平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:平安大华基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月20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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月19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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安大华智慧中国混合
交易代码	001297
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月9日
报告期末基金份额总额	1,501,192,197.02份
投资目标	本基金致力于发掘中国经济转型和产业升级中新技术或新模式带来的投资机会。通过重点投资与高端装备制造、工业4.0、互联网主题相关的优质证券,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	从我国宏观层面(经济转型、区域经济增长、通货膨胀和利率的预期)社发,依据工业增加值与CPI的变动划分经济周期的不同阶段(复苏、扩张、滞涨、萧条),依据产业的生命周期把产业分为概念、导入、萌芽、成长、繁荣、衰退六个阶段,同时将行业非系统风险均值与其分布的GINI系数结合运用,全面准确地判断大类资产风险程度和收益前景,统筹考量短、中、长期资产配置比例。股票投资在投资时钟与产业生命周期策略基础上秉持自上而下与自下而上相结合的选股理念,精选有成长潜力的优质股票构建投资组合。债券投资以目标久期管理和品种选择策略为主,以收益率利差策略、债券置换策略为辅,构造能获取稳定收益的固定收益类投资品种组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是混合型,属于中高风险收益水平的基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§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(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-312,410,306.26
2.本期利润	-400,675,856.29
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2699
4.期末基金资产净值	970,099,735.91
5.期末基金份额净值	0.646

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	-29.93%	3.55%	-10.70%	1.94%	-19.23%	1.61%

业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%

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2015年6月09日正式生效,截至报告期末未满一年;
2、按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末本基金已完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
史畝涛	本基金的基金经理	2015年11月10日	-	8	史畝涛先生曾任职于广发证券资产管理(广东)有限公司投资研究部,于2015年2月加入平安大华基金,现任平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金、平安大华景享文娱灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
孙健	本基金的基金经理	2015年6月9日	-	15	自2001年起,先后在湘财证券资产管理部、中国太平人寿保险公司投资部/太平资产管理公司从事投资工作,2006年起,分别在摩根士丹利华鑫基金公司、银华基金公司担任基金经理。2011年9月加入平安基金,现担任平安大华保本混合型证券投资基金、平安大华添利债券型证券投资基金、平安大华日增利货币市场基金、平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金、平安大华鑫享混合型证券投资基金、平安大华鑫安混合型证券投资基金、平安大华鑫安增益一年期定期开放混合型证券投资基金、平安大华安心保本混合型证券投资基金、平安大华安享保本混合型证券投资基金基金经理。

任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内,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未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

由于对熔断政策的判断失误,本基金在一月份未能回避市场的系统性风险,2月份之后,随着汇率稳定、经济数据企稳、新兴产业业绩持续向好,我们判断市场存在喘息期,由此也积极提高仓位,3月份把握住了市场的修复性机会,为投资人赢得了一定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,本基金份额净值为0.646元,份额累计净值为0.646元。报告期内,本基金份额净值增长率为-29.93%,同期业绩基准增长率为-10.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着政策面供给侧改革的推进,一季度经济数据出现触底回升,人民币汇率基本实现稳定,流动性来源正在重建,房地产风险得到大大降低,市场投资偏好从2月份开始逐步回升,而由于改革推进意愿强烈,政策可腾挪空间较大,预计经济数据仍以稳定为主。而绝大多数的龙头产业业绩均呈现拐点向上或者持续加速迹象,这使得资本市场在二季度有望迎来较为难得的投资期。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人、基金资产净值低于5000万的情形。

§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	901,703,143.59	92.43
	其中:股票	901,703,143.59	92.43
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	71,329,891.41	7.31
8	其他资产	2,500,886.25	0.26
9	合计	975,533,921.25	100.00

注:本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	485,787,291.91	50.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,484,177.80	2.52
E	建筑业	9,702,550.00	1.00
F	批发和零售业	27,948,327.73	2.88
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	257,744,052.78	26.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	22,561,808.00	2.33
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	73,474,935.37	7.57
S	综合	-	-
	合计	901,703,143.59	92.95

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	300324	旋极信息	939,389	45,654,305.40	4.71
2	002292	奥飞娱乐	1,109,920	45,184,843.20	4.66
3	300459	浙江金科	850,180	32,876,460.60	3.39
4	300036	超图软件	783,458	32,631,025.70	3.36
5	002587	奥拓电子	1,922,450	30,739,975.50	3.17
6	002313	日海通讯	1,933,390	30,508,894.20	3.14
7	002460	赣锋锂业	586,500	30,052,260.00	3.10
8	300014	亿纬锂能	1,081,600	29,635,840.00	3.05
9	300336	新文化	953,700	29,211,831.00	3.01
10	600584	长电科技	1,562,600	29,204,994.00	3.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资情况。

