# 建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 第一季度 报告

2019年3月31日

**基金管理人：建信基金管理有限责任公司**
**基金托管人：交通银行股份有限公司**
**报告送出日期：2019年4月19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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月17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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 建信战略精选 | |
| 基金主代码 | 005596 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018年4月4日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 207,973,235.48份 | |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，精选战略性看好的股票，追求超越业绩比较基准的投资回报，力求基金资产的长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金采取"自上而下"和"自下而上"相结合的投资策略，灵活配置大类资产，动态控制组合风险，力求实现基金资产的持续稳定增值。<br>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。<br>具体由大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略和权证投资策略七部分组成。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×50%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×10%+中证综合全债(总值)指数收益率×40% | |
| 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，属于中高预期收益/风险特征的基金。本基金的基金资产如投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 建信战略精选A | 建信战略精选C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005596 | 005597 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 197,255,100.39份 | 10,718,134.89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1月1日 - 2019年3月31日) | 报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日) |
|---|---|---|
| | 建信战略精选A | 建信战略精选C |
| 1.本期已实现收益 | 11,183,829.68 | 587,208.16 |
| 2.本期利润 | 56,780,058.29 | 2,597,229.76 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2601 | 0.2543 |
| 4.期末基金资产净值 | 204,074,083.91 | 11,030,044.76 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0346 | 1.0291 |

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

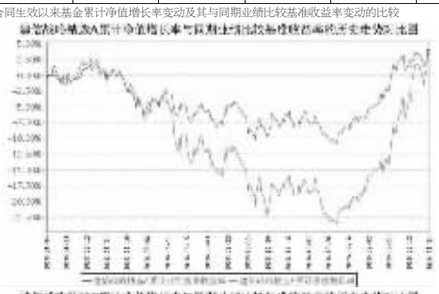
建信战略精选A

| 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 | 33.84% | 1.44% | 15.33% | 0.85% | 18.51% | 0.59% |

建信战略精选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 | 33.68% | 1.44% | 15.33% | 0.85% | 18.35% | 0.59% |

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



注:本基金基金合同于2018年4月4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 | | |
| 王东杰 | 本基金的基金经理 | 2018年4月4日 | - | 10年 | 王东杰先生,博士,权益投资部联席投资总监,2008年9月至2012年5月在高盛高华证券公司从事销售交易工作;2012年5月至今在兴业证券工作,历任初级研究员、研究员、研究主管、基金经理、权益投资部联席投资总监,2015年5月13日至2017年7月12日任建信回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年7月29日起任建信大安全战略精选股票型证券投资基金的基金经理;2016年6月3日至2017年6月9日任建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年8月28日起任建信核心精选混合型证券投资基金的基金经理;2017年12月26日起任建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年2月7日起任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年4月4日起任建信战略精选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,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《建信战略精选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

宏观层面,2019年1季度经济增长小幅回落,物价水平保持平稳。在去年年底中央经济工作会议上,政府突出了"稳增长"的重要性。年初以来,各项稳增长政策逐步落实,货币政策也处于偏宽松的环境中,市场对未来经济企稳的预期逐渐增强。

市场层面,1季度市场大幅上涨,上证综指上涨23.93%,创业板指上涨35.43%。在经历了2018年的大幅下跌后,去年年底市场估值处于历史低位。1季度,在偏宽松的货币环境和稳增长政策不断出台的背景下,各类指数都取得了显著的涨幅。行业方面,计算机、农林牧渔和电子元器件领涨。受到科创板即将成立的影响,以计算机和电子元器件为代表的TMT行业涨幅居前。猪价在经历了4年的完整周期后,即将在2019年开启新一轮的上涨周期,农林牧渔板块大幅上涨。另一方面,银行、餐饮旅游、电力及公用事业涨幅落后。这些行业贝塔属性较低,2018年下跌幅度较小,今年以来反弹幅度有限。

本基金在1季度始终保持中性仓位。我们认为,以合理价格买入优质公司并长期持有是持续获得超额回报的有效途径。本基金会重点布局符合国家战略发展方向的、竞争优势明显、管理层优秀、估值相对合理的优质成长股和价值成长股,力求赢得长期稳定的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信战略精选A净值增长率33.84%,波动率1.44%,建信战略精选C净值增长率33.68%,波动率1.44%;业绩比较基准收益率15.33%,波动率0.85%。

§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 | 181,880,629.87 | 82.33 |
| | 其中:股票 | 181,880,629.87 | 82.33 |
| 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 | 38,839,930.56 | 17.58 |
| 8 | 其他资产 | 203,529.56 | 0.09 |
| 9 | 合计 | 220,924,089.99 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 86,383,078.13 | 40.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | 14,423,630.74 | 6.71 |
| J | 金融业 | 18,744,322.00 | 8.71 |
| K | 房地产业 | 62,329,591.00 | 28.98 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | 181,880,629.87 | 84.55 |

