建信睿盈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：广发证券股份有限公司

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。

基金托管人广发证券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	建信睿盈灵活配置混合	
基金主代码	000994	
交易代码	000994	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年2月3日	
报告期末基金份额总额	250,743,152.87份	
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置和主动的投资管理，在精选个股、个券的基础上适度集中投资，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。	
投资策略	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。具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和权证投资策略四部分组成。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率(全价)×35%	
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	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信睿盈灵活配置混合A	建信睿盈灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	000994	000995
报告期末下属分级基金的份额总额	152,029,656.66份	98,713,496.21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)	
	建信睿盈灵活配置混合A	建信睿盈灵活配置混合C
1. 本期已实现收益	3,610,621.33	1,831,860.24
2. 本期利润	-1,941,876.60	-1,181,687.39
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0109	-0.0115
4. 期末基金资产净值	155,600,152.46	98,261,338.88
5. 期末基金份额净值	1.023	0.995

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

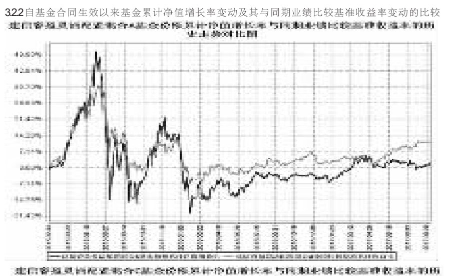
建信睿盈灵活配置混合A

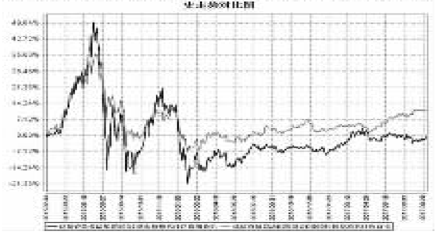
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.97%	0.52%	2.96%	0.38%	-3.93%	0.14%

建信睿盈灵活配置混合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	-1.09%	0.52%	2.96%	0.38%	-4.05%	0.14%

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		
许杰	权益投资部副总经理、本基金的基金经理	2015年2月3日	-	15	硕士，特许金融分析师(CFA)。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员，2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职，2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理，2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理，2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011年10月加入我公司，2012年3月21日至2017年1月24日任建信恒稳价值混合型证券投资基金基金经理，2012年8月14日起任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理；2014年9月10日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金经理；2015年2月3日起任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015年5月26日起任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年3月22日起任建信中小盘先锋股票基金经理。

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《建信睿盈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

本基金报告期内重点配置了食品饮料、医药等消费类行业以及电子、高端制造等创新类行业的龙头公司。中国经济未来增长的驱动力将主要来自于消费和创新，而从微观层面上市公司的经营情况来看，这两类企业也表现出良好的增长势头和长期潜力。由于本基金三季度对于周期类行业以及主题投资参与较少，而这类股票报告期内上涨较多，而消费和创新行业的龙头企业大多处于盘整状态，因此本基金在三季度的表现落后于市场。但本基金认为消费和创新的大方向不会发生变化，长期看坚定持有消费和创新的龙头企业将取得较好的投资收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期睿盈灵活A净值增长率-0.97%，波动率0.52%，睿盈灵活C净值增长率-1.09%，波动率0.52%，业绩比较基准收益率2.96%，波动率0.38%。

§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	160,803,938.01	62.62
	其中：股票	160,803,938.01	62.62
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	78,800,000.00	30.69
	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	11,339,063.63	4.42
8	其他资产	5,838,879.91	2.27
9	合计	256,781,881.55	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	2,704,560.00	1.07
C	制造业	132,739,069.28	52.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,127,408.60	2.02
F	批发和零售业	2,813,561.45	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,891.38	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,359,465.07	2.51
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,214,118.36	1.66
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	0.05
R	文化、体育和娱乐业	6,609,991.97	2.60
S	综合	-	-
	合计	160,803,938.01	63.34

