建信安心回报定期开放债券型证券投资基金

2017 第四季度 报告

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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2018年1月22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2018年1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2017年10月1日起至12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	86,999,359.14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、期限结构管理、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	50,662,775.48份　36,336,583.66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10月1日 — 2017年12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	655,594.99	423,943.26
2. 本期利润	178,510.82	88,062.95
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0035	0.0024
4. 期末基金资产净值	60,663,645.35	42,693,650.62
5. 期末基金份额净值	1.197	1.175

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

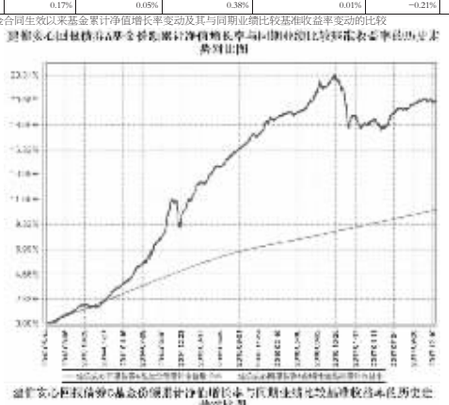
建信安心回报债券A

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	0.25%	0.05%	0.38%	0.01%	-0.13%	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	0.17%	0.05%	0.38%	0.01%	-0.21%	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



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	－	10	硕士。曾任大连博迅系统工程公司职员、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；2016年4月28日起任建信安心保本六号基金经理；2016年6月1日任建信转债增强债券基金经理；2016年11月1日起任建信瑞丰添利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，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2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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，国内宏观经济整体运行平稳，工业生产保持稳定，出口增长有所加速，特别是财新的非制造业PMI回升至55，显示经济的较强的韧性，这也在部分程度上抵消了投资下滑所带来的冲击。虽然2017年全国各地出台了一系列地产调控措施，但全年地方政府卖地收入依然创历史新高，这也在很大程度上弥补了地方基建投资的缺口，同时12月超预期的地产销售数据显示目前地产的需求势头总体强劲，此外人民币的持续升值也带来外汇储备的微幅增长，四季度在环保限产和补库存的带动下，大宗商品价格整体维持高位震荡，而国际市场上铜、铝等则创出几年新高，显示全球经济回暖的态势正在加速，市场在经历了这一轮的供给侧改革后，周期类行业的集中度和抗风险能力比以往都有了明显回升，未来盈利的波动性也有望下降。另外在供需紧平衡的背景下，四季度市场对未来需求端的预期增速有所增长，这也是跟三季度不同的地方。通胀方面，目前通胀的压力整体不大，但需要注意的是，随着全球经济的逐步复苏，企业盈利的提升将进一步推动需求的回暖与价格的上涨，特别是油价的回升趋势没有停止的迹象，未来价格的继续传导值得关注。货币政策方面，央行依然延续了中性偏紧的货币政策，四季度市场资金层面看并没有出现明显的紧张状况，但非银机构的整体融资成本依然不低，银行间的信用收缩带来的影响从shibor和市场利率之间的差异可以明显看出。

债券方面，金融去杠杆依然没有结束的迹象，相反监管层面在四季度继续出台多个文件，从流动性到杠杆、负债端等多个方面进一步限制未来机构的交易行为，显示了上层坚定去杠杆的决心，这对本已脆弱的债券市场造成了一轮新的冲击。债券收益率在四季度出现了一波明显的上行，除短融外其余多数品种均难以获得正收益。另外市场对信用债的担忧越发加剧，部分城投和高收益信用债受到抛压，短久期获得票息收入是当下市场的主要操作思路。

四季度，安心回报定期开放基金的持仓与三季度变化不大，主要以短融为主，杠杆比例比上个季度略有下降总体维持在接近140%的水平，其操作策略主要是吃票息为主，但因为四季度债市机会不多加上原有持仓中部分债券的估值波动造成收益不是很理想。接下来的操作，我们认为在金融去杠杆结束前债市难以有明显的投资机会，而短融在经历了一轮调整后是目前性价比最高的。因此本基金将维持现在有的持仓结构和操作思路等待市场的回暖。

