# 建信内生动力混合型证券投资基金

## 2018年第四季度报告

2018年12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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019年1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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 建信内生动力混合 |
| 基金主代码 | 530011 |
| 交易代码 | 530011 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年11月16日 |
| 报告期末基金份额总额 | 220,154,353.33份 |
| 投资目标 | 在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将采取积极、主动的资产配置策略，重点投资于消费性内生动力行业、投资性内生动力行业、服务性内生动力行业中具有持续竞争力优势的上市公司股票，力求实现基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 本基金投资业绩比较基准为：75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，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 | 中国工商银行股份有限公司 |

§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10月1日 – 2018年12月31日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | –25,380,545.08 |
| 2.本期利润 | –33,045,396.38 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | –0.1493 |
| 4.期末基金资产净值 | 270,188,079.10 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.227 |

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。

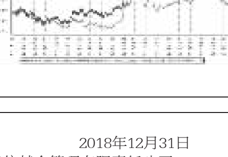
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | –10.63% | 1.29% | –8.58% | 1.22% | –2.05% | 0.07% |

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 | | |
| 吴尚伟 | 权益投资部联席投资官、本基金的基金经理 | 2014年11月25日 | – | 12 | 硕士，权益投资部联席投资官。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日起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，该基金于2018年2月28日起改名为建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金，吴尚伟继续担任该基金的基金经理；2017年1月24日起任建信恒稳价值混合型证券投资基金的基金经理；2018年1月30日起任建信安心保本五号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于2018年2月6日起转型为建信弘利灵活配置混合型证券投资基金，吴尚伟继续担任该基金的基金经理。 |

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《建信内生动力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》、《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2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

宏观经济方面，受全球经济增长放缓、中美贸易摩擦等多因素影响，2018年四季度宏观经济运行稳中缓降，但整体平稳。2018年10–12月份制造业PMI指数分别为50.2%，50.0%和49.4%，PMI指数逐渐放缓且已经低于临界点，结合稳中有变的发展环境，我国制造业景气度有所减弱，但生产指数仍在临界点以上，说明制造业PMI回落而企业生产层面的积极因素仍在发挥支撑作用，整体表现出制造业稳中缓降的态势。从需求端来看，固定资产投资增速有所回升，1–11月累计增速5.9%，较9月末累计增速上升了0.5个百分点，其中制造业投资累计同比增长9.5%，增速相比于三季度末抬升0.8个百分点，对整体固定资产投资形成有力支撑。受汽车类商品降幅扩大和石油类商品增速高位回落等因素影响，消费四季度增速稳中缓降，社会消费品零售总额11月末累计增速为9.1%，对比8月末下滑0.2个百分点。进出口方面，中美两国元首于阿根廷G20峰会成功会晤，停止升级关税等贸易限制措施，但受全球需求缩量、前期"赶出口"效应的滞后影响以及全球大宗商品价格下滑的影响，四季度进出口贸易增速出现相对明显的回落趋势。11月末中国进出口贸易总额累计同比增长14.8%，相较于8月末放缓1.2个百分点。从生产端上看，11月末全国规模以上工业增加值累计同比实际增长6.3%，增速相比于二季度末回落0.2个百分点，其中高技术产业和战略性新兴产业增速仍较快。总体看，2018年四季度宏观经济整体出现稳中缓降的趋势，但制造业投资继续向好、基建投资在政策呵护下企稳反弹，为四季度经济提供支撑，宏观经济有一定的韧性。

通胀方面，今年四季度居民消费价格同比经历先升后降，而工业品同比增速持续下滑。11月份来看居民消费价格CPI同比上涨2.2%，涨幅比8月末下滑0.1个百分点，其中天气因素导致蔬菜供应较为充足，且猪肉价格环比下滑，拖累消费者价格指数出现微幅下滑；而国际油价大幅下跌拖累非食品价格环比下滑0.1%。11月全国工业生产者出厂价格同比上涨2.7%，较8月4.0%的增速有所回落，环比降幅较大的均为石化产业链，对工业品价格有一定拖累。

资金面和货币政策层面，四季度资金面整体维持合理充裕水平，近期央行推出定向中期借贷便利(TMLF)、提高小微企业贷款考核标准，并决定于2019年1月下调金融机构存款准备金率1个百分点，为宏观经济提供更为宽裕的资金环境，并对冲春节前流动性缺口。三季度人民币汇率经历较大贬值逐渐缓解的过程，并在12月末美元中间价收于6.8632，较9月末升值0.23%。

