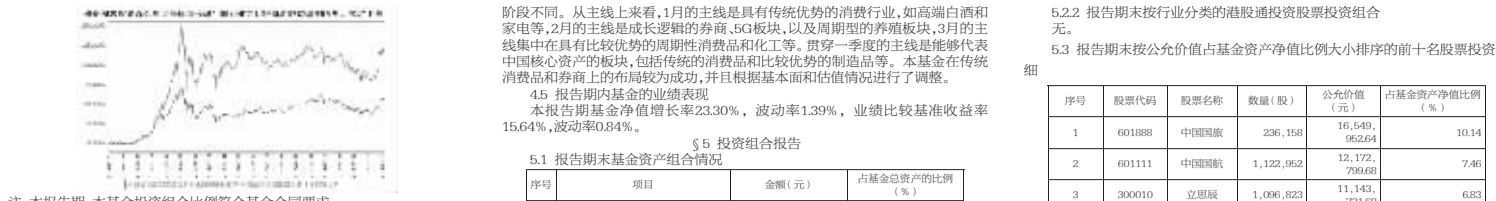


建信积极配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告



阶段不同，从主线上来看，1月的主线是具有传统优势的消费品行业，如高端白酒和农牧业等，2月的主线是成长型新兴产业，5G板块，以及一季度爆发的科创板，3月的主线集中在具有比较优势的周期性消费品和化工等。贯穿季度的主线是能够代表中国核心资产的板块，包括传统的消费品和比较优势的制造业等。本基金在传统消费品和券商上的布局较为传统，并且根据基本面和估值情况进行了调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期基金净值增长率为23.30%，波动率1.39%，业绩比较基准收益率为15.64%，波动率0.84%。

§ 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	110,091,072.74	62.61
2	其中:股票	110,091,072.74	62.61
3	固定收益投资	—	0.00
4	其中:债券	—	0.00
5	资产支持证券	—	0.00
6	贵金属投资	—	0.00
7	买入返售金融资产	—	0.00
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	0.00
9	银行存款和结算备付金合计	66,461,610.37	37.23
10	其他资产	114,768.68	0.07
11	合计	176,847,452.29	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股票投资组合情况

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	—	—
B	采矿业	7,118,804.00	4.06
C	制造业	29,526,118.14	17.46
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	—	—
E	建筑业	4,922,820.00	3.02
F	批发性零售	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	26,502,726.48	15.02
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息技术业	16,360,362.48	10.02
J	金融业	—	—
K	房地产业	6,835,500.00	5.29
L	租赁和商务服务业	16,549,862.64	10.14
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	国防装备、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社公事业	2,565,300.00	1.54
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	110,091,072.74	67.46

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。

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4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。

本报告中期财务资料未经审计。
本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信积极配置混合
基金代码	500012
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2014年1月23日
报告期末基金份额总额	73,094,639.69份

投资策略
本基金在充分分析基金经理的研究优势,在分析并判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上,动态调整大类资产配置比例,在符合基金合同约定的投资范围的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准
本基金业绩比较基准:50%×沪深300指数+40%×中国债券综合指数

§ 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	报告期末2019年1月1日至2019年3月31日	比较基准
1.本期已实现收益	11,308,302.44	—
2.本期利润	31,787,324.97	—
3.期末可供基金份额本期利润	0.4253	—
4.期末基金份额净值	163,227,303.63	—
5.期末基金份额净值增长率	2.33%	—

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 本报告期末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	23.30%	1.39%	15.64%	0.84%	7.66%	0.56%

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

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4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。

本报告中期财务资料未经审计。
本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信嘉薪宝货币
基金代码	000098
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2014年6月17日
报告期末基金份额总额	1,589,386,178.66份

投资策略
本基金采取主动管理策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场未被广泛识别的投资机会,实现组合增值。
业绩比较基准
本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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	报告期末2019年1月1日至2019年3月31日	比较基准
1.本期已实现收益	13,729,158.27	—
2.本期利润	13,729,158.27	—
3.期末基金份额净值	1,589,386,178.66	—
4.期末基金份额净值增长率	5,199,772.14%	—

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、持有人认购或交易基金时,不缴纳赎回费用。
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末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

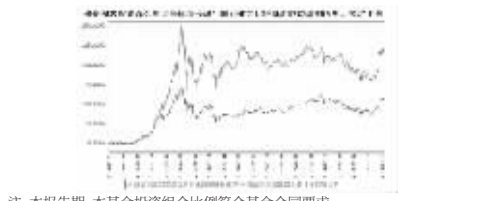
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.0194%	0.0039%	0.3229%	0.0000%	0.4985%	0.0039%

过去六个月

净值增长率①	0.0192%	净值增长率标准差②	0.0039%	业绩比较基准收益率③	0.3229%	业绩比较基准收益率标准差④	0.0000%	①-③	0.5403%	②-④	0.0039%
--------	---------	-----------	---------	------------	---------	---------------	---------	-----	---------	-----	---------

