建信多因子量化股票型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019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:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2019年7月17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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信多因子量化股票
基金主代码	002952
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月9日
报告期末基金份额总额	36,784,791.49 份
投资目标	在有效控制风险的基础上,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	本基金采用多因子量化型投资策略,综合技术、财务、情绪等多方面指标,精选股票进行投资,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	本基金业绩比较基准为:85%×中证800指数收益率+15%×商业银行活期存款利率(税前)。
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	中国民生银行股份有限公司

§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4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	2,228,663.43
2.本期利润	-280,916.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0076
4.期末基金资产净值	34,721,053.94
5.期末基金份额净值	0.9439

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。

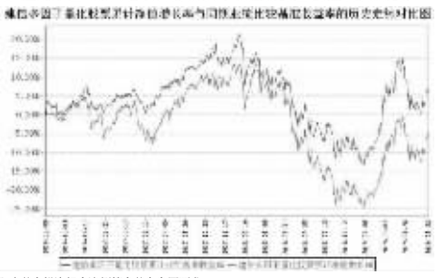
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.85%	1.39%	-2.96%	1.33%	2.11%	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



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		
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	2016年8月9日	-	11年	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8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;2018年8月24日起任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年11月22日起任建信中证1000指数增强型发起式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。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《建信多因子量化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》、《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

在报告期内,基金管理人以量化分析研究为基础,利用量化模型优选个股和风险管理,坚持量化策略,尽量控制回撤。在报告期内,考虑到权益市场整体仍存在一定风险,本基金持股较为分散,偏向于大盘股,在二季度市场整体上涨的背景下,基金净值也有一定程度上涨。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率-0.85%,波动率1.39%,业绩比较基准收益率-2.96%,波动率1.33%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,自2019年4月1日至2019年6月30日,本基金基金资产净值低于五千万元超过连续20个工作日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》(2014年8月8日生效)第四十一条的要求,现将该情况在本次报告中予以披露。

§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	28,971,731.27	82.26
	其中:股票	28,971,731.27	82.26
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	6,193,112.44	17.58
8	其他资产	56,053.32	0.16
9	合计	35,220,897.03	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	736,168.00	2.12
B	采矿业	461,027.65	1.33
C	制造业	16,254,744.18	46.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	913,018.00	2.63
E	建筑业	170,682.60	0.49
F	批发和零售业	688,733.40	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	1,111,919.10	3.20
H	住宿和餐饮业	127,224.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,414,753.94	4.07
J	金融业	3,175,326.30	9.15
K	房地产业	616,463.20	1.78
L	租赁和商务服务业	1,019,883.00	2.94
M	科学研究和技术服务业	95,655.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	148,801.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,213,866.90	3.50
R	文化、体育和娱乐业	664,895.00	1.91
S	综合	158,570.00	0.46
	合计	28,971,731.27	83.44

注:以上行业分类以2019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

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	000661	长春高新	3,700	1,250,600.00	3.60
2	601318	中国平安	10,100	894,961.00	2.58
3	601888	中国国旅	9,600	851,040.00	2.45
4	600030	中信证券	35,500	845,255.00	2.43
5	600887	伊利股份	23,700	791,817.00	2.28
6	600519	贵州茅台	800	787,200.00	2.27
7	600276	恒瑞医药	9,000	594,000.00	1.71
8	600763	通策医疗	6,600	584,694.00	1.68
9	601158	重庆水务	94,300	528,080.00	1.52
10	300498	温氏股份	13,800	494,868.00	1.43

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被监管部门立案调查,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	14,607.55
2	应收证券清算款	21,548.10
3	应收股利	-
4	应收利息	17,987.52
5	应收申购款	1,910.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,053.32

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	37,502,611.11
报告期期间基金总申购份额	425,577.37
减:报告期期间基金总赎回份额	1,143,396.99
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	36,784,791.49

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多因子量化股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信多因子量化股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信多因子量化股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信多因子量化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

2019年7月17日

建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2019 第二季度 报告

2019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:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2019年7月17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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信丰裕多策略灵活配置混合(LOF)
场内简称	建信丰裕
基金主代码	165317
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2018年2月28日
报告期末基金份额总额	197,116,746.71 份
投资目标	本基金主要在对公司股票投资价值的长期跟踪和深入分析的基础上,利用多策略挖掘和把握国内经济结构调整和升级的大背景下的投资机会,力争基金资产的长期稳定增值。
投资方式	上市契约型开放式(LOF)
投资策略	本基金将按照风险收益配比原则,实行动态的资产配置。 本基金将综合考量宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及国家财政、税收、货币、汇率各项政策,来动态调整大类资产的配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率(全价)×50%。
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	中国银行股份有限公司

