建信精工制造指数增强型证券投资基金

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	建信精工制造指数增强
基金主代码	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	82,427,222.91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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	5,641,421.93
2.本期利润	-1,698,139.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0196
4.期末基金资产净值	83,978,575.30
5.期末基金份额净值	1.0188

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。

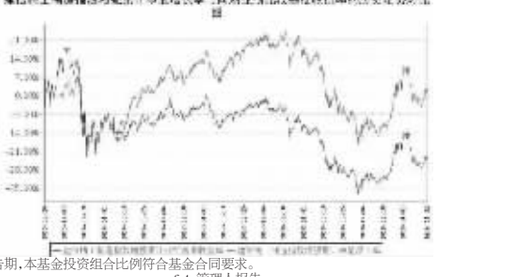
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-3.36%	1.47%	-6.50%	1.53%	3.14%	-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	2015年8月26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26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;2015年3月26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;2014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8月22日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年1月16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,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》、《证券投资基金公司内部控制指导意见》、《建信精工制造指数增强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

本基金为指数增强型基金,管理人以量化分析研究为基础,利用量化模型进行指数增强和风险管理。在报告期内,本基金严格保持与标的指数相近的行业分布和风格特征,在个股选择上做了一定的主动暴露,在二季度市场波动较大的情况下,本基金通过量化选股仍获取一定超额收益。

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-3.36%,波动率1.47%,业绩比较基准收益率-6.50%,波动率1.53%。

§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	78,055,038.04	86.55
	其中:股票	78,055,038.04	86.55
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	8,246,146.05	9.14
8	其他资产	3,887,632.83	4.31
9	合计	90,188,816.92	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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	24,155,454.63	28.76
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	9,904,292.70	11.79
F	批发和零售业	1,083,560.36	1.29
G	交通运输,仓储和邮政业	9,121,453.82	10.86
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输,软件和信息技术服务业	518,192.00	0.62
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	222,552.00	0.27
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	84,940.00	0.10
	合计	45,090,445.51	53.69

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 报告期末积极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	-	0.00
B	采矿业	2,092,171.10	2.49
C	制造业	13,574,672.33	18.53
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	2,291,488.00	2.73
E	建筑业	972,743.00	1.16
F	批发和零售业	2,135,828.80	2.54
G	交通运输,仓储和邮政业	2,347,580.00	2.80
H	住宿和餐饮业	404,103.00	0.48
I	信息传输,软件和信息技术服务业	969,221.76	1.15
J	金融业	2,324,039.94	2.77
K	房地产业	1,105,163.00	1.32
L	租赁和商务服务业	487,575.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	74,700.00	0.09
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	253,820.00	0.30
R	文化,体育和娱乐业	1,423,758.60	1.70
S	综合	507,728.00	0.60
	合计	32,964,592.53	39.25

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。

5.2.3 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

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	601668	中国建筑	571,340	3,205,203.00	3.91
2	600031	三一重工	166,600	2,179,128.00	2.59
3	600009	上海机场	24,869	2,083,524.82	2.48
4	601766	中国中车	247,510	2,002,353.90	2.38
5	000063	中兴通讯	56,600	1,841,198.00	2.19
6	601012	隆基股份	75,642	1,748,086.62	2.08
7	601669	中国电建	280,400	1,483,316.00	1.77
8	600170	上海建工	392,100	1,474,296.00	1.76
9	601989	中国重工	264,500	1,470,620.00	1.75
10	000338	潍柴动力	97,300	1,195,817.00	1.42

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	600269	赣粤高速	273,400	1,213,896.00	1.45
2	601158	重庆水务	209,174	1,171,374.40	1.39
3	601666	平煤股份	234,800	981,464.00	1.17
4	601717	郑煤机	123,100	702,901.00	0.84
5	600611	大众交通	150,500	699,825.00	0.83

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

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
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-236,501.14
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-236,040.00

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将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

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	52,693.76
2	应收证券清算款	3,810,507.43
3	应收股利	-
4	应收利息	1,028.80
5	应收申购款	23,402.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,887,632.83

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

5.11.5.1 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

无。

5.11.5.2 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

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	103,077,680.05
报告期期间基金总申购份额	3,494,835.16
减:报告期期间基金总赎回份额	24,945,292.30
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	82,427,222.91

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	29,570,950.84	-	-	29,570,950.84	35.88
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,尽量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
2019年7月17日

建信龙头企业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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	建信龙头企业股票
基金主代码	005259
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月24日
报告期末基金份额总额	345,974,363.82份
投资目标	在严格控制风险的前提下,积极挖掘A股市场和港股市场(通过港股通)所蕴含的投资机会,重点投资沪港深股票市场各细分行业中的龙头公司,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以追求基金资产收益长期增长为目标,根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和货币市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置,力争获得与所承担的风险相匹配的收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×20%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期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	中国农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4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	9,483,885.79
2.本期利润	7,213,470.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0203
4.期末基金资产净值	349,792,988.23
5.期末基金份额净值	1.0110

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。

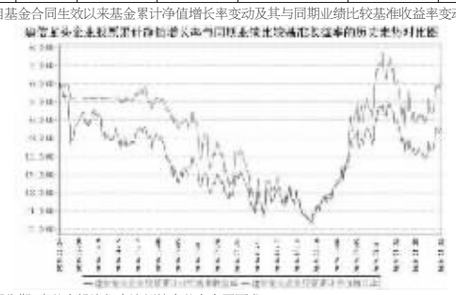
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.62%	1.60%	-0.48%	1.05%	2.09%	0.55%

