建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）

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	建信优势动力混合（LOF）
场内简称	建信优势
基金主代码	165313
交易代码	165313
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2013年3月19日
报告期末基金份额总额	321,423,552.09份
投资目标	采取定量和定性相结合的方法，寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力、但是价值被低估的优势上市公司，通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产来获取超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人对经济环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析，作出投资决策。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高收益/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	交通银行股份有限公司

§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	38,013,367.04
2.本期利润	23,143,829.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0693
4.期末基金资产净值	486,968,172.47
5.期末基金份额净值	1.515

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。

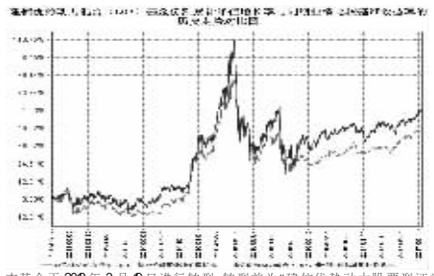
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.92%	0.48%	3.56%	0.44%	1.36%	0.04%

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



本基金于2008年3月19日进行转型，转型前为“建信优势动力股票型证券投资基金”。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		
娄锋	权益投资部执行投资官、本基金的基金经理	2013年3月19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），娄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。

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《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）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4.92%，波动率0.48%，业绩比较基准收益率3.56%，波动率0.44%。

§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	320,648,082.36	64.65
	其中：股票	320,648,082.36	64.65
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	175,055,759.56	35.29
8	其他资产	299,203.44	0.06
9	合计	496,003,045.36	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	10,400,000.00	2.14
B	采矿业	-	-
C	制造业	200,368,983.06	41.15
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	11,914,196.00	2.45
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	43,601,024.04	8.95
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	37,603,233.26	7.72
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	16,760,646.00	3.44
S	综合	-	-
	合计	320,648,082.36	65.85

以上行业分类以2017年9月30日的中国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	600872	中炬高新	1,350,500	31,912,315.00	6.55
2	002322	理工环科	1,099,912	24,715,022.64	5.08
3	601988	中国银行	5,439,981	22,412,721.72	4.60
4	601288	农业银行	5,546,676	21,188,302.32	4.35
5	601888	中国国旅	599,974	20,693,103.26	4.25
6	600146	商赢环球	732,500	18,620,150.00	3.82
7	603808	歌力思	749,842	18,018,703.26	3.70
8	002027	分众传媒	1,682,600	16,910,130.00	3.47
9	300426	唐德影视	600,740	16,760,646.00	3.44
10	000858	五粮液	267,600	15,328,128.00	3.15

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	216,575.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	77,997.14
5	应收申购款	4,630.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	299,203.44

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

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	600146	商赢环球	18,620,150.00	3.82	重大资产重组

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	369,070,131.36
报告期期间基金总申购份额	559,316.90
减：报告期期间基金总赎回份额	48,205,896.17
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	321,423,552.09

总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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	3,591,235.63
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,591,235.63
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.12

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势动力混合型证券投资基金（LOF）设立的文件；

2.《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3.《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；

4.《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）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

建信优选成长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	建信优选成长混合
基金主代码	530003
交易代码	530003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月8日
报告期末基金份额总额	1,115,898,870.04份
投资目标	通过投资于具有良好业绩成长性和投资价值的上市公司，实现基金资产长期增值。
投资策略	本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	75%×富时中国600成长指数+20%×中国债券总指数+5%×1年定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、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
下属分级基金的基金简称	建信优选成长混合A / 建信优选成长混合H
下属分级基金的交易代码	530003 / 960028
报告期末下属分级基金的份额总额	1,113,473,060.24份 / 2,425,809.80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）	
	建信优选成长混合A	建信优选成长混合H
1. 本期已实现收益	119,655,353.20	254,160.76
2. 本期利润	146,990,442.44	314,318.04
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1230	0.1255
4. 期末基金资产净值	2,107,814,313.73	4,603,700.70
5. 期末基金份额净值	1.8930	1.8978

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入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.本基金自2016年4月7日起新增H类份额，并于2016年6月22日开始在香港特别行政区发售。

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

建信优选成长混合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	7.12%	0.67%	3.52%	0.51%	3.60%	0.16%

建信优选成长混合H

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	7.15%	0.67%	3.52%	0.51%	3.63%	0.16%

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2016年4月7日起新增H类份额，并于2016年6月22日发售。

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		
姚锦	权益投资部总经理、本基金的基金经理	2012年2月17日	-	13	博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师，天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职。2009年3月17日至2011年3月3日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理；2009年12月17日至2011年5月5日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理。历任我公司研究部首席策略分析师、权益投资部副总监兼研究部首席策略分析师、权益投资部总经理。2012年2月17日起任建信优选成长混合型证券投资基金基金经理，2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理；2014年1月20日起任建信保本基金的基金经理，该基金于1月23日起转型为建信积极配置混合型证券投资基金基金，姚锦继续担任该基金的基金经理；2017年6月9日起任建信核心精选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《建信优选成长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年第三季度，伴随全球经济的温和复苏，以及中国供给侧改革对于过剩产能行业的调整，以钢、铝为代表的工业金属和煤炭等表现较好。国内在金融去杠杆的大环境下，经济增长速度保持较快水平，价格水平温和，汇率出现较快升值。

三季度股票市场流动性环境平稳，以新能源汽车为代表的成长板块和周期品行业表现较为突出，以食品饮料为代表的消费板块表现平稳。本基金较为看好必须消费品行业的投资机会，在周期品和新能源汽车产业链上，根据相关公司的估值水平和产业链位置进行了部分配置。