注:以上行业分类以2019年3月31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 | 000961 | 中南建设 | 1,615,946 | 15,351,487.00 | 7.14 |
| 2 | 600048 | 保利地产 | 1,062,800 | 15,134,272.00 | 7.04 |
| 3 | 601155 | 新城控股 | 329,700 | 14,885,955.00 | 6.92 |
| 4 | 000661 | 长春高新 | 29,500 | 9,351,205.00 | 4.35 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 98,300 | 9,338,500.00 | 4.34 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 244,700 | 8,300,224.00 | 3.86 |
| 7 | 002312 | 金凤科技 | 511,466 | 7,441,830.30 | 3.46 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 147,800 | 6,977,638.00 | 3.24 |
| 9 | 603027 | 千禾味业 | 275,400 | 6,636,418.00 | 3.09 |
| 10 | 600325 | 华发股份 | 707,000 | 6,560,960.00 | 3.05 |

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 | 89,143.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,241.48 |
| 5 | 应收申购款 | 107,144.12 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | 0.96 |
| 9 | 合计 | 203,529.56 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002312 | 金凤科技 | 1,188,196.65 | 0.55 | 配股未上市 |

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 | 225,977,195.99 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,413,354.50 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 32,135,449.90 |
| 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 | 197,255,100.59 |

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

无。

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战略精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;
2、《建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信战略精选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4月19日

# 建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金

## 2019 第一季度 报告

2019年3月31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：2019年4月19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2019年4月17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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 建信智享添鑫定期开放混合 | |
| 基金主代码 | 004798 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年3月8日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 86,926,127.71份 | |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险并保持资产流动性的前提下,充分利用较低风险的量化投资策略,力争为投资者提供持续、稳定的回报。 | |
| 投资策略 | 封闭期内,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;然后,进行各大类资产中的个股、个券精选。<br>具体由大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略五个部分组成。<br>开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。 | |
| 业绩比较基准 | 20%×中证500指数收益率+80%×中证全债指数收益率 | |
| 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 | 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(2019年1月1日 - 2019年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 2,434,154.82 |
| 2.本期利润 | 2,909,587.16 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0162 |
| 4.期末基金资产净值 | 57,028,216.78 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0038 |

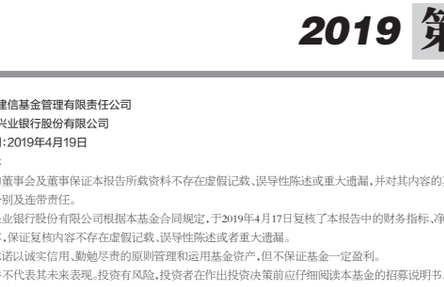
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 1.50% | 0.06% | 7.25% | 0.34% | -5.75% | -0.28% |

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




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 | | |
| 薛玲 | 本基金的基金经理 | 2018年3月31日 | - | 5年 | 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/电网研究所工作,任项目经理;2010年1月至2013年4月在路透中国有限公司量化指数部/数据部工作,任高级软件工程师;2013年4月至2015年6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5月27日至2018年4月25日任建信鑫泰回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;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日起任建信鑫稳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5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;2018年10月25日起任建信上证50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;2018年12月13日起任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数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,本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,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《建信智享添鑫定期开放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

报告期间,本基金根据期权模型调整权益仓位,权益仓位主要投向中证500期货,以跟踪中证500指数。在开放期,未配置股票仓位。本基金在债券组合的配置上主要投向为国有股份制银行以及一类城商行的存款和三年期以内的国债、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1.50%,波动率0.06%,业绩比较基准收益率7.25%,波动率0.34%。

§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 | 848,232.49 | 1.47 |
| | 其中:股票 | 848,232.49 | 1.47 |
| 2 | 基金投资 | - | 0.00 |
| 3 | 固定收益投资 | 10,313,996.21 | 17.87 |
| | 其中:债券 | 10,313,996.21 | 17.87 |
| | 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 | 2,500,000.00 | 4.33 |
| | 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 | 41,753,863.18 | 72.35 |
| 8 | 其他资产 | 2,291,920.71 | 3.97 |
| 9 | 合计 | 57,708,012.59 | 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 | - | 0.00 |
| B | 采矿业 | 88,245.00 | 0.15 |
| C | 制造业 | 483,933.49 | 0.85 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | 0.00 |
| E | 建筑业 | - | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | - | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 16,490.00 | 0.03 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | 0.00 |
| J | 金融业 | 230,689.00 | 0.40 |
| K | 房地产业 | 28,873.00 | 0.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | 0.00 |
| P | 教育 | - | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | 0.00 |
| S | 综合 | - | 0.00 |
| | 合计 | 848,232.49 | 1.49 |

