建信信用增强债券型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	建信信用增强债券
场内简称	建信信用
基金主代码	165311
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月16日
报告期末基金份额总额	32,263,973.63份
投资目标	在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。 同时,在固定收益资产所提供的稳健收益基础上,适当参与新股发行中购及增发新股中购,为基金份额持有人增加收益,实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中债债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于中等风险基金产品。其预期风险和收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 由于主要投资于除国债、中央银行票据以外的信用类金融工具,因此本基金投资组合一定的信用风险,预期风险和收益水平高于一般的不涉及股票二级市场投资的债券型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信信用增强债券A / 建信信用增强债券C
下属分级基金的交易代码	165311 / 165314
报告期末下属分级基金的份额总额	26,865,551.84份 / 5,398,421.79份

§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)	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
	建信信用增强债券A	建信信用增强债券C
1.本期已实现收益	2,197,267.49	406,600.90
2.本期利润	2,909,156.16	533,579.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.1034	0.1004
4.期末基金资产净值	35,840,235.62	7,077,054.02
5.期末基金份额净值	1.334	1.311

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

建信信用增强债券A

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	8.37%	0.44%	1.11%	0.09%	7.26%	0.35%

建信信用增强债券C

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	8.26%	0.45%	1.11%	0.09%	7.15%	0.36%

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李峰	本基金的基金经理	2017年5月15日	-	12年	李峰先生,硕士。曾任清华紫光股份有限公司财务会计助理,2007年4月至2012年9月任华夏基金管理公司基金会计业务经理、风控高级经理,2012年9月至2015年6月任建信基金管理公司交易员、交易主管,2015年7月至2016年6月任银华基金管理公司询价研究主管,2016年6月起任建信基金管理助理,2017年5月15日起任建信信用增强债券型证券投资基金和建信稳定鑫利债券型证券投资基金的基金经理;2018年2月2日起任建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;2018年3月14日起任建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;2019年3月8日起任建信中短债纯债债券型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《建信信用增强债券型证券投资基金合同》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

一季度宏观经济运行平稳,随着社融数据的反弹以及中美贸易谈判的展开,市场对于经济增速大幅下滑的预期有所修复。投资方面,虽然新开工数据走弱,但在建安投资的拉动下,房地产投资1-2月维持11.6%高位;基建投资方面,随着地方债发行的提前与放量,基建投资将有效对冲制造业投资下行对经济的拖累。净出口方面,尽管市场对中美贸易谈判的结果较为乐观,但前期因抢出口带来的需求透支,导致2月份出口增速大幅下滑至-20.7%的低位。消费方面整体稳定,社会消费品零售总额的同比增速维持8.2%,与去年四季度基本持平。政策方面,一季度通过减税刺激内需,并持续改善民营企业的融资环境,引导"宽货币"向"宽信用"的传导。资金面在季度内整体宽松,央行通过定向降准以及TMLF操作释放流动性。通胀方面,一季度CPI仍处于2%以内的低位。但受猪瘟疫情影响,市场对于未来猪价推动CPI上涨预期较强,但对于猪价上涨的节奏以及幅度存在分歧,后续应持续跟踪猪价走势并确认对于通胀的冲击。国际方面,全球经济随着美国经济数据的不及预期或将进入其振式衰退。结合美联储对于加息的鸽派表述以及年内停止缩表的确认,各国央行陆续开启降息模式,国内货币政策的掣肘也将消除。受此影响,美元指数以及美股震荡加剧,人民币兑美元汇率持续升值。

在此背景下,一季度债券收益率震荡上行,收益率曲线有所陡峭化。一季度1年期国开债收益率上行5bp,而长端10年期收益率上行达10bp。信用债方面,随着社融增速的反弹以及企业债券融资的放量,违约风险得到有效缓释,其中短端信用利差有所收窄,中长端变化不大。权益市场方面,随着贸易摩擦的缓和,市场修复对宏观经济的悲观预期,叠加政策利好频出,权益市场表现较好,上证指数较去年年底大幅反弹。

回顾一季度的基金管理工作,组合维持信用债的票息策略结合可转债的交易策略,跟随市场热点精选个券、积极操作,随着季度内股票市场的持续上涨,获得较好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期信用增强A净值增长率8.37%,波动率0.44%,信用增强C净值增长率8.26%,波动率0.45%;业绩比较基准收益率1.11%,波动率0.09%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,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五千万元超过连续20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。

