

建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 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 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信睿盈灵活配置混合	
基金主代码	000994	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 2 月 3 日	
报告期末基金份额总额	153,299,606.46 份	
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置和主动的投资管理，在精选个股、个券的基础上适度集中投资，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、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权证投资策略四部分组成。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65% +中债综合指数收益率（全价）×35%	
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	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信睿盈灵活配置混合 A	建信睿盈灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	000994	000995
报告期末下属分级基金的份额总额	95,486,491.98 份	57,813,114.48 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(2019年7月1日 - 2019年9月30日)	报告期(2019年7月1日 - 2019年9月30日)
	建信睿盈灵活配置混合 A	建信睿盈灵活配置混合 C
1. 本期已实现收益	767,107.22	333,459.68
2. 本期利润	-4,527.20	-100,876.38
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0000	-0.0017
4. 期末基金资产净值	94,373,588.24	54,689,336.36
5. 期末基金份额净值	0.988	0.946

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

建信睿盈灵活配置混合 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	-0.10%	1.10%	0.04%	0.62%	-0.14%	0.48%

建信睿盈灵活配置混合 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	-0.21%	1.10%	0.04%	0.62%	-0.25%	0.48%

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

建信睿盈灵活配置混合A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



建信睿盈灵活配置混合C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：本报告期，本基金投资组合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		
许杰	本基金的基金经理	2015年2月3日	-	17年	许杰先生，权益投资部副总经理，硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员，2002年3

				月加入泰达宏利基金管理有 限公司，历任研究员、研究部 副总经理、基金经理等职， 2006 年 12 月 23 日至 2011 年 9 月 30 日任泰达宏利风险预 算混合基金基金经理；2010 年 2 月 8 日至 2011 年 9 月 30 日任泰达宏利首选企业股票 基金基金经理；2008 年 9 月 26 日至 2011 年 9 月 30 日任泰达 宏利集利债券基金基金经理。 2011 年 10 月加入我公司， 2012 年 3 月 21 日至 2017 年 1 月 24 日任建信恒稳价值混合 型证券投资基金的基金经理； 2012 年 8 月 14 日起任建信社 会责任混合型证券投资基金 的基金经理；2014 年 9 月 10 日起任建信潜力新蓝筹股票 型证券投资基金的基金经理； 2015 年 2 月 3 日起任建信睿 盈灵活配置混合型证券投资 基金的基金经理；2015 年 5 月 26 日起任建信新经济灵活 配置混合型证券投资基金的 基金经理；2017 年 3 月 22 日 起任建信中小盘先锋股票型 证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内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《建信睿盈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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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 1 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

报告期内全球经济下行压力继续加大，欧洲和日本的制造业 PMI 指数在荣枯线以下延续下行趋势，美国 9 月份的制造业 PMI 指数也连续两个月位于荣枯线下并创下了 10 年来的新低。全球经济进入周期性调整，美国发动的贸易战又加剧了世界经济的调整压力。在此背景下，全球央行开始了新一轮货币宽松。中国经济同样面临较大的下行压力，但表现出一定的韧性，9 月份制造业 PMI 指数出现了小幅回升。尽管出口和投资在低位徘徊，但消费者信心处于高位。

三季度 A 股市场走出了震荡的走势。从整个季度来看，电子、计算机、通信等新兴经济产业以及医药和食品饮料等防御行业涨幅排名靠前，房地产、建筑、钢铁等传统行业排名落后。

资产配置方面，本基金三季度提高了股票资产的配置比例。报告期内，本基金首先继续围绕高质量增长这条中国未来经济发展的主线，重点投资了先进制造、新材料、电子、计算机等创新类行业的龙头企业；其次，投资了消费行业的龙头公司。中国经济今年的亮点在于新经济的动能明显增强，5G 投资等新需求对经济的拉动明显，美国发动的贸易战反而倒逼国内企业自主创新步伐加快，上市公司层面也涌现出了一批创新驱动具有核心竞争力的公司。本基金将积极跟踪甄选此类优秀公司，通过投资这类成长公司提高投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率-0.10%，波动率 1.10%，本报告期本基金 C 净值增长率-0.21%，波动率 1.10%；业绩比较基准收益率 0.04%，波动率 0.62%。

§ 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	126,902,041.80	83.95
	其中：股票	126,902,041.80	83.95
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	20,587,113.55	13.62
8	其他资产	3,681,097.11	2.44
9	合计	151,170,252.46	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	641,550.00	0.43
B	采矿业	6,365,540.08	4.27
C	制造业	83,653,683.82	56.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,945,732.40	1.98
E	建筑业	5,336,365.48	3.58
F	批发和零售业	1,729,524.00	1.16
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	22,936,167.75	15.39
J	金融业	86,082.27	0.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	753,786.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	2,453,610.00	1.65
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	126,902,041.80	85.13

注：以上行业分类以 2019 年 9 月 30 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

无。

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	300316	晶盛机电	643,760	9,585,586.40	6.43
2	600519	贵州茅台	6,100	7,015,000.00	4.71
3	002624	完美世界	240,516	6,662,293.20	4.47
4	000858	五粮液	51,300	6,658,740.00	4.47
5	603063	禾望电气	588,800	5,340,416.00	3.58
6	002185	华天科技	912,000	4,970,400.00	3.33
7	300271	华宇软件	215,698	4,691,431.50	3.15
8	300655	晶瑞股份	212,400	4,422,168.00	2.97
9	600584	长电科技	256,000	4,405,760.00	2.96
10	000603	盛达矿业	298,800	4,123,440.00	2.77

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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未披露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	561,929.95
2	应收证券清算款	3,110,555.81
3	应收股利	-
4	应收利息	5,658.20
5	应收申购款	2,953.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,681,097.11

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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

项目	建信睿盈灵活配置混合 A	建信睿盈灵活配置混合 C
报告期期初基金份额总额	100,266,138.28	60,717,230.25
报告期期间基金总申购份额	528,131.44	1,032,699.99
减:报告期期间基金总赎回份额	5,307,777.74	3,936,815.76
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	95,486,491.98	57,813,114.48

注: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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,132,443.53
报告期期间买入/申购总份	-

额	
报告期期间卖出/赎回总份 额	
报告期期末管理人持有的本 基金份额	5,132,443.53
报告期期末持有的本基金份 额占基金总份额比例 (%)	3.35

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 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睿盈灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信睿盈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

2019 年 10 月 22 日