注:以上行业分类以2019年3月31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 | 601318 | 中国平安 | 1,200 | 92,520.00 | 0.16 |
| 2 | 601088 | 中国神华 | 4,300 | 88,245.00 | 0.15 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 2,600 | 88,192.00 | 0.15 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 100 | 85,399.00 | 0.15 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 1,700 | 82,841.00 | 0.15 |
| 6 | 601004 | 北汽集团 | 3,107 | 80,999.49 | 0.14 |
| 7 | 600585 | 海螺水泥 | 1,300 | 49,634.00 | 0.09 |
| 8 | 002142 | 宁波银行 | 1,800 | 38,232.00 | 0.07 |
| 9 | 000858 | 五粮液 | 400 | 38,000.00 | 0.07 |
| 10 | 600383 | 金地集团 | 2,100 | 28,875.00 | 0.05 |

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 | - | 0.00 |
| 2 | 央行票据 | - | 0.00 |
| 3 | 金融债券 | 10,113,000.00 | 17.73 |
| | 其中:政策性金融债 | 10,113,000.00 | 17.73 |
| 4 | 企业债券 | - | 0.00 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | 0.00 |
| 6 | 中期票据 | - | 0.00 |
| 7 | 可转债(可交换债) | 200,996.21 | 0.35 |
| 8 | 同业存单 | - | 0.00 |
| 9 | 其他 | - | 0.00 |
| 10 | 合计 | 10,313,996.21 | 18.09 |

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 | 108604 | 国开1805 | 100,000 | 10,113,000.00 | 17.73 |
| 2 | 127012 | 招路转债 | 630 | 62,999.31 | 0.11 |
| 3 | 110053 | 苏银转债 | 510 | 50,998.88 | 0.09 |
| 4 | 128059 | 视源转债 | 360 | 35,999.37 | 0.06 |
| 5 | 123023 | 迪森转债 | 190 | 18,999.50 | 0.03 |

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

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| IC1904 | IC1904 | 1 | 1,106,280.00 | 21,360.00 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | 21,360.00 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | 1,508,177.86 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | 444,280.00 |

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

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 | 120,803.13 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,994.55 |
| 5 | 应收申购款 | 18,939.06 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 144,736.74 |

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 211,731,371.54 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 46,536.69 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 154,851,780.52 |
| 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 | 56,926,127.71 |

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

无。

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智享添鑫定期开放混合型证券投资基金设立的文件;
2、《建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金基金合同》;
3、《建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信智享添鑫定期开放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4月19日

# 建信中国制造2025股票型证券投资基金

## 2019 第一季度 报告

2019年3月31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：2019年4月19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2019年4月17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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 建信中国制造2025股票型 |
| 基金主代码 | 001825 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年3月8日 |
| 报告期末基金份额总额 | 133,568,962.84份 |
| 投资目标 | 在中国经济增长、结构转型的大背景下,挖掘国内制造业产业升级过程中的投资机会,力争获取超越业绩比较基准的收益,实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法,对符合中国制造2025战略方向的领域进行深入研究,挖掘该领域内上市公司的投资价值,力争获得实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为:80%×沪深300指数收益率+20%×中证综合债券指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于高收益/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 | 中国光大银行股份有限公司 |

§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(2019年1月1日 - 2019年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 10,917,074.90 |
| 2.本期利润 | 26,839,972.50 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1944 |
| 4.期末基金资产净值 | 125,474,965.84 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9394 |

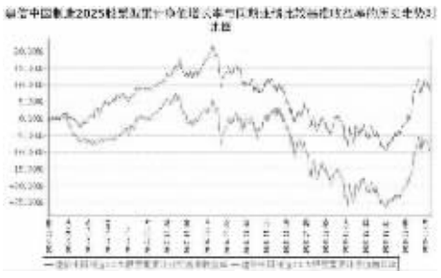
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 25.86% | 1.58% | 22.78% | 1.24% | 3.08% | 0.34% |

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




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 | | |
| 孙晨 | 本基金的基金经理 | 2017年3月8日 | - | 7年 | 孙晨先生,硕士,2011年7月至2013年6月就职于华夏基金管理公司,任研究员;2013年6月加入我公司,历任研究员、研究主管、基金经理等职务;2016年3月30日至2018年6月12日任建信健康民生混合型证券投资基金的基金经理;2017年3月8日起任建信中国制造2025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,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《建信中国制造2025股票型基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明