

建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金

2017 年第 4 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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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

转型后：

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 建信鑫利灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 001858 |
| 交易代码 | 001858 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 11 月 4 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 680,734,779.38 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 | 本基金业绩比较基准为： $65\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+35\% \times$ 中债总财富（总值）指数收益率。 |
| 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 | 中信银行股份有限公司 |

转型前：

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 建信安心保本二号混合 |
| 基金主代码 | 001858 |
| 交易代码 | 001858 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 10 月 29 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1, 216, 532, 419. 72 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（即权益类资产）和安全资产（即固定收益类资产），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）*1. 3。 |
| 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 | 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（转型后）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2017 年 11 月 4 日 — 2017 年 12 月 31 日） |
|-----------------|---|
| 1. 本期已实现收益 | -864, 967. 14 |
| 2. 本期利润 | -2, 721, 842. 23 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0. 0034 |
| 4. 期末基金资产净值 | 703, 874, 087. 44 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1. 0340 |

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、根据本基金基金合同的约定，本基金自 2017 年 11 月 4 日起转型为非保本基金“建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金”。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2017 年 10 月 1 日 — 2017 年 11 月 3 日） |
|-----------------|--|
| 1. 本期已实现收益 | 3,519,903.36 |
| 2. 本期利润 | 7,475,264.56 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0024 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,261,641,894.50 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.037 |

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。

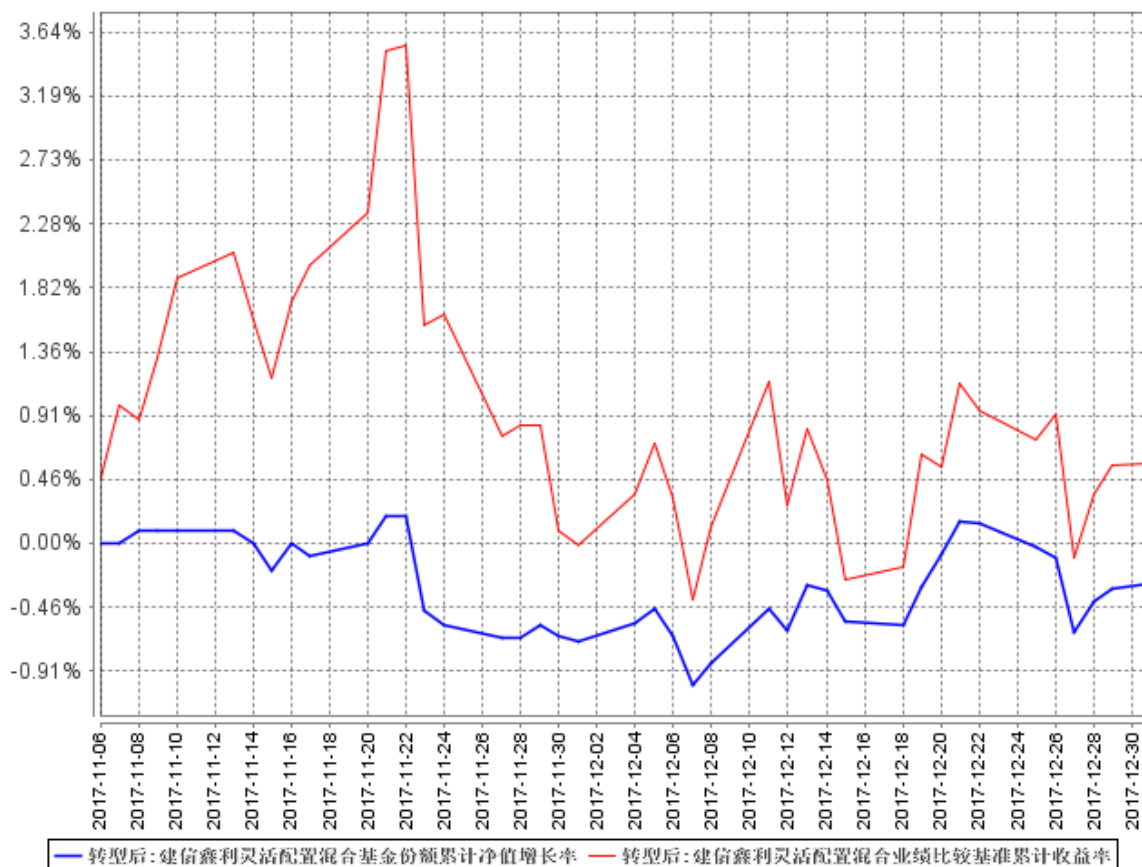
3.2 基金净值表现（转型后）

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% | 0.21% | 0.57% | 0.60% | -0.86% | -0.39% |