展望四季度，企业经营环境的变化还在持续，简单依靠外生的增长方式受到不断挑战，如依靠加杠杆做大规模、过度依靠人脉关系、依靠收购等。企业的经营更多需要依靠可持续的内生增长方式，如精益化管理、加大研发投入、加大对于行业环境的认识和战略部署等。本基金将持续关注具有管理优势的公司，同时考虑行业竞争环境和产业发展态势、企业的盈利和估值水平等，进行组合的动态管理。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期优选成长A净值增长率7.12%，波动率0.67%，优选成长H净值增长率7.15%，波动率0.67%业绩比较基准收益率3.52%，波动率0.51%。

§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	1,710,056,126.67	73.45
	其中：股票	1,710,056,126.67	73.45
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	200,000,000.00	8.59
	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	416,736,765.42	17.90
8	其他资产	1,451,163.37	0.06
9	合计	2,328,244,055.46	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	76,617,220.92	3.63
C	制造业	812,368,324.21	38.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	13,956,813.75	0.66
F	批发和零售业	259,657,246.57	12.29
G	交通运输、仓储和邮政业	73,845,524.91	3.50
H	住宿和餐饮业	58,944,080.00	2.79
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,566,199.36	4.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	168,027,990.96	7.95
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	59,489,886.02	2.82
R	文化、体育和娱乐业	96,551,746.53	4.57
S	综合	-	-
	合计	1,710,056,126.67	80.95

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	7,904,110	217,363,025.00	10.29
2	300081	恒信东方	9,839,608	145,921,386.64	6.91
3	300356	光一科技	11,168,935	107,556,844.05	5.09
4	601888	中国国旅	2,994,824	103,291,479.76	4.89
5	600872	中炬高新	4,293,361	101,452,120.43	4.80
6	002624	完美世界	2,764,536	90,566,199.36	4.29
7	601933	永辉超市	10,412,522	83,196,050.78	3.94
8	600519	贵州茅台	159,400	82,511,816.00	3.91
9	300364	中文在线	5,585,672	73,395,730.08	3.47
10	002127	南极电商	4,120,720	64,736,511.20	3.06

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	685,567.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	83,293.64
5	应收申购款	682,302.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,451,163.37

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

项目	建信优选成长混合A	建信优选成长混合H
报告期期初基金份额总额	1,252,705,294.45	2,532,130.07
报告期期间基金总申购份额	40,475,180.54	-
减：报告期期间基金总赎回份额	179,707,414.75	106,320.27
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	1,113,473,060.24	2,425,809.80

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	2,965,973.76
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	2,965,973.76
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.27

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选成长混合型证券投资基金设立的文件；

2.《建信优选成长混合型证券投资基金基金合同》；

3.《建信优选成长混合型证券投资基金招募说明书》；

4.《建信优选成长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

建信月盈安心理财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	建信月盈安心理财
基金主代码	530028
交易代码	530028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月20日
报告期末基金份额总额	4,729,142,936.94份
投资目标	严格控制风险并保持良好流动性的基础上，通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报，并为争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过积极主动的组合管理，充分运用各种短期投资工具，力争为持有人创造低风险基础上的投资收益。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过150天。
业绩比较基准	七天通知存款利率（税前）
风险收益特征	本基金属于债券基金，长期风险收益水平低于股票基金、混合基金，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	中国民生银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信月盈安心理财A / 建信月盈安心理财B
下属分级基金的交易代码	530028 / 531028
报告期末下属分级基金的份额总额	393,286,867.75份 / 4,335,856,069.19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）	
	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
1. 本期已实现收益	3,418,909.10	30,391,529.15
2. 本期利润	3,418,909.10	30,391,529.15
3. 期末基金资产净值	393,286,867.75	4,335,856,069.19

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入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

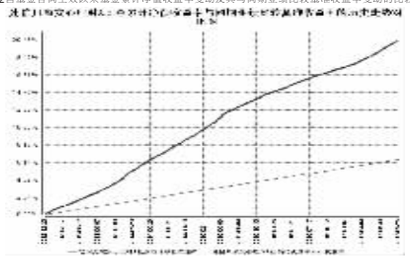
建信月盈安心理财A

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	1.0596%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.7193%	0.0004%

建信月盈安心理财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	1.1334%	0.0004%	0.3403%	0.0000%	0.7931%	0.0004%

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



1.本基金于2012年12月20日起新增B类份额，并于2012年12月20日发售。

2.本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

§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		
刘思	本基金的基金经理	2016年7月19日	-	8	刘思女士，硕士。2009年5月加入建信基金管理公司，历任助理交易员、初级交易员、交易员、交易主管、基金经理助理，2016年7月19日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理；2016年11月8日起任建信睿罗纯债债券型证券投资基金基金经理；2016年11月22日至2017年8月3日任建信恒丰纯债债券型证券投资基金基金经理；2016年11月25日起任建信睿富纯债债券型证券投资基金基金经理；2017年8月9日起任建信中证政策性金融债1-3年指数（LOF）、建信中证政策性金融债3-5年指数（LOF）、建信中证政策性金融债8-10年指数（LOF）的基金经理；2017年8月16日起任建信中证政策性金融债5-8年指数（LOF）、建信睿源纯债债券的基金经理。
陈建良	固定收益投资部总经理、本基金的基金经理	2014年1月21日	-	10	2005年6月加入中国建设银行厦门分行，任客户经理；2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部，任债券交易员；2013年9月加入我公司，历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总监助理。2013年12月10日起任建信货币市场基金基金经理；2014年1月21日起任建信月盈安心理财基金基金经理；2014年6月17日起任建信嘉新宝货币市场基金基金经理；2014年9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日起任建信理财现金添益交易型货币市场基金基金经理；2016年9月13日起任建信瑞盛添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