§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4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	21,477,665.86
2.本期利润	-3,478,456.98
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0165
4.期末基金资产净值	208,555,674.68
5.期末基金份额净值	1.0580

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	-2.08%	1.46%	-0.54%	0.75%	-1.54%	0.71%

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		
吴尚伟	权益投资部联席投资总监,本基金的基金经理	2018年2月28日	-	13年	吴尚伟先生,硕士,权益投资部联席投资总监,2004年9月至2007年4月任长城伟业期货经纪有限公司深圳分公司投资顾问;2008年8月至2011年7月任银华基金管理公司研究员;2011年7月加入我公司,历任研究员、研究主管、研究部总监助理、权益投资部基金经理兼研究部总经理助理、权益投资部基金经理、权益投资部联席投资官,2014年11月25日起任建信内生动力混合型证券投资基金的基金经理;2016年9月29日至2018年2月27日担任建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;自2018年2月28日起离任本基金;具有基金从业资格。中国国籍。

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。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《建信丰裕多策略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。本报告期内,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

宏观经济方面,在内外需共振向下、需求压力逐渐兑现和传导的影响下,2019年二季度宏观经济增速下滑趋势仍在持续。2019年4-6月制造业PMI指数分别为50.1%,49.4%和49.4%,生产层面的微观预期下滑趋势开始收敛,预期低位的情况应该在今年三季度前后开始明显改善。

从需求端来看,固定资产投资增速有所下滑,1-5月累计增速5.6%,较一季度累计增速下滑了0.7个百分点,制造业投资、房地产投资和基建投资增速都有下滑表现。受假期周末错位因素、低基数支撑以及汽车类商品和通讯器材零售增速的明显改善,二季度消费增速虽在回落但有较强的韧性表现。社会消费品零售总额1-5月末累计增速8.6%,对比一季度仅下滑0.1个百分点。

5月初中美贸易谈判情况的短期恶化,使抢出口重新成为企业端的主要出口动力。1-5月中国进口累计同比-3.7%,相对于一季度跌幅收窄1个百分点,出口累计同比0.4%,较一季度增速下滑0.9个百分点。

从生产端上看,5月末全国规模以上工业增加值累计同比实际增长6.0%,增速相比于一季度抬升0.7个百分点,其中通用设备制造业、计算机通信制造业同比增速较快。

通胀方面,2019年二季度居民消费价格、工业品价格同比增速均出现回升。资金面和货币政策层面,二季度资金面整体维持合理充裕水平,并于5月15日开始,对聚焦当地、服务县域的中小银行,实行较低的优惠存款准备金率,为宏观经济运行和中小银行提供更为宽裕的资金环境。二季度人民币对美元汇率先升后贬,并在6月末对美元中间价收于6.8683,较3月末贬值2.2%。

总体看,受到投资端压力、中美贸易战反复以及全球经济增速的放缓,2019年二季度宏观经济传递需求层面的压力仍在逐渐兑现,也是对之前高经济预期的持续向下修复。但目前积极因素正在逐渐增加,中美贸易谈判重回缓和区间、稳增长政策效果逐渐出现、宏观经济仍有韧性,对经济增长企稳应该给予更多的时间和耐心。

2019年二季度,国内权益市场出现明显的下跌,其中上证综指下跌3.62%,沪深300下跌1.21%,中证500下跌10.76%,中小板指下跌10.31%,创业板指下跌10.75%。行业层面,消费和TMT领涨,周期稍跑输市场。

本基金长期聚焦在具有持续内生增长的行业与公司,个股选择上综合考虑了潜在收益空间、未来景气度的变化、以及该公司的估值水平与增长速度的匹配情况。回顾二季度,本基金仓位基本稳定,结构较为均衡,重点配置了食品饮料、金融、医药、家电、轻工制造等行业。我们看好品牌消费品通过渠道下沉和产品创新带来的收入利润持续增长,基于对宏观经济的展望,我们增加了必须消费品的配置比例。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率-2.08%,波动率1.46%,业绩比较基准收益率-0.54%,波动率0.75%。

§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	166,571,062.41	73.42
	其中:股票	166,571,062.41	73.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	155,265.00	0.07
	其中:债券	155,265.00	0.07
	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	59,948,172.81	26.42
8	其他资产	204,342.49	0.09
9	合计	226,878,842.71	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	133,210.20	0.06
C	制造业	118,413,928.35	56.78
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	3,741,000.00	1.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,490,253.92	2.15
J	金融业	32,054,669.94	15.37
K	房地产业	3,572,800.00	1.71
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	4,165,200.00	2.00
S	综合	-	-
	合计	166,571,062.41	79.87