§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	791,925.48	1.62
	其中:股票	791,925.48	1.62
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	42,079,016.33	85.96
	其中:债券	42,079,016.33	85.96
	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	3,800,000.00	7.76
	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	903,782.73	1.85
8	其他资产	1,385,416.59	2.83
9	合计	48,960,141.13	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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	791,925.48	1.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
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	-	0.00
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	791,925.48	1.85

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	600031	三一重工	61,966	791,925.48	1.85

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	2,627,194.50	6.12
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	3,430,240.40	7.99
	其中:政策性金融债	2,404,240.40	5.60
4	企业债券	18,101,800.00	42.18
5	企业短期融资券	3,018,000.00	7.03
6	中期票据	6,041,100.00	14.08
7	可转债(可交换债)	8,860,681.43	20.65
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	42,079,016.33	98.05

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	155085	18紫光04	40,000	4,025,200.00	9.38
2	136449	16油服01	40,000	3,998,400.00	9.32
3	101751041	17汇金MTN001	30,000	3,087,600.00	7.19
4	143725	18光明01	30,000	3,066,600.00	7.15
5	041900001	19铜陵龙CP001	30,000	3,018,000.00	7.03

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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本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	7,026.93
2	应收证券清算款	807,638.28
3	应收股利	-
4	应收利息	568,531.39
5	应收申购款	2,219.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,385,416.59

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132009	17中油EB	1,284,959.00	2.99
2	113019	玖盈转债	876,647.20	2.04
3	123010	博世转债	776,734.14	1.81
4	123002	国祯转债	723,399.68	1.69
5	110031	航信转债	591,518.40	1.38
6	123015	蓝盾转债	418,917.50	0.98
7	113515	高能转债	415,263.60	0.97
8	123006	东财转债	396,306.71	0.92
9	113517	曙光转债	359,410.10	0.84
10	123012	万顺转债	311,542.93	0.73
11	110044	广电转债	19,316.40	0.05

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

项目	建信信用增强债券A	建信信用增强债券C
报告期期初基金份额总额	28,827,747.02	5,251,707.28
报告期期间基金总申购份额	309,630.01	436,920.16
减:报告期期间基金总赎回份额	2,271,825.19	290,206.65
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	26,865,551.84	5,398,421.79

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	6,967,513.07	-	200,000.00	6,767,513.07	20.98
产品持有风险							
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信用增强债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信信用增强债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信信用增强债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信信用增强债券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

建信兴利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	建信兴利灵活配置混合
基金主代码	002585
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月15日
报告期末基金份额总额	96,265,677.93份
投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理,在严格控制风险和保证本金安全的基础上,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金的资产包括风险资产和安全资产,本基金投资策略分为两个层次:一层为基金在风险资产和安全资产两大类资产上的配置策略;另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。
业绩比较基准	2年期银行定期存款收益率(税前)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属于证券投资基金中的中低风险品种。
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	6,030,176.40
2.本期利润	10,025,259.40
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0896
4.期末基金资产净值	109,538,089.24
5.期末基金份额净值	1.1379

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。

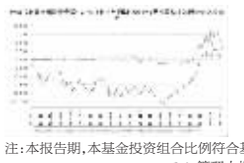
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	8.82%	1.10%	18.17%	1.00%	-9.35%	0.10%

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李菁	本基金的基金经理	2018年6月15日	-	16年	李菁女士,固定收益投资部总经理,硕士,2002年7月进入中国建设银行股份有限公司基金托管部工作,从事基金托管业务,任主任科员。2005年9月进入建信基金管理有限责任公司,历任债券研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、投资管理部副总监、固定收益投资部总监,2007年11月1日至2012年2月17日任建信货币市场基金的基金经理;2009年6月2日起任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理;2011年6月16日至2018年8月10日任建信信用增强债券型证券投资基金的基金经理;2016年2月4日起任建信安心保本五号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2018年2月10日起转型为建信弘利灵活配置混合型证券投资基金,李菁自2018年2月10日至2018年8月10日继续担任该基金的基金经理;2016年6月8日起任建信安心保本七号混合型证券投资基金的基金经理,该基金于2018年6月15日起转型为建信兴利灵活配置混合型证券投资基金,李菁继续担任该基金的基金经理;2016年11月16日起任建信恒瑞一年期开放债券型证券投资基金的基金经理;2017年5月26日起任建信瑞福添利混合型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《建信兴利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

