

# 建信睿富纯债债券型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2017 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金简称       | 建信睿富纯债债券           |
| 基金主代码      | 003590             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2016 年 11 月 25 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         |
| 报告期末基金份额总额 | 9,697,284,916.23 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。  |
| 投资策略   | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，深入挖掘价值被低估的标的券种。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。   |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                        | 基金托管人               |
|---------|------|------------------------------|---------------------|
| 名称      |      | 建信基金管理有限责任公司                 | 兴业银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 吴曙明                          | 张志永                 |
|         | 联系电话 | 010-66228888                 | 021-52629999-212004 |
|         | 电子邮箱 | xinxipilu@ccbfund.cn         | zhangzhy@cib.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-81-95533<br>010-66228000 | 95561               |
| 传真      |      | 010-66228001                 | 021-62159217        |

## 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的住所  |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 183,460,378.77              |
| 本期利润          | 111,348,206.83              |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0120                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.17%                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日)            |

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0147           |
| 期末基金资产净值     | 9,839,744,453.46 |
| 期末基金份额净值     | 1.0147           |

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（不含公允价值变动收益）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收益。

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、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。

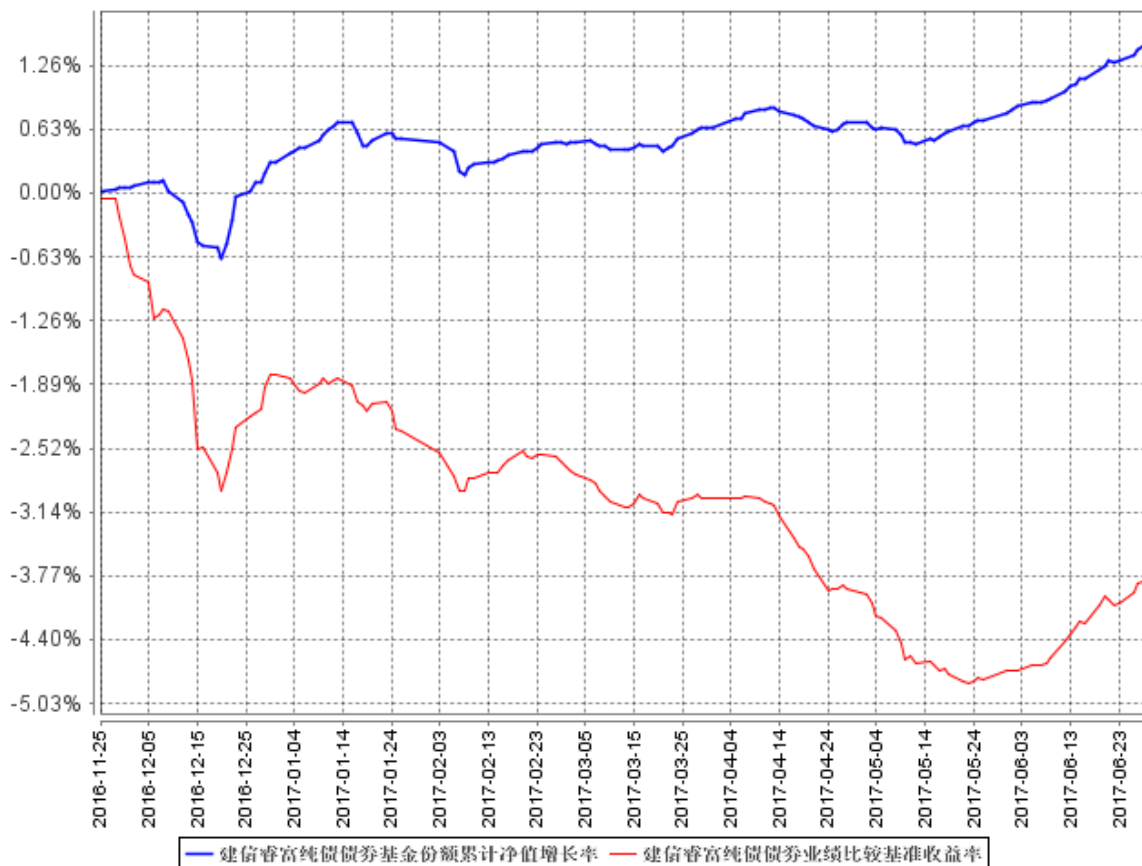
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去一个月          | 0.67%        | 0.03%               | 0.90%              | 0.06%                 | -0.23% | -0.03% |
| 过去三个月          | 0.81%        | 0.04%               | -0.88%             | 0.08%                 | 1.69%  | -0.04% |
| 过去六个月          | 1.17%        | 0.04%               | -2.11%             | 0.08%                 | 3.28%  | -0.04% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 1.47%        | 0.06%               | -3.86%             | 0.11%                 | 5.33%  | -0.05% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

