建信精工制造指数增强型证券投资基金

2018 第二季度 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
报告送出日期:2018年7月18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7月16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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信精工制造指数增强
基金主代码	001397
交易代码	001397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月26日
报告期末基金份额总额	104,677,643.79份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对中证精工制造指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略。以中证精工制造指数作为基金投资组合的标的指数,结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术,在指数化投资基础上优化调整投资组合,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过8%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	90%×中证精工制造指数收益率+10%×商业银行活期存款利率(税前)。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。
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

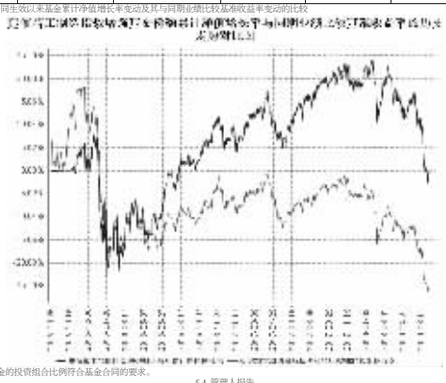
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 — 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-9,015,928.86
2.本期利润	-18,422,517.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1746
4.期末基金资产净值	104,795,116.74
5.期末基金份额净值	1.0011

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	-14.89%	1.14%	-15.75%	1.00%	0.86%	0.14%

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



本报告期本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§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		
叶乐天	金融工程及指数投资部副总经理,本基金的基金经理	2015年8月26日	-	10	叶乐天先生,金融工程及指数投资部副总经理,硕士,2008年5月至2011年9月就职于中国国际金融有限公司,历任市场风险管理分析员、量化分析经理,从事风险模型、量化研究与投资,2011年9月加入建信基金管理有限责任公司,历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理,2012年3月21日至2016年7月20日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2013年3月28日起任建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金的基金经理;2014年1月27日起任建信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理;2015年8月26日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理;2016年4月9日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理;2017年4月18日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理;2017年5月22日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年1月10日起任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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,本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《证券法》、《证券投资基金法》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
报告期间,本基金在股票组合的配置上以量化分析为基础,利用量化模型精选股票,并在此基础上积极参与新股申购。本基金在债券组合的配置上久期基本保持稳定,主要投向为国有股份制银行以及一类城商行的存款和一年期以内的国债、金融债。
4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期基金净值增长率-11.7%,波动率1.03%,业绩比较基准收益率-9.53%,波动率0.98%。

§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	86,162,974.67	80.82
	其中:股票	86,162,974.67	80.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,019,000.00	4.71
	其中:债券	5,019,000.00	4.71
	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	5,000,000.00	4.69
	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	8,691,820.16	8.15
8	其他资产	1,731,316.67	1.62
9	合计	106,605,111.50	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按指数投资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	11,985,013.64	11.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	9,178,196.88	8.76
F	批发和零售业	1,373,409.00	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	6,262,329.08	5.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,044,380.00	1.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	634,368.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	964,108.00	0.92
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	31,441,804.60	30.00

以上行业分类以2018年6月30日的证监会行业分类标准为依据。
5.2.2 报告期末按指数投资按行业分类的境外股票投资组合

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	764,085.00	0.73
B	采掘业	1,154,719.70	1.10
C	制造业	34,627,086.46	33.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	855,091.50	0.82
E	建筑业	999,658.00	0.95
F	批发和零售业	1,839,855.45	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	1,100,120.00	1.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,501,860.98	3.34
J	金融业	4,231,588.00	4.04
K	房地产业	3,159,769.74	3.02
L	租赁和商务服务业	188,322.60	0.18
M	科学研究和技术服务业	268,802.05	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	1,637,180.00	1.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	26,614.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	366,416.59	0.35
S	综合	-	-
	合计	54,721,170.07	52.22

