

建信现代服务业股票型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告

2016 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 25 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 20 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信现代服务业股票
基金主代码	001781
交易代码	001781
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 2 月 23 日
报告期末基金份额总额	99,204,352.75 份
投资目标	本基金主要投资于同现代服务业相关的行业的上市公司股票，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值，力争创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势等因素对各个行业及上市公司的影响以及核心股票资产的估值水平，综合分析证券市场的走势，主动判断市场时机，通过稳健的资产配置，合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	85%×中证服务业指数收益率+15%×中债总财富（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	-1,209,829.52
2. 本期利润	2,427,031.70
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0199
4. 期末基金资产净值	101,647,439.20
5. 期末基金份额净值	1.025

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。

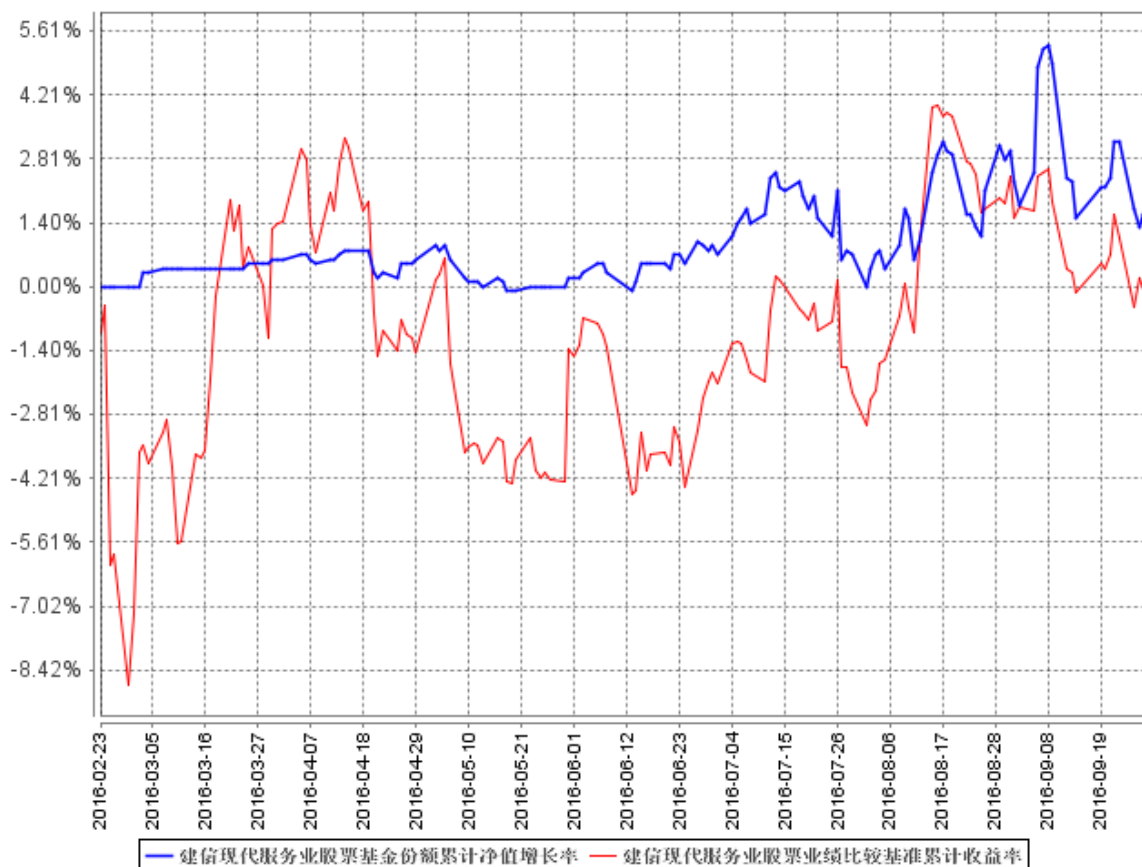
3.2 基金净值表现

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

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	1.59%	0.70%	2.30%	0.76%	-0.71%	-0.06%

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

建信现代服务业股票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：1. 本基金基金合同于 2016 年 2 月 23 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。

§ 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		
陶灿	本基金的基金经理	2016 年 2 月 23 日	-	9	硕士。2007 年 7 月加入本公司，从事行业研究，历任研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理。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基金经理；2014 年 5 月 14 日起任建信改革红利股票型证券

					投资基金基金经理，2016 年 2 月 23 日起任建信现代服务业股票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

本报告期内未出现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。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年三季度以来，市场整体呈现区间震荡的格局，从风格上看，以低估值、高股息为代表的大盘蓝筹获得正收益，而以高估值为代表的中小创录得负收益。

从基本面看，2016 年三季度宏观经济层面数据维持平稳，流动性方面受制于汇率压力，进一步宽松空间有限，同时在财政政策方面，通过政府投资、PPP 等各种形式实现一定程度扩张。企业盈利在产品价格恢复上涨的状态下，呈现一定程度复苏格局。

在 2016 年三季度，8 月 23 号本基金顺利度过建仓期，在不跌破面值的前提下完成建仓任务，正式常态运作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 1.59%，波动率 0.70%，业绩比较基准收益率 2.30%，波动率 0.76%。

§ 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	88,628,665.14	86.37
	其中：股票	88,628,665.14	86.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	13,903,056.02	13.55
8	其他资产	86,424.67	0.08
9	合计	102,618,145.83	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	2,181,726.00	2.15
B	采矿业	-	-
C	制造业	52,044,277.88	51.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,937,120.00	5.84
E	建筑业	7,083,599.48	6.97
F	批发和零售业	3,764,676.56	3.70
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	1,036,083.05	1.02
J	金融业	2,471,303.97	2.43
K	房地产业	3,614,048.00	3.56
L	租赁和商务服务业	4,902,408.00	4.82
M	科学研究和技术服务业	2,618,622.20	2.58

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	2,974,800.00	2.93
S	综合	-	-
	合计	88,628,665.14	87.19

注：以上行业分类以 2016 年 09 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沪港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	600900	长江电力	446,400	5,937,120.00	5.84
2	002127	南极电商	397,600	4,902,408.00	4.82
3	000925	众合科技	162,500	3,826,875.00	3.76
4	600963	岳阳林纸	463,249	3,705,992.00	3.65
5	300237	美晨科技	222,242	3,111,388.00	3.06
6	000711	京蓝科技	103,400	3,057,538.00	3.01
7	600715	文投控股	120,000	2,974,800.00	2.93
8	300398	飞凯材料	39,300	2,916,453.00	2.87
9	300356	光一科技	72,232	2,773,708.80	2.73
10	300207	欣旺达	179,400	2,771,730.00	2.73

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	79,621.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,993.36
5	应收申购款	809.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	86,424.67
---	----	-----------

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300398	飞凯材料	2,916,453.00	2.87	重大资产重组

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	140,878,448.84
报告期期间基金总申购份额	2,059,062.18
减：报告期期间基金总赎回份额	43,733,158.27
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	99,204,352.75

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

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现代服务业股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信现代服务业股票型证券投资基金基金合同》；

- 3、《建信现代服务业股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信现代服务业股票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
2016 年 10 月 25 日