建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:2019年7月17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2019年7月15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2019年4月1日起至6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	
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	160,983,368.53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	β*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	100,266,138.28份	60,717,230.25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(2019年4月1日-2019年6月30日)	报告期(2019年4月1日-2019年6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	6,393,149.69	3,768,443.57
2.本期利润	-6,368,464.15	-3,717,892.44
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0630	-0.0601
4.期末基金资产净值	99,163,601.18	57,589,606.32
5.期末基金份额净值	0.989	0.948

注: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

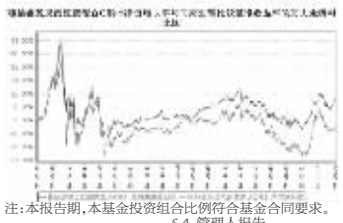
建信睿盈灵活配置混合A

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	-6.08%	1.13%	-0.70%	0.99%	-5.38%	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	-6.32%	1.13%	-0.70%	0.99%	-5.62%	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



注:本报告期,本基金投资组合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		
许杰	本基金的基金经理	2015年2月3日	-	17年	许杰先生,权益投资部副总经理,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的基金经理;2012年8月14日起任建信社会责任混合型证券投资基金的基金经理;2014年9月10日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的基金经理;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的基金经理;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的基金经理;2017年3月22日起任建信中小盘先锋股票型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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

报告期内全球经济下行压力加大,自今年2月份开始欧洲和日本的制造业PMI指数已经跌落至荣枯线以下并处于下行趋势,美国6月份的制造业PMI也跌落至2016年9月份以来的最低。全球经济进入周期性调整,美国发动的贸易战又加剧了世界经济的调整压力。中国制造业PMI指数3月份回升至荣枯线以上后,5月份又重新回落至荣枯线以下,显示中国经济也存在着较大的调整压力。

二季度A股市场走出了前高后低的走势。四月初股票市场延续了一季度的上涨趋势,但四月下旬开始股票市场出现了较大幅度的调整。一方面,四月份开始监管得到加强,继续进行金融供给侧改革,包商事件等的出现导致投资者的风险偏好降低,另一方面,美国重燃贸易战,并对华为等公司列入所谓的实体清单,打击了本来就比较脆弱的世界经济。

资产配置方面,本基金二季度降低了股票的配置比例。报告期内,本基金主要投资了以下三个方面的公司:首先继续围绕高质量增长这条中国未来经济发展的主线,重点投资了先进制造、新材料等创新类行业的龙头企业;其次,投资了消费行业尤其是必选消费行业的龙头公司;最后,配置了环保、建筑等需求侧出现改善的公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A净值增长率-6.08%,波动率1.13%,本报告期本基金C净值增长率-6.32%,波动率1.13%;业绩比较基准收益率-0.70%,波动率0.99%。

§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	76,147,351.50	48.09
	其中:股票	76,147,351.50	48.09
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	78,891,341.60	49.82
8	其他资产	3,302,108.32	2.09
9	合计	158,340,801.42	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	3,112,641.00	1.99
C	制造业	45,448,724.78	28.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,086,099.00	3.88
F	批发和零售业	2,345,240.00	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	1,596,560.00	1.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,441,536.72	6.66
J	金融业	3,163,377.00	2.02
K	房地产业	1,550,289.00	0.99
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	2,402,884.00	1.53
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	76,147,351.50	48.58

注:以上行业分类以2019年6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

无。

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	300316	晶盛机电	484,590	6,149,447.10	3.92
2	600519	贵州茅台	5,000	4,920,000.00	3.14
3	002624	完美世界	182,016	4,697,832.96	3.00
4	000498	山东路桥	860,400	4,568,724.00	2.91
5	601318	中国平安	35,700	3,163,377.00	2.02
6	300395	菲利华	176,500	3,122,285.00	1.99
7	000968	蓝焰控股	268,100	3,112,641.00	1.99
8	603886	元祖股份	99,024	2,623,145.76	1.67
9	600990	四创电子	53,100	2,470,212.00	1.58
10	603218	日月股份	125,300	2,430,820.00	1.55