以上行业分类以2018年6月30日的证监会行业分类标准为依据。
5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期未投资港股通股票。
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
5.3.1 报告期末指数投资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	601186	中国铁建	372,551	3,211,389.62	3.06
2	601668	中国建筑	255,640	1,395,794.40	1.33
3	000547	航天发展	165,900	1,295,679.00	1.24
4	600029	南方航空	149,900	1,266,655.00	1.21
5	600018	上港集团	180,300	1,074,588.00	1.03
6	600406	国电南瑞	66,100	1,044,380.00	1.00
7	002310	东方园林	67,500	1,014,525.00	0.97
8	601012	隆基股份	56,040	935,307.60	0.89
9	601766	中国中车	117,510	904,827.00	0.86
10	600153	建发股份	99,900	898,101.00	0.86

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600519	贵州茅台	2,000	1,462,920.00	1.40
2	000568	泸州老窖	23,900	1,454,554.00	1.39
3	600887	伊利股份	48,100	1,341,990.00	1.28
4	601318	中国平安	21,700	1,271,186.00	1.21
5	002245	澳洋顺昌	167,000	1,080,490.00	1.03

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	5,019,000.00	4.79
	其中:政策性金融债	5,019,000.00	4.79
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,019,000.00	4.79

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(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开1701	50,000	5,019,000.00	4.79

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1807	IC1807	7	7,263,200.00	-550,585.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-550,585.00
股指期货投资本期收益(元)					-712,112.78
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-435,847.22

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资股指期货根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约,本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,同时兼顾基差的变化,以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。
本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。
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	1,604,972.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	47,891.71
5	应收申购款	78,452.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,731,316.67

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
5.11.5.1 报告期末指数投资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	002310	东方园林	1,014,525.00	0.97	重大资产重组

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。
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

单位:份

报告期期初基金份额总额	105,827,613.35
报告期期间基金总申购份额	6,628,148.90
减:报告期期间基金总赎回份额	7,778,118.46
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	104,677,643.79

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

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	2018年04月01日-2018年06月30日	29,570,950.84	0.00	0.00	29,570,950.84	28.25%	
产品持有风险								
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。								

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1.中国证监会批准建信精工制造指数增强型证券投资基金设立的文件;
2.《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》;
3.《建信精工制造指数增强型证券投资基金招募说明书》;
4.《建信精工制造指数增强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。
9.2 存放地点
基金管理人或基金托管人处。
9.3 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7月18日

建信量化事件驱动股票型证券投资基金

2018 第二季度 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:中国国际金融股份有限公司
报告送出日期:2018年7月18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。
基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信量化事件驱动股票
基金主代码	004730
交易代码	004730
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月13日
报告期末基金份额总额	126,178,343.20份
投资目标	在严格控制风险的基础上,力争获取稳定、持续超越业绩比较基准的投资回报,实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在积极把握宏观经济变迁、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上,将影响行业和公司投资价值的事件性因素作为投资的主线,以事件驱动为核心的投资策略;并且采用多因子量化分析模型,综合技术、财务、情绪等多方面指标,深入分析事件性因素冲击的标的股票,精选受益于事件影响、具有超额收益的股票进行投资,优化调整投资组合,力争实现高于业绩基准的投资收益和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证800指数收益率×85%+商业银行活期存款利率×15%
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	中国国际金融股份有限公司

§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(2018年4月1日 — 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-5,611,303.99
2.本期利润	-14,931,286.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1151
4.期末基金资产净值	110,600,386.28
5.期末基金份额净值	0.8765

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	-11.70%	1.03%	-9.53%	0.98%	-2.17%	0.05%

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

1.本基金基金合同于2017年9月13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		
薛玲	本基金的基金经理	2017年9月13日	-	5	薛玲女士,金融工程及指数投资部总经理助理,博士,2009年5月至2009年12月在国家电网公司研究院农电配电研究所工作,任项目经理;2010年1月至2013年4月在路通世纪公司宜洲数据收集部工作,任高级软件工程师;2013年4月至2015年8月在中国中投证券公司工作,历任研究员、投资经理;2015年9月加入我公司金融工程及指数投资部,历任基金经理助理、基金经理,2018年5月起兼任部门总经理助理,2016年7月4日起任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2017年9月13日起任建信量化事件驱动股票型证券投资基金的基金经理;2017年9月28日起任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金(ETF)及其联接基金的基金经理;2017年12月20日起任建信鑫榕回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年12月22日起任建信上证50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2018年3月1日起任建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金的基金经理。

