建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人光大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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信量化优享定期开