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

本基金本报告期末无债券投资情况。

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

本基金本报告期末无资产支持证券投资情况。

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

本基金本报告期末无贵金属投资情况。

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

本基金本报告期末无权证投资情况。

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

本基金本报告期无股指期货投资情况。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或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中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,185,508.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,794.66
5	应收申购款	298,583.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,500,886.25

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	600584	长电科技	29,204,994.00	3.01	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

报告期期初基金份额总额	1,450,615,006.22
报告期期间基金总申购份额	82,612,820.73
减:报告期期间基金总赎回份额	32,035,629.93
报告期期间基金份额分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,501,192,197.02

§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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十三次会议审议通过,由陈特正先生接替肖宇鹏先生任职公司督察长职务,任职日期为2016年1月21日,该事项已于2016年1月22日公告。

经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第二十六次会议审议通过,由肖宇鹏先生接替罗春风先生任职公司总经理职务,任职日期为2016年1月22日,该事项已于2016年1月23日公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(2)平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(3)平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金托管协议

(4)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5)报告期内平安大华智慧中国灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

(1)投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

(2)投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人平安大华基金管理有限公司,客户服务电话:4008004800(免长途话费)

平安大华基金管理有限公司
2016年4月20日

建信安心保本三号混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月20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2016年4月18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2016年1月4日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信安心保本三号混合
基金主代码	002281
交易代码	002281
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月4日
报告期末基金份额总额	4,960,232,839.30份
投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理,在严格控制风险和保证本金安全的基础上,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金的资产包括风险资产和安全资产,本基金投资策略分为两个层次:层为基金在风险资产和安全资产两大类资产上的配置策略;另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。
业绩比较基准	2年期银行定期存款收益率(税前)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属于证券投资基金中的中低风险品种。
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
基金保证人	重庆三峡担保集团股份有限公司

§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(2016年1月4日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-8,198,193.09
2.本期利润	6,546,269.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0013
4.期末基金资产净值	4,966,794,344.43
5.期末基金份额净值	1.001

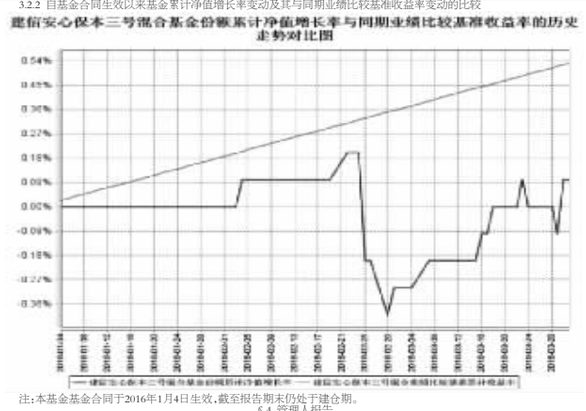
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3、本基金基金合同于2016年1月4日生效,合同生效当期未满一季度。

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
过去三个月	0.10%	0.08%	0.53%	0.01%	-0.43%	0.07%

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2016年1月4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		
朱虹	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2016年1月4日	-	8	硕士。2007年加入长城人寿保险股份有限公司,任债券投资助理。2009年4月加入宏弘基金管理有限公司,任基金经理、固定收益投资总监助理。2012年1月,加入万家基金管理有限公司,任基金经理、固定收益总监。2014年8月加入我公司,历任投资管理部副总监、固定收益投资部副总经理。2015年10月29日任建信安心保本三号混合型证券投资基金基金经理,2016年1月4日起任建信安心保本三号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《建信安心保本三号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

一季度宏观经济无论从供给、需求还是价格因素看短期改善的证据越来越明显。补库存、地产回暖、政府项目加大推进均是推动经济反弹的因素。各项工业品价格、食品价格均有所上涨。一线楼市价格的反弹尤为剧烈。经济基本面的短期企稳和美联储在3月偏鸽派的表态大大缓解了人民币的贬值压力。

年初由于人民币贬值压力较大,央行货币政策相对谨慎,投放资金以公开市场操作为主,降准被迫延后,市场资金面一度稍显紧张。美联储加息预期降低后央行灵活性加大,在原有公开市场操作基础上实施了降准、降低MLF利率等积极政策,引导社会融资成本继续下降,但过剩产能行业的信用风险不断上升,违约事件时有发生。长久期利率债因通胀有所抬头表现疲弱,金融债调整尤其明显;权益市场本季波动较大,1季度前半段跌幅惨烈,人民币贬值压力是主要推手,后半段指数有所修复,但全季来看主要指数均告下跌。

本基金1季度处于建仓期,采取的策略是低久期、低权益仓位。全季回报0.09%,未能战胜投资基准。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信安心保本三号混合型证券投资基金基金份额净值增长率0.10%,波动率0.08%,业绩比较基准收益率0.53%,波动率0.01%。

