

建信瑞盛添利混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

2016 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 1 月 19 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 2017 年 1 月 17 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信瑞盛添利混合
基金主代码	003057
交易代码	003057
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 13 日
报告期末基金份额总额	1,008,248,318.46 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力求实现基金资产的持续稳定增值。
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金融衍生品投资策略四部分组成。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40% +中债综合指数（全价）收益率×60%
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	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信瑞盛添利混合 A	建信瑞盛添利混合 C
下属分级基金的交易代码	003057	003058
报告期末下属分级基金的份额总额	3,708,807.44 份	1,004,539,511.02 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10月1日—2016年12月31日）	
	建信瑞盛添利混合 A	建信瑞盛添利混合 C
1. 本期已实现收益	28,697.17	4,614,878.95
2. 本期利润	1,142.53	-2,224,555.03
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0002	-0.0022
4. 期末基金资产净值	3,713,453.69	1,003,582,686.20
5. 期末基金份额净值	1.0013	0.9990

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

建信瑞盛添利混合 A

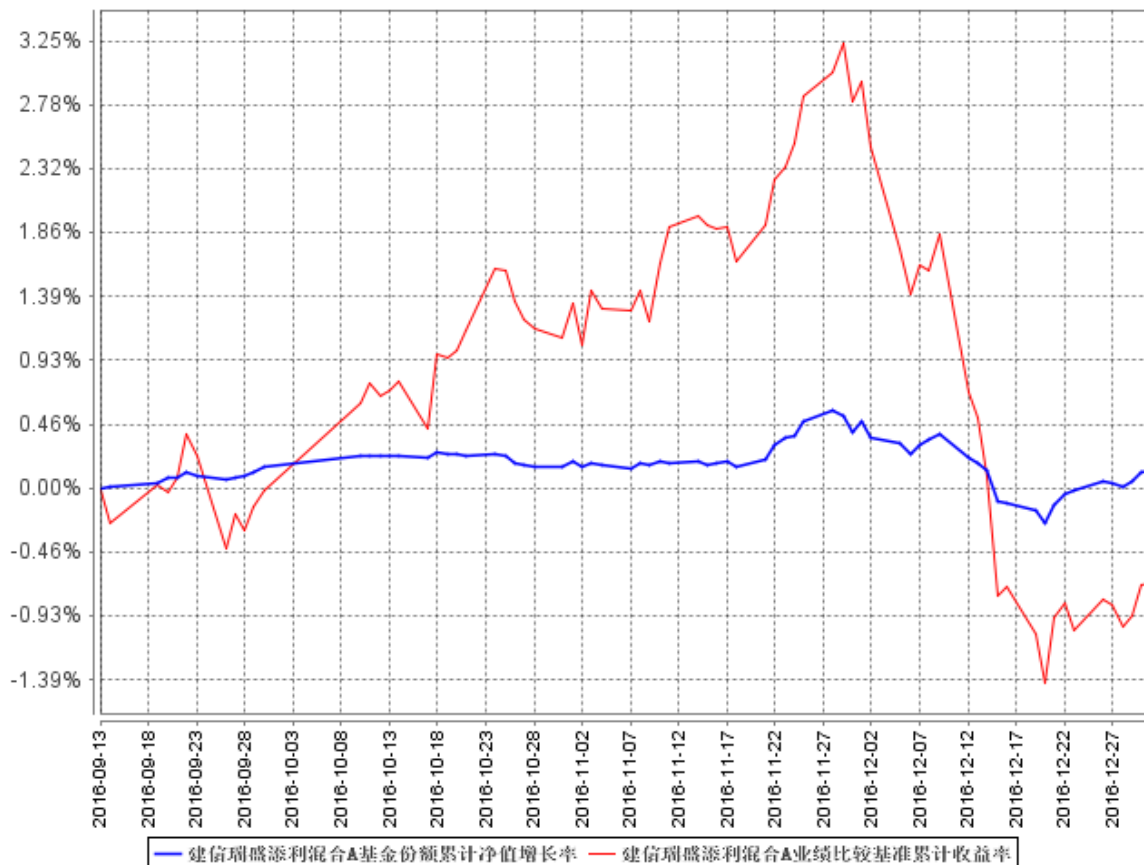
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.02%	0.06%	-0.68%	0.32%	0.66%	-0.26%

