建信安心回报定期开放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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	建信安心回报债券
基金主代码	000105
交易代码	000105
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月14日
报告期末基金份额总额	152,025,781.42份
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	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。本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析,比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用特征的券种及债券与现金之间进行动态调整。本基金在综合分析宏观经济、货币政策等因素的基础上,采用久期管理、期限管理、类属管理和风险管理相结合的投资策略。在个券选择上,本基金将综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险分析、流动性分析等方法来评估个券的投资价值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款收益率(税前)。
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	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信安心回报债券A / 建信安心回报债券C
下属分级基金的交易代码	000105 / 000106
报告期末下属分级基金的份额总额	81,611,568.62份 / 70,414,212.80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(2016年1月1日 - 2016年3月31日)	
	建信安心回报债券A	建信安心回报债券C
1.本期已实现收益	2,054,256.60	1,679,260.32
2.本期利润	715,470.52	538,276.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0076
4.期末基金资产净值	96,845,079.98	82,511,118.77
5.期末基金份额净值	1.187	1.172

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

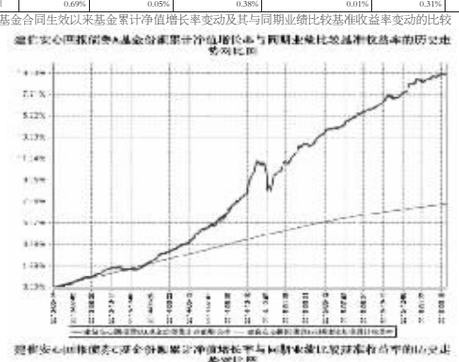
建信安心回报债券A

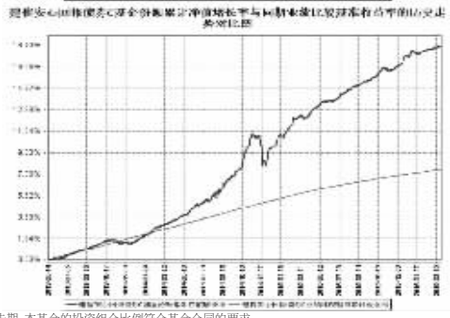
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.76%	0.05%	0.38%	0.01%	0.38%	0.04%

建信安心回报债券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	0.69%	0.05%	0.38%	0.01%	0.31%	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





注: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		
朱建华	本基金的基金经理	2013年5月14日	-	8	硕士。曾任大连博达系统工程公司职员、中诚信国际信用评级公司项目组长、2007年10月起任中诚信证券评估有限公司公司评级部总经理助理、2008年8月起任国泰基金管理公司高级研究员。朱建华于2011年6月加入本公司,历任高级债券研究员、货币市场基金的基金经理助理、2012年8月28日至2015年8月11日任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年11月15日至2014年3月6日任建信纯债债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日至2014年3月27日任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年5月14日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金经理;2013年12月10日起任建信稳定添利债券型证券投资基金基金经理;2016年3月14日起任建信鑫丰回报灵活配置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

在本报告期内,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《建信安心回报定期开放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

一季度,宏观经济呈现前低后高的筑底迹象,不仅三月份pmi指数站在了荣枯线之上,而且微观层面看企业经营活力也有所恢复,工业增加值预计将出现反弹。这种现象的发生主要是因为去年悲观预期的背景下实体经济库存偏低,一季度企业补库存带动产品价格的上涨,加之国际大宗价格的上升,促进实体经济活力恢复。但与传统的库存周期不同,由于目前总体产能过剩严重,实体投资回报率偏低,投资主要依赖中央政府,难以吸引私人投资,因此在信用没有出清的前提下价格的上涨缺乏需求的支撑,预示着经济的复苏时间可能会较短,中长期的经济增长预期仍不乐观。货币政策方面,在年初汇率闯关失败的背景下,央行再次将稳定利率预期、降低长期利率水平为实体经济服务作为货币政策的重心,在经济维稳的基础上央行的货币操作空间比以往要小。国际看,由于对联储短期内加息预期发生改变,市场上的风险偏好出现短期上升,除了带动美元汇率走低外也为稳定人民币汇率留出了时间窗口。当前债市特点是整体收益水平较低,信用息差、绝对收益水平处于历史低位,但配置需求仍然旺盛,债市一季度总体呈现窄幅波动。