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

建信鑫利灵活配置混合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 2017 年 11 月 4 日生效，转型前为建信安心保本二号混合基金。截至报告期末，仍处于建仓期。

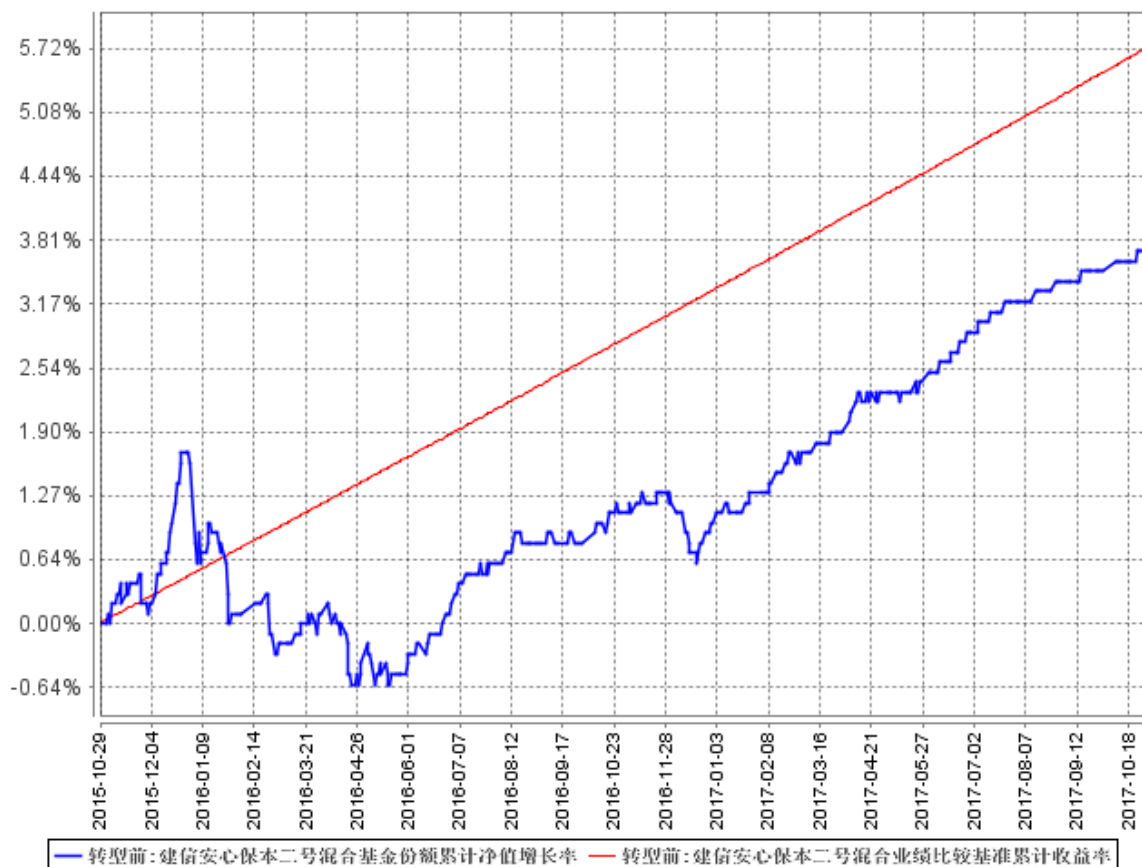
3.2 基金净值表现（转型前）

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 | 0.19% | 0.04% | 0.26% | 0.01% | -0.07% | 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

建信安心保本二号混合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 2017 年 11 月 4 日生效，转型前为建信安心保本二号混合基金。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

| 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 | 2015 年 10 月 29 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。 |
|--|--|--|--|--|---|