建信瑞盛添利混合 C

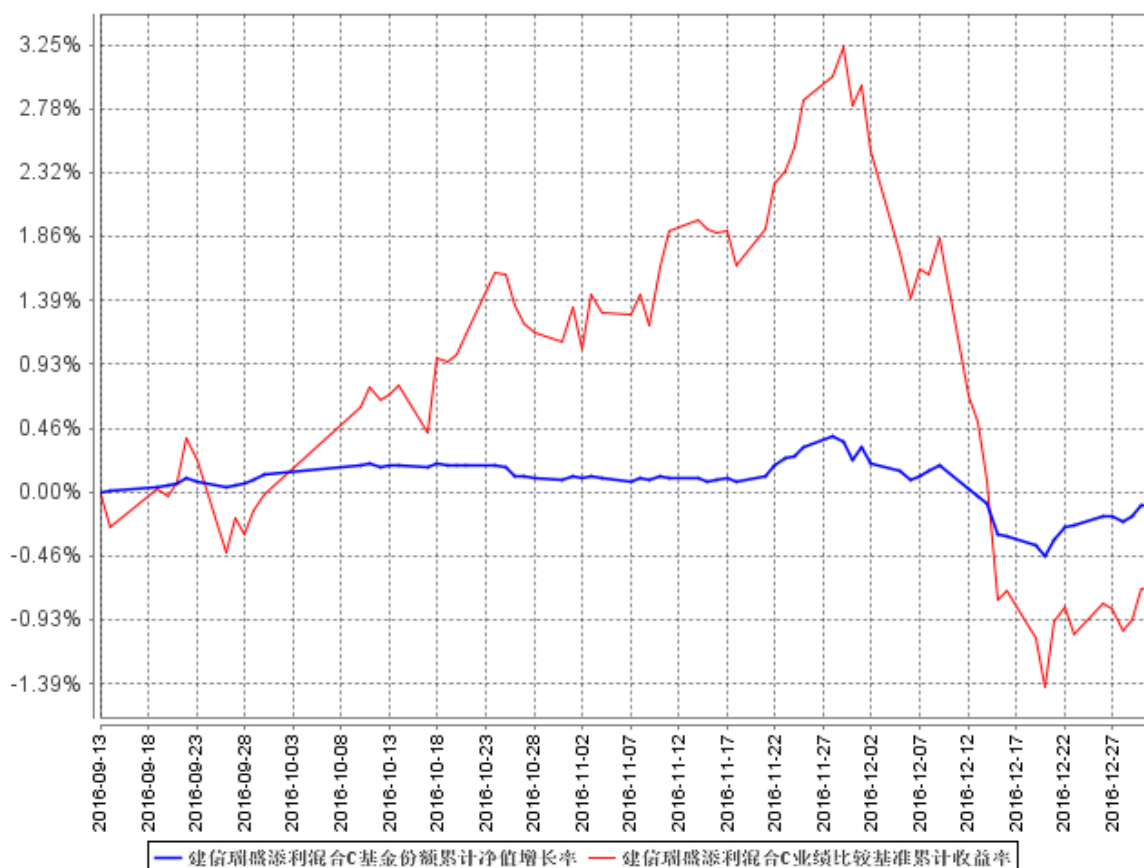
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.23%	0.06%	-0.68%	0.32%	0.45%	-0.26%

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

建信瑞盛添利混合A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



建信瑞盛添利混合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



注：本基金基金合同于 2016 年 9 月 13 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		
陈建良	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2016 年 9 月 13 日	-	9	2005 年 6 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，历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总监助理。2013 年 12 月 10 日起任建信货币市场基金基金经理；2014 年 1 月 21 日起任建信月盈安心理财基金基金经

				理；2014 年 6 月 17 日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理；2014 年 9 月 17 日起任建信现金添利货币基金的基金经理；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基金经理；2016 年 7 月 26 日起任建信现金增利货币市场基金基金经理；2016 年 9 月 2 日起任建信现金添益交易型货币市场基金基金经理；2016 年 9 月 13 日起任建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金经理；2016 年 10 月 18 日起任建信基金天添益货币市场基金基金经理。
牛兴华	本基金的基金经理	2016 年 10 月 25 日	-	6 硕士，曾任神州数码中国有限公司投资专员；2010 年 9 月加入中诚信国际信用评级有限责任公司，历任分析师、分析师/项目经理、高级分析师/项目经理。2013 年 4 月加入我公司，历任研究部债券研究员、固定收益投资部基金经理。2014 年 12 月 2 日起任建信稳定得利债券基金基金经理；2015 年 4 月 17 日起任建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015 年 5 月 13 日起任建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015 年 5 月 14 日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2015 年 6 月 16 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；2015 年 7 月 2 日至 2015 年 11 月 25 日任建信鑫裕回报灵活配置混合

				型证券投资基金；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基金经理；2016 年 2 月 22 日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金基金经理；2016 年 10 月 25 日起任建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 2 日起任建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 23 日起任建信鑫荣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合规守信情况的说明

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《建信瑞盛添利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

四季度政府出台全面地产限购政策，由于政策传导存在滞后，地产投资增速并未出现断崖式下跌，宏观经济整体保持平稳态势，1-11 月固定资产投资实现累计增速 8.3%。随着供给侧改革的深入推进，过剩产能行业库存去化明显，产品价格稳步抬升，制造业投资也在四季度出现小幅反弹迹象。工业增加值 11 月当月同比为增速为 6.2%较 9 月提高 0.1 个百分点。消费数据四季度相比于前三季度基本持平，而进出口数据则有小幅改善，11 月进出口总额当月同比 1.1%已经转正。总体来看，四季度经济增速保持平稳，全年实现经济增长 6.7%的目标已经实现。