2018年四季度，上证指数下跌11.61%，创业板指下跌11.39%，行业层面普遍收跌，仅农林牧渔、综合和通信跌幅在5%以内，钢铁、采掘和医药生物跌幅最大，市场整体波动偏大。同时，12月中下旬美股出现大幅下挫，也带动A股市场也同步走弱。

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。回顾四季度，本基金保持了中性仓位，核心配置在食品饮料、轻工制造、旅游等消费类行业，看好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；同时基于对行业景气度变化的判断，本基金也增加了风电设备、传媒、火电等板块的配置。回顾四季度的失误，我们低估了政策对医药板块的冲击力度，配置的医药股出现了较大跌幅；虽然油价出现较大调整，但对客座率等行业数据的担忧，也带动了航空股的调整，上述配置让我们的净值出现了一定影响。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率–10.63%，波动率1.29%，业绩比较基准收益率–8.58%，波动率1.22%。

§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 | 172,811,610.52 | 48.22 |
| | 其中：股票 | 172,811,610.52 | 48.22 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中：债券 | – | – |
| | 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 | 80,000,000.00 | 22.32 |
| | 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 | 105,240,209.28 | 29.37 |
| 8 | 其他资产 | 293,676.62 | 0.08 |
| 9 | 合计 | 358,345,496.42 | 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 | 114,326,116.52 | 42.31 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,070,000.00 | 4.10 |
| E | 建筑业 | – | – |
| F | 批发和零售业 | – | – |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,014,400.00 | 2.23 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 14,284,300.00 | 5.29 |
| J | 金融业 | – | – |
| K | 房地产业 | 24,460,794.00 | 9.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,656,000.00 | 0.98 |
| 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 | 172,811,610.52 | 63.96 |

以上行业分类以2018年12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

本基金本报告期末未投资港股通股票。

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

| 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 | 600048 | 保利地产 | 1,468,600 | 17,314,794.00 | 6.41 |
| 2 | 002643 | 万润股份 | 1,500,000 | 15,180,000.00 | 5.62 |
| 3 | 600600 | 青岛啤酒 | 400,000 | 13,944,000.00 | 5.16 |
| 4 | 600011 | 华能国际 | 1,500,000 | 11,070,000.00 | 4.10 |
| 5 | 601766 | 中国中车 | 1,200,000 | 10,824,000.00 | 4.01 |
| 6 | 600872 | 中炬高新 | 350,000 | 10,311,000.00 | 3.82 |
| 7 | 600132 | 重庆啤酒 | 320,000 | 9,833,600.00 | 3.64 |
| 8 | 600406 | 国电南瑞 | 500,000 | 9,265,000.00 | 3.43 |
| 9 | 603711 | 香飘飘 | 430,000 | 9,137,500.00 | 3.38 |
| 10 | 002557 | 洽洽食品 | 450,035 | 8,568,666.40 | 3.17 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

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 | 247,620.20 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 21,462.11 |
| 5 | 应收申购款 | 24,594.31 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 293,676.62 |

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未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 | 236,528,716.57 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,514,052.62 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 18,888,415.86 |
| 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 | 220,154,353.33 |

上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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内生动力混合型证券投资基金设立的文件；

2、《建信内生动力混合型证券投资基金基金合同》；

3、《建信内生动力混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信内生动力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1月19日

# 建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 2018年第四季度报告

2018年12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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019年1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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 建信责任 |
| 基金主代码 | 530010 |
| 交易代码 | 530010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年5月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 60,258,241.20份 |
| 投资目标 | 通过将绝大部分基金财产投资于上证社会责任ETF，密切跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为上证社会责任ETF的联接基金，主要通过投资于上证社会责任ETF以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖上证社会责任ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。 |
| 业绩比较基准 | 95%×上证社会责任指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率 |
| 风险收益特征 | 本基金为上证社会责任ETF的联接基金，风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时，本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。 |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 责任ETF |
| 基金主代码 | 510090 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年5月28日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2010年8月9日 |
| 基金管理人名称 | 建信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人名称 | 中国工商银行股份有限公司 |

2.1.2 目标基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。 |
| 业绩比较基准 | 上证社会责任指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。本基金为指数型基金，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。 |

