建信中小盘先锋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:招商证券股份有限公司
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。

基金托管人招商证券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	建信中小盘先锋股票
基金主代码	000729
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月19日
报告期末基金份额总额	150,864,095.01份
投资目标	本基金主要投资于具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票，在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期,进而对未来做出科学预测。 在此基础上,结合对流动性及资金流向的分析,综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。 此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	85%×中证500指数收益率+15%×中债综合全价(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金,混合型基金,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

§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	15,889,859.01
2.本期利润	46,650,126.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.3076
4.期末基金资产净值	209,154,628.45
5.期末基金份额净值	1.386

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。

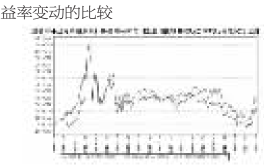
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	28.45%	1.69%	27.75%	1.45%	0.70%	0.24%

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		
许杰	本基金的基金经理	2017年3月22日	–	17年	许杰先生,权益投资部副总经理,硕士,特许金融分析师(CFA)。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员,2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司,历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职,2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理;2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理;2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011年10月加入我公司,2012年3月21日至2017年1月24日任建信恒稳价值混合型证券投资基金的基金经理;2012年8月14日起任建信社会责任混合型证券投资基金的基金经理;2014年9月10日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的基金经理;2015年2月3日起任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年5月26日起任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2017年3月22日起任建信中小盘先锋股票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,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《建信中小盘先锋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

报告期内全球经济仍然存在下行压力，尽管美国的经济指标显示其经济仍处于繁荣状态,但自2月份开始欧洲和日本的制造业PMI指数已经跌落至荣枯线以下。与此相对应的是,中国经济开始出现一些改善的迹象,PMI指数3月份回升至荣枯线以上,PMI新订单指标2月和月3逐月回升;统计局公布的2月份消费者信心指数创了历史新高。

今年以来股票市场大涨,原因主要来自于风险偏好的提升,以及对经济企稳的预期。去年经济下行压力加大,政府采取了多项稳经济稳预期的政策,包括坚定民营企业家的信心、多次降准、调整金融去杠杆的节奏、加大基建投资力度等,这些政策在今年逐渐显现成果。代表无风险利率的10年期国债收益率今年以来持续处于较低的水平。1月份开始社会融资规模恢复正增长,信用利差逐级下行。在无风险利率持续下降到了较低的水平,同时信用扩张得以实现的阶段,风险偏好提升,流动性推动股市上涨，对经济企稳的预期也一定程度上改善了对上市公司业绩的预期。

报告期内,本基金主要投资了以下三个方面的中小盘公司:首先围绕高质量增长这条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、医药等创新类行业中成长潜力大的公司;另外,配置了汽车零部件、环保、建材等需求侧出现改善同时自身竞争力强的周期成长公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率28.45%,波动率1.69%,业绩比较基准收益率27.75%,波动率1.45%。

§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	180,454,399.71	85.20
	其中:股票	180,454,399.71	85.20
2	基金投资	–	0.00
3	固定收益投资	–	0.00
	其中:债券	–	0.00
	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	30,188,836.05	14.25
8	其他资产	1,160,402.60	0.55
9	合计	211,803,638.36	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	2,038,224.50	0.97
C	制造业	140,809,384.97	67.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	0.00
E	建筑业	6,649,543.00	3.18
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	15,203,744.00	7.27
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	9,551,371.24	4.57
N	水利、环境和公共设施管理业	6,202,132.00	2.97
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	180,454,399.71	86.28

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	002384	东山精密	745,150	14,150,398.50	6.77
2	300316	晶盛机电	590,869	8,473,061.46	4.05
3	002920	德赛西威	278,997	8,060,223.33	3.85
4	300274	阳光电源	707,135	7,771,413.65	3.72
5	601966	玲珑轮胎	428,629	7,625,309.91	3.65
6	300134	大富科技	462,400	6,977,616.00	3.34
7	603496	恒为科技	218,000	6,912,780.00	3.31
8	002632	道明光学	772,012	6,685,623.92	3.20
9	600970	中材国际	864,700	6,649,543.00	3.18
10	002009	天奇股份	602,900	6,547,494.00	3.13

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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	358,060.42
2	应收证券清算款	611,305.01
3	应收股利	–
4	应收利息	13,832.15
5	应收申购款	177,205.02
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,160,402.60