建信睿富纯债债券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



本基金基金合同于 2016 年 11 月 25 日生效，截至报告期末未满一年。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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心，并在上海设立了子公司--建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票

型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信瑞盛添利混合型证券投资基金、建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒丰纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金，共计 87 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 3,439.09 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限  |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|----------|------------------|------|--------|--|
|    |          | 任职日期             | 离任日期 |        |  |
| 刘思 | 本基金的基金经理 | 2016 年 11 月 25 日 | -    | 8      | 刘思女士，硕士。2009 年 5 月加入建信基金管理公司，历任助理交易员、初级交易员、交易员、交易主管、基金经理助理，2016 年 7 月 19 日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月 8 日起任建信睿享纯债债券型证券投资基金基 |



|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>金经理，2016 年 11 月 22 日起任建信恒丰纯债债券型证券投资基金基金经理，2016 年 11 月 25 日起任建信睿富纯债债券型证券投资基金基金经理，2017 年 8 月 9 日起任建信中证政策性金融债 1-3 年指数(LOF)基金经理，2017 年 8 月 9 日起任建信中证政策性金融债 3-5 年指数(LOF)基金经理，2017 年 8 月 9 日起任建信中证政策性金融债 8-10 年指数(LOF)基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

## 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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年，全球经济继续复苏，整体延续良好势头，美欧日经济实现了同步向好。美国上半年就业增长稳定，居民收入和财富稳步增长，消费信心保持强劲，尤其劳工部 5 月发布的月度非农就业报告表明，4 月美国的失业率降至 4.4%，创 10 年来最低水平。欧洲经济也复苏渐强，从 GDP 数据看，除希腊外，欧盟成员国均已连续三个季度保持经济正增长。日本经济指标也表现良好，已实现连续 5 个季度增长，消费和出口均有所好转。新兴市场和发展中经济体的经济增长数据也很抢眼，中国、印度经济分别增长 6.9% 和 6.1%，增速在主要经济体中居于领先地位。另外，自今年 4 月份以来，俄罗斯、印度、巴西制造业 PMI 均已处于 50% 以上的扩张区间。

国内方面，上半年经济稳健增长，GDP 增速延续去年四季度以来的回升态势，一季度同比增长 6.9%，创一年半来新高。经济的回升主要源于房地产和基建投资的贡献，在政府淡化经济增长底线，供给侧改革持续推进的情况下，下游需求能否得到进一步提振还有待观察。通胀方面，蔬菜和猪肉价格分别在春节后和二季度出现超预期下跌，但非食品价格仍然保持 2.2% 以上的温和增长，由于三季度 CPI 基数较低，若食品价格降幅收窄而非食品价格温和上涨态势延续，预计未来通胀水平将会缓慢提升。汇率方面，上半年人民币汇率整体稳中有升，5 月份央行在中间价形成机制中引入逆周期因子来平抑市场单边预期，人民币汇率开始跟随中间价和离岸走势大幅升值至 6.80 附近。

从货币政策来看，上半年在去杠杆、防风险的大背景下，央行在政策取向上维持了“稳健偏紧”的基调。央行不仅强化了 MPA 考核的金融治理思路，还频繁采用价格手段引导市场预期，多次上调货币政策工具利率。其中 MLF、OMO 利率均累计上调 20BP，SLF 隔夜利率上调 35BP，7 天和 1 个月均上调 10BP，推动货币市场利率中枢水平在上半年出现明显抬升，流动性环境整体维持紧

平衡状态。

从债券收益来看，上半年在金融监管趋严叠加经济复苏预期升温的双重影响下，1 年国债攀升至 3.46% 附近，较去年底上行幅度达 80BP，10 年国债收益也一度冲高至 3.70% 附近，收益曲线整体平坦化抬升。