建信嘉薪宝货币市场基金

2019年第一季度报告



阶段不同,从主线上来看,1月的主线是具有传统优势的消费品行业,如高端白酒和农牧业等,2月的主线是成长型新兴产业,5G板块,以及一季度爆发的科创板,3月的主线集中在具有比较优势的周期性消费品和化工等。贯穿季度的主线是能够代表中国核心资产的板块,包括传统的消费品和比较优势的制造业等。本基金在传统消费品和券商上的布局较为传统,并且根据基本面和估值情况进行了调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期基金净值增长率为5.19%,波动率0.00%,业绩比较基准收益率为0.00%,波动率0.00%。

§ 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	11,461,917.74	65.84
2	其中:股票	11,461,917.74	65.84
3	固定收益投资	—	0.00
4	其中:债券	—	0.00
5	资产支持证券	—	0.00
6	贵金属投资	—	0.00
7	买入返售金融资产	306,450,371.18	22.76
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	0.00
9	银行存款和结算备付金合计	176,073,461.88	10.11
10	其他资产	22,537,492.28	1.29
11	合计	171,943,223.03	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股票投资组合情况

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	40,456,958.00	53.78
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	—	—
E	建筑业	1,312,863.00	1.74
F	批发性零售	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息技术业	6,990,584.15	9.15
J	金融业	945,020.00	1.25
K	房地产业	5,028,175.00	6.67
L	租赁和商务服务业	2,719,104.00	3.61
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	国防装备、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社公事业	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	61,619,340.13	81.72

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。

建信嘉薪宝货币市场基金

2019年第一季度报告

3.2.1 本报告期末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	0.0194%	0.0039%	0.3229%	0.0000%	0.4985%	0.0039%

过去六个月

净值增长率①	0.0192%	净值增长率标准差②	0.0039%	业绩比较基准收益率③	0.3229%	业绩比较基准收益率标准差④	0.0000%	①-③	0.5403%	②-④	0.0039%
--------	---------	-----------	---------	------------	---------	---------------	---------	-----	---------	-----	---------

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、持有人认购或交易基金时,不缴纳赎回费用。
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末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	0.0194%	0.0039%	0.3229%	0.0000%	0.4985%	0.0039%

过去六个月

净值增长率①	0.0192%	净值增长率标准差②	0.0039%	业绩比较基准收益率③	0.3229%	业绩比较基准收益率标准差④	0.0000%	①-③	0.5403%	②-④	0.0039%
--------	---------	-----------	---------	------------	---------	---------------	---------	-----	---------	-----	---------

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4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。

本报告中期财务资料未经审计。
本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信积极配置混合
基金代码	500012
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2014年1月23日
报告期末基金份额总额	73,094,639.69份

投资策略
本基金在充分分析基金经理的研究优势,在分析并判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上,动态调整大类资产配置比例,在符合基金合同约定的投资范围的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准
本基金业绩比较基准:50%×沪深300指数+40%×中国债券综合指数

§ 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	报告期末2019年1月1日至2019年3月31日	比较基准
1.本期已实现收益	11,308,302.44	—
2.本期利润	31,787,324.97	—
3.期末可供基金份额本期利润	0.4253	—
4.期末基金份额净值	163,227,303.63	—
5.期末基金份额净值增长率	2.33%	—

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 本报告期末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	23.30%	1.39%	15.64%	0.84%	7.66%	0.56%

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

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4月19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4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。

本报告中期财务资料未经审计。
本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信积极配置混合
基金代码	500012
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2014年1月23日
报告期末基金份额总额	73,094,639.69份

投资策略
本基金在充分分析基金经理的研究优势,在分析并判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上,动态调整大类资产配置比例,在符合基金合同约定的投资范围的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准
本基金业绩比较基准:50%×沪深300指数+40%×中国债券综合指数

§ 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	报告期末2019年1月1日至2019年3月31日	比较基准
1.本期已实现收益	11,308,302.44	—
2.本期利润	31,787,324.97	—
3.期末可供基金份额本期利润	0.4253	—
4.期末基金份额净值	163,227,303.63	—
5.期末基金份额净值增长率	2.33%	—

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 本报告期末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	23.30%	1.39%	15.64%	0.84%	7.66%	0.56%

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

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4月19日

建信嘉薪宝货币市场基金

2019年第一季度报告

3.2.1 本报告期末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	0.0194%	0.0039%	0.3229%	0.0000%	0.4985%	0.0039%

过去六个月

净值增长率①	0.0192%	净值增长率标准差②	0.0039%	业绩比较基准收益率③	0.3229%	业绩比较基准收益率标准差④	0.0000%	①-③	0.5403%	②-④	0.0039%
--------	---------	-----------	---------	------------	---------	---------------	---------	-----	---------	-----	---------

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、持有人认购或交易基金时,不缴纳赎回费用。
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期末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	0.0194%	0.0039%	0.3229%	0.0000%	0.4985%	0.0039%

过去六个月

净值增长率①	0.0192%	净值增长率标准差②	0.0039%	业绩比较基准收益率③	0.3229%	业绩比较基准收益率标准差④	0.0000%	①-③	0.5403%	②-④	0.0039%
--------	---------	-----------	---------	------------	---------	---------------	---------	-----	---------	-----	---------

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4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。

本报告中期财务资料未经审计。
本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	
------	--