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	152,116,274.10
报告期期间基金总申购份额	9,028,940.86
减:报告期期间基金总赎回份额	10,281,119.95
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	150,864,095.01

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中小盘先锋股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信中小盘先锋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

建信中证500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	建信中证500指数增强	
基金主代码	000478	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年1月27日	
报告期末基金份额总额	3,050,785,050.98份	
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的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500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,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。 在资产配置策略方面,本基金以追求基金资产收益长期增长为目标,根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。 本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段,严格将跟踪误差控制在规定范围内,控制与标的指数主动偏离的风险。 本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标,同时根据需要进行积极操作,以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值,控制组合风险,达到在有效跟踪标的指数的基础上,力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。	
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×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	
下属分级基金的基金简称	建信中证500指数增强A	建信中证500指数增强C
下属分级基金的交易代码	000478	005633
报告期末下属分级基金的份额总额	2,740,175,506.46份	310,609,544.52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)
	建信中证500指数增强A	建信中证500指数增强C
1.本期已实现收益	385,567,031.00	50,729,977.95
2.本期利润	1,128,398,759.11	217,317,500.73
3. 加权平均基金份额本期利润	0.4983	0.5342
4.期末基金资产净值	5,799,575,868.01	653,747,405.57
5.期末基金份额净值	2.1165	2.1047

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

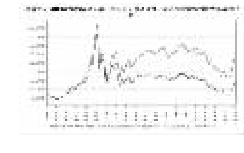
建信中证500指数增强A

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	31.08%	1.55%	31.27%	1.63%	–0.19%	–0.08%

建信中证500指数增强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	30.89%	1.55%	31.27%	1.63%	–0.38%	–0.08%

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		
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	2014年1月27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

在本报告期内,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《建信中证500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。本基金从成立以来一直坚持保持与标的指数极为相近的行业分布和风格选择,只在个股选择上进行了一定的主动暴露。由于基金规模相对较大,基金管理人采用分散持仓、算法交易等方式尽量降低交易成本,同时对风险事件进行实时监控,以尽量避免踩雷风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信中证500A净值增长率31.08%，波动率1.55%，建信中证500C净值增长率30.89%,波动率1.55%;业绩比较基准收益率31.27%,波动率1.63%。

§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	5,401,865,597.65	82.98
	其中:股票	5,401,865,597.65	82.98
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	2,446,065.94	0.04
	其中:债券	2,446,065.94	0.04
	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	994,947,804.42	15.28
8	其他资产	110,804,543.77	1.70
9	合计	6,510,064,011.78	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	43,623,793.94	0.68
B	采矿业	129,898,285.62	2.01
C	制造业	2,028,403,771.85	31.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	131,735,537.73	2.04
E	建筑业	31,551,984.76	0.49
F	批发和零售业	163,754,336.18	2.54
G	交通运输、仓储和邮政业	246,785,269.03	3.82
H	住宿和餐饮业	27,739,892.15	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	297,678,883.67	4.61
J	金融业	168,305,338.33	2.61
K	房地产业	303,526,768.14	4.70
L	租赁和商务服务业	121,149,371.64	1.88
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	15,562,464.18	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	5,194,538.70	0.08
R	文化、体育和娱乐业	103,732,803.38	1.61
S	综合	89,884,698.74	1.39
	合计	3,908,527,738.04	60.57

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	38,130,747.63	0.59
B	采矿业	34,095,147.36	0.53
C	制造业	845,806,933.64	13.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,187,067.15	0.93
E	建筑业	57,172,440.37	0.89
F	批发和零售业	47,663,743.92	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	44,491,200.46	0.69
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	112,727,325.51	1.75
J	金融业	41,439,502.70	0.64
K	房地产业	56,252,136.89	0.87
L	租赁和商务服务业	20,438,316.80	0.32
M	科学研究和技术服务业	13,926,142.85	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	36,168,509.67	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	7,123,320.40	0.11
P	教育	1,038,312.00	0.02
Q	卫生和社会工作	10,377,106.50	0.16
R	文化、体育和娱乐业	60,480,456.47	0.94
S	综合	5,819,449.29	0.09
	合计	1,493,337,859.61	23.14

