建信精工制造指数增强型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人：建信基金管理有限责任公司
基金托管人：中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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。

本报告中财务资料未经审计。

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

基金简称	建信精工制造指数增强
基金主代码	001397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月26日
报告期末基金份额总额	103,877,680.05份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对中证精工制造指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证精工制造指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过8%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。 如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	90%×中证精工制造指数收益率+10%×商业银行活期存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§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	6,452,633.44
2.本期利润	21,037,032.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.2006
4.期末基金资产净值	109,508,207.53
5.期末基金份额净值	1.0542

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。

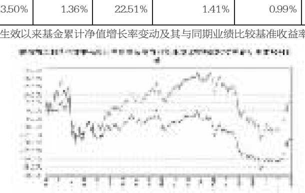
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	23.50%	1.36%	22.51%	1.41%	0.99%	-0.05%

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



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
叶乐天	金融工程及指数投资部副总经理，本基金的基金经理	2015年8月26日	－	10年	叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理，硕士。2008年5月至2011年9月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。2011年9月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理，2012年3月21日至2016年7月20日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；2013年3月28日起任建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014年1月27日起任建信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理；2015年8月26日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016年8月9日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017年4月18日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017年5月22日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年1月10日起任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年8月24日起任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年11月22日起任建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。

4.2 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，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《建信精工制造指数增强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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数增强型基金，管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型进行指数增强和风险管理。在报告期内，本基金严格保持与标的指数相近的行业分布和风格特征，在个股选择上做了一定的主动暴露，在一季度市场大幅上涨的情况下，本基金通过量化选股仍获取一定超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率23.50%，波动率1.36%，业绩比较基准收益率22.51%，波动率1.41%。

§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	89,809,108.93	80.76
	其中：股票	89,809,108.93	80.76
2	基金投资	－	0.00
3	固定收益投资	4,160,396.98	3.74
	其中：债券	4,160,396.98	3.74
	资产支持证券	－	0.00
4	贵金属投资	－	0.00
5	金融衍生品投资	－	0.00
6	买入返售金融资产	－	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	14,774,136.33	13.29
8	其他资产	2,456,724.07	2.21
9	合计	111,200,366.31	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	－	0.00
B	采矿业	－	0.00
C	制造业	28,239,996.99	25.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	－	0.00
E	建筑业	11,327,892.72	10.34
F	批发和零售业	467,391.00	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	8,771,837.35	8.01
H	住宿和餐饮业	－	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,072,388.00	0.98
J	金融业	－	0.00
K	房地产业	－	0.00
L	租赁和商务服务业	433,068.80	0.40
M	科学研究和技术服务业	－	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	40,163.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	－	0.00
P	教育	－	0.00
Q	卫生和社会工作	－	0.00
R	文化、体育和娱乐业	－	0.00
S	综合	－	0.00
	合计	50,352,737.86	45.98

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 报告期末积极投资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	666,119.00	0.61
B	采矿业	974,261.96	0.89
C	制造业	18,499,435.23	16.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,981,421.36	3.64
E	建筑业	638,264.00	0.58
F	批发和零售业	1,748,476.61	1.60
G	交通运输、仓储和邮政业	1,493,708.25	1.36
H	住宿和餐饮业	－	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,390,966.72	1.27
J	金融业	3,449,406.16	3.15
K	房地产业	1,925,381.00	1.76
L	租赁和商务服务业	707,171.63	0.65
M	科学研究和技术服务业	423,317.80	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	1,650,365.00	1.51
O	居民服务、修理和其他服务业	66,688.00	0.06
P	教育	222,922.35	0.20
Q	卫生和社会工作	98,700.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	1,393,452.00	1.27
S	综合	126,314.00	0.12
	合计	39,456,371.07	36.03

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。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601668	中国建筑	662,940	4,057,192.80	3.70
2	601766	中国中车	342,710	3,118,661.00	2.85
3	000157	中联重科	549,100	2,459,968.00	2.25
4	000063	中兴通讯	79,000	2,306,800.00	2.11
5	601186	中国铁建	185,500	2,135,105.00	1.95
6	601989	中国重工	330,500	1,930,120.00	1.76
7	601390	中国中铁	210,500	1,530,335.00	1.40
8	600009	上海机场	24,269	1,508,318.35	1.38
9	601800	中国交建	119,200	1,491,192.00	1.36
10	601012	隆基股份	55,340	1,444,374.00	1.32