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

| 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 | 2017 年 11 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 |

| | | | | |
|----|------------------------------|-----------------|---|--|
| | | | | <p>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。</p> |
| 陶灿 | 权益投资部总经理助理兼研究部首席策略官、本基金的基金经理 | 2017 年 11 月 4 日 | - | <p>10</p> <p>硕士，权益投资部总经理助理兼研究部首席策略官。2007 年 7 月加入本公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、权益投资部总经理助理兼研究部首席策略官。2011 年 7 月 11 日至 2016 年 4 月 22 日任建信优化配置混合型证券投资基金的基金经理；2014 年 5 月</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>14 日起任建信改革红利股票型证券投资基金的基金经理；</p> <p>2016 年 2 月 23 日起任建信现代服务业股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 2 月 9 日起任建信回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 3 月 22 日起任建信恒久价值混合型证券投资基金的基金经理；</p> <p>2017 年 10 月 27 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 日起转型为建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金，陶灿继续担任该基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

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《建信鑫利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》、《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

2017 年四季度以来，市场分化依然明显，以沪深 300 为代表的大盘蓝筹表现较好，而以中证 1000 为代表的小盘股表现较差。在流动性现实以及预期偏紧的背景下，高估值板块遭遇较大的调整。

从基本面看，2017 年四季度宏观经济层面数据依然处于较好状态，企业盈利在供给侧改革、环保高压的影响下，各行业龙头公司现金流、盈利继续得到改善，而行业中的中小企业面临了成长环境已经不同于改革开放前 30 年的状态。人口红利的趋势下滑、环保成本趋高、金融体系的整顿均导致中小企业无法复制现有行业龙头的成长轨迹。

在 2017 年四季度，本基金发生了较大变化，从保本型基金转型为灵活配置型基金，在建仓期，我们采取了逐步建仓、积累安全垫、稳起步的策略，以类绝对收益的思路为持有人谋求较为稳定的收益。在后续安全垫达到一定程度后，再逐步放大股票仓位，积极为持有人创造超额回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后本报告期基金净值增长率-0.29%，波动率 0.21%；业绩比较基准收益率 0.57%，波动率 0.60%。

§5 投资组合报告

转型后:

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 | 149,089,652.15 | 20.95 |
| | 其中：股票 | 149,089,652.15 | 20.95 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 111,369,760.70 | 15.65 |
| | 其中：债券 | 111,369,760.70 | 15.65 |
| | 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 | 390,000,000.00 | 54.81 |
| | 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 | 41,534,330.48 | 5.84 |
| 8 | 其他资产 | 19,619,422.39 | 2.76 |
| 9 | 合计 | 711,613,165.72 | 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 | 5,066,840.00 | 0.72 |
| B | 采矿业 | 4,207,741.90 | 0.60 |
| C | 制造业 | 91,547,521.25 | 13.01 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,896,918.10 | 0.55 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 9,436,879.20 | 1.34 |
| 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 | 25,122,127.00 | 3.57 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 4,700,785.82 | 0.67 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 5,110,838.88 | 0.73 |
| 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 | 149,089,652.15 | 21.18 |

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

本基金本报告期末投资港股通股票。

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 | 000651 | 格力电器 | 421,000 | 18,397,700.00 | 2.61 |
| 2 | 600887 | 伊利股份 | 426,100 | 13,716,159.00 | 1.95 |
| 3 | 601336 | 新华保险 | 134,200 | 9,420,840.00 | 1.34 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 156,700 | 8,685,881.00 | 1.23 |
| 5 | 601818 | 光大银行 | 1,978,700 | 8,013,735.00 | 1.14 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 185,600 | 7,687,552.00 | 1.09 |
| 7 | 600487 | 亨通光电 | 189,235 | 7,648,878.70 | 1.09 |
| 8 | 600872 | 中炬高新 | 291,325 | 7,213,207.00 | 1.02 |
| 9 | 000858 | 五粮液 | 83,400 | 6,661,992.00 | 0.95 |
| 10 | 000888 | 峨眉山 A | 474,544 | 5,110,838.88 | 0.73 |

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 | 68,247,000.00 | 9.70 |
| | 其中：政策性金融债 | 68,247,000.00 | 9.70 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 43,122,760.70 | 6.13 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 111,369,760.70 | 15.82 |

