

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4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，并对其中内容的真实性、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有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月19日复核了本报告的财务指标、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。

基金净值由中行民生银行有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月19日复核了本报告的财务指标、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。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称		建信多因子量化股票型证券投资基金	
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
基金类型	股票型基金	运作方式	开放式基金
基金代码	002682	上市交易方式	场内开市买卖(LOF)
基金经理	叶乐天	基金合同生效日	2016年8月9日
报告期末基金份额总额	37,524,111.00份	在投资目标的基础上,力争获取收益,并降低风险的股票型基金。	
投资目标	本基金主要通过量化模型精选股票,综合成长、价值、稳定等多种风格,精选个股进行投资,优化整体配置,力求实现长期稳健的投资回报。		
投资策略	本基金主要通过量化模型精选股票,综合成长、价值、稳定等多种风格,精选个股进行投资,优化整体配置,力求实现长期稳健的投资回报。		
业绩比较基准	本基金的业绩基准为:0.8%+中证800指数收益率×115%+恒生指数收益率×8.5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险,较高预期的回报率,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	基金代销	中国银行股份有限公司
基金代理人	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1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益		1,355,352.58
2.本期利润		7,607,379.55
3.加权平均基金份额本期利润		0.1893
4.期末基金资产净值		35,703,075.53

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.所述基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用和赎回费除外。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	24.90%	1.26%	24.88%	1.13%	0.02%	-0.05%

3.2.2 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



3.2.3 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,基金管理人不存在利用基金财产进行内幕交易和不公平交易的行为,并公平对待所有投资人,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金销售行为规范指引(试行)》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《证券投资基金评价方法指引(试行)》、《证券投资基金宣传推介材料管理办法》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理制度》、《异常交易监控办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突冲销管理办法》、《异常交易监控办法》、《公平交易管理制度》等风险管理政策。公司使用的交易系统设置了公平交易模块,一旦出现相同基金经理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。

3.2.4 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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1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。

3.2.5 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为基础,利用量化模型优化风险管理,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的风险,本基金持股风格偏向于中证500指数,在一季度市场大幅上涨的背景下,基金净值也上涨较为明显。