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	601158	重庆水务	308,774	1,895,872.36	1.73
2	600578	京能电力	368,900	1,235,815.00	1.13
3	002541	鸿路钢构	108,200	987,866.00	0.90
4	601166	兴业银行	49,100	892,147.00	0.81
5	601898	中煤能源	168,300	861,696.00	0.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	－	0.00
2	央行票据	－	0.00
3	金融债券	4,000,400.00	3.65
	其中：政策性金融债	4,000,400.00	3.65
4	企业债券	－	0.00
5	企业短期融资券	－	0.00
6	中期票据	－	0.00
7	可转债（可交换债）	159,996.98	0.15
8	同业存单	－	0.00
9	其他	－	0.00
10	合计	4,160,396.98	3.80

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开1701	40,000	4,000,400.00	3.65
2	127012	招路转债	700	69,999.23	0.06
3	110053	苏银转债	430	42,999.06	0.04
4	123023	迪森转债	220	21,999.42	0.02
5	128061	启明转债	140	13,999.63	0.01

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

无。

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

无。

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

无。

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC1904	IC1904	9	9,956,520.00	236,040.00	－
公允价值变动总额合计（元）					236,040.00
股指期货投资本期收益（元）					133,480.39
股指期货投资本期公允价值变动（元）					300,810.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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	1,640,896.38
2	应收证券清算款	574,547.60
3	应收股利	－
4	应收利息	150,992.44
5	应收申购款	90,287.65
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	2,456,724.07

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	105,106,689.62
报告期期间基金总申购份额	4,688,322.81
减：报告期期间基金总赎回份额	5,917,332.38
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	103,877,680.05

注：上述总申购份额含转换转入份额，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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	2019年01月01日-2019年03月31日	29,570,950.84	－	－	29,570,950.84	28.47
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信精工制造指数增强型证券投资基金设立的文件；
2、《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》；
3、《建信精工制造指数增强型证券投资基金招募说明书》；
4、《建信精工制造指数增强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。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 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4月19日

建信量化事件驱动股票型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人：建信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国国际金融股份有限公司
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。

基金托管人中国国际金融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。

本报告中财务资料未经审计。

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

基金简称	建信量化事件驱动股票
基金主代码	004730
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月13日
报告期末基金份额总额	111,078,250.17份
投资目标	在有效控制风险的基础上，力争获取稳定、持续超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在积极把握宏观经济变迁、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，将影响行业和公司投资价值的事件性因素作为投资的主线，以事件驱动为核心的投资策略；并且采用多因子量化分析模型，综合技术、财务、情绪等多方面指标，深入分析事件性因素冲击的标的股票，精选受益于事件影响，具有超额收益的股票进行投资，优化调整投资组合，力争实现高于业绩比较基准的投资收益和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证800指数收益率×85%+商业银行活期存款利率×15%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其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
基金托管人	中国国际金融股份有限公司

§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	4,318,413.69
2.本期利润	18,563,434.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.1619
4.期末基金资产净值	99,842,301.88
5.期末基金份额净值	0.8988

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。

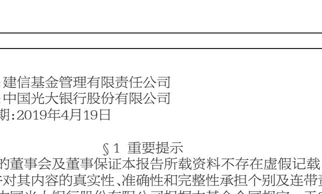
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	21.99%	1.29%	24.88%	1.31%	-2.89%	-0.02%

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



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
薛玲	本基金的基金经理	2017年9月13日	－	5年	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《建信量化事件驱动股票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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期间，本基金在股票组合的配置上以量化分析为基础，利用量化模型精选股票，并在此基础上积极参与新股申购。本基金在债券组合的配置上久期基本保持稳定，主要投向为国有股份制银行以及一类城商行的存款和一年期以内的国债、金融债。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率21.99%，波动率1.29%，业绩比较基准收益率24.88%，波动率1.31%。