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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 150216 | 15 国开 16 | 400,000 | 38,604,000.00 | 5.48 |
| 2 | 132006 | 16 皖新 EB | 224,960 | 21,956,096.00 | 3.12 |
| 3 | 150317 | 15 进出 17 | 200,000 | 19,730,000.00 | 2.80 |
| 4 | 132009 | 17 中油 EB | 194,310 | 18,912,192.30 | 2.69 |
| 5 | 150217 | 15 国开 17 | 100,000 | 9,913,000.00 | 1.41 |

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**

本报告期本基金未投资国债期货。

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 | 48,542.40 |
| 2 | 应收证券清算款 | 17,994,617.93 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,565,008.05 |
| 5 | 应收申购款 | 11,254.01 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 19,619,422.39 |

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 | 132006 | 16 皖新 EB | 21,956,096.00 | 3.12 |
| 2 | 110034 | 九州转债 | 1,327,023.40 | 0.19 |
| 3 | 127004 | 模塑转债 | 237,226.50 | 0.03 |
| 4 | 132004 | 15 国盛 EB | 913.90 | 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。

转型前:

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 | 49,093,569.58 | 2.62 |
| | 其中：股票 | 49,093,569.58 | 2.62 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 214,640,528.40 | 11.45 |
| | 其中：债券 | 214,640,528.40 | 11.45 |
| | 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 | 1,605,866,688.43 | 85.69 |
| 8 | 其他资产 | 4,382,747.28 | 0.23 |
| 9 | 合计 | 1,873,983,533.69 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 2,751,177.18 | 0.22 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,906,540.12 | 0.31 |
| E | 建筑业 | 25,547,005.00 | 2.02 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,424,681.40 | 1.06 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 319.80 | 0.00 |
| 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 | 3,463,846.08 | 0.27 |
| 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 | 49,093,569.58 | 3.89 |

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

本基金本报告期末投资港股通股票。

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 | 601668 | 中国建筑 | 2,609,500 | 25,547,005.00 | 2.02 |
| 2 | 600004 | 白云机场 | 628,690 | 8,763,938.60 | 0.69 |
| 3 | 000089 | 深圳机场 | 529,326 | 4,658,068.80 | 0.37 |
| 4 | 601139 | 深圳燃气 | 481,101 | 3,906,540.12 | 0.31 |
| 5 | 000888 | 峨眉山 A | 335,644 | 3,463,846.08 | 0.27 |
| 6 | 600761 | 安徽合力 | 263,600 | 2,659,724.00 | 0.21 |
| 7 | 603345 | 安井食品 | 3,227 | 91,453.18 | 0.01 |
| 8 | 601866 | 中远海发 | 700 | 2,674.00 | 0.00 |
| 9 | 300518 | 盛讯达 | 6 | 319.80 | 0.00 |

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 | 68,783,000.00 | 5.45 |
| | 其中：政策性金融债 | 68,783,000.00 | 5.45 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 100,658,000.00 | 7.98 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 45,199,528.40 | 3.58 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 214,640,528.40 | 17.01 |

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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|----|---------|--------------|
|----|------|------|----|---------|--------------|

| | | | | | |
|---|-----------|-----------------|---------|---------------|------|
| 1 | 041656031 | 16 碧水源 CP001 | 800,000 | 80,520,000.00 | 6.38 |
| 2 | 150216 | 15 国开 16 | 400,000 | 39,048,000.00 | 3.10 |
| 3 | 132006 | 16 皖新 EB | 224,960 | 22,918,924.80 | 1.82 |
| 4 | 041658069 | 16 康缘集 CP001 | 200,000 | 20,138,000.00 | 1.60 |
| 5 | 132009 | 17 中油 EB | 194,310 | 19,887,628.50 | 1.58 |

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 | 13,378.86 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,369,368.42 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,382,747.28 |

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 | 132006 | 16 皖新 EB | 22,918,924.80 | 1.82 |
| 2 | 110034 | 九州转债 | 1,460,320.60 | 0.12 |
| 3 | 132004 | 15 国盛 EB | 925.00 | 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（转型后）

单位：份

| | |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2017年11月4日）基金份额总额 | 1,216,532,419.72 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 880,666.38 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 536,678,306.72 |
| 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 | 680,734,779.38 |

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。

§6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,373,824,252.05 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 98,981.49 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,157,390,813.82 |
| 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 | 1,216,532,419.72 |

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（转型后）**基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）**

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（转型后）

本基金本报告期未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

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（转型前）

本基金本报告期未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信鑫利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
2018 年 1 月 22 日