3.2.6 报告期内基金业绩表现

本报告期内基金净值增长率24.90%,波动率1.26%,业绩比较基准收

率-0.05%。

3.2.7 管理人对报告期内基金估值政策和会计政策的说明

本报告期内,基金管理人不存在违反《企业会计准则》、《金融工具确认和计量》、《金融工具列报》、《关于公允价值计量的指导意见》、《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第13号——现金及现金等价物》、《企业会计准则第30号——资产负债表日后事项》、《企业会计准则第31号——现金流量表》、《企业会计准则第32号——中期财务报告》、《企业会计准则第37号——金融工具列报》、《企业会计准则第40号——外币折算》、《企业会计准则第41号——存货》、《企业会计准则第42号——持有待售商品》、《企业会计准则第43号——合营安排》、《企业会计准则第44号——每股收益》、《企业会计准则第45号——预计负债》、《企业会计准则第46号——关联方披露》、《企业会计准则第47号——石油天然气开采》、《企业会计准则第48号——衍生工具》、《企业会计准则第49号——政府补助》、《企业会计准则第50号——非货币性资产交换》、《企业会计准则第51号——资产负债表日后调整事项》、《企业会计准则第52号——重新计量设定受益计划净资产》、《企业会计准则第53号——财务报表列报》、《企业会计准则第54号——收入》、《企业会计准则第55号——借款费用》、《企业会计准则第56号——企业合并》、《企业会计准则第57号——非金融资产处置》、《企业会计准则第58号——金融资产减值》、《企业会计准则第59号——债务重组》、《企业会计准则第60号——租赁》、《企业会计准则第61号——存货》、《企业会计准则第62号——非货币性资产交换》、《企业会计准则第63号——或有事项》、《企业会计准则第64号——借款费用》、《企业会计准则第65号——生物资产》、《企业会计准则第66号——无形资产》、《企业会计准则第67号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第68号——资产减值》、《企业会计准则第69号——职工薪酬》、《企业会计准则第70号——预计负债》、《企业会计准则第71号——股份支付》、《企业会计准则第72号——租赁》、《企业会计准则第73号——金融工具列报》、《企业会计准则第74号——受托代理业务》、《企业会计准则第75号——亏损合同》、《企业会计准则第76号——多项交易》、《企业会计准则第77号——非货币性资产交换》、《企业会计准则第78号——会计政策、会计估计及其变更》、《企业会计准则第79号——会计差错更正和资产负债表日后调整事项》、《企业会计准则第80号——企业合并》、《企业会计准则第81号——收入》、《企业会计准则第82号——坏债准备》、《企业会计准则第83号——或有事项》、《企业会计准则第84号——借款费用》、《企业会计准则第85号——生物资产》、《企业会计准则第86号——无形资产》、《企业会计准则第87号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第88号——资产减值》、《企业会计准则第89号——职工薪酬》、《企业会计准则第90号——预计负债》、《企业会计准则第91号——股份支付》、《企业会计准则第92号——租赁》、《企业会计准则第93号——金融工具列报》、《企业会计准则第94号——收入》、《企业会计准则第95号——借款费用》、《企业会计准则第96号——生物资产》、《企业会计准则第97号——无形资产》、《企业会计准则第98号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第99号——资产减值》、《企业会计准则第100号——职工薪酬》、《企业会计准则第101号——预计负债》、《企业会计准则第102号——股份支付》、《企业会计准则第103号——租赁》、《企业会计准则第104号——金融工具列报》、《企业会计准则第105号——收入》、《企业会计准则第106号——借款费用》、《企业会计准则第107号——生物资产》、《企业会计准则第108号——无形资产》、《企业会计准则第109号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第110号——资产减值》、《企业会计准则第111号——职工薪酬》、《企业会计准则第112号——预计负债》、《企业会计准则第113号——股份支付》、《企业会计准则第114号——租赁》、《企业会计准则第115号——金融工具列报》、《企业会计准则第116号——收入》、《企业会计准则第117号——借款费用》、《企业会计准则第118号——生物资产》、《企业会计准则第119号——无形资产》、《企业会计准则第120号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第121号——资产减值》、《企业会计准则第122号——职工薪酬》、《企业会计准则第123号——预计负债》、《企业会计准则第124号——股份支付》、《企业会计准则第125号——租赁》、《企业会计准则第126号——金融工具列报》、《企业会计准则第127号——收入》、《企业会计准则第128号——借款费用》、《企业会计准则第129号——生物资产》、《企业会计准则第130号——无形资产》、《企业会计准则第131号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第132号——资产减值》、《企业会计准则第133号——职工薪酬》、《企业会计准则第134号——预计负债》、《企业会计准则第135号——股份支付》、《企业会计准则第136号——租赁》、《企业会计准则第137号——金融工具列报》、《企业会计准则第138号——收入》、《企业会计准则第139号——借款费用》、《企业会计准则第140号——生物资产》、《企业会计准则第141号——无形资产》、《企业会计准则第142号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第143号——资产减值》、《企业会计准则第144号——职工薪酬》、《企业会计准则第145号——预计负债》、《企业会计准则第146号——股份支付》、《企业会计准则第147号——租赁》、《企业会计准则第148号——金融工具列报》、《企业会计准则第149号——收入》、《企业会计准则第150号——借款费用》、《企业会计准则第151号——生物资产》、《企业会计准则第152号——无形资产》、《企业会计准则第153号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第154号——资产减值》、《企业会计准则第155号——职工薪酬》、《企业会计准则第156号——预计负债》、《企业会计准则第157号——股份支付》、《企业会计准则第158号——租赁》、《企业会计准则第159号——金融工具列报》、《企业会计准则第160号——收入》、《企业会计准则第161号——借款费用》、《企业会计准则第162号——生物资产》、《企业会计准则第163号——无形资产》、《企业会计准则第164号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第165号——资产减值》、《企业会计准则第166号——职工薪酬》、《企业会计准则第167号——预计负债》、《企业会计准则第168号——股份支付》、《企业会计准则第169号——租赁》、《企业会计准则第170号——金融工具列报》、《企业会计准则第171号——收入》、《企业会计准则第172号——借款费用》、《企业会计准则第173号——生物资产》、《企业会计准则第174号——无形资产》、《企业会计准则第175号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第176号——资产减值》、《企业会计准则第177号——职工薪酬》、《企业会计准则第178号——预