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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未披露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	431,851.43
2	应收证券清算款	2,848,371.42
3	应收股利	-
4	应收利息	16,294.50
5	应收申购款	5,590.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,302,108.32

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	104,278,870.30	66,041,381.27
报告期期间基金总申购份额	932,684.21	953,332.79
减:报告期期间基金总赎回份额	4,945,416.23	6,277,483.81
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	100,266,138.28	60,717,230.25

注: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(%)	3.19

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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
2019年7月17日

建信睿怡纯债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:2019年7月17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2019年7月15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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信睿怡纯债债券
基金主代码	002377
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年9月19日
报告期末基金份额总额	5,405,652,565.95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	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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	28,455,354.69
2.本期利润	17,036,980.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.0032
4.期末基金资产净值	5,903,827,610.72
5.期末基金份额净值	1.0922

注: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	0.29%	0.05%	-0.24%	0.06%	0.53%	-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

注:本报告期,本基金投资组合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		
问晗	本基金的基金经理	2018年9月19日	-	6年	问晗先生,硕士。2012年10月至今历任建信基金管理公司交易员、交易主管、基金经理助理,2017年11月3日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理。该基金在2018年9月19日转型为建信睿怡纯债债券型证券投资基金。同晗继续担任该基金的基金经理;2018年4月20日起任建信安心同报定期开放债券型基金的基金经理;2018年4月20日起任建信安心同报两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理,该基金自2019年4月26日转型为建信安心同报6个月定期开放债券型证券投资基金,同晗继续担任该基金的基金经理;2019年3月26日起任建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理;2019年4月30日起任建信中债3-5年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。
陈建良	固收投资部总监,基金经理	定益资副经本金基金 2018年9月19日	-	12年	陈建良先生,双学士,固定收益投资部副总经理。2005年7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月加入我公司投资管理部,担任基金经理助理,基金经理,固定收益投资部总经理助理,副总经理。2013年12月10日起任建信货币市场基金的基金经理;2014年1月21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;2014年6月17日起任建信惠新宝货币市场基金的基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币市场基金的基金经理;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的基金经理。该基金在2018年9月19日转型为建信睿怡纯债债券型证券投资基金,陈建良继续担任该基金的基金经理;2016年7月26日起任建信现金增利货币市场基金的基金经理;2016年9月2日起任建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理;2016年9月13日至2017年12月6日任建信隔夜添利混合型证券投资基金的基金经理;2016年10月18日起任建信天添益货币市场基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内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《建信睿怡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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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

宏观经济方面,19年二季度经济运行保持平稳的发展态势,但相比于一季度有所回落。从生产端层面看,1-5月全国规模以上工业增加值累计同比增长6.0%,增速较一季度有所回落,但是其中高技术制造业仍保持较快增长。从需求端层面看,固定资产投资增速1-5月累计增速5.6%,较一季度末有所回落。从分项上看,制造业投资增速继续回落,基建投资增速也有小幅下行,房地产投资增速虽然较一季度末也有所回落,但是仍保持了两位数的高速增长。消费二季度增速继续保持平稳态势,网上零售占比继续提高。总体来看,19年二季度经济受到国内和国外影响,下行压力较大。

价格指数方面,19年二季度CPI涨势温和,PPI涨幅回落。具体来看,1-5月CPI累计同比上涨2.2%,涨幅比一季度末上行0.4个百分点,其中食品项中鲜果价格受到供给影响价格涨幅较大,猪肉价格面临的供给收缩压力也较大。PPI方面,5月当月PPI同比走势从4月的0.9%回落到0.6%,石油价格回落导致输入性压力减弱。