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	000656	金科股份	11,255,220	82,163,106.00	1.27
2	600673	东阳光科	6,341,231	58,466,149.82	0.91
3	603885	吉祥航空	3,950,057	58,342,341.89	0.90
4	601872	招商轮船	11,908,285	58,112,430.80	0.90
5	000061	农产品	8,655,755	51,847,972.45	0.80
6	600079	人福医药	4,507,792	51,478,984.64	0.80
7	601880	大连港	20,550,900	51,171,741.00	0.79
8	002013	中航机电	6,290,670	50,451,173.40	0.78
9	000600	建投能源	6,115,720	49,048,074.40	0.76
10	002344	海宁皮城	8,743,535	48,614,054.60	0.75

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	002075	沙钢股份	5,199,610	51,944,103.90	0.80
2	601138	工业富联	2,343,558	32,880,118.74	0.51
3	603516	淳中科技	1,085,715	30,356,591.40	0.47
4	601118	海南橡胶	5,261,785	29,308,142.45	0.45
5	002303	美盈森	4,762,700	28,338,065.00	0.44

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	央行票据	–	–
3	金融债券	10,113.00	0.00
	其中:政策性金融债	10,113.00	0.00
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)	2,435,952.94	0.04
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	2,446,065.94	0.04

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	110053	苏银转债	11,690	1,168,974.38	0.02
2	127012	招路转债	7,000	699,992.33	0.01
3	128059	视源转债	1,600	159,997.19	0.00
4	128061	启明转债	1,260	125,996.69	0.00
5	123023	迪森转债	1,160	115,996.95	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	490	542,077,200.00	13,424,209.19	–
IC1906	IC1906	12	13,156,800.00	244,720.00	–
IC1905	IC1905	3	3,307,680.00	18,120.00	–
公允价值变动总额合计(元)					13,687,049.19
股指期货投资本期收益(元)					23,635,542.40
股指期货投资本期公允价值变动(元)					16,996,351.33

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	85,885,095.02
2	应收证券清算款	574,548.34
3	应收股利	–
4	应收利息	221,246.51
5	应收申购款	24,123,653.90
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	110,804,543.77

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 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 报告期末积极投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	公司名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601138	工业富联	32,880,118.74	0.51	非公开发行

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	建信中证500指数增强A	建信中证500指数增强C
报告期期初基金份额总额	2,019,321,342.80	383,575,717.72
报告期期间基金总申购份额	1,192,524,048.69	105,225,643.45
减:报告期期间基金总赎回份额	471,669,885.03	178,191,816.65
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	2,740,175,506.46	310,609,544.52

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中证500指数增强型证券投资基金设立的文件;

2、《建信中证500指数增强型证券投资基金基金合同》;

3、《建信中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信中证500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。

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

建信中证1000指数增强型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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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	建信中证1000指数增强	
基金主代码	006165	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年11月22日	
报告期末基金份额总额	28,062,340.46份	
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在对标的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1000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7.75%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。 在资产配置策略方面,本基金以追求基金资产收益长期增长为目标,根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。 本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段,严格将跟踪误差控制在规定范围内,控制与标的指数主动偏离的风险。 本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标,同时根据需要进行积极操作,以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值,控制组合风险,达到在有效跟踪标的指数的基础上,力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中证1000指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。	
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、债券型基金、混合型基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金A	建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金C
下属分级基金的交易代码	006165	006166
报告期末下属分级基金的份额总额	19,670,800.76份	8,391,539.70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)
	建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金A	建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金C
1.本期已实现收益	3,889,225.15	1,352,147.59
2.本期利润	5,537,550.89	1,766,196.05
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2813	0.2640
4.期末基金资产净值	25,358,179.32	10,785,801.10
5.期末基金份额净值	1.2891	1.2853

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

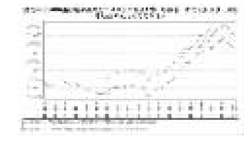
建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金A

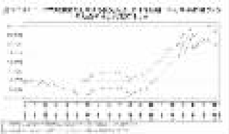
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	28.50%	1.59%	31.59%	1.71%	–3.09%	–0.12%

建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金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	28.44%	1.59%	31.59%	1.71%	–3.15%	–0.12%