计负债》、《企业会计准则第179号——股份支付》、《企业会计准则第180号——租赁》、《企业会计准则第181号——金融工具列报》、《企业会计准则第182号——收入》、《企业会计准则第183号——借款费用》、《企业会计准则第184号——生物资产》、《企业会计准则第185号——无形资产》、《企业会计准则第186号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第187号——资产减值》、《企业会计准则第188号——职工薪酬》、《企业会计准则第189号——预计负债》、《企业会计准则第190号——股份支付》、《企业会计准则第191号——租赁》、《企业会计准则第192号——金融工具列报》、《企业会计准则第193号——收入》、《企业会计准则第194号——借款费用》、《企业会计准则第195号——生物资产》、《企业会计准则第196号——无形资产》、《企业会计准则第197号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第198号——资产减值》、《企业会计准则第199号——职工薪酬》、《企业会计准则第200号——预计负债》、《企业会计准则第201号——股份支付》、《企业会计准则第202号——租赁》、《企业会计准则第203号——金融工具列报》、《企业会计准则第204号——收入》、《企业会计准则第205号——借款费用》、《企业会计准则第206号——生物资产》、《企业会计准则第207号——无形资产》、《企业会计准则第208号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第209号——资产减值》、《企业会计准则第210号——职工薪酬》、《企业会计准则第211号——预计负债》、《企业会计准则第212号——股份支付》、《企业会计准则第213号——租赁》、《企业会计准则第214号——金融工具列报》、《企业会计准则第215号——收入》、《企业会计准则第216号——借款费用》、《企业会计准则第217号——生物资产》、《企业会计准则第218号——无形资产》、《企业会计准则第219号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第220号——资产减值》、《企业会计准则第221号——职工薪酬》、《企业会计准则第222号——预计负债》、《企业会计准则第223号——股份支付》、《企业会计准则第224号——租赁》、《企业会计准则第225号——金融工具列报》、《企业会计准则第226号——收入》、《企业会计准则第227号——借款费用》、《企业会计准则第228号——生物资产》、《企业会计准则第229号——无形资产》、《企业会计准则第230号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第231号——资产减值》、《企业会计准则第232号——职工薪酬》、《企业会计准则第233号——预计负债》、《企业会计准则第234号——股份支付》、《企业会计准则第235号——租赁》、《企业会计准则第236号——金融工具列报》、《企业会计准则第237号——收入》、《企业会计准则第238号——借款费用》、《企业会计准则第239号——生物资产》、《企业会计准则第240号——无形资产》、《企业会计准则第241号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第242号——资产减值》、《企业会计准则第243号——职工薪酬》、《企业会计准则第244号——预计负债》、《企业会计准则第245号——股份支付》、《企业会计准则第246号——租赁》、《企业会计准则第247号——金融工具列报》、《企业会计准则第248号——收入》、《企业会计准则第249号——借款费用》、《企业会计准则第250号——生物资产》、《企业会计准则第251号——无形资产》、《企业会计准则第252号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第253号——资产减值》、《企业会计准则第254号——职工薪酬》、《企业会计准则第255号——预计负债》、《企业会计准则第256号——股份支付》、《企业会计准则第257号——租赁》、《企业会计准则第258号——金融工具列报》、《企业会计准则第259号——收入》、《企业会计准则第260号——借款费用》、《企业会计准则第261号——生物资产》、《企业会计准则第262号——无形资产》、《企业会计准则第263号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第264号——资产减值》、《企业会计准则第265号——职工薪酬》、《企业会计准则第266号——预计负债》、《企业会计准则第267号——股份支付》、《企业会计准则第268号——租赁》、《企业会计准则第269号——金融工具列报》、《企业会计准则第270号——收入》、《企业会计准则第271号——借款费用》、《企业会计准则第272号——生物资产》、《企业会计准则第273号——无形资产》、《企业会计准则第274号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第275号——资产减值》、《企业会计准则第276号——职工薪酬》、《企业会计准则第277号——预计负债》、《企业会计准则第278号——股份支付》、《企业会计准则第279号——租赁》、《企业会计准则第280号——金融工具列报》、《企业会计准则第281号——收入》、《企业会计准则第282号——借款费用》、《企业会计准则第283号——生物资产》、《企业会计准则第284号——无形资产》、《企业会计准则第285号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第286号——资产减值》、《企业会计准则第287号——职工薪酬》、《企业会计准则第288号——预计负债》、《企业会计准则第289号——股份支付》、《企业会计准则第290号——租赁》、《企业会计准则第291号——金融工具列报》、《企业会计准则第292号——收入》、《企业会计准则第293号——借款费用》、《企业会计准则第294号——生物资产》、《企业会计准则第295号——无形资产》、《企业会计准则第296号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第297号——资产减值》、《企业会计准则第298号——职工薪酬》、《企业会计准则第299号——预计负债》、《企业会计准则第300号——股份支付》、《企业会计准则第301号——租赁》、《企业会计准则第302号——金融工具列报》、《企业会计准则第303号——收入》、《企业会计准则第304号——借款费用》、《企业会计准则第305号——生物资产》、《企业会计准则第306号——无形资产》、《企业会计准则第307号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第308号——资产减值》、《企业会计准则第309号——职工薪酬》、《企业会计准则第310号——预计负债》、《企业会计准则第311号——股份支付》、《企业会计准则第312号——租赁》、《企业会计准则第313号——金融工具列报》、《企业会计准则第314号——收入》、《企业会计准则第315号——借款费用》、《企业会计准则第316号——生物资产》、《企业会计准则第317号——无形资产》、《企业会计准则第318号——非货币性职工薪酬》、《企业会计准则第319号——资产减值》、《企业会计准则第320号——职工薪酬》、《企业会计准则第321号——预计负债》、《企业会计准则第322号——股份支付》、《企业会计准则第323号——租赁》、《企业会计准则第324号——金融工具列报》、《企业会计准则第325号——收入》、《企业会计准则第326号——借款费用》、《企业会计准则第327号——生物资产》、《企业会计准则第328号——无形资产》、《企业会计准则第329