

建信创新中国混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

相结合,通过寻找和筛选个股的基本面变化,力争实现超额收益。二季度投资基本遵循了组合仓位,结构上偏向内资。到二季度末,组合在仓位和结构上进行了部分调整,增加了消费板块的配置比例。

4.5 报告期内基金的投资表现
本报告期末基金净值增长率3.73%,波动率1.22%,业绩比较基准收益率-0.67%,波动率1.14%。

§ 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	100,962,739.61	89.79
2	其中:股票	100,962,739.61	89.79
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	贵金属投资	-	0.00
7	买入返售金融资产	-	0.00
8	银行存款和结算备付金合计	16,444,220.04	13.97
9	其他资产	274,361.13	0.25
合计		117,671,320.79	100.00

5.2 报告期末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	-	-
B	采矿业	72,696.26	0.06
C	制造业	48,336,711.62	41.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,286,184.80	7.19
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	8,900,019.04	7.73
J	金融业	17,280,676.00	14.99
K	房地产业	8,343,030.30	7.24
L	租赁和商务服务业	9,702,428.00	8.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	文化、体育和娱乐业	-	-
O	综合	23,106.60	0.02
合计		100,962,739.61	89.79

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	600519	贵州茅台	10,301	10,726,588.00	9.30
2	601318	中国平安	119,700	10,606,617.00	9.29
3	601398	工商银行	1,133,100	6,673,269.00	5.79
4	002123	梦洁集团	438,762	6,194,056.28	5.37
5	603899	天润股份	221,407	6,228,708.00	5.35
6	601898	中国铝业	61,300	5,487,426.00	4.76
7	300828	亿嘉和	44,223	4,734,166.61	4.11
8	002127	南极电商	376,000	4,218,000.00	3.66
9	000651	格力电器	73,800	4,069,000.00	3.52
10	000688	五粮液	33,800	3,989,710.00	3.46

5.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	国债	-	-
B	地方政府债	-	-
C	金融债	-	-
D	企业债	-	-
E	央行票据	-	-
F	中期票据	-	-
G	短期融资券	-	-
H	超短期融资券	-	-
I	资产支持证券	-	-
J	债券回购	-	-
K	银行存款	-	-
L	其他	-	-
合计		-	-

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十名资产支持证券投资明细

序号	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	建信安盈1号	-	-
2	建信安盈2号	-	-
3	建信安盈3号	-	-
4	建信安盈4号	-	-
5	建信安盈5号	-	-
6	建信安盈6号	-	-
7	建信安盈7号	-	-
8	建信安盈8号	-	-
9	建信安盈9号	-	-
10	建信安盈10号	-	-

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五名贵金属投资明细

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债券投资明细

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 投资品种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。

5.11.2 报告期内基金投资的前十名证券的发行人主体未被监管部门立案调查和在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.3 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.4 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.5 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.6 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.7 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.8 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.9 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.10 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.11 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.12 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.13 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.14 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.15 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.16 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.17 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.18 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.19 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.20 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.21 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.22 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.23 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.24 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.25 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.26 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.27 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.28 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.29 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.30 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.31 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.32 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.33 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.34 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.35 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.36 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.37 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.38 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.39 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.40 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.41 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

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7月17日

§ 1 重要提示
基金管理人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7月15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。

本报告中期财务资料未经审计。
本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	建信创新中国混合
基金代码	000808
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年09月24日
报告期末基金份额总额	41,922,295.61份

投资目标
本基金为完全复制标的指数,追求基金资产的长期增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

投资策略
本基金采取被动式投资策略,主动的资产配置策略,本基金根据各项重要的经济指标和宏观经济政策变动趋势,判断当前所处的经济周期,进而对未预期到的市场波动进行及时调整。

业绩比较基准
75%×沪深300指数收益率+25%×中国国债收益率。

风险收益特征
本基金属于完全复制型证券投资基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中低风险收益特征的基金。

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

主要财务指标	报告期2019年4月1日至2019年6月30日
1.本期已实现收益	6,360,719.26
2.本期利润	4,220,628.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0105
4.期末基金资产净值	115,279,073.61
5.期末基金份额净值	2.760

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 本基金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	3.73%	1.22%	-0.67%	1.14%	4.40%	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

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国银河证券股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17日

§ 1 重要提示
基金管理人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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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。

本报告中期财务资料未经审计。
本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	建信创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	159966
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018年02月01日
报告期末基金份额总额	80,376,674.00份

投资目标
紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

投资策略
本基金为完全复制型指数基金,采用完全复制法,即按照成份股在标的指数中的权重进行配置,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为标的指数,即创业板指数收益率。

风险收益特征
本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于证券投资基金中的高风险品种,其预期收益及预期风险水平要高于其他证券投资基金。

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国银河证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期2019年4月1日至2019年6月30日
1.本期已实现收益	724,200.19
2.本期利润	-6,390,037.17
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0868
4.期末基金资产净值	69,416,997.60
5.期末基金份额净值	0.8634

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 本基金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	-0.79%	1.91%	-10.75%	1.86%	0.96%	-0.04%

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

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国银河证券股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17日

§ 1 重要提示
基金管理人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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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。

本报告中期财务资料未经审计。
本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	建信创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	159966
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018-02-01
报告期末基金份额总额	80,376,674.00份

投资目标
紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

投资策略
本基金为完全复制型指数基金,采用完全复制法,即按照成份股在标的指数中的权重进行配置,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为标的指数,即创业板指数收益率。

风险收益特征
本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于证券投资基金中的高风险品种,其预期收益及预期风险水平要高于其他证券投资基金。

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国银河证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期2019年4月1日至2019年6月30日
1.本期已实现收益	1,136,269.02
2.本期利润	-2,030,028.46
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0191
4.期末基金资产净值	19,780,484.30
5.期末基金份额净值	0.9227

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 本基金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	-0.83%	1.79%	-10.13%	1.85%	0.79%	-0.07%

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

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国银河证券股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17日

§ 1 重要提示
基金管理人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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月15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。

建信创新中国混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

相结合,通过寻找和筛选个股的基本面变化,力争实现超额收益。二季度投资基本遵循了组合仓位,结构上偏向内资。到二季度末,组合在仓位和结构上进行了部分调整,增加了消费板块的配置比例。

4.5 报告期内基金的投资表现
本报告期末基金净值增长率3.73%,波动率1.22%,业绩比较基准收益率-0.67%,波动率1.14%。

§ 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	100,962,739.61	