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,本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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信量化事件驱动股票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
报告期间,本基金在股票组合的配置上以量化分析为基础,利用量化模型精选股票,并在此基础上积极参与新股申购。本基金在债券组合的配置上久期基本保持稳定,主要投向为国有股份制银行以及一类城商行的存款和一年期以内的国债、金融债。
4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期基金净值增长率-11.7%,波动率1.03%,业绩比较基准收益率-9.53%,波动率0.98%。

§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	88,624,040.65	78.02
	其中:股票	88,624,040.65	78.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,026,600.00	6.19
	其中:债券	7,026,600.00	6.19
	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	7,000,000.00	6.16
	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	9,378,887.41	8.26
8	其他资产	1,563,645.61	1.38
9	合计	113,593,173.67	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	634,944.06	0.57
B	采矿业	3,692,162.40	3.34
C	制造业	39,251,183.51	35.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,344,056.00	2.12
E	建筑业	3,411,489.00	3.08
F	批发和零售业	1,105,549.20	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,884,577.50	3.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,647,263.62	4.20
J	金融业	22,563,244.87	20.40
K	房地产业	4,172,178.79	3.77
L	租赁和商务服务业	1,822,619.10	1.65
M	科学研究和技术服务业	238,622.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	154,975.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	233,232.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	467,943.60	0.42
S	综合	-	-
	合计	88,624,040.65	80.13

以上行业分类以2018年6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
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	601318	中国平安	62,500	3,661,250.00	3.31
2	000333	美的集团	50,700	2,647,554.00	2.39
3	601166	兴业银行	172,985	2,490,984.00	2.25
4	002415	海康威视	61,693	2,290,661.09	2.07
5	601288	农业银行	647,400	2,227,056.00	2.01
6	000858	五粮液	29,000	2,204,000.00	1.99
7	600016	民生银行	286,800	2,007,600.00	1.82
8	601988	中国银行	513,100	1,852,291.00	1.67
9	000001	平安银行	200,500	1,822,545.00	1.65
10	000651	格力电器	37,700	1,777,535.00	1.61

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	7,026,600.00	6.35
	其中:政策性金融债	7,026,600.00	6.35
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,026,600.00	6.35

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(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开1701	70,000	7,026,600.00	6.35

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1807	IC1807	5	5,188,000.00	-313,440.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-313,440.00
股指期货投资本期收益(元)					-488,480.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-196,800.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资股指期货根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,综合考虑基差成本、流动性等因素选择合适的股指期货合约。本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。
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	1,468,362.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	69,795.14
5	应收申购款	25,488.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,563,645.61

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
本基金本报告期末前十名股票中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

单位:份

报告期期初基金份额总额	132,921,584.74
报告期期间基金总申购份额	925,199.31
减:报告期期间基金总赎回份额	7,668,440.85
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	126,178,343.20

上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,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量化事件驱动股票型证券投资基金设立的文件;
2.《建信量化事件驱动股票型证券投资基金基金合同》;
3.《建信量化事件驱动股票型证券投资基金招募说明书》;
4.《建信量化事件驱动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
2018年7月18日

建信健康民生混合型证券投资基金

2018 第二季度 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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月18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。
基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月16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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信健康民生混合
基金主代码	000547
交易代码	000547
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月21日
报告期末基金份额总额	33,593,288.61份
投资目标	本基金主要投资于有利于提升居民健康水平和促进国计民生的行业及公司,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的股票投资包含健康和民生这两大主题,本基金将精选有利于提升居民健康水平和促进国计民生的公司进行投资。 在债券组合的构造和调整上,本基金综合运用久期管理、期限配置策略、类属配置管理、套利策略等组合管理手段进行日常管理,获取稳健增值的机会。
业绩比较基准	70%×沪深300指数收益率+30%×中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益