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0.25%，波动率0.05%，安心回报C净值增长率0.17%，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	139,299,786.20	97.53
	其中：债券	139,299,786.20	97.53
	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	510,335.47	0.36
8	其他资产	3,012,775.72	2.11
9	合计	142,822,897.39	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	9,335,000.00	9.03
	其中：政策性金融债	9,335,000.00	9.03
4	企业债券	19,961,786.20	19.31
5	企业短期融资券	110,003,000.00	106.43
6	中期票据	－	－
7	可转债（可交换债）	－	－
8	同业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	139,299,786.20	134.77

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	011769010	17华联SCP002	100,000	10,023,000.00	9.70
2	011761062	17远东租赁SCP003	100,000	10,010,000.00	9.68
3	011764062	17晋能SCP007	100,000	10,009,000.00	9.68
4	011761058	17中建材SCP012	100,000	10,006,000.00	9.68
5	011762036	17三安SCP004	100,000	10,005,000.00	9.68
6	011778007	17华夏幸福SCP005	100,000	10,005,000.00	9.68

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	1,084.10
2	应收证券清算款	500,821.92
3	应收股利	－
4	应收利息	2,510,869.70
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	3,012,775.72

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

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	50,662,775.48	36,336,583.66
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	50,662,775.48	36,336,583.66

上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额，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

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 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
2018年1月22日

建信安心保本五号混合型证券投资基金

2017 第四季度 报告

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
报告送出日期：2018年1月22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2018年1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2017年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信安心保本五号混合
基金主代码	002378
交易代码	002378
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月4日
报告期末基金份额总额	3,099,966,924.72份
投资目标	本基金自上而下积极、动态地配置大类资产，同时通过合理的证券选择，在有效控制风险的前提下，谋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，在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整大类资产配置比例，同时将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，运用自上而下和自下而上相结合的个股、个券投资策略，在大类资产配置和证券选择两个层面上实现投资组合的双重优化。
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	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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
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（2017年10月1日 — 2017年12月31日）
1.本期已实现收益	33,106,898.63
2.本期利润	22,156,379.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.0070
4.期末基金资产净值	3,248,721,169.83
5.期末基金份额净值	1.048

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。

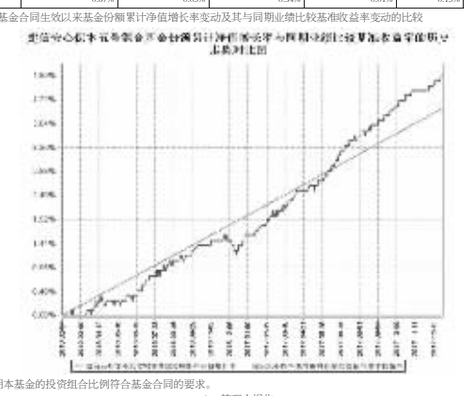
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.67%	0.03%	0.54%	0.01%	0.13%	0.02%

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		
李菁	固定收益投资部总经理、本基金的基金经理	2016年2月4日	－	12	李菁女士，固定收益投资部总经理，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13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；2016年6月8日起任建信安心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日起任建信瑞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，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《建信安心保本五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，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2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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度宏观经济整体运行平稳，随着海外经济的复苏出口增速在四季度重回12.3%的高位，同期物价水平仍在低位运行，但是随着国际原油价格上升至60美元以上，对通胀和经济增长韧性的预期在整个四季度逐步修正。政策方面，防范金融风险和降杠杆是贯彻全年的政策工作重点，继《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》之后，四季度银监会进一步颁布《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见（征求意见稿）》以及《商业银行流动性风险管理办法（修订征求意见稿）》，均对从2011年以来迅速扩张的银行理财和资管行业进行了诸多规范，打破刚性兑付和降杠杆是政策核心，对四季度的债券市场以及未来的市场均将产生重大影响。国际方面，欧美经济持续复苏，美联储在12月如期加息。