货币政策方面,二季度资金面整体维持合理适度水平,市场资金较为充裕。受到5月下旬包商银行被接管影响,全市场质押式回购利率出现明显上行,非银机构融资成本显著抬升,特别是低等级信用债的质押融资变得极为困难,银行间市场的流动性出现分层。随着6月人民银行采用头部券商定向支持和增加常备借贷便利等操作,非银机构融资难的问题才有所缓解。此外央行在4月24日开展定向中期借贷便利(TMLF)操作2674亿元,5月15日开始对中小银行实行较低存款准备金率释放长期资金约2800亿元。

债券市场方面,二季度债券市场收益率先上后下,整体收益率维持区间震荡。具体来看,4月受到一季度经济和金融数据好转影响收益率显著上行,然而进入5月分,随着特朗普发文要继续加税,贸易战风波重燃,收益率开始出现一定回落。之后随着美国对华为制裁的加大,同时国内经济和金融数据也开始出现回落,整体收益率水平开始震荡向下。总体来看,二季度末10年国开债收益率相比于一季度末3.58%的位置上行3BP到3.61%,而10年国债收益率则上行16BP到3.23%。

基金操作方面,组合准确的判断了二季度市场资金面整体宽松的态势,保持了较高的杠杆水平,获得了稳定的票息收益,与此同时,也在6月份较为及时的增加了组合的久期,把握住了二季度末收益率下行的行情。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率0.29%,波动率0.05%,业绩比较基准收益率-0.24%,波动率0.06%。

§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	-	0.00
	其中:股票	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	7,500,548,897.98	97.35
	其中:债券	7,500,548,897.98	97.35
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	69,765,853.27	0.91
8	其他资产	134,342,678.32	1.74
9	合计	7,704,657,429.57	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

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

无。

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	62,382,000.00	1.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,213,731,000.00	20.56
	其中:政策性金融债	1,110,926,000.00	18.82
4	企业债券	1,178,400,602.00	19.96
5	企业短期融资券	2,164,213,600.00	36.66
6	中期票据	2,736,270,700.00	46.35
7	可转债(可交换债)	305,906.98	0.01
8	同业存单	145,245,000.00	2.46
9	其他	-	-
10	合计	7,500,548,897.98	127.06

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	180211	18国开11	3,400,000	344,080,000.00	5.83
2	180204	18国开04	2,000,000	208,980,000.00	3.54
3	101900586	19中油股MTN005	2,000,000	201,020,000.00	3.40
4	101900821	19广金MTN012	2,000,000	198,480,000.00	3.36
5	180312	18进出12	1,900,000	190,304,000.00	3.22

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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未披露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

基金投资的前十名证券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	140,472.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	134,202,095.40
5	应收申购款	109.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	134,342,678.32

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	5,389,612,996.96
报告期期间基金总申购份额	32,138,885.64
减:报告期期间基金总赎回份额	16,099,326.65
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	5,405,652,565.95

注: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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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	2019年04月01日-2019年06月30日	4,801,079,000.00	-	-	4,801,079,000.00	88.82
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怡纯债债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信睿怡纯债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信睿怡纯债债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信睿怡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
2019年7月17日

建信睿兴纯债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:2019年7月17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2019年7月15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2019年4月26日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信睿兴纯债债券
基金主代码	006791
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年4月26日
报告期末基金份额总额	451,783,892.23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,力争实现超越业绩比较基准的投资回报,追求基金资产的长期稳健增值。
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	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,预期收益和风险水平低于股票型基金及混合型基金,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(2019年4月26日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	2,651,240.61
2.本期利润	3,066,370.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0050
4.期末基金资产净值	454,110,881.23
5.期末基金份额净值	1.0052

注: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、本基金基金合同于2019年4月26日生效,合同生效当期未满一季度。

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
自基金合同生效起至今	0.52%	0.01%	0.81%	0.04%	-0.29%	-0.03%

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

注:本基金基金合同于2019年4月26日生效,截至报告期末仍处于建仓期。

§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		
黎颖芳	本基金的基金经理	2019年4月26日	-	18年	黎颖芳女士,硕士。2000年7月加入大成基金管理公司,先后在金融工程部、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的基金经理;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的基金经理;2012年11月15日起任建信纯债债券型证券投资基金的基金经理;2014年12