回顾一季度的基金管理工作,由于建信安心定期开放债券型基金属于一年期开放品种,随着离下一个开放日的临近,一季度本基金进一步降低了组合久期与杠杆,并增持了一些存单配置。预防未来的流动性风险一直摆在重要的位置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期安心回报A净值增长率0.76%,波动率0.05%,安心回报C净值增长率0.69%,波动率0.05%;业绩比较基准收益率0.38%,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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	181,192,340.10	96.50
	其中:债券	181,192,340.10	96.50
	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	2,962,359.01	1.58
8	其他资产	3,616,000.23	1.93
9	合计	187,770,699.34	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

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	20,770,000.00	11.58
	其中:政策性金融债	20,770,000.00	11.58
4	企业债券	20,571,340.10	11.47
5	企业短期融资券	40,092,000.00	22.35
6	中期票据	30,256,000.00	16.87
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	69,503,000.00	38.75
9	其他	-	-
10	合计	181,192,340.10	101.02

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	111609115	16浦发CD115	300,000	29,787,000.00	16.61
2	150216	15国开16	200,000	20,770,000.00	11.58
3	1182183	11彩彩MTN2	200,000	20,308,000.00	11.32
4	011599585	15川能投SCP002	200,000	20,100,000.00	11.21
5	071608002	16东方证券CP02	200,000	19,992,000.00	11.15

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	999,328.19
3	应收股利	-
4	应收利息	2,616,672.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,616,000.23

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信安心回报债券A	建信安心回报债券C
报告期期初基金份额总额	81,611,568.62	70,414,212.80
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	-	-
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	81,611,568.62	70,414,212.80

注: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

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回报定期开放债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信安心回报定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信安心回报定期开放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。

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

建信创新中国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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	建信创新中国混合
基金主代码	000308
交易代码	000308
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月24日
报告期末基金份额总额	31,436,433.03份
投资目标	在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略,本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势,判断当前所处的经济周期,进而对未来做出科学预测。在此基础上,结合对流动性及资金流向的分析,综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。
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	中信银行股份有限公司

§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	-5,315,420.57
2.本期利润	-6,041,075.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2009
4.期末基金资产净值	62,694,897.19
5.期末基金份额净值	1.994

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。

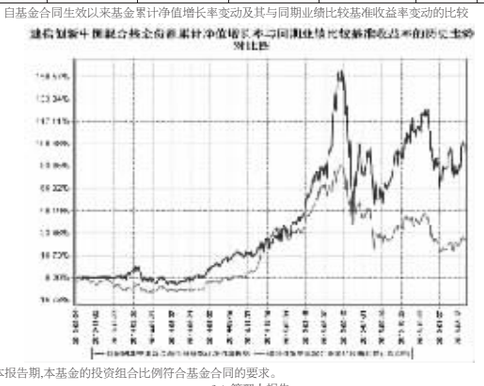
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-10.18%	2.71%	-9.95%	1.82%	-0.23%	0.89%

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		
邵卓	本基金的基金经理	2015年5月22日	-	8	硕士。2006年4月至2006年12月任明基(西门子)移动通信研发中心软件工程师;2007年2月至2010年7月任IBM中国软件实验室软件工程师;2010年7月加入广发证券公司,任计算机行业研究员、2011年9月加入我公司,历任研究员、研究主管、基金经理,2015年3月24日起任建信信息产业股票基金经理;2015年5月22日起任建信创新中国混合基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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《建信创新中国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

2016年一季度,A股市场经历了较大幅度的下跌。美元加息背景下对人民币贬值的担忧,国内供给侧改革背景下的经济压力加大,降低了市场的风险偏好。沪深两市两融余额,也从年初的11615亿元降低到3月31日的8809亿元。

一季度根据市场变化,本基金适时调整配置思路和策略,从15年末的成长股为主转换到稳健均衡的配置策略,提高了高增长低估值的白马成长和业绩稳健的蓝筹的持仓比例,聚焦景气度高的细分子行业,更加注重自下而上选股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-10.18%,波动率2.71%,业绩比较基准收益率-9.95%,波动率1.82%.