注:以上行业分类以2019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

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	000651	格力电器	370,000	20,350,000.00	9.76
2	600519	贵州茅台	18,000	17,712,000.00	8.49
3	601318	中国平安	180,000	15,949,800.00	7.65
4	000858	五 粮 液	120,000	14,154,000.00	6.79
5	000661	长春高新	31,500	10,647,000.00	5.11
6	603886	元祖股份	400,000	10,596,000.00	5.08
7	603517	绝味食品	250,074	9,730,379.34	4.67
8	601688	华泰证券	400,000	8,928,000.00	4.28
9	603711	香飘飘	250,000	8,492,500.00	4.07
10	600030	中信证券	300,000	7,143,000.00	3.42

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	155,265.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	155,265.00	0.07

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	123025	精测转债	1,375	155,265.00	0.07

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	176,647.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,852.86
5	应收申购款	12,842.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	204,342.49

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	261,198,999.06
报告期期间基金总申购份额	1,522,410.06
减:报告期期间基金总赎回份额	65,604,662.41
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	197,116,746.71

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 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

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	2019年04月01日-2019年06月30日	60,004,400.00	-	8,004,400.00	52,000,000.00	26.38
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丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)设立的文件;

2、《建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;

3、《建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》;

4、《建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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

2019年7月17日

建信福泽安泰混合型基金中基金(FOF)

2019 第二季度 报告

2019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:2019年7月17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2019年7月15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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信福泽安泰混合(FOF)
基金主代码	005217
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年11月2日
报告期末基金份额总额	552,704,784.39 份
投资目标	本基金以多元资产配置为核心驱动力,通过优化配置各类资产实现投资组合的风险分散和长期稳健增长,同时本基金通过精选各类基金并构造分散的基金组合,力求实现投资组合的稳健超额收益和风险再分散。
投资策略	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,进行各大类资产中的基金筛选。 具体由大类资产配置策略、基金筛选策略、股票/债券投资策略、资产支持证券投资策略四部分组成。
业绩比较基准	20%×中证800指数收益率+80%×中债综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金,高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。同时,本基金为目标风险系列基金中基金中风险收益特征相对稳健的基金。
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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	4,049,230.26
2.本期利润	-5,643,514.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0094
4.期末基金资产净值	567,457,624.69
5.期末基金份额净值	1.0267

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。

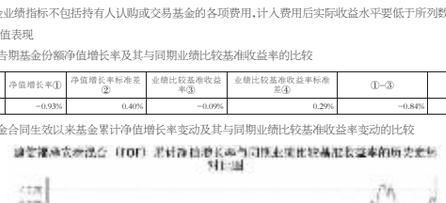
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.93%	0.40%	-0.09%	0.29%	-0.84%	0.11%

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		
王锐	本基金的基金经理	2017年11月2日	-	8年	王锐先生,学士,2009年加入美国CLS投资公司,从事资产配置、组合管理、风险管理研究,2015年加入我公司,担任衍生品与量化投资部研究员、投资经理,2017年11月2日起任建信福泽安泰混合型基金中基金(FOF)的基金经理;2019年6月5日起任建信福泽睿泰混合型基金中基金(FOF)的基金经理。
姜华	本基金的基金经理	2019年1月10日	-	10年	姜华先生,硕士,曾任中国农业银行大连中山支行担任信贷部经理;2004年4月至2008年3月在新华人寿保险股份有限公司精算部担任资产负债管理高级专员;2008年5月至2008年7月在安永(中国)企业咨询有限公司北京分公司担任高级精算咨询顾问;2008年8月至2017年2月在新华资产管理股份有限公司担任投资经理、量化投资负责人;2017年2月至2018年12月在建信基金管理公司资产配置及量化投资部担任投资经理;2019年1月10日起担任建信福泽安泰混合型基金中基金(FOF)的基金经理。
梁展	资产配置及量化投资部总经理,本基金的基金经理	2017年11月2日	-	14年	梁展先生,硕士,2005年6月至2007年6月在鹏华基金管理有限公司金融工程部任研究员;2007年7月加入我公司,历任创新发展部产品开发专员、产品开发主管、创新发展部副总监、创新发展部执行总监、量化衍生品条线执行总经理、资产配置及量化投资部总经理,2017年11月2日起任建信福泽安泰混合