综上所述，本基金在 2017 年上半年保持了一贯稳健的投资风格，维持了中性的久期和较低的杠杆操作，业绩表现良好。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 1.17%，波动率 0.04%，业绩比较基准收益率-2.11%，波动率 0.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球经济增速预计将保持弱复苏的格局，同时主要央行资产负债表终将“瘦身”，可能会令全球资本市场承压。美国经济预计维持温和复苏，但政策的不确定性将是抑制经济增长的关键因素，并且预计美联储在 2017 年至少还将加息一次，同时还可能在今年开始缩减规模达 4.5 万亿美元的资产负债表，届时可能对全球流动性带来冲击。欧洲的政治风险并未完全消除，“黑天鹅”事件的发生概率仍较大。部分新兴经济体还有反弹的趋势，比如巴西有望实现正增长。

国内方面，虽然上半年经济短期稳定，6 月份工业、投资消费增速数据全面反弹，但是下半年经济存在下行压力。投资方面，预计基建投资资金来源受限，投资增速难以持续高增长；而在地产调控趋严的背景下，预计地产投资增速将趋于下降；制造业需求回升幅度有限，预计下半年整体投资增速将维持温和回升的局面。库存方面，PMI 原材料库存已升至 48.6% 的高位，工业产成品增速已升至 10% 的高位，意味着企业库存水平已升至高点，再回补空间有限。通胀方面，7 月份以来菜价涨，猪价降，油价等大宗价格下跌，但是下半年 CPI 基数较低，如果食品价格整体降幅较小且非食品价格能稳住，预计整体通胀水平将会比较平稳。汇率方面，目前外汇储备余额达到 3.06 万亿美元，已连续五个月回升，预计下半年人民币汇率依然会维持稳定。

货币政策方面，预计下半年货币政策仍维持稳健中性的基调，央行继续通过“削峰填谷”熨平临时性、季节性因素对流动性的扰动，维持流动性的紧平衡状态。在表外理财纳入 MPA 考核以及金融强监管的背景下，中性情形预计 2017 年年末 M2 同比增速将震荡下行至 9.7%，社会融资规模同比增速降至 11.4%。刚召开的金融工作会议也强调金融要服务于社会经济发展，要推动经济去杠杆，坚定执行稳健的货币政策，加强金融监管协调，主动防范化解金融风险。因此，下半年利率上行的概率较小，预计整体较为平稳甚至小幅下行，利率短期波动的幅度会比上半年小。

综上所述，本基金在 2017 年下半年仍将保持稳健的投资风格，以存款、存单和信用债为主，在保证组合流动性的同时力争保证组合能够跟随市场的发展变化，为投资人获得合理的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总裁、督察长、投资总经理、研究总经理、风险管理总经理、运营总经理及内控合规总经理组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、内控合规人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。

自 2015 年 3 月 26 日起，公司按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值价格，对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私

募债券除外)进行估值。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期，兴业银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信睿富纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            |            | 163,294,323.90                 | 224,672,295.51                   |
| 结算备付金           |            | -                              | -                                |
| 存出保证金           |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         |            | 9,497,609,000.00               | 7,872,884,000.00                 |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 9,497,609,000.00               | 7,872,884,000.00                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          |            | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        |            | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            |            | 182,373,049.71                 | 132,633,324.99                   |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            |            | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 9,843,276,373.61               | 8,230,189,620.50                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |

|               |  |                  |                  |
|---------------|--|------------------|------------------|
| <b>负 债：</b>   |  |                  |                  |
| 短期借款          |  | -                | -                |
| 交易性金融负债       |  | -                | -                |
| 衍生金融负债        |  | -                | -                |
| 卖出回购金融资产款     |  | -                | -                |
| 应付证券清算款       |  | -                | -                |
| 应付赎回款         |  | -                | -                |
| 应付管理人报酬       |  | 2,417,443.71     | 1,294,582.66     |
| 应付托管费         |  | 805,814.59       | 431,527.55       |
| 应付销售服务费       |  | -                | -                |
| 应付交易费用        |  | 5,100.00         | 25,826.50        |
| 应交税费          |  | -                | -                |
| 应付利息          |  | -                | -                |
| 应付利润          |  | -                | -                |
| 递延所得税负债       |  | -                | -                |
| 其他负债          |  | 303,561.85       | 40,437.16        |
| 负债合计          |  | 3,531,920.15     | 1,792,373.87     |
| <b>所有者权益：</b> |  |                  |                  |
| 实收基金          |  | 9,697,284,916.23 | 8,203,410,800.11 |
| 未分配利润         |  | 142,459,537.23   | 24,986,446.52    |
| 所有者权益合计       |  | 9,839,744,453.46 | 8,228,397,246.63 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 9,843,276,373.61 | 8,230,189,620.50 |