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	600519	贵州茅台	28,457	14,730,481.48	5.80
2	002304	洋河股份	144,200	14,636,300.00	5.77
3	000858	五粮液	237,600	13,609,728.00	5.36
4	000423	东阿阿胶	175,566	11,399,500.38	4.49
5	002426	胜利精密	1,736,704	10,732,830.72	4.23
6	002217	合力泰	720,600	8,106,750.00	3.19
7	300426	唐德影视	236,300	6,592,770.00	2.60
8	600872	中炬高新	255,200	6,030,376.00	2.38
9	000895	双汇发展	240,700	5,993,430.00	2.36
10	000513	丽珠集团	106,300	5,389,410.00	2.12

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	572,078.45
2	应收证券清算款	5,166,167.19
3	应收股利	-
4	应收利息	61,576.25
5	应收申购款	39,058.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,838,879.91

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

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	002426	胜利精密	10,732,830.72	4.23	重大事项

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	建信睿盈灵活配置混合A	建信睿盈灵活配置混合C
报告期期初基金份额总额	183,190,577.63	107,857,290.63
报告期期间基金总申购份额	1,131,223.27	1,288,232.41
减：报告期期间基金总赎回份额	32,292,144.24	10,432,026.83
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	152,029,656.66	98,713,496.21

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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,132,443.53
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	5,132,443.53
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.05

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期末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睿盈灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

2、《建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信睿盈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

建信睿享纯债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	建信睿享纯债债券
基金主代码	003681
交易代码	003681
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月8日
报告期末基金份额总额	5,600,001,206.68份
投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，深入挖掘价值被低估的标的券种。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、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	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	54,138,960.14
2.本期利润	52,333,997.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0093
4.期末基金资产净值	5,777,705,330.60
5.期末基金份额净值	1.0317

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。

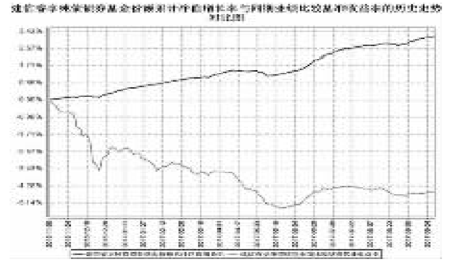
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.91%	0.02%	-0.15%	0.03%	1.06%	-0.01%

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本基金基金合同于2016年11月8日生效，截至报告期末未满一年。

2本基金建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§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11月8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日起任建信睿享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。
黎颖芳	本基金的基金经理	2016年11月8日	-	16	黎颖芳女士，硕士。2000年7月毕业于湖南大学金融保险学院，同年进入大成基金管理公司，在金融工程部、规划发展部任职。2005年11月加入本公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理。2009年2月19日至2011年5月11日任建信稳定增利债券型证券投资基金基金经理；2011年1月18日至2014年1月22日任建信保本混合型证券投资基金基金经理；2012年11月15日起任建信纯债债券型证券投资基金基金经理；2014年12月2日起任建信稳定得利债券型证券投资基金基金经理；2015年12月8日起任建信稳定丰利债券型证券投资基金基金经理；2016年6月1日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016年11月8日起任建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2016年11月8日起任建信睿享纯债债券型证券投资基金基金经理，2016年11月15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，2017年1月6日起建信稳定鑫利债券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《建信睿享纯债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

从需求端层面看，投资增速较二季度末增速下滑0.8个百分点，结构上看，虽然地产信贷和限购政策仍然严格，投资增速小幅放缓，但重点城市加大土地供应仍支撑地产投资；基础设施投资增速仍保持在19.8%的高位；制造业投资因去产能政策推进以及环保督查等因素影响增速有所回落，1-8月制造业投资同比增长4.5%，增速回落1个百分点。三季度消费保持平稳增长，进口增速维持两位数增长，出口增速较2季度有所回落，但与去年比大幅改善。

三季度物价水平总体稳定，1-8月份CPI(居民消费价格)同比上涨1.5%，通胀处于比较温和的水平，工业品价格同比增速有所回升，8月份工业生产者出厂价格上涨6.3%，主要是由于环保督查限制供给导致。