§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	45,339,093.70	70.00
	其中:股票	45,339,093.70	70.00
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	16,631,858.80	25.68
8	其他资产	2,798,321.90	4.32
9	合计	64,769,274.40	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	1,954,583.00	3.12
B	采矿业	3,238,870.85	5.17
C	制造业	25,176,651.53	40.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	848,174.00	1.35
E	建筑业	1,914,174.48	3.05
F	批发和零售业	1,476,840.00	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	613,254.00	0.98
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,685,724.72	9.07
J	金融业	3,069,151.00	4.90
K	房地产业	519,349.20	0.83
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	842,320.92	1.34
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	45,339,093.70	72.32

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

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	300017	网宿科技	33,942	1,982,552.22	3.16
2	000697	炼石有色	74,200	1,931,426.00	3.08
3	000488	晨鸣纸业	222,100	1,881,187.00	3.00
4	002673	西部证券	68,300	1,845,466.00	2.94
5	002152	广电运通	66,200	1,580,856.00	2.52
6	600303	曙光股份	120,600	1,552,122.00	2.48
7	300202	聚龙股份	64,601	1,438,018.26	2.29
8	002099	海翔药业	139,600	1,435,088.00	2.29
9	002051	中工国际	61,000	1,396,290.00	2.23
10	600549	厦门钨业	71,900	1,373,290.00	2.19

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	183,201.36
2	应收证券清算款	2,495,380.17
3	应收股利	-
4	应收利息	4,460.48
5	应收申购款	115,279.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,798,321.90

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	27,772,826.50
报告期期间基金总申购份额	8,574,277.04
减:报告期期间基金总赎回份额	4,910,670.51
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	31,436,433.03

注: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

本基金本报告期基金管理人未持有本金。

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创新中国混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信创新中国混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信创新中国混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信创新中国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

建信纯债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	建信纯债债券
基金主代码	530021
交易代码	530021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月15日
报告期末基金份额总额	1,190,610,200.29份
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资人创造稳定的当期回报,并力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	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。通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析,比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用特征的券种及债券与现金之间进行动态调整。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数
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	建信纯债债券A / 建信纯债债券C
下属分级基金的交易代码	530021 / 531021
报告期末下属分级基金的份额总额	834,279,519.43份 / 356,330,680.86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)	
	建信纯债债券A	建信纯债债券C
1.本期已实现收益	11,769,011.88	6,572,093.29
2.本期利润	5,110,258.05	1,730,328.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0037
4.期末基金资产净值	994,528,981.44	419,183,883.84
5.期末基金份额净值	1.192	1.176

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

建信纯债债券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	0.51%	0.06%	0.31%	0.07%	0.20%	-0.01%

建信纯债债券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	0.43%	0.06%	0.31%	0.07%	0.12%	-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		
黎颖芳	本基金的基金经理	2012年11月15日	-	15	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月加入本公司研究部,历任研究员、高级研究员、基金经理助理。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01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基金基金经理;2015年12月8日起任建信稳定丰利债券基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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

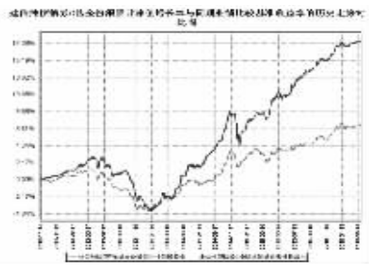
本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1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,中短久期高等级及城投债券表现较好。

本基金规模相对年末有所扩张,1月大幅减持了长久期利率债,组合以高等级中短久期信用债为主,全季收益0.5%,战胜了投资基准。



注: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		
黎颖芳	本基金的基金经理	2012年11月15日	-	15