

建信多因子量化股票型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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
送出日期:2019年3月26日

1 重要提示
基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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3月22日复核了本报告中的财务指标、净值数据、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证投资数据不存在虚假记载、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及其更新。

本报告中的财务资料未经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

2 基金简介

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名: 魏明	罗静
联系电话	010-66228888	010-68600666
电子邮箱	xinxi@cbccfund.com	lq@icbc.com.cn
客户服务热线	400-81-96633	95588
网址	010-66228881	010-68607798

2.2 基金产品说明

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名: 魏明	罗静
联系电话	010-66228888	010-68600666
电子邮箱	xinxi@cbccfund.com	lq@icbc.com.cn
客户服务热线	400-81-96633	95588
网址	010-66228881	010-68607798

2.3 信息披露方式

载基金年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.cbccfund.com

基金年度报告备置地点: 基金管理人、基金托管人住所

3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	2018年	2017年	2016年2月1日至2016年12月31日
本期已实现收益	-16,944,891.27	11,266,414.61	8,433,660.32
本期公允价值变动收益	-16,389,093.06	18,538,201.88	-2,766,871.15
加权平均基金份额本期利润	-0.3032	0.1093	-0.0073
本期基金份额净值增长率	-29.06%	10.81%	-1.79%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2602	0.0883	-0.0279
期末基金份额净值	31.360,01936	307,584,40834	240,066,02654
期末基金资产净值	0.7622	1.0893	0.0821

1.期末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,本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分)。

3.所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 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

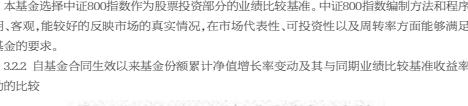
阶段	份额净值增长率	业绩比较基准增长率	份额净值增长率-业绩比较基准增长率
过去三个月	-11.55%	1.44%	-10.72%
过去六个月	-19.60%	1.32%	-13.36%
过去一年	-29.06%	1.26%	-23.55%
自基金合同生效起至今	-23.70%	1.01%	-12.65%

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(税后)。

本基金为股票型基金,所持有的股票市值买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差)占基金资产的比例不高于80%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的80%,股指期货合约价值在一年内由政府债券不低于基金资产净值的5%,放在业绩比较基准中给予5%的跟踪收益率5%的跟踪,相应将15%作为体现股指期货在一年内以内股指期货业务业绩表现的权重。

本基金选择中证800指数作为股票投资业绩的业绩比较基准,中证800指数的编制方法和程序透明、客观,能较好的反映市场的真实情况,在市场中代表、可投资性及可操作性能够充分满足本基金的要求。

3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额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



本基金合同自2016年3月9日生效,2016年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同自2016年3月9日起生效,基金合同生效以来未发生利润分配。

3.4 基金管理人、基金托管人、基金销售机构

4.1 基金管理人及基金托管人

4.1.1 基金管理人及基金托管人

4.1.2 基金管理人及基金托管人

4.1.3 基金管理人及基金托管人

4.1.4 基金管理人及基金托管人

4.1.5 基金管理人及基金托管人

4.1.6 基金管理人及基金托管人

4.1.7 基金管理人及基金托管人

4.1.8 基金管理人及基金托管人

4.1.9 基金管理人及基金托管人

4.1.10 基金管理人及基金托管人

4.1.11 基金管理人及基金托管人

4.1.12 基金管理人及基金托管人

4.1.13 基金管理人及基金托管人

4.1.14 基金管理人及基金托管人

4.1.15 基金管理人及基金托管人

4.1.16 基金管理人及基金托管人

4.1.17 基金管理人及基金托管人

4.1.18 基金管理人及基金托管人

4.1.19 基金管理人及基金托管人

4.1.20 基金管理人及基金托管人

4.1.21 基金管理人及基金托管人

4.1.22 基金管理人及基金托管人

4.1.23 基金管理人及基金托管人

4.1.24 基金管理人及基金托管人

4.1.25 基金管理人及基金托管人

4.1.26 基金管理人及基金托管人

4.1.27 基金管理人及基金托管人

4.1.28 基金管理人及基金托管人

4.1.29 基金管理人及基金托管人

4.1.30 基金管理人及基金托管人

4.1.31 基金管理人及基金托管人

4.1.32 基金管理人及基金托管人

4.1.33 基金管理人及基金托管人

4.1.34 基金管理人及基金托管人

4.1.35 基金管理人及基金托管人

4.1.36 基金管理人及基金托管人

4.1.37 基金管理人及基金托管人

4.1.38 基金管理人及基金托管人

4.1.39 基金管理人及基金托管人

4.1.40 基金管理人及基金托管人

4.1.41 基金管理人及基金托管人

4.1.42 基金管理人及基金托管人

4.1.43 基金管理人及基金托管人

4.1.44 基金管理人及基金托管人

4.1.45 基金管理人及基金托管人

4.1.46 基金管理人及基金托管人

建信龙头企业股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信

享享添添定期开放组合型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金及联接基金、建信睿和纯

债定期开放债券型