

## 建信优化配置混合型证券投资基金

### 2019年第一季度报告

产后周期和受特殊事件影响导致供给收缩的周期股行情；整个市场呈现多主线、多热点轮动的特征，交易量和交易金额也屡创新高。

本基金一季度主要布局在优质消费成长类公司，并顺应市场趋势，增加了部分具有核心技术和较高战略定位的科技公司的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率24.02%，波动率1.39%，业绩比较基准收益率17.23%，波动率0.90%。

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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,474,762,159.68	76.84
2	其中:股票	1,474,762,159.68	76.84
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	金融衍生品投资	-	0.00
7	买入返售金融资产	-	0.00
8	其中:买入返售金融资产	-	0.00
9	银行存款和结算备付金合计	462,392,346.19	23.16
10	其他资产	1,589,440,931.18	80.86

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	28,062,400.00	0.15
B	采矿业	17,069,688.00	0.06
C	制造业	862,444,120.04	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,332,170.00	1.76
E	建筑业	69,361,643.44	3.06
F	批发和零售业	26,561,310.60	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	31,094,540.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	507,762,251.10	26.85
J	金融业	124,343.00	0.01
K	房地产业	110,066,771.50	5.98
L	租赁和商务服务业	37,690,912.00	1.98
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	医药制造业、医药批发和零售业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生健康业	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
合计		1,474,762,159.68	77.87

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

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	28,062,400.00	0.15
B	采矿业	17,069,688.00	0.06
C	制造业	862,444,120.04	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,332,170.00	1.76
E	建筑业	69,361,643.44	3.06
F	批发和零售业	26,561,310.60	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	31,094,540.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	507,762,251.10	26.85
J	金融业	124,343.00	0.01
K	房地产业	110,066,771.50	5.98
L	租赁和商务服务业	37,690,912.00	1.98
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	医药制造业、医药批发和零售业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生健康业	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
合计		1,474,762,159.68	77.87

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

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	28,062,400.00	0.15
B	采矿业	17,069,688.00	0.06
C	制造业	862,444,120.04	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,332,170.00	1.76
E	建筑业	69,361,643.44	3.06
F	批发和零售业	26,561,310.60	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	31,094,540.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	507,762,251.10	26.85
J	金融业	124,343.00	0.01
K	房地产业	110,066,771.50	5.98
L	租赁和商务服务业	37,690,912.00	1.98
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	医药制造业、医药批发和零售业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生健康业	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
合计		1,474,762,159.68	77.87

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

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	28,062,400.00	0.15
B	采矿业	17,069,688.00	0.06
C	制造业	862,444,120.04	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,332,170.00	1.76
E	建筑业	69,361,643.44	3.06
F	批发和零售业	26,561,310.60	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	31,094,540.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	507,762,251.10	26.85
J	金融业	124,343.00	0.01
K	房地产业	110,066,771.50	5.98
L	租赁和商务服务业	37,690,912.00	1.98
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	医药制造业、医药批发和零售业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生健康业	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
合计		1,474,762,159.68	77.87

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

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	28,062,400.00	0.15
B	采矿业	17,069,688.00	0.06
C	制造业	862,444,120.04	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,332,170.00	1.76
E	建筑业	69,361,643.44	3.06
F	批发和零售业	26,561,310.60	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	31,094,540.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	507,762,251.10	26.85
J	金融业	124,343.00	0.01
K	房地产业	110,066,771.50	5.98
L	租赁和商务服务业	37,690,912.00	1.98
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	医药制造业、医药批发和零售业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生健康业	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
合计		1,474,762,159.68	77.87

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

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	28,062,400.00	0.15
B	采矿业	17,069,688.00	0.06
C	制造业	862,444,120.04	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,332,170.00	1.76
E	建筑业	69,361,643.44	3.06
F	批发和零售业	26,561,310.60	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	31,094,540.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	507,762,251.10	26.85
J	金融业	124,343.00	0.01
K	房地产业	110,066,771.50	5.98
L	租赁和商务服务业	37,690,912.00	1.98
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	医药制造业、医药批发和零售业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生健康业	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
合计		1,474,762,159.68	77.87

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

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	28,062,400.00	0.15
B	采矿业	17,069,688.00	0.06
C	制造业	862,444,120.04	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,332,170.00	1.76
E	建筑业	69,361,643.44	3.06
F	批发和零售业	26,561,310.60	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	31,094,540.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	507,762,251.10	26.85
J	金融业	124,343.00	0.01
K	房地产业	110,066,771.50	5.98
L	租赁和商务服务业	37,690,912.00	1.98
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	医药制造业、医药批发和零售业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生健康业	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
合计		1,474,762,159.68	77.87

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

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	28,062,400.00	0.15
B	采矿业	17,069,688.00	0.06
C	制造业	862,444,120.04	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,332,170.00	1.76
E	建筑业	69,361,643.44	3.06
F	批发和零售业	26,561,310.60	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	31,094,540.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	507,762,251.10	26.85
J	金融业	124,343.00	0.01
K	房地产业	110,066,771.50	5.98
L	租赁和商务服务业	37,690,912.00	1.98
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	医药制造业、医药批发和零售业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生健康业	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
合计		1,474,762,159.68	77.87

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

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	28,062,400.00	0.15
B	采矿业	17,069,688.00	0.06
C	制造业	862,444,120.04	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,332,170.00	1.76
E	建筑业	69,361,643.44	3.06
F	批发和零售业	26,561,310.60	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	31,094,540.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	507,762,251.10	26.85
J	金融业	124,343.00	0.01
K	房地产业	110,066,771.50	5.98
L	租赁和商务服务业	37,690,912.00	1.98
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	医药制造业、医药批发和零售业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生健康业	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
合计		1,474,762,159.68	77.87

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

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	28,062,400.00	0.15
B	采矿业	17,069,688.00	0.06
C	制造业	862,444,120.04	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,332,170.00	1.76
E	建筑业	69,361,643.44	3.06
F	批发和零售业	26,561,310.60	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	31,094,540.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	507,762,251.10	26.85
J	金融业	124,343.00	0.01
K	房地产业	110,066,771.50	5.98
L	租赁和商务服务业	37,690,912.00	1.98
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	医药制造业、医药批发和零售业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生健康业	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
合计		1,474,762,159.68	77.87

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

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	28,062,400.00	0.15
B	采矿业	17,069,688.00	0.06
C	制造业	862,444,120.04	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,332,170.00	1.76
E	建筑业	69,361,643.44	3.06
F	批发和零售业	26,561,310.60	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	31,094,540.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	507,762,251.10	26.85
J	金融业	124,343.00	0.01
K	房地产业	110,066,771.50	5.98
L	租赁和商务服务业	37,690,912.00	1.98
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	医药制造业、医药批发和零售业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生健康业	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
合计		1,474,762,159.68	77.87

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

J	金融业	13,135,725.00	3.57
K	房地产业	14,795,300.00	4.02