§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	82,679,024.97	82.13
	其中：股票	82,679,024.97	82.13
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	5,117,397.53	5.08
	其中：债券	5,117,397.53	5.08
	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	10,290,689.36	10.22
8	其他资产	2,580,231.60	2.56
9	合计	100,667,343.46	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	926,928.00	0.93
B	采矿业	1,900,640.00	1.90
C	制造业	35,885,004.00	35.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,448,942.75	3.45
E	建筑业	2,869,593.00	2.87
F	批发和零售业	1,505,429.00	1.51
G	交通运输、仓储和邮政业	3,145,692.50	3.15
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,700,517.34	2.70
J	金融业	21,636,524.88	21.67
K	房地产业	3,222,684.00	3.23
L	租赁和商务服务业	2,262,284.60	2.27
M	科学研究和技术服务业	168,253.90	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	195,948.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	－	－
P	教育	45,540.00	0.05
Q	卫生和社会工作	542,177.00	0.54
R	文化、体育和娱乐业	1,408,084.00	1.41
S	综合	814,782.00	0.82
	合计	82,679,024.97	82.81

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。

5.3 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	50,600	3,901,260.00	3.91
2	601288	农业银行	620,200	2,313,346.00	2.32
3	600036	招商银行	64,700	2,194,624.00	2.20
4	601166	兴业银行	118,285	2,149,238.45	2.15
5	600000	浦发银行	189,046	2,132,438.88	2.14
6	000651	格力电器	38,100	1,798,701.00	1.80
7	600519	贵州茅台	2,000	1,707,980.00	1.71
8	601211	国泰君安	81,900	1,650,285.00	1.65
9	600016	民生银行	254,760	1,615,178.40	1.62
10	603288	海天味业	15,600	1,352,520.00	1.35

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,012,000.00	4.02
2	央行票据	－	－
3	金融债券	1,003,400.00	1.00
	其中：政策性金融债	1,003,400.00	1.00
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	可转债（可交换债）	101,997.53	0.10
8	同业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	5,117,397.53	5.13

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019566	17国债12	40,000	4,012,000.00	4.02
2	108901	农发1801	10,000	1,003,400.00	1.00
3	110053	苏银转债	350	34,999.23	0.04
4	123023	迪森转债	190	18,999.50	0.02
5	128059	视源转债	180	17,999.68	0.02

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

无。

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

无。

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

无。

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC1904	IC1904	4	4,425,120.00	91,283.20	－
公允价值变动总额合计（元）					91,283.20
股指期货投资本期收益（元）					401,744.46
股指期货投资本期公允价值变动（元）					91,283.20

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑基差成本、流动性等因素选择合适的股指期货合约。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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	767,017.95
2	应收证券清算款	1,664,685.00
3	应收股利	－
4	应收利息	146,019.26
5	应收申购款	2,509.39
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	2,580,231.60

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	117,196,120.08
报告期期间基金总申购份额	454,358.90
减：报告期期间基金总赎回份额	6,572,228.81
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	111,078,250.17

注：上述总申购份额含转换转入份额，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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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量化事件驱动股票型证券投资基金设立的文件；
2、《建信量化事件驱动股票型证券投资基金基金合同》；
3、《建信量化事件驱动股票型证券投资基金招募说明书》；
4、《建信量化事件驱动股票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4月19日

建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人：建信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人中国光大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。

本报告中财务资料未经审计。

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

基金简称	建信量化优享定期开放灵活配置混合
基金主代码	004546
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年8月24日
报告期末基金份额总额	212,984,224.63份
投资目标	本基金在严格控制风险并保持资产流动性的前提下，充分利用量化投资策略，力争为投资者提供持续、稳定的回报。
投资策略	封闭期运作期内，本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；然后，进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略五个部分组成。开放运作期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。
业绩比较基准	50%*中证500指数收益率+50%*中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高预期收益/预期风险特征的基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§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	9,297,674.76
2.本期利润	20,674,468.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0971
4.期末基金资产净值	226,272,129.78
5.期末基金份额净值	1.0624

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。

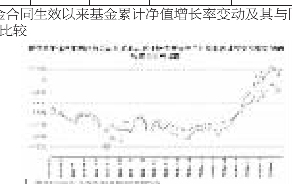
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	10.06%	0.64%	16.45%	0.85%	-6.39%	-0.21%

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



注：本基金基金合同于2018年8月24日生效，截至报告期末未满一年。本基金建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
赵云煜	本基金的基金经理	2018年11月16日	－	6年	赵云煜先生，硕士。2012年11月加入太平资产管理有限公司，任风险管理分析师；2014年7月加入建信基金，历任助理研究员、研究员、基金经理助理，2016年6月22日至2018年11月7日任专户投资经理。2018年11月16日起任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年11月22日起任建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
叶乐天	金融工程及指数投资部副总经理，本基金的基金经理	2018年8月24日	－	10年	叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理，硕士。2008年5月至2011年9月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。2011年9月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理，2012年3月21日至2016年7月20日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；2013年3月28日起任建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014年1月27日起任建信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理；2015年8月26日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016年8月9日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017年4月18日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017年5月22日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年1月10日起任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年8月24日起任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年11月22日起任建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。