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		
刘定飞	本基金的基金经理	2018年3月6日	-	7年	刘定飞先生,硕士,2012年6月毕业于中国人民大学金融工程专业,同年7月加入建信基金,历任助理研究员、初级研究员、研究员、研究部总经理助理,2018年3月6日起任建信龙头企业股票型证券投资基金的基金经理。
姚锋	权益投资部总经理,本基金的基金经理	2018年1月24日	-	15年	姚锋女士,权益投资部总经理,博士,曾任天津通广三星电子有限公司工程师,2004年4月至2011年3月任天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职,2009年3月17日至2011年3月3日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理;2009年12月17日至2011年3月3日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理,历任建信基金管理公司研究部首席策略分析师、权益投资部副总经理兼研究部首席策略分析师、权益投资部总经理,2012年2月17日起任建信恒远灵成长混合型证券投资基金的基金经理;2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任股票型证券投资基金的基金经理;2014年1月30日起任建信保本混合型证券投资基金的基金经理,该基金于1月23日起转型为建信积极配置混合型证券投资基金,姚锋继续担任该基金的基金经理;2017年4月9日至2018年9月12日任建信核心精选混合型证券投资基金的基金经理;2018年1月24日起任建信龙头企业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,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》、《证券投资基金公司内部控制指导意见》、《建信龙头企业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

报告期内,宏观经济运行平稳,部分指标有所回落。19年6月,制造业采购经理指数(PMI)为49.4%,与上月持平。其中,生产指数高于临界点,新订单指数低于临界点。非制造业商务活动指数为54.2%,比上月微落0.1个百分点,继续位于扩张区间。

市场方面,二季度A股整体、沪深300指数、创业板指数分别下跌4.6%、下跌1.2%、下跌10.8%,H股恒生指数下跌1.8%,比上个季度有所回调。其中食品饮料、餐饮旅游、银行、家电涨幅居前,传媒、轻工、基础化工等跌幅较大。板块表现的原因包括,消费品零售维持景气、中美贸易谈判遇冷、经济稳增长力度减弱等。

报告期内,本基金遵循行业景气、个股优质、估值合理的配置思路,致力于选取具有持续成长性的公司,提高组合表现的稳定性。

报告期内,股票仓位保持中性水平。持仓结构以消费类为主,降低周期、非银类比例,适当增加银行比例。重点配置方向包括白酒、家电、医药、银行、地产、免税、超市、体育等。其中免税、白酒、医药、超市、家电取得超额收益,地产表现平淡。6月以来,全球流动性趋于宽松、中美贸易谈判有所缓和、科创板首批公司开始询价,本基金将及时挖掘研究、不断优化组合,力求为持有人获取长期稳定回报。

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1.61%,波动率1.60%,业绩比较基准收益率-0.48%,波动率1.05%。

§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	297,137,927.35	84.35
	其中:股票	297,137,927.35	84.35
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	54,221,264.66	15.39
8	其他资产	902,593.59	0.26
9	合计	352,281,785.60	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	193,038.35	0.06
C	制造业	170,717,661.85	48.81
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	15,381,079.12	4.40
G	交通运输,仓储和邮政业	3,470,828.46	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	1,797,035.81	0.51
J	金融业	34,921,044.94	9.98
K	房地产业	21,682,908.00	6.20
L	租赁和商务服务业	16,456,631.40	4.70
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	264,633,334.53	75.65

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

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
Materials材料	-	0.00
Consumer Discretionary非日常生活消费品	14,677,259.05	4.20
Consumer Staples日常消费品	7,519,228.12	2.15
Energy能源	-	0.00
Financials金融	-	0.00
Health Care医疗保健	-	0.00
Industrials工业	8,684,214.64	2.48
Information Technology信息技术	-	0.00
Telecommunication Services通讯服务	1,643,891.01	0.47
Utilities公用事业	-	0.00
Real Estate房地产	-	0.00
合计	32,524,592.82	9.30

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	000858	五粮液	278,100	32,801,895.00	9.38
2	601398	工商银行	4,713,100	27,760,159.00	7.94
3	000333	美的集团	528,690	27,417,863.40	7.84
4	000651	格力电器	431,793	23,748,615.00	6.79
5	000661	长春高新	67,500	22,813,000.00	6.52
6	000963	中国建设	2,503,800	21,682,908.00	6.20
7	601888	中国国旅	385,636	16,456,631.40	4.70
8	601933	永辉超市	1,506,472	15,381,079.12	4.40
9	300760	迈瑞医疗	94,199	15,373,276.80	4.39
10	02020	安踏体育	311,000	14,677,259.05	4.20

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	651,630.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	231,200.00
4	应收利息	9,383.40
5	应收申购款	10,379.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	902,593.59

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	406,142,901.54
报告期期间基金总申购份额	24,373,152.68
减:报告期期间基金总赎回份额	83,541,690.40
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	345,974,363.82

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龙头企业股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信龙头企业股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信龙头企业股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信龙头企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
2019年7月17日

建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金

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	建信民丰回报定期开放混合
基金主代码	004413
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年4月18日
报告期末基金份额总额	94,385,895.53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,充分利用投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	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。 具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生品投资策略四个部分组成。 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,减少基金净值的波动。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为: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	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	1,709,180.45
2.本期利润	-389,417.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0031
4.期末基金资产净值	100,864,483.72
5.期末基金份额净值	1.0686