§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	285,153,322.46	5.71
	其中:股票	285,153,322.46	5.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,458,075,273.70	89.34
	其中:债券	4,458,075,273.70	89.34
	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	140,000,190.00	2.81
	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	59,910,982.95	1.20
8	其他资产	46,852,410.63	0.94
9	合计	4,989,992,179.74	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	30,478,213.40	0.61
B	采矿业	8,286,560.00	0.17
C	制造业	174,641,587.98	3.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	24,665,038.48	0.50
F	批发和零售业	27,610.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	9,490,192.00	0.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,709,509.00	0.56
J	金融业	9,842,608.00	0.20
K	房地产业	12,003.60	0.00
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	285,153,322.46	5.74

注:以上行业分类以2016年3月31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沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

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	002458	益生股份	408,260	19,163,724.40	0.39
2	300017	网宿科技	259,100	15,134,031.00	0.30
3	600528	中铁二局	1,077,000	14,744,130.00	0.30
4	002196	方正电机	555,751	14,516,216.12	0.29
5	002465	海格通信	1,050,572	13,583,895.96	0.27
6	002439	启明星辰	529,300	12,523,238.00	0.25
7	000858	五粮液	417,300	11,730,303.00	0.24
8	300322	硕贝德	762,500	11,391,750.00	0.23
9	002086	东方海洋	619,972	11,314,489.00	0.23
10	300146	汤臣倍健	331,556	11,007,659.20	0.22

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	422,693,560.60	8.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,085,251,000.00	62.12
	其中:政策性金融债	3,085,251,000.00	62.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	851,170,000.00	17.14
6	中期票据	82,986,000.00	1.67
7	可转债(可交换债)	15,974,713.10	0.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,458,075,273.70	89.76

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	150317	15进出17	8,600,000	869,546,000.00	17.51
2	150223	15国开23	7,800,000	784,602,000.00	15.80
3	160401	16农发01	5,000,000	500,200,000.00	10.07
4	150418	15农发18	3,200,000	326,048,000.00	6.56
5	020103	16贴现国债05	3,000,000	298,410,000.00	6.01

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

本基金本报告期末股指期货投资政策

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	93,092.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	46,759,318.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,852,410.63

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	002439	启明星辰	12,523,238.00	0.25	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2016年1月4日)基金份额总额	4,978,395,127.27
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,426,170.87
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	23,588,458.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	4,960,232,839.30

注:1、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。
2、本基金基金合同于2016年1月4日生效,合同生效当期未满一季度。

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信安心保本三号混合型证券投资基金设立的文件;
2、《建信安心保本三号混合型证券投资基金基金合同》;
3、《建信安心保本三号混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信安心保本三号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
2016年4月20日

建信稳定丰利债券型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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
报告送出日期:2016年4月20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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月18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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信稳定丰利债券	
基金主代码	001948	
交易代码	001948	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年12月8日	
报告期末基金份额总额	942,229,908.37份	
投资目标	通过重点投资于债券投资组合,本基金在严格控制风险和追求基金资产稳定增长的基础上,力争为投资者创造较高的当期收入和总回报。	
投资策略	本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征,通过自上而下的定性分析和定量分析,综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素,判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值,对各大类资产的风险收益特征进行评估,从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例,并依据各因素的动态变化进行及时调整。	
业绩比较基准	中债总财富(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	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信稳定丰利债券A	建信稳定丰利债券C
下属分级基金的交易代码	001948	001949
报告期末下属分级基金的份额总额	644,803,914.09份	297,425,994.28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(2016年1月1日 - 2016年3月31日)	
	建信稳定丰利债券A	建信稳定丰利债券C
1.本期已实现收益	1,943,702.24	454,695.97
2.本期利润	871,296.82	-112,771.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0013	-0.0003
4.期末基金资产净值	647,583,461.32	298,331,272.95
5.期末基金份额净值	1.004	1.003

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

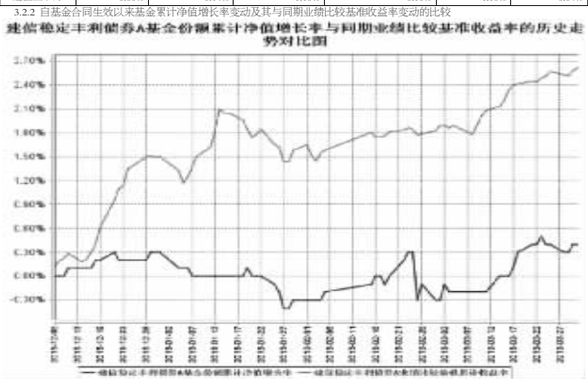
建信稳定丰利债券A

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	0.10%	0.12%	1.10%	0.10%	-1.00%	0.02%

建信稳定丰利债券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	0.00%	0.14%	1.10%	0.10%	-1.10%	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



建信稳定丰利债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图