4.2 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《建信量化优享定期开放灵活配置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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期间，本基金正常开展投资运作。本基金的核心策略为量化资产配置模型。报告期间，权益市场涨幅明显，本基金严格按照模型进行配置，提升权益资产的仓位。权益资产部分，本基金主要通过精选股票组合和股指期货的方式灵活跟踪中证500指数。固定收益配置方面，本基金综合考虑潜在收益、流动性以及利率波动，同时配置了久期相对较短的政策性金融债品种、货币市场工具以及银行存款。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率10.06%，波动率0.64%，业绩比较基准收益率16.45%，波动率0.85%。

§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	84,815,873.86	37.34
	其中：股票	84,815,873.86	37.34
2	基金投资	－	0.00
3	固定收益投资	7,210,236.83	3.17
	其中：债券	7,210,236.83	3.17
	资产支持证券	－	0.00
4	贵金属投资	－	0.00
5	金融衍生品投资	－	0.00
6	买入返售金融资产	39,200,000.00	17.26
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	90,780,528.06	39.97
8	其他资产	5,121,430.24	2.25
9	合计	227,128,068.99	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	1,903,454.00	0.84
B	采矿业	3,434,319.00	1.52
C	制造业	41,156,115.20	18.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,094,702.02	2.25
E	建筑业	1,580,368.00	0.70
F	批发和零售业	4,384,502.00	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	5,894,930.00	2.61
H	住宿和餐饮业	383,226.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,731,912.94	1.65
J	金融业	7,326,423.00	3.24
K	房地产业	5,311,066.00	2.35
L	租赁和商务服务业	749,675.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	110,410.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	938,103.00	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	－	0.00
P	教育	337,223.70	0.15
Q	卫生和社会工作	105,750.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,996,708.00	0.88
S	综合	376,986.00	0.17
	合计	84,815,873.86	37.48

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。

5.3 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	000656	金科股份	301,200	2,198,760.00	0.97
2	600132	重庆啤酒	55,010	1,941,853.00	0.86
3	002419	天虹股份	122,100	1,782,660.00	0.79
4	601118	海南橡胶	310,900	1,731,713.00	0.77
5	601018	宁波港	394,800	1,717,380.00	0.76
6	002773	康弘药业	33,300	1,695,636.00	0.75
7	002493	荣盛石化	132,700	1,673,347.00	0.74
8	000709	河钢股份	483,200	1,652,544.00	0.73
9	600674	川投能源	175,986	1,641,949.38	0.73
10	601158	重庆水务	263,626	1,618,663.64	0.72

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	－	0.00
2	央行票据	－	0.00
3	金融债券	7,209,236.90	3.19
	其中：政策性金融债	7,209,236.90	3.19
4	企业债券	－	0.00
5	企业短期融资券	－	0.00
6	中期票据	－	0.00
7	可转债（可交换债）	999.93	0.00
8	同业存单	－	0.00
9	其他	－	0.00
10	合计	7,210,236.83	3.19

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	108602	国开1704	71,090	7,209,236.90	3.19
2	128055	长青转2	10	999.93	0.00

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

无。

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

无。

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

无。

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC1904	IC1904	4	4,425,120.00	47,120.00	－
IC1906	IC1906	14	15,349,600.00	1,112,615.00	－
公允价值变动总额合计（元）					1,159,735.00
股指期货投资本期收益（元）					1,614,626.21
股指期货投资本期公允价值变动（元）					1,553,575.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货的主要目的是套期保值，力争使用股指期货有效调节产品的风险暴露，同时降低频繁交易股票带来的成本。本基金综合考虑不同合约的标的指数、期限和基差的情况并配置于流动性较好的合约。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响较小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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	3,020,195.86
2	应收证券清算款	131,866.95
3	应收股利	－
4	应收利息	1,969,367.43
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	5,121,430.24

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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	212,984,224.63
报告期期间基金总申购份额	－
减：报告期期间基金总赎回份额	－
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	212,984,224.63

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
2、《建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3、《建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
4、《建信量化优享定期开放灵活配置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4月19日