在此背景下，四季度各期限债券收益率大幅上行，曲线持续平坦化。整个季度短端收益率上行超过70bp，长端收益率上行也超过60bp，期限利差显著收窄。股票市场方面，上证指数在11月中旬一度突破3450点，随后受到金融监管预期以及年末资金面收紧影响，股指再度回落至3300点附近。

回顾四季度的基金管理工作，面对监管以及资金面的不确定性，本基金延续了前期以流动性管理为主、追求绝对收益的投资策略，本基金在2018年一季度将结束第一个保本周期，因此四季度的组合管理基本是配置与剩余期限匹配的存款和信用债券，在提高组合流动性的同时增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率0.67%，波动率0.03%，业绩比较基准收益率0.54%，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	5,144,000.00	0.16
	其中：股票	5,144,000.00	0.16
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	719,829,253.20	21.91
	其中：债券	719,829,253.20	21.91
	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	159,968,269.95	4.87
	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	2,375,199,905.49	72.28
8	其他资产	25,921,933.04	0.79
9	合计	3,286,063,361.68	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	5,144,000.00	0.16
B	采矿业	－	－
C	制造业	－	－
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	－	－
E	建筑业	－	－
F	批发和零售业	－	－
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	－	－
J	金融业	－	－
K	房地产业	－	－
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	5,144,000.00	0.16

以上行业分类以2017年12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港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

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	000998	隆平高科	200,000	5,144,000.00	0.16

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	238,002,000.00	7.33
	其中：政策性金融债	238,002,000.00	7.33
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	431,902,000.00	13.29
6	中期票据	－	－
7	可转债（可交换债）	49,925,253.20	1.54
8	同业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	719,829,253.20	22.16

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	170207	17国开07	1,800,000	179,136,000.00	5.51
2	011760069	17晋煤SCP005	900,000	90,459,000.00	2.78
3	011754090	17康美SCP001	700,000	70,287,000.00	2.16
4	041773001	17中信重工CP001	600,000	60,432,000.00	1.86
5	160402	16农发02	600,000	58,866,000.00	1.81

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交易情况说明

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	22,098.55
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	25,897,551.79
5	应收申购款	2,282.70
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	25,921,933.04

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113009	广汽转债	17,483,337.30	0.54
2	132007	16凤凰EB	12,475,190.00	0.38
3	120001	16辽岭EB	1,102,886.40	0.03
4	127004	模塑转债	237,226.50	0.01
5	113012	骆驼转债	75,302.80	0.00

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。

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	3,224,534,716.79
报告期期间基金总申购份额	335,867.21
减：报告期期间基金总赎回份额	124,903,659.28
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	3,099,966,924.72

上述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安心保本五号混合型证券投资基金设立的文件；

2、《建信安心保本五号混合型证券投资基金基金合同》；

3、《建信安心保本五号混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信安心保本五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
2018年1月22日

建信安心保本三号混合型证券投资基金

2017 第四季度 报告

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：交通银行股份有限公司
报告送出日期：2018年1月22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2018年1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2017年10月1日起至12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	3,359,697,743.96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：一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（2017年10月1日 — 2017年12月31日）
1.本期已实现收益	4,734,705.78
2.本期利润	14,232,563.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0041
4.期末基金资产净值	3,477,628,722.92
5.期末基金份额净值	1.035

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	0.39%	0.03%	0.54%	0.01%	-0.15%	0.02%

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	－	10	朱虹女士，固定收益投资部副总经理，硕士。2007年1月至2009年4月任长城人寿保险公司债券投资助理；2009年4月至2011年12月任天弘基金管理公司固定收益部总监助理；2012年1月至2014年5月任万家基金管理公司固定收益部总监；2015年8月至今历任我公司投资管理部副总监、固定收益投资部副总监、副总经理。2015年10月29日起任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于2017年11月4日转型为建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金，朱虹继续担任该基金的基金经理；2016年1月4日任建信安心保本三号混合型证券投资基金的基金经理；2016年6月1日起任建信双债增强债券型证券投资基金的基金经理；2016年11月17日起任建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
邵卓	权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官、本基金的基金经理	2017年12月19日	－	7	邵卓先生，硕士，权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官。2006年4月至2006年12月任职达（西门子）