
基金主代码	165311	
交易代码	165311	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月16日	
报告期末基金份额总额	49,766,350.33份	
投资目标	在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益,实现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,适当参与新股发行申购及增发新股申购,为基金份额持有人增加收益,实现基金资产的长期增值。	
业绩比较基准	中国债券总指数收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于中等风险基金产品。其预期风险和收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 由于主要投资于除国债、中央银行票据以外的信用类金融工具,因此本基金投资蕴含一定的信用风险,预期风险和收益水平高于一般的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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信信用增强债券A	建信信用增强债券C
下属分级基金的场内简称	建信信用	-
下属分级基金的交易代码	165311	165314
报告期末下属分级基金的份额总额	40,003,361.86份	9,762,988.47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)	
	建信信用增强债券A	建信信用增强债券C
1.本期已实现收益	139,754.74	4,387.37
2.本期利润	1,048,167.28	-108,206.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0107	-0.0105
4.期末基金资产净值	53,348,903.72	12,861,528.51
5.期末基金份额净值	1.334	1.317

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

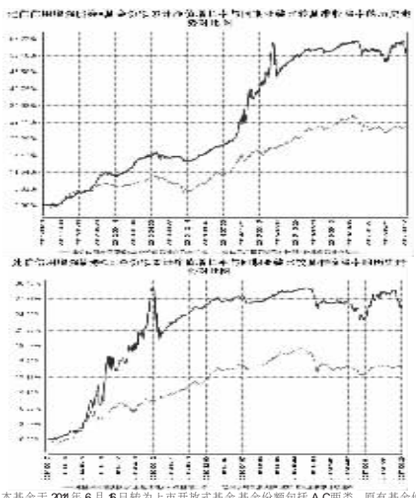
建信信用增强债券A

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	-0.74%	0.19%	0.33%	0.06%	-1.07%	0.13%

建信信用增强债券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	-0.83%	0.19%	0.33%	0.06%	-1.16%	0.13%

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



1.本基金于2014年6月6日转为上市开放式基金,基金份额包括A、C两类。原有基金份额全部转换为建信信用增强A类份额,C类份额为新增份额。

2.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		
李峰	本基金的基金经理	2017年5月15日	-	10	李峰先生,硕士。曾任清华紫光股份有限公司财务会计助理,2007年4月至2012年9月任华夏基金管理公司基金会计业务经理、风控高级经理,2012年9月至2015年6月建信基金管理公司交易员、交易主管,2015年7月至2016年6月任银华基金管理公司询价研究主管,2016年6月起任建信基金管理公司基金经理助理,2017年5月15日起任建信信用增强债券基金和建信稳定鑫利债券基金的基金经理。
李菁	固定收益投资部总经理、本基金的基金经理	2011年6月16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日起任建信瑞福添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,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《建信信用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

在报告期内,本基金根据基金合同规定,采取了对指数的被动复制策略,尽力控制年化跟踪误差和日均跟踪偏离度。

报告期内,本基金跟踪误差主要来自所持股票组合中长期停牌的权重股按基金合同规定进行净值调整导致与所跟踪标的指数在权重结构和计算方法上的差异以及标的指数中建设银行受到法规限制无法投资,必须寻找其他股票进行替代等两方面原因。

本基金管理人在量化分析基础上,采取了适当的组合调整与优化策略,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率7.02%,波动率0.65%,业绩比较基准收益率5.32%,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	4,275,108.75	6.01
	其中:股票	4,275,108.75	6.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	57,113,091.50	80.23
	其中:债券	57,113,091.50	80.23
	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	9,456,901.44	13.28
8	其他资产	343,629.68	0.48
9	合计	71,188,731.37	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	2,026,469.28	3.06
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	2,248,639.47	3.40
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	-	-
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	-	-
	合计	4,275,108.75	6.46

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

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	600004	白云机场	171,783	2,248,639.47	3.40
2	002241	歌尔股份	100,122	2,026,469.28	3.06

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	4,967,500.00	7.50
	其中:政策性金融债	4,967,500.00	7.50
4	企业债券	3,432,384.00	5.18
5	企业短期融资券	5,031,000.00	7.60
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	43,682,207.50	65.97
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	57,113,091.50	86.26

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	113009	广汽转债	50,000	6,335,500.00	9.57
2	113011	光大转债	53,970	6,013,337.40	9.08
3	011752027	17阳煤SCP006	50,000	5,031,000.00	7.60
4	132004	15国盛EB	54,000	4,992,300.00	7.54
5	132009	17中油EB	48,930	4,981,074.00	7.52

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国债期货交易情况说明

5.9.1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。

5.9.2本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1本期股指期货投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10.2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。

5.10.3本期股指期货投资评价

本基金报告期内未投资于股指期货。

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	10,534.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	331,594.78
5	应收申购款	1,500.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	343,629.68

5.11.4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	6,335,500.00	9.57
2	113011	光大转债	6,013,337.40	9.08
3	132004	15国盛EB	4,992,300.00	7.54
4	128012	辉丰转债	4,619,250.00	6.98
5	120001	16以岭EB	3,778,190.20	5.71
6	110034	九州转债	3,700,166.20	5.59
7	110032	三一转债	2,361,200.00	3.57
8	132003	15清控EB	2,048,000.00	3.09

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

项目	建信信用增强债券A	建信信用增强债券C
报告期期初基金份额总额	120,525,604.62	10,692,406.72
报告期期间基金总申购份额	49,051.53	112,471.18
减:报告期期间基金总赎回份额	80,571,294.29	1,041,889.43
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	40,003,361.86	9,762,988.47

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08月21日,2017年08月23日-2017年09月11日	72,272,762.75	0.00	72,272,762.75	0.00	0.00%

注:本基金本报告期未不存在单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。

§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信用增强债券型证券投资基金设立的文件;

2.《建信信用增强债券型证券投资基金基金合同》;

3.《建信信用增强债券型证券投资基金招募说明书》;

4.《建信信用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。

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

建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金

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: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	建信央视50		
场内简称	建信50		
基金主代码	165312		
交易代码	165312		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年3月28日		
报告期末基金份额总额	263,790,516.52份		
投资目标	本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化,实现对央视财经50指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数,并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金对标的指数的跟踪目标:力争使得日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。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,基金管理人应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	本基金的业绩比较基准:95%×央视50价格指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。		
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,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,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。 从本基金所分离的两类基金份额来看,建信央视50A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额;建信央视50B份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险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	交通银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	建信央视50	建信央视50A	建信央视50B
下属分级基金场内简称	建信50	建信50A	建信50B
下属分级基金的交易代码	165312	150123	150124
报告期末下属分级基金的份额总额	197,433,964.52份	33,178,276.00份	33,178,276.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,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,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。	建信央视50A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额。	建信央视50B份额将表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险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	10,592,467.56
2.本期利润	24,369,931.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.1192
4.期末基金资产净值	463,427,881.94
5.期末基金份额净值	1.7568

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。

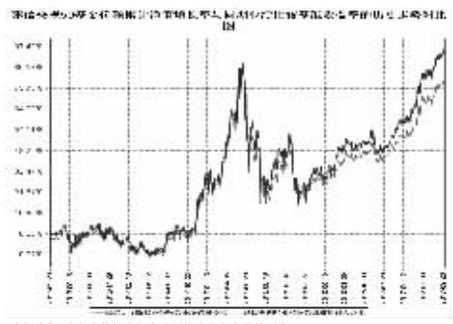
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	7.02%	0.65%	5.32%	0.66%	1.70%	-0.01%

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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	2013年3月28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