§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10月1日 – 2018年12月31日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | –220,154.21 |
| 2.本期利润 | –11,995,026.26 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | –0.2006 |
| 4.期末基金资产净值 | 93,275,428.62 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.5479 |

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。

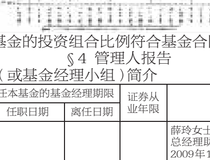
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | –11.53% | 1.50% | –11.54% | 1.51% | 0.01% | –0.01% |

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



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 | | |
| 薛玲 | 本基金的基金经理 | 2016年7月4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月在路通世纪公司亚洲数据收集部门工作，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5月27日至2018年4月25日任建信鑫盛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 管理人对报告期内本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《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同》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，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2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

本基金绝大部分资产投资于上证社会责任ETF，因此基金的跟踪误差和偏离度主要取决于上证责任ETF的表现。此外，由于申赎造成的基金份额变动以及成份股的集中分红也会对本基金的跟踪误差和偏离度造成一定影响。在报告期内，基金跟踪误差和日均偏离度均被控制在基金合同约定的范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率–11.53%，波动率1.5%，业绩比较基准收益率–11.54%，波动率1.51%。

§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 | 2,125,584.15 | 2.27 |
| | 其中：股票 | 2,125,584.15 | 2.27 |
| 2 | 基金投资 | 85,804,800.00 | 91.57 |
| 3 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中：债券 | – | – |
| | 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 | 5,690,716.98 | 6.07 |
| 8 | 其他资产 | 83,998.21 | 0.09 |
| 9 | 合计 | 93,705,099.34 | 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 | 30,732.00 | 0.03 |
| C | 制造业 | 453,808.56 | 0.49 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 21,735.00 | 0.02 |
| E | 建筑业 | 197,782.56 | 0.21 |
| F | 批发和零售业 | 63,872.80 | 0.07 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 38,286.75 | 0.04 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 77,517.00 | 0.08 |
| J | 金融业 | 1,109,315.60 | 1.19 |
| K | 房地产业 | 120,513.40 | 0.13 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,867.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,250.48 | 0.00 |
| 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 | 3,903.00 | 0.00 |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 2,125,584.15 | 2.28 |

以上行业分类以2018年12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

本基金本报告期末未投资港股通股票。

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

| 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 | 7,200 | 403,920.00 | 0.43 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 6,900 | 173,880.00 | 0.19 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 8,100 | 121,014.00 | 0.13 |
| 4 | 601328 | 交通银行 | 18,000 | 104,220.00 | 0.11 |
| 5 | 601668 | 中国建筑 | 13,760 | 78,432.00 | 0.08 |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 7,764 | 76,087.20 | 0.08 |
| 7 | 600104 | 上汽集团 | 2,400 | 64,008.00 | 0.07 |
| 8 | 601601 | 中国太保 | 2,100 | 59,703.00 | 0.06 |
| 9 | 600048 | 保利地产 | 4,800 | 56,592.00 | 0.06 |
| 10 | 601229 | 上海银行 | 3,520 | 39,388.80 | 0.04 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 上证社会责任ETF | 指数基金 | 交易型开放式指数基金 | 建信基金管理有限责任公司 | 85,804,800.00 | 91.99 |

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

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。

5.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,309.61 |
| 2 | 应收证券清算款 | 15,801.98 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 1,287.19 |
| 5 | 应收申购款 | 65,599.43 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 83,998.21 |

5.12.4 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。

5.12.5 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未存在流通受限的情况。

5.12.6 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 | 59,113,673.09 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,735,410.46 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,590,842.35 |
| 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 | 60,258,241.20 |

上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金设立的文件；

2、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同》；

3、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金招募说明书》；

4、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金托管协议》；

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1月19日

# 建信核心精选混合型证券投资基金

## 2018年第四季度报告

2018年12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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019年1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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 建信核心精选混合 |
| 基金主代码 | 530006 |
| 交易代码 | 530006 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年11月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 198,840,616.92份 |
| 投资目标 | 本基金通过对宏观经济环境、市场环境、行业特征和公司基本面的深入研究，精选具有良好成长性和价值性的上市公司股票，在有效控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人对经济环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析，作出投资决策。 |
| 业绩比较基准 | 本基金投资业绩比较基准为：75%×沪深300指数+25%×中国债券总指数。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，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 | 中国工商银行股份有限公司 |

§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10月1日 – 2018年12月31日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | –13,518,863.92 |
| 2.本期利润 | –32,968,779.55 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | –0.1672 |
| 4.期末基金资产净值 | 238,942,007.60 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.202 |

