

## 建信社会责任混合型证券投资基金

## 2019年第一季度报告

资产配置方面,本基金一季度维持了积极的股票资产配置。报告期内,本基金重点投资了以下三个方面的公司:首先聚焦高质量增长企业中国未来经济发展的主线,重点投资了计算机、先进制造、电子、新材料、医药等新兴行业的龙头企业;其次,投资了受益于证券市场回暖的保险和券商的龙头企业;最后,配置了环保、建材等需求侧出现改善的公司。本基金重点投资了以上三个行业中积极履行社会责任的公司。

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26.27%,波动率1.64%,业绩比较基准收益率为21.28%,波动率1.16%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明  
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5亿元,未超过连续两个工作日。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。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	24,106,313.34	81.41
2	其中:股票	24,106,313.34	81.41
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	6,481,562.03	18.41
9	其中:应收股利	62,000.00	0.18
10	合计	30,587,875.37	100.00

## 5.2 报告期内基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,301,287.06	60.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,570,072.00	5.03
F	批发和零售业	17,204.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	272,030.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,366,027.88	12.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	432,000.00	1.53
L	租赁和商务服务业	180,193.00	0.63
M	科学研究和技术服务业	272,426.00	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	414,233.00	1.56
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	-	-
B	合计	24,106,313.34	84.08

## 5.1 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	95,562,000.00	92.09
2	其中:股票	96,363,000.00	92.09
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	6,960,478.44	6.70
9	其中:应收股利	100,347,267.08	93.81
10	合计	102,544,648.47	100.00

## 5.2 报告期内基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,473,504.20	4.36
B	采矿业	51,403,482.78	50.02
C	制造业	61,800,482.78	60.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,776,722.00	4.59
J	金融业	17,796,400.00	17.19
K	房地产业	6,776,062.24	6.59
L	租赁和商务服务业	1,012,702.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	6,776,062.24	6.59
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	-	-
B	合计	79,128,789.02	77.05

## 5.1 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	95,562,000.00	92.09
2	其中:股票	96,363,000.00	92.09
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	6,960,478.44	6.70
9	其中:应收股利	100,347,267.08	93.81
10	合计	102,544,648.47	100.00

## 5.2 报告期内基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,473,504.20	4.36
B	采矿业	51,403,482.78	50.02
C	制造业	61,800,482.78	60.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,776,722.00	4.59
J	金融业	17,796,400.00	17.19
K	房地产业	6,776,062.24	6.59
L	租赁和商务服务业	1,012,702.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	6,776,062.24	6.59
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	-	-
B	合计	79,128,789.02	77.05

## 5.1 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	95,562,000.00	92.09
2	其中:股票	96,363,000.00	92.09
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	6,960,478.44	6.70
9	其中:应收股利	100,347,267.08	93.81
10	合计	102,544,648.47	100.00

## 5.2 报告期内基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	21,070,048.20	4.87
B	采矿业	3,492,881.44	0.61
C	制造业	262,387,082.28	59.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,146,452.12	1.59
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,761,471.29	2.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,212,000.00	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,877,748.08	16.66
J	金融业	68,477,074.13	15.44
K	房地产业	4,990,324.89	1.11
L	租赁和商务服务业	-	-
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	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	-	-
B	合计	442,078,473.29	99.71

## 5.1 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	442,078,473.29	99.63
2	其中:股票	442,078,473.29	99.63
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	1,460,134.27	0.33
9	其中:应收股利	444,000,000.00	100.00
10	合计	443,538,607.56	100.00

## 5.2 报告期内基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	107,605,026	23.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,302.04	0.01
J	金融业	134,338.00	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	-	-
B	合计	276,071.28	0.06

## 5.1 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	442,078,473.29	99.63
2	其中:股票	442,078,473.29	99.63
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	1,460,134.27	0.33
9	其中:应收股利	444,000,000.00	100.00
10	合计	443,538,607.56	100.00

## 5.2 报告期内基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	107,605,026	23.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,302.04	0.01
J	金融业	134,338.00	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	-	-
B	合计	276,071.28	0.06

## 5.1 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	442,078,473.29	99.63
2	其中:股票	442,078,473.29	99.63
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	1,460,134.27	0.33
9	其中:应收股利	444,000,000.00	100.00
10	合计	443,538,607.56	100.00

## 5.2 报告期内基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	107,605,026	23.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,302.04	0.01
J	金融业	134,338.00	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	-	-
B	合计	276,071.28	0.06

## 5.1 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	442,078,473.29	99.63
2	其中:股票	442,078,473.29	99.63
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	1,460,134.27	0.33
9	其中:应收股利	444,000,000.00	100.00
10	合计	443,538,607.56	100.00

## 5.2 报告期内基金资产组合情况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	107,605,026	23.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,302.04	0.01
J	金融业	134,338.00	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	-	-
B	合计	276,071.28	0.06

## 5.1 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	442,078,473.29	99.63
2	其中:股票	442,078,473.29	99.63
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	金融衍生品投资	-</	