

信息披露 Disclosure

建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2019年第一季度报告

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《证券发行管理办法》、《证券投资基金管理人内部控制指导意见》、《证券投资基金公司证券投资管理指导意见》、《证券投资基金销售管理办法》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》、《公司范内公平交易管理制度》、《利益冲突管理办法》等风险管理制度。公司使用的交易系统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,确保在投资活动中公平对待不同投资资产,严禁直接或通过第三方交易安排存在利益

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
本基金绝大部分资产投资于深证基本面60ETF，因此基金的跟踪误差和偏离度主要取决于深证基本面60ETF的表现。此外，由于申赎造成的基金份额变动以及成份股的集中分红也会对本基金的跟踪误差和偏离度造成一定影响。在报告期内，基金跟踪误差和日均偏离度均被控制在基金合同约定的范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期深60ETF联接A净值增长率34.88%，波动率154%，深60ETF联接C净值增长率26.26%，波动率154%。业绩比较基准收益率为25.01%，波动率156%。

§5 投资组合报告

资产类别	项目	金额(元)	占基金总资产的占比(%)
1	权益投资	15,000,490.50	3.63
2	其中:股票	15,000,490.50	3.63
3	基金投资	300,964,797.00	69.89
4	固定收益投资	56,998,520	0.01
5	其中:债券	56,998,520	0.01
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	金融衍生品投资	-	-
9	买入返售金融资产	-	0.00
10	其中:买入返售金融资产中的买入返售金融资产	-	-
11	银行存款和结算备付金合计	2,076,204.13	0.48
12	其他资产	29,045,042.16	0.68

9	合计	434,961,458.67	100.00
---	----	----------------	--------

5.2 报告期末按行业分类的权益投资组合

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	779,520.00	0.18
B	医药生物	126,296.00	0.03
C	制造业	8,003,912.62	2.08
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	207,960.00	0.06
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	945,032.00	0.08
G	交通运输、仓储和 邮政业	51,080.00	0.01
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和 信息技术服务业	--	--
J	金融业	2,676,188.96	0.62
K	房地产业	2,476,728.00	0.58
L	租赁和商务服务业	150,810.00	0.04
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	居民服务、修理和 其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	--	--
R	文化、体育和娱乐	--	--
S	综合	--	--
合计		15,103,466.56	3.67

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。

建信收益增强债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

行节奏较去年同期显著加快。中美贸易谈判的持续推进也修正了市场对于宏观经济过度悲观的预期,有利于资本市场的情绪修复。物价水平方面,一季度CPI增速持续下行,但随着猪瘟疫情影响加剧,猪肉价格的上涨引发市场对未来通胀的担忧。国际方面,通过美联储议息会议的鸽派表态,联储后续停止加息成为市场的一致预期。随着美国国债收益率曲线的持续平坦化,美债波动加剧,美元兑人民币汇率也贬值至6.22的水平。

在此背景下,一季度债券市场表现较好的是3年以内的政策性金融债以及中低评级中期信用债,长久期利率债收益率区域震荡明显,10年国开债收益率相比于去年末64%的位置下行6BP到3.58%。权益市场随着风险偏好回升涨幅明显,沪深300指数单季涨幅达到28.62%,受正股驱动影响转债市场涨幅表现较强,中证转债指数一季度实现涨幅17.48%。

回顾一季度的基金管理工作,组合缩短债券久期并大幅增加权益类资产的持仓,跟随市场热点精选个股个券,积极操作,随着股票市场的持续上涨,获得较好的投资回报。

本报告期收益增强A净值增长率3.90%，波动率0.39%，收益增强C净值增长率3.79%，波动率0.38%；业绩比较基准收益率1.42%，波动率0.08%。

§5 投资组合报告

序号	资产名称	金额(元)	占基金资产的比重(%)
1	权益投资	39,387,626.66	13.37
2	其中:股票	39,387,626.66	13.37
3	基金投资	0.00	0.00
4	固定收益投资	248,064,310.52	82.46
5	其中:债券	248,064,310.52	82.46
6	资产支持证券	0.00	0.00
7	贵金属投资	0.00	0.00
8	其他金融资产投资	0.00	0.00
9	买入返售金融资产	0.00	0.00
10	其中:买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
11	银行存款和结算备付金合计	6,798,694.92	2.27
12	其他货币资金	5,653,660.67	1.89
13	其他资产	2,381,371.28	0.81

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	1,814,820.00	0.62
B	24" 工业	—	—
C	制造业	14,499,178.15	4.04
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	1,594,056.00	0.54
E	建筑业	1,795,548.00	0.50
F	批发和零售业	2,473,238.00	0.69
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	9,447,123.80	2.52
J	金融业	2,528,887.20	0.69
K	房地产业	2,510,088.00	0.69
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	3,263,285.00	1.11
O	居民服务、修理和 其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐 业	—	—
S	综合	—	—
合计		39,887,425.00	13.69

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。

5.3 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)	占合并资产净值比例
1	000061	格力电器	34,400	1,624,024.00	0.30
2	000002	万科 A	41,526	1,276,966.20	0.23
3	000001	平安银行	84,800	1,087,126.00	0.26
4	000333	美的集团	20,764	1,012,404.32	0.24
5	300498	温氏股份	19,200	779,120.00	0.15
6	000100	TCL 集团	156,200	630,112.00	0.18
7	000338	潍柴动力	48,000	548,800.00	0.13
8	000858	五粮液	5,600	522,000.00	0.12
9	000725	京东方 A	113,600	443,040.00	0.10
10	000676	新希 望	32,000	426,400.00	0.10

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	-	0.00
	其中:政策性金融债	-	0.00

4	正业股份	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00

6	申购净额	-	0.00
7	可转换(可交换债)	56,998.50	0.01
8	回购存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	56,998.50	0.01

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	128061	白明转债	570	56.99850	0.01
---	--------	------	-----	----------	------

56 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

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	------	-----	---------	--------------

		股票型	交易型开放	建信基金管	200.284	
--	--	-----	-------	-------	---------	--

4	1000000	数基金	式指数基金	佳竹投资有 限公司	750.00	1000000
---	---------	-----	-------	--------------	--------	---------

5.12 投资组合报告附注

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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。