今年一季度政策仍然延续去年下半年"稳增长、补短板"的基调,货币政策维持宽松并在1月份下调金融机构存款准备金率1个百分点,信贷和社融增速均有所反弹,同时地方债发行提前,一季度地方政府债累计发行14067亿元,2018年同期发行仅2195亿元,发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,但随着猪瘟疫情的影响加剧,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述,联储后续停止加息成为市场的一致判断。随着美国国债收益率曲线的持续平坦化,美股波动加剧,美元兑人民币汇率也贬值至6.72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的中期信用债,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3.64%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指数单季度涨幅达到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%,农业、非银、TMT和食品饮料行业的涨幅靠前。

回顾一季度的基金管理工作,组合1月份减持长久期利率债并增持高收益短融,在2月份将偏债的组合逐步调整成偏权益的组合结构,积极参与了农业、券商和部分5G主题行业股票,取得了较好的投资回报,但整体来说组合股票加仓的节奏晚于市场和同行。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率8.82%,波动率1.10%,业绩比较基准收益率18.17%,波动率1.00%。

§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	58,003,936.20	51.30
	其中:股票	58,003,936.20	51.30
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	41,411,092.23	36.62
	其中:债券	41,411,092.23	36.62
	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	10,032,994.67	8.87
8	其他资产	3,628,867.02	3.21
9	合计	113,076,890.12	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	4,489,596.00	4.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,927,456.30	20.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,005,235.00	0.92
E	建筑业	2,655,886.00	2.42
F	批发和零售业	1,391,764.00	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	1,366,926.00	1.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,036,106.90	9.16
J	金融业	3,188,355.00	2.91
K	房地产业	8,100,261.00	7.39
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	2,842,350.00	2.59
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	58,003,936.20	52.96

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	300232	洲明科技	228,320	3,260,409.60	2.98
2	601128	常熟银行	425,114	3,188,355.00	2.91
3	600383	金地集团	208,600	2,868,250.00	2.62
4	300388	国祯环保	270,700	2,842,350.00	2.59
5	000961	中南建设	298,300	2,833,850.00	2.59
6	600031	三一重工	215,035	2,748,147.30	2.51
7	300059	东方财富	130,897	2,536,783.86	2.32
8	603707	健友股份	61,350	2,238,048.00	2.04
9	002439	启明星辰	74,200	2,187,416.00	2.00
10	002714	牧原股份	31,200	1,975,272.00	1.80

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	6,195,619.50	5.66
	其中:政策性金融债	6,195,619.50	5.66
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)	35,215,472.73	32.15
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	41,411,092.23	37.81

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	61,950	6,195,619.50	5.66
2	110044	广电转债	25,000	4,024,250.00	3.67
3	128048	张行转债	32,400	3,829,032.00	3.50
4	123012	万顺转债	27,462	3,364,369.62	3.07
5	110050	佳都转债	19,680	2,679,670.50	2.45

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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	99,742.19
2	应收证券清算款	3,250,194.81
3	应收股利	-
4	应收利息	277,079.41
5	应收申购款	1,850.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,628,867.02

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110044	广电转债	4,024,250.00	3.67
2	123012	万顺转债	3,364,369.62	3.07
3	127005	长证转债	2,382,692.80	2.18
4	113013	国君转债	2,343,333.90	2.14
5	113517	曙光转债	1,916,019.00	1.75
6	128036	金宏转债	1,412,864.39	1.29
7	128030	天康转债	1,351,753.20	1.23
8	110040	生益转债	1,233,451.80	1.13
9	128016	雨虹转债	1,232,982.00	1.13
10	123002	国祯转债	1,152,426.80	1.05

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	126,393,090.65
报告期期间基金总申购份额	543,118.40
减:报告期期间基金总赎回份额	30,670,531.12
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	96,265,677.93

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兴利灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信兴利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信兴利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信兴利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

建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	建信央视50
场内简称	建信50
基金主代码