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0147 元，基金份额总额 9,697,284,916.23 份。

## 6.2 利润表

会计主体：建信睿富纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本 期 |
|-----|-----|-----|
|-----|-----|-----|

|                        |  | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|------------------------|--|---------------------------------|
| <b>一、收入</b>            |  | 130,149,798.79                  |
| 1.利息收入                 |  | 197,176,499.28                  |
| 其中：存款利息收入              |  | 4,232,616.86                    |
| 债券利息收入                 |  | 192,929,347.69                  |
| 资产支持证券利息收入             |  | -                               |
| 买入返售金融资产收入             |  | 14,534.73                       |
| 其他利息收入                 |  | -                               |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）       |  | 5,085,471.45                    |
| 其中：股票投资收益              |  | -                               |
| 基金投资收益                 |  | -                               |
| 债券投资收益                 |  | 5,085,471.45                    |
| 资产支持证券投资收益             |  | -                               |
| 贵金属投资收益                |  | -                               |
| 衍生工具收益                 |  | -                               |
| 股利收益                   |  | -                               |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）  |  | -72,112,171.94                  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）      |  | -                               |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）      |  | -                               |
| <b>减：二、费用</b>          |  | 18,801,591.96                   |
| 1. 管理人报酬               |  | 13,878,644.56                   |
| 2. 托管费                 |  | 4,626,214.92                    |
| 3. 销售服务费               |  | -                               |
| 4. 交易费用                |  | 8,087.50                        |
| 5. 利息支出                |  | -                               |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |  | -                               |
| 6. 其他费用                |  | 288,644.98                      |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b> |  | <b>111,348,206.83</b>           |



|                   |  |                |
|-------------------|--|----------------|
| 号填列)              |  |                |
| 减：所得税费用           |  | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 111,348,206.83 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信睿富纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期                              |                |                  |
|--|---------------------------------|----------------|------------------|
|  | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |                |                  |
|  | 实收基金                            | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 8,203,410,800.11                | 24,986,446.52  | 8,228,397,246.63 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 111,348,206.83 | 111,348,206.83   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 1,493,874,116.12                | 6,124,883.88   | 1,499,999,000.00 |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,493,874,116.12                | 6,124,883.88   | 1,499,999,000.00 |
| 2.基金赎回款                                | -                               | -              | -                |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                               | -              | -                |

|                 |                  |                |                  |
|-----------------|------------------|----------------|------------------|
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 9,697,284,916.23 | 142,459,537.23 | 9,839,744,453.46 |
|-----------------|------------------|----------------|------------------|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|              |              |             |
|--------------|--------------|-------------|
| _____<br>孙志晨 | _____<br>吴曙明 | _____<br>丁颖 |
| 基金管理人负责人     | 主管会计工作负责人    | 会计机构负责人     |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信睿富纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2342号《关于准予建信睿富纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信睿富纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 200,001,445.24 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1567 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信睿富纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,001,445.24 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信睿富纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、政府支持机构债券、资产支持证券、银行存款、国债期货、同业存单、债券回购等金融工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资股票、权证等权益类资产,也不投资可转换债券。本基金投资于债券类资产占基金资产的比例不低于 80%,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中债综合全价(总值)指数收益率。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信睿富纯债债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权

定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小

的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）   | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）     | 基金托管人、基金销售机构        |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金管理人的股东、基金销售机构     |
| 美国信安金融服务公司             | 基金管理人的股东            |
| 中国华电集团资本控股有限公司         | 基金管理人的股东            |
| 建信资本管理有限责任公司           | 基金管理人的子公司           |

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.8.1 关联方报酬

#### 6.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                              |
|-----------------|---------------------------------|
|                 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 13,878,644.56                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                               |

支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。



**6.4.8.1.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   |
|----------------|----------------------|
|                | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,626,214.92         |

支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

**6.4.8.1.3 销售服务费**

本基金无销售服务费。

**6.4.8.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

**6.4.8.3 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

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。

**6.4.8.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

| 关联方名称  | 本期末<br>2017年6月30日 |                                  | 上年度末<br>2016年12月31日 |                              |
|--------|-------------------|----------------------------------|---------------------|------------------------------|
|        | 持有的<br>基金份额       | 持有的基<br>金份额<br>占基金总<br>份额的比<br>例 | 持有的<br>基金份额         | 持有的基<br>金份额<br>占基金总份<br>额的比例 |
| 中国建设银行 | 9,697,282,470.99  | 99.99%                           | -                   | -                            |