受到供给侧改革、补库存以及海外市场回暖等因素影响，四季度物价水平上涨较快。工业品价格指数四季度同比继续大幅回升，11 月当月同已经升至 3.3%。消费者价格指数方面，由于天气原因蔬菜价格延续环比上行以及低基数因素影响，四季度 CPI 水平也有小幅回升，11 月 CPI 同比为 2.3%，较三季度末回升了 0.4 个百分点。

受到特朗普上台、美联储加息等海外因素影响，美元指数从三季度末 95.4 的水平一度达到高点 103.6，人民币中间价从 9 月底 6.6778 贬值到最近 6.95 左右的位置。除人民币大幅贬值外，四季度资金面也出现了较大波动，整体资金面情况较为紧张。货币市场七天质押式回购利率水平在 10 月中下旬、11 月下旬和 12 月均有较大程度上行，而代表非银机构资金面的全市场回购利率水平相比于存款类机构质押回购利率波动更加剧烈。

四季度债券市场收益率快速大幅上行，10 年国开上行程度最高达到 80BP，而 10 年国债收益率上行程度最高也超过 60BP。信用利差水平有小幅恢复，分位数水平仍低于历史中位数。资金面的全面收紧同样对权益市场造成了较大的负面影响，上证综指 12 月下跌接近 7%，创业板跌幅则达到 11.3%。

回顾四季度的基金管理工作，组合久期保持较短水平，小幅增加短久期信用债配置比例。权益方面，择机参与了包括股票和转债在内的权益产品的波段操作，并积极参与新股申购以增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信瑞盛添利 A 净值增长率-0.02%，波动率 0.06%，建信瑞盛添利 C 净值增长率-0.23%，波动率 0.06%；业绩比较基准收益率-0.68%，波动率 0.32%。

§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	70,556,552.65	6.98
	其中：股票	70,556,552.65	6.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	767,053,000.00	75.89
	其中：债券	767,053,000.00	75.89
	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	155,240,425.36	15.36
	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	7,563,639.44	0.75
8	其他资产	10,301,631.53	1.02
9	合计	1,010,715,248.98	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	2,965,912.00	0.29
B	采矿业	-	-
C	制造业	42,439,511.22	4.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,119,167.00	1.10
E	建筑业	2,911,926.23	0.29
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,014,968.00	0.20
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	9,105,068.20	0.90
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	70,556,552.65	7.00

以上行业分类以 2016 年 12 月 31 日的中国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	002366	台海核电	114,600	6,144,852.00	0.61
2	000001	平安银行	659,172	5,998,465.20	0.60
3	600900	长江电力	455,700	5,769,162.00	0.57
4	600236	桂冠电力	877,050	5,350,005.00	0.53
5	000625	长安汽车	310,600	4,640,364.00	0.46
6	600660	福耀玻璃	219,900	4,096,737.00	0.41
7	600160	巨化股份	325,600	3,444,848.00	0.34
8	002202	金风科技	175,600	3,004,516.00	0.30
9	601328	交通银行	519,900	2,999,823.00	0.30
10	000998	隆平高科	138,400	2,965,912.00	0.29

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	59,664,000.00	5.92
	其中：政策性金融债	59,664,000.00	5.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	368,879,000.00	36.62
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	338,510,000.00	33.61
9	其他	-	-
10	合计	767,053,000.00	76.15

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	111609362	16 浦发 CD362	1,000,000	97,250,000.00	9.65
2	111608316	16 中信 CD316	1,000,000	96,320,000.00	9.56
2	111617234	16 光大 CD234	1,000,000	96,320,000.00	9.56
3	160308	16 进出 08	600,000	59,664,000.00	5.92
4	011697047	16 中天建设 SCP001	500,000	50,075,000.00	4.97
5	011698857	16 联合水泥 SCP004	500,000	49,865,000.00	4.95

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，中信银行股份有限公司(601998)于2016年1月29日发布公告：中信银行兰州分行发生票据业务风险事件。经核查，涉及风险金额为人民币9.69亿元，公安机关已立案侦查。

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	60,945.94
2	应收证券清算款	5,005,527.78
3	应收股利	-
4	应收利息	5,235,147.83
5	应收申购款	9.96
6	其他应收款	0.02
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,301,631.53

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

项目	建信瑞盛添利混合 A	建信瑞盛添利混合 C
报告期期初基金份额总额	5,544,121.00	1,012,008,509.27
报告期期间基金总申购份额	49,673.69	916.56
减：报告期期间基金总赎回份额	1,884,987.25	7,469,914.81
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	3,708,807.44	1,004,539,511.02

§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瑞盛添利混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信瑞盛添利混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信瑞盛添利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
2017 年 1 月 19 日