建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金 2017年年度报告摘要

2017年 12 月 31 日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2018 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信恒瑞一年定期开放债券
基金主代码	003400
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年 11 月 16 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,000,002,962.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过积极主动的组合管理,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	封闭期运作期内,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。开放运作期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于较低风险基金产品,其长期平均风险和预期收益率低于股票型及混合型基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	石立平
	联系电话	010- 66228888	010- 63639180
	电子邮箱	xinxipilu@cbfund.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400- 81- 95533 010- 66228000	95595
传真		010- 66228001	010- 63639132

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年 11 月 16 日(基金合同生效日)- 2016 年 12 月 31 日	2015年
本期已实现收益	856,174,643.86	103,578,247.42	-
本期利润	808,722,768.34	101,811,805.10	-
加权平均基金份额本期利润	0.0339	0.0041	-
本期基金份额净值增长率	3.34%	0.41%	-
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0076	0.0041	-
期末基金资产净值	16,121,417,482.15	24,901,813,866.62	-
期末基金份额净值	1.0076	1.0041	-

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、期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分)。

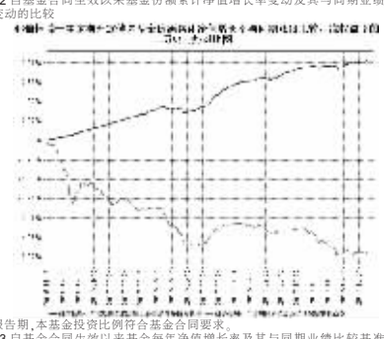
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

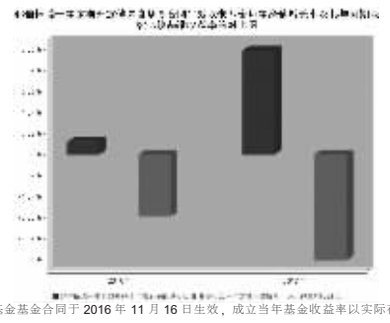
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.40%	0.02%	- 1.15%	0.06%	1.55%	- 0.04%
过去六个月	1.35%	0.02%	- 1.30%	0.05%	2.65%	- 0.03%
过去一年	3.34%	0.02%	- 3.38%	0.06%	6.72%	- 0.04%
自基金合同生效起至今	3.77%	0.02%	- 5.28%	0.09%	9.05%	- 0.07%

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,本基金投资比例符合基金合同要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本基金基金合同于 2016 年 11 月 16 日生效,成立当年基金收益率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	0.3000	744,000,059.32	-	744,000,059.32	
2016	-	-	-	-	
合计	0.3000	744,000,059.32	-	744,000,059.32	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字 [2005]158 号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日,注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司,其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%,信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%,中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部,以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心,并在上海设立了子公司--建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观,恪守“持有人利益重于泰山”的原则,以“建设财富生活”为崇高使命,坚持规范运作,致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2017 年 12 月 31 日,公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、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、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信增利债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉新宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信稳定中利债券型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信睿泽纯债债券型证券投资基金、建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金(LOF)基金、建信中证政策性金融债 3-5 年指数证券投资基金(LOF)基金、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金(LOF)基金、建信中证政策性金融债 5-8 年指数证券投资基金(LOF)基金、建信睿源纯债债券型证券投资基金、建信转债量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金(FOF)、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金,共计 95 只开放式基金,管理的基金净资产规模共计为 3,609.83 亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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	2016 年 11 月 16 日	-	12	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的基金经理;2009 年 6 月 2 日起任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理;2011 年 6 月 16 日起任建信信用增强债券型证券投资基金的基金经理;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的基金经理,该基金于 2018 年 2 月 6 日起转变为建信弘利灵活配置混合型证券投资基金。建信稳定保本七号混合型证券投资基金的基金经理;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的基金经理;2017 年 5 月 25 日起任建信福添利混合型证券投资基金的基金经理。

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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下(日内、3 日内、5 日内)管理的不同投资组合(包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等)同向交易的交易价差从 T 检验(置信度为 95%)、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下:

当时间窗为 1 日时,配了 31458 对投资组合,有 6807 对投资组合未通过 T 检验,其中 3392 对投资组合的正溢价率占优频率小于 55%,其它 3415 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中,2509 对平均溢价率低于 2%,其它 906 对平均溢价率超过 2%的投资组合中,有 20 对投资组合的贡献率超过 5%,但因为其溢价金额占平均净值的比例较低,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为 3 日时,配了 34512 对投资组合,有 8794 对投资组合未通过 T 检验,其中 3914 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%,其它 4880 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中,4523 对平均溢价率低于 5%,其它 357 对平均溢价率超过 5%的投资组合,有 5 对投资组合贡献率超过 5%,但因为其溢价金额占平均净值的比例较低,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为 5 日时,配了 35964 对投资组合,有 10419 对投资组合未通过 T 检验,其中 4515 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%,其它 5904 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中,5809 对平均溢价率低于 10%,其它 95 对平均溢价率超过 10%的投资组合,有 3 对投资组合贡献率超过 5%,但因为其溢价金额占平均净值的比例较低,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人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%的情况有 3 次,原因是投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年宏观经济平稳增长,GDP 同比增速全年维持 6.9%的水平,较 2016 年提高了 0.2 个百分点。需求方面,消费与出口成为全年拉动经济增长的主要动力。消费层面,居民消费转型升级的态势明显,旅游休闲、娱乐消费快速增长;出口层面,由于世界经济稳健复苏,净出口对于经济的贡献在 2017 年由负转正,全年进出口总额同比增长 14.2%。投资层面,固定资产投资增速整体回落的趋势不改,但随着供给侧改革的推进,制造业投资增速较 2016 年企稳回升。物价方面,2017 年 CPI 同比温和上涨,而 PPI 指数涨幅趋缓。受到食品价格的拖累,CPI 增速除了 1 月 2.5%的高点外,其他月份均在 0.8-1.9%区间内波动,全年同比涨幅 1.6%。PPI 受大宗商品价格上涨以及基数效应的影响,全年同比增速 4.9%,并呈现 M 型走势。国际方面,欧洲与日本的复苏已经确认,尽管美联储 3 次加息结合川普税改方案获得通过,仍然难以扭转美元阶段性走弱的趋势。

政策方面,2017 年央行继续维持稳健中性的货币政策,全年 3 次上调公开市场操作利率,资金面维持紧平衡态势,季末、年末等时点资金价格显著抬升。监管方面,央行不断完善宏观审慎框架,防范金融风险和降杠杆的政策导向贯穿全年。“一行三会”在二季度与四季度颁布了多项政策法规,旨在规范银行同业业务及整个资管行业,对市场造成显著的冲击。

在此影响下,2017 年债券市场除了三季度保持震荡外,受公开市场利率调整以及金融监管影响,全年债券收益率大幅上行。其中,1 年期与 10 年期国债收益率较年初分别上行 114BP 与 87BP。收益率曲线平坦化的同时,信用利差有所走阔。

回顾全年的基金管理工作,本基金以流动性管理为主、追求绝对收益的投资策略,配置上优先存款与短期高收益信用债,并在收益率上行过程中配置一定比例的中长久期中票及利率债,在市场调整过程中展现了较好的抗跌性及正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 3.34%,波动率 0.02%,业绩比较基准收益率 -3.38%,波动率 0.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年,我们认为经济转型期内,在追求增长质量的诉求下,基本面仍有下行的压力。全球经济复苏对出口的拉动,以及国内消费的平稳增长将继续对经济形成支撑,但在基数效应下其幅度不及 2017 年。随着限购影响的逐步展现以及三四线城市去库存的结束,房地产对于经济的拉动效果将较为有限;结合政府对经济下行容忍度的提升,基建投资的托底作用也不宜过度预期。通胀层面,原油价格上涨和食品价格的低基数效应将成为 2018 年影响 CPI 的主要因素,通胀中枢的抬升则是大概率事件。政策方面,随着金融去杠杆的深化以及宏观审慎框架的完善,央行预计将维持中性的货币政策,在控制系统性风险的同时稳定机构的杠杆水平。在此影响下,债券市场趋势性机会需要通胀预期的兑现以及政策冲击的结束,在此之前利率债将维持震荡寻顶的状态,而信用利差则仍有走阔空间。组合管理方面,在控制久期、合理杠杆的同时,关注地方平台融资问题以及可能触发的城投类债券投资风险。