货币政策方面，三季度货币政策基调维持稳健中性，资金面基本稳定，但在8月中下旬和季末跨季时点资金较为紧张，央行通过MLF和逆回购等工具进行对冲操作；9月底央行依据国务院常务会议精神，宣布2018年起对普惠金融实施定向降准，新标准能够覆盖绝大多数商业银行，对于明年一季度资金面有正面影响。三季度人民币兑美元总体呈现先升后贬态势，9月上旬美元中间价最高升值到6.49的位置，季度末美元中间价收在6.6076，相比于二季度末6.7744进一步升值，贬值预期大幅缓解，外汇储备环比持续小幅回升。

债券市场方面，三季度债券收益率维持区间震荡态势，曲线较为平坦。7月份由于经济数据好于预期、工业品价格供需因素下大幅上行，债券收益率持续走高，10年国债收益率从二季度末3.57%最高上行到3.66%的水平，三季度末10年期国债收益率收于3.61%，较季度初小幅上行4BP。中证转债指数先上后下，整体上涨4.26%，转债供给有所加快，发行2只可转债1只交换债，此外转债和交换债信用申购模式正式运行，对于资金面的扰动大幅减轻。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率0.91%，波动率0.02%，业绩比较基准收益率-0.15%，波动率0.03%。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,474,065,831.50	93.03
	其中：债券	5,474,065,831.50	93.03
	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	316,111,847.26	5.37
8	其他资产	94,230,015.21	1.60
9	合计	5,884,407,693.97	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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	27,600,000.00	0.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	813,789,000.00	14.08
	其中：政策性金融债	813,789,000.00	14.08
4	企业债券	1,377,925,023.50	23.85
5	企业短期融资券	2,697,696,000.00	46.69
6	中期票据	520,512,000.00	9.01
7	可转债(可交换债)	36,543,808.00	0.63
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,474,065,831.50	94.74

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	136513	16电投03	1,700,000	167,569,000.00	2.90
2	011772014	17云投SCP003	1,000,000	100,280,000.00	1.74
3	150207	15国开07	1,000,000	100,220,000.00	1.73
4	150309	15进出09	1,000,000	100,070,000.00	1.73
5	170204	17国开04	1,000,000	99,800,000.00	1.73

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

5.10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	44,721.73
2	应收证券清算款	2,829,651.65
3	应收股利	-
4	应收利息	91,355,641.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	94,230,015.21

5.10.4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。

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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

报告期期初基金份额总额	5,600,001,236.50
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	29.82
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	5,600,001,206.68

§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

本基金本报告期末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09月30日	5,599,999,000.00	0.00	0.00	5,599,999,000.00	99.99%
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。							

§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睿享纯债债券型证券投资基金设立的文件；

2、《建信睿享纯债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《建信睿享纯债债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信睿享纯债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

建信睿富纯债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：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	建信睿富纯债债券
基金主代码	003590
交易代码	003590
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月25日
报告期末基金份额总额	9,017,284,916.23份
投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，深入挖掘价值被低估的标的券种。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、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	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	92,765,023.85
2.本期利润	78,290,024.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0084
4.期末基金资产净值	9,224,774,478.25
5.期末基金份额净值	1.0230

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。

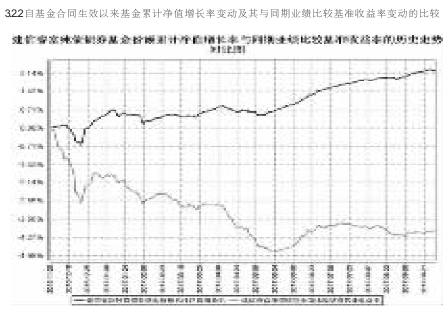
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.82%	0.02%	-0.15%	0.03%	0.97%	-0.01%

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本基金基金合同于2016年11月25日生效，截至报告期末未满一年。

