

建信福泽安泰混合型基金中基金(FOF) 2018年第2季度报告

2018年6月30日

建信稳定得利债券型证券投资基金 2018年第2季度报告

2018年6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:中信银行股份有限公司

重要提示 基金管理人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

Table with 3 columns: 基金简称, 基金代码, 交易代码

Table with 3 columns: 基金简称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 3 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)

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

Table with 5 columns: 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.本基金基金合同于2017年11月2日生效,截至报告期末未满一年。 2.本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

建信福泽安泰混合(FOF)基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 证券从业年限, 说明

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 公平对待持有人的专项说明

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

受国内信用债违约、全球贸易摩擦持续升级、人民币贬值预期升温等多重利空因素影响,二季度期间出现股债分化行情。

本基金在第二季度保持与基准相近的资产配置仓位(20%左右),在5月期间组合适当增加了权益类资产与市场联动。

经过多轮下跌,大量股票的估值已经处于历史底部区域,这通常意味着历史平均更高的收益水平和确定性,也提供了丰富的选股空间。

4.5 报告期内基金的投资业绩 本报告期基金净值增长率-0.97%,波动率0.29%,业绩比较基准收益率-0.75%,波动率

0.24%。 \$5 投资组合报告

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元)

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.2 基金资产构成 5.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

\$6 基金管理人报告 6.1 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基金投资明细

Table with 5 columns: 序号, 基金代码, 基金名称, 运作方式, 持有份额(份)

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

Table with 3 columns: 项目, 本期费用, 其中:交易及持有基金管理人以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

持有基金产生的费用是根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费、托管费进行估算,上述费用已在基金中基金所持有基金的净值中体现,不构成基金中基金的费用。

\$7 开放式基金份额变动 单位:份

Table with 3 columns: 报告期初基金份额总额, 报告期间基金份额总额, 报告期末基金份额总额

\$8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

\$9 基金文件目录 9.1 基金文件目录

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

重要提示 基金管理人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

Table with 3 columns: 基金简称, 基金代码, 交易代码

Table with 3 columns: 基金简称, 基金代码, 交易代码, 基金运作方式, 基金合同生效日

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 3 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)

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

Table with 5 columns: 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.本基金基金合同于2017年11月2日生效,截至报告期末未满一年。 2.本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

建信稳定得利债券(C)基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



5.10.1 基金资产构成 5.10.2 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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元)

5.10.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流受限情况的说明

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 3 columns: 主要财务指标, 报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)

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

Table with 5 columns: 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.本基金基金合同于2017年11月2日生效,截至报告期末未满一年。 2.本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

向降准,收益率重回下行态势,10年期国债收益率相比于一季度末4.65%的位置下行40BP到4.25%,而10年期国债收益率也下行26BP到3.45%。

5.1 投资组合报告 5.1.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

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

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

以上行业分类以2018年6月30日的证监会行业分类标准为准。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 基金资产构成 5.10.2 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

Table with 5 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.10.3 其他资产构成

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流受限情况的说明

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

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