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。

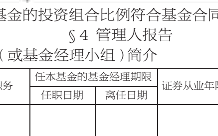
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | –12.20% | 1.40% | –8.58% | 1.22% | –3.62% | 0.18% |

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 | | |
| 王东杰 | 权益投资部联席投资官、本基金的基金经理 | 2017年8月28日 | – | 10 | 博士，权益投资部联席投资官。2008年7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月至今在我公司工作，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官，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日任建信鑫盛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；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《建信核心精选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》、《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2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，2018年经济增长小幅回落，物价水平保持平稳。随着经济下行压力逐步加大，政府出台了一系列稳增长政策，包括基建补短板、促消费和减税降费等系列措施。在年底中央工作经济会议上，政府突出了"稳增长"的重要性。我们预计随着稳增长政策的陆续落实和强化，我国经济会在未来逐步企稳。

市场方面，4季度股市持续下跌。上证综指下跌11.61%，创业板指下跌11.39%。行业层面，农林牧渔（上涨0.07%）、电力设备（下跌3.73%）和房地产（5.28%）表现相对较好。在猪瘟持续扩散的背景下，猪周期底部有望提前到来。4季度多家光伏企业参加中央民企座谈会，国内光伏补贴政策预期向好，带动电力设备板块行情。在因城施策的背景下，部分城市地产调控政策出现微调，地产板块表现较好。另一方面，石油石化（–23.96%）、钢铁（–18.66%）、医药（18.00%）跌幅较大。受宏观经济放缓和产能逐步释放的影响，石油价格和钢铁价格都出现了大幅回调。医药受带量采购等政策趋严的影响，跌幅较大。

本基金在四季度始终保持中性仓位。在经济下行压力加大且稳增长政策不断出台的背景下，持仓以逆周期板块和符合长期发展方向的优质制造龙头为主。我们认为，以合理的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。

操作层面，我国经济正在由高速增长阶段转向高质量发展阶段。在新旧动能转换的过程中，必然会有一批优秀公司脱颖而出。本基金会重点布局竞争优势明显、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

本报告期基金净值增长率–12.2%，波动率1.4%，业绩比较基准收益率–8.58%，波动率1.22%。

§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 | 178,879,510.76 | 74.17 |
| | 其中：股票 | 178,879,510.76 | 74.17 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中：债券 | – | – |
| | 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 | 62,102,215.87 | 25.75 |
| 8 | 其他资产 | 197,300.39 | 0.08 |
| 9 | 合计 | 241,179,027.02 | 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 | 65,009,063.13 | 27.21 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 11,668,508.90 | 4.88 |
| 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 | 11,754,255.00 | 4.92 |
| J | 金融业 | 41,218,845.42 | 17.25 |
| K | 房地产业 | 44,774,295.83 | 18.74 |
| 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 | 4,454,542.48 | 1.86 |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 178,879,510.76 | 74.86 |

以上行业分类以2018年12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

本基金本报告期末未投资港股通股票。

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

| 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 | 2,357,123 | 13,223,460.03 | 5.53 |
| 2 | 601155 | 新城控股 | 525,670 | 12,453,122.30 | 5.21 |
| 3 | 600048 | 保利地产 | 1,046,850 | 12,342,361.50 | 5.17 |
| 4 | 601688 | 华泰证券 | 582,500 | 9,436,500.00 | 3.95 |
| 5 | 601211 | 国泰君安 | 610,700 | 9,355,924.00 | 3.92 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 605,793 | 9,050,547.42 | 3.79 |
| 7 | 002531 | 天顺风能 | 1,847,200 | 8,220,040.00 | 3.44 |
| 8 | 601766 | 中国中车 | 889,900 | 8,026,898.00 | 3.36 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 307,600 | 7,751,520.00 | 3.24 |
| 10 | 000661 | 长春高新 | 40,100 | 7,017,500.00 | 2.94 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

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 | 102,977.43 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 13,947.06 |
| 5 | 应收申购款 | 80,375.90 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 197,300.39 |

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未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 | 195,231,446.14 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 8,119,286.26 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,510,115.48 |
| 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 | 198,840,616.92 |

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核心精选混合型证券投资基金设立的文件；

2、《建信核心精选混合型证券投资基金基金合同》；

3、《建信核心精选混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信核心精选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1月19日