2本基金建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§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11月25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日起任建信睿享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。

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《建信睿富纯债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

2017年第三季度，全球经济呈现温和复苏态势。美联储9月货币政策声明，维持基准利率不变，并计划开始缩表，这对市场情绪造成一定冲击，但由于市场预期充分，初期的规模也较低，这种冲击应是可控的，对中国债市影响也有限。德国大选结束，政局的稳定性在中长期有助于整个欧元区基本面保持稳定，未来欧元区经济复苏趋势不变。

国内方面，三季度经济整体呈现稳中有进、稳中向好的发展态势。从工业生产看，8月份的全国规模以上工业增加值同比实际增长6.0%，环比增长0.46%。投资的增长基本平稳，1-8月份固定资产投资同比增长7.8%，环比增长0.57%。进出口继续保持了两位数的增长，8月份的进出口总额24064亿元，同比增长10.1%。物价增长较温和，8月CPI同比上涨1.8%，环比上涨0.4%，主要是食品价格有所上涨。外汇方面，8月以来人民币汇率进入加速升值通道，外汇储备连续7个月回升。国际收支持续改善提高了应对外部风险冲击的能力，有利于国内流动性的相应改善、银行存款恢复，降低对同业杠杆的依赖。

从货币政策来看，央行"削峰填谷"的思路未变，三季度的资金面整体维持了紧平衡的态势。为了维稳市场流动性和应对缴税，央行公开市场操作灵活，尤其9月初在经历暂停回购、启动MLF(中期借贷便利)操作之后，中旬又开始加大逆回购操作金额并且重启28天期逆回购，向市场释放流动性。但是9月末银行因面临季末考核因素，对非银机构的资金投放谨慎，导致月底出现结构性不平衡。

三季度，债券市场整体窄幅震荡，10年国债在最高曾触及3.66%，最低曾下探至3.56%。货币政策维持稳健基调，金融监管协调推进，去杠杆对债市的影响弱化等促进市场做多情绪升温，但是银行的'表内配债空间'被新增信贷和地方债挤占，再加上理财和同业总体规模被压缩，所以配置需求明显减弱。

综上所述，本基金在2017年第三季度维持了一贯稳健的投资风格，维持了中性的久期，没有进行杠杆操作，并且有效的根据申赎合理安排资金和配置债券，在收益高位时点配置了部分优质资产，业绩表现良好。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率0.82%，波动率0.02%，业绩比较基准收益率-0.15%，波动率0.03%。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,587,269,000.00	93.05
	其中：债券	8,587,269,000.00	93.05
	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	450,000,000.00	4.88
	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	30,758,607.72	0.33
8	其他资产	160,246,595.29	1.74
9	合计	9,228,274,203.01	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	3,614,994,000.00	39.19
	其中：政策性金融债	1,870,019,000.00	20.27
4	企业债券	1,001,684,000.00	10.86
5	企业短期融资券	250,340,000.00	2.71
6	中期票据	2,592,481,000.00	28.10
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	1,127,770,000.00	12.23
9	其他	-	-
10	合计	8,587,269,000.00	93.09

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	100412	10农发12	8,900,000	889,377,000.00	9.64
2	091501002	15中国信达债02	7,000,000	693,420,000.00	7.52
3	1282205	12中船MTN1	6,000,000	606,660,000.00	6.58
4	120418	12农发18	5,000,000	500,300,000.00	5.42
5	120321	12进出21	4,500,000	450,225,000.00	4.88

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

5.10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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	160,246,595.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	160,246,595.29

5.10.4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。

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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

报告期期初基金份额总额	9,697,284,916.23
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	680,000,000.00
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	9,017,284,916.23

§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

本基金本报告期末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09月30日	9,697,282,470.99	0.00	680,000,000.00	9,017,282,470.99	99.99%
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。							

§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睿富纯债债券型证券投资基金设立的文件；

2、《建信睿富纯债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《建信睿富纯债债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信睿富纯债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