本基金 2018 年维持中性的回报预期,在严控各类风险的前提下合理控制久期和杠杆水平,精选个券,力求为持有人获得较好的绝对收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[2017]13 号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产估值委员会,主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜,确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、风险管理部和资产核算部门负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作,熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》,与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金和理财类基金);对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》,并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣,对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内实施了 1 次收益分配,于 2017 年 11 月 13 日向建信恒瑞一年定期开放债券基金份额持有人每 10 份基金份额分配 0.30 元,收益分配基准日为 2017 年 10 月 31 日,共发放现金红利人民币 744,000,059.32 元,符合相关法律法规及基金合同中关于收益分配条款的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国光大银行股份有限公司在建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金(以下称“本基金”)托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。同时,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金 2017 年年度报告》进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“建信恒瑞一年定期开放债券基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了普华永道中天审字(2018)第 22708 号标准无保留意见。投资者可通过年度报告正文查看审计报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年 12 月 31 日	上年度末 2016年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款		893,236,395.54	14,313,467,274.93
结算备付金		66,511,818.18	909,090.91
存出保证金		8,803.56	-
交易性金融资产		14,580,160,238.40	1,048,822,000.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		14,520,444,238.40	1,048,822,000.00
资产支持证券投资		59,716,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		270,000,000.00	9,484,455,669.07
应收证券清算款		-	-
应收利息		317,779,195.10	62,744,108.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		16,127,696,450.78	24,910,398,143.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年 12 月 31 日	上年度末 2016年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,311,272.11	6,316,837.93
应付托管费		1,437,090.72	2,105,612.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		25,469.18	14,121.18
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		505,136.62	147,704.93
负债合计		6,278,968.63	8,584,276.69
所有者权益:			
实收基金		16,000,002,962.12	24,800,002,061.52
未分配利润		121,414,520.03	101,811,805.10
所有者权益合计		16,121,417,482.15	24,901,813,866.62
负债和所有者权益总计		16,127,696,450.78	24,910,398,143.31

报告截止日 2017 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.0076 元,基金份额总额 16,000,002,962.12 份。

7.2 利润表

会计主体:建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2017年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一.收入		910,984,293.43	114,182,456.05
1.利息收入		959,737,979.95	115,948,898.37
其中:存款利息收入		360,725,083.93	81,153,201.92
债券利息收入		554,553,881.09	2,193,564.90
资产支持证券利息收入		410,789.04	-
买入返售金融资产收入		44,048,225.89	32,602,131.55
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-1,301,811.00	-
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,301,811.00	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-47,451,875.52	-1,766,442.32
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-	-
减:二.费用		102,261,525.09	12,370,650.95
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	72,968,581.97	9,164,378.26
2.托管费	7.4.8.2.2	24,322,860.69	3,054,792.76
3.销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4.交易费用		101,596.65	3,375.00
5.利息支出		4,359,085.78	-
其中:卖出回购金融资产支出		4,359,085.78	-
6.其他费用		509,400.00	148,104.93
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)		808,722,768.34	101,811,805.10
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)		808,722,768.34	101,811,805.10

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2017年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	24,800,002,061.52	101,811,805.10	24,901,813,866.62
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	808,722,768.34	808,722,768.34
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-8,799,999,099.40	-45,119,994.09	-8,845,119,093.49
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-8,799,999,099.40	-45,119,994.09	-8,845,119,093.49
四.本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-744,000,059.32	-744,000,059.32
五.期末所有者权益(基金净值)	16,000,002,962.12	121,414,520.03	16,121,417,482.15

项目	上年度可比期间 2016年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	24,800,002,061.52	-	24,800,002,061.52
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	101,811,805.10	101,811,805.10
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四.本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五.期末所有者权益(基金净值)	24,800,002,061.52	101,811,805.10	24,901,813,866.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____孙志晨_____ _____吴曙明_____ _____丁颖_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2104 号《关于准予建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 24,800,002,061.52 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1471 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 24,800,002,061.52 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金以定期开放方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日的下一个工作日起(包括该日)至一年后的对应日的前一工作日止。如该对应日不存在对应日期或为非工作日,则顺延至下一工作日。封闭期内,本基金不办理申购与赎回业务,也不上市交易。本基金自封闭期结束后第一个工作日起(包括该日)进入开放期,期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期不少于五个工作日并且最长不超过二十个工作日,开放期的具体安排以基金管理人届时公告为准。如封闭期结束之后第一个工作日因不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的,开放期自不可抗力或基金合同约定的其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。如在开放期内发生不可抗力或基金合同约定的其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的,开放期时间中止计算,在不可抗力或基金合同约定的其他情形影响因素消除之日次一工作日起,继续计算该开放期时间,直至满足开放期的时间要求。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购等金融工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:债券资产占基金资产的比例不低于 80%(在每个开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内,基金投资不受上述比例限制)。开放期内,本基金持有现金或者到期日在一个月以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,在封闭期,本基金不受前述 5%的限制。本基金不参与投资股票、权证等权益类资产,但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而形成的权证。本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2018 年 3 月 21 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”),中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2016 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对