**6.4.8.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方<br>名称 | 本期                              |            |
|-----------|---------------------------------|------------|
|           | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |            |
|           | 期末余额                            | 当期利息收入     |
| 兴业银行-活期存款 | 23,294,323.90                   | 550,714.88 |
| 兴业银行-定期存款 | 10,000,000.00                   | 177,750.00 |

本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按约定利率计息。

**6.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.8.6 其他关联交易事项的说明**

本报告期本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

**6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本报告期末，本基金银行间市场无债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

**6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易，故未存在作为抵押的债券。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层级的余额，属于第二层级的余额为 9,497,609,000 元，无属于第三层级的余额。于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

###### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运

营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -                |
|    | 其中：股票             | -                | -                |
| 2  | 固定收益投资            | 9,497,609,000.00 | 96.49            |
|    | 其中：债券             | 9,497,609,000.00 | 96.49            |
|    | 资产支持证券            | -                | -                |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -                |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -                |
| 5  | 买入返售金融资产          | -                | -                |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -                |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 163,294,323.90   | 1.66             |
| 7  | 其他各项资产            | 182,373,049.71   | 1.85             |
| 8  | 合计                | 9,843,276,373.61 | 100.00           |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 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。

### 7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未投资股票。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未投资股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未投资股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 2,252,857,000.00 | 22.90        |
|    | 其中：政策性金融债 | 570,285,000.00   | 5.80         |
| 4  | 企业债券      | 1,003,832,000.00 | 10.20        |
| 5  | 企业短期融资券   | 451,085,000.00   | 4.58         |
| 6  | 中期票据      | 4,375,485,000.00 | 44.47        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | 1,414,350,000.00 | 14.37        |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 9,497,609,000.00 | 96.52        |

**7.6 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**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称             | 数量（张）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 1282290   | 12 船重 MTN2       | 7,000,000 | 705,670,000.00 | 7.17         |
| 2  | 091501002 | 15 中国信达<br>债 02  | 7,000,000 | 694,330,000.00 | 7.06         |
| 3  | 1282205   | 12 中船 MTN1       | 6,000,000 | 608,280,000.00 | 6.18         |
| 4  | 111792417 | 17 宁波银行<br>CD042 | 6,000,000 | 587,040,000.00 | 5.97         |
| 5  | 120418    | 12 农发 18         | 5,000,000 | 500,250,000.00 | 5.08         |

**7.7 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。

**7.8 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 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。

**7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

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，宁波银行股份有限公司(002142)于2016年7月7日发布公告：宁波银行深圳分行原员工违规办理票据业务，共涉及3笔，金额合计人民币32亿元。目前该3笔票据业务已结清，银行没有损失，公安机关已立案侦查。

### 7.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额             |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | -              |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 182,373,049.71 |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 182,373,049.71 |



**7.11.4 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。

**7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.11.6 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。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构            |            |          |            |
|--------------|---------------|------------------|------------|----------|------------|
|              |               | 机构投资者            |            | 个人投资者    |            |
|              |               | 持有份额             | 占总份<br>额比例 | 持有份额     | 占总份<br>额比例 |
| 247          | 39,260,262.82 | 9,697,282,470.99 | 100.00%    | 2,445.24 | 0.00%      |

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

| 项目                   | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员<br>持有本基金 | 19.88     | 0.00%    |

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2016年11月25日）基金份额总额 | 200,001,445.24   |
| 本报告期期初基金份额总额               | 8,203,410,800.11 |
| 本报告期基金总申购份额                | 1,493,874,116.12 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | -                |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）   | -                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 9,697,284,916.23 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期末发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

（4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金与同一托管行托管的基金共用原有交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易        |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额          | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信证券 | -    | -            | 20,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                     |                  |                  |      | 报告期末持有基金情况       |       |
|---|----------------|-------------------------------------|------------------|------------------|------|------------------|-------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间            | 期初份额             | 申购份额             | 赎回份额 | 持有份额             | 份额占比  |
| 机构  | 1              | 2017 年 01 月 01 日 - 2017 年 06 月 30 日 | 8,203,408,354.87 | 1,493,874,116.12 | 0.00 | 9,697,282,470.99 | 99.99 |
| 产品特有风险  |                |                                     |                  |                  |      |                  |       |
| 本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。 |                |                                     |                  |                  |      |                  |       |

本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。

建信基金管理有限责任公司

2017 年 8 月 26 日