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11月22日生效,截至报告期末仍处于建仓期。

§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		
赵云煜	本基金的基金经理	2018年11月22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11月22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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信中证1000指数增强型发起式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,本基金逐步建仓并正常开展投资运作。本基金为指数增强型基金,主要通过以建信多因子模型为主的量化选股模型进行个股选择，同时严格管理股票组合和基准之间的相对风险。总体来说,基金组合保持与基准指数相似的行业和风格配置,在保持一定的成分股比例下,主动超配或减配了部分个股品种。报告期间,权益市场涨幅明显,本基金前期表现稍落后基准指数,后期超额收益有所修复。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信中证1000A净值增长率28.50%,波动率1.59%,建信中证1000C净值增长率28.44%,波动率1.59%;业绩比较基准收益率31.59%,波动率1.71%。

§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	33,545,339.61	90.63
	其中:股票	33,545,339.61	90.63
2	基金投资	–	0.00
3	固定收益投资	–	0.00
	其中:债券	–	0.00
	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	3,231,290.17	8.73
8	其他资产	236,125.90	0.64
9	合计	37,012,755.68	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	191,548.00	0.53
B	采矿业	1,209,184.00	3.35
C	制造业	17,380,408.37	48.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	373,684.00	1.03
E	建筑业	684,205.00	1.89
F	批发和零售业	720,689.20	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	832,962.00	2.30
H	住宿和餐饮业	–	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,508,265.92	6.94
J	金融业	–	0.00
K	房地产业	1,251,361.00	3.46
L	租赁和商务服务业	143,670.00	0.40
M	科学研究和技术服务业	429,143.00	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	346,859.00	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	–	0.00
P	教育	273,331.08	0.76
Q	卫生和社会工作	213,774.00	0.59
R	文化、体育和娱乐业	427,747.00	1.18
S	综合	191,701.00	0.53
	合计	27,178,532.57	75.20

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	173,092.00	0.48
B	采矿业	–	0.00
C	制造业	2,650,922.88	7.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	660,263.00	1.83
E	建筑业	222,954.00	0.62
F	批发和零售业	133,821.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	363,592.00	1.01
H	住宿和餐饮业	–	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	523,401.00	1.45
J	金融业	60,902.16	0.17
K	房地产业	384,258.00	1.06
L	租赁和商务服务业	416,233.00	1.15
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	205,412.00	0.57
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	571,956.00	1.58
S	综合	–	0.00
	合计	6,366,807.04	17.62

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	603599	广信股份	42,500	674,900.00	1.87
2	601500	通用股份	82,000	654,360.00	1.81
3	300363	博腾股份	46,400	517,360.00	1.43
4	603277	银都股份	48,700	515,246.00	1.43
5	600129	太极集团	45,600	506,616.00	1.40
6	603636	南威软件	36,600	503,250.00	1.39
7	601069	西部黄金	33,200	478,744.00	1.32
8	601369	陕鼓动力	67,100	448,228.00	1.24
9	000631	顺发恒业	115,900	421,876.00	1.17
10	000828	东莞控股	43,700	420,394.00	1.16

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	600578	京能电力	141,500	474,025.00	1.31
2	601999	出版传媒	50,400	332,640.00	0.92
3	300656	民德电子	11,600	283,620.00	0.78
4	603516	淳中科技	9,200	257,232.00	0.71
5	600317	营口港	81,900	248,976.00	0.69

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，江苏通用科技股份有限公司（601500）于2019年1月23日发布公告,2018年12月07日17时30分左右,该公司位于江苏省无锡市锡山区东港镇的4号轮胎仓库发生火灾事故,被立案调查。

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	24,076.24
2	应收证券清算款	58,511.41
3	应收股利	–
4	应收利息	1,519.48
5	应收申购款	152,018.77
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	236,125.90

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 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 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

项目	建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金A	建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金C
报告期期初基金份额总额	19,936,918.37	9,433,210.52
报告期期间基金总申购份额	10,957,722.68	7,935,334.55
减:报告期期间基金总赎回份额	11,223,840.29	8,977,005.37
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	19,670,800.76	8,391,539.70

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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	35.63

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	35.63	10,000,000.00	35.63	3年
基金管理人高级管理人员	–	–	–	–	–
基金经理等人员	–	–	–	–	–
基金管理人股东	–	–	–	–	–
其他	–	–	–	–	–
合计	10,000,000.00	35.63	10,000,000.00	35.63	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	10,000,000.00	–	–	10,000,000.00	35.63
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。							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金设立的文件;

2、《建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》;

3、《建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》;

4、《建信中证1000指数增强型发起式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。

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

10.3 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