

建信多因子量化股票型证券投资基金

2019年第一季度报告

净值24.08%，波动率1.31%。

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1月1日至2019年3月31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	31,675,039.86	87.47
2	其中:股票	31,674,939.86	87.47
3	固定收益投资	455,038.97	1.26
4	其中:债券	455,038.97	1.26
5	贵金属投资	-	0.00
6	金融衍生品投资	-	0.00
7	买入返售金融资产	-	0.00
8	其他资产	3,500,295.81	9.67
9	其他资产	883,154.79	2.43
10	合计	36,213,409.43	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	654,567.44	1.83
B	采矿业	601,638.00	1.69
C	制造业	15,939,166.50	44.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,904,527.00	5.33
E	建筑业	37,569.60	0.10
F	批发和零售业	963,905.60	2.70
G	交通运输、仓储和邮政业	799,643.10	2.23
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	金融业	1,014,853.84	2.83
J	房地产业	3,577,879.72	10.02
K	医药生物	1,977,072.80	5.52
L	信息技术	499,500.00	1.37
M	科学、技术和艺术业	241,812.92	0.68
N	通信设备、计算机软件和互联网	103,542.14	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	35,428.00	0.10
P	教育	87,587.00	0.25
Q	卫生和社会工作	886,700.00	2.47
R	文化、体育和娱乐业	1,175,699.60	3.29
S	其他	1,175,699.60	3.29
合计		31,675,039.86	87.22

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。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.4 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.5 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.6 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.7 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.8 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.9 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.10 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.11 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.12 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.13 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.14 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.15 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.16 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.17 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.18 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.19 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.20 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.21 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.22 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.23 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.24 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.25 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.26 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.27 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.28 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.29 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.30 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.31 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.32 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.33 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.34 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.35 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.36 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.37 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.38 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.39 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.40 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.41 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.42 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.43 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.44 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.45 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.46 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.47 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.48 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.49 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.50 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.51 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.52 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.53 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.54 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.55 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.56 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.57 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.58 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.59 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.60 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.61 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.62 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.63 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.64 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.65 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.66 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.67 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.68 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.69 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.70 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.71 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.72 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.73 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.74 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.75 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.76 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.77 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.78 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.79 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.80 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.81 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.82 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.83 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.84 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.85 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.86 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.87 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.88 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.89 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.90 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.91 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.92 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.93 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.94 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.95 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.96 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.97 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.98 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.99 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.100 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.101 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.102 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.103 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.104 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.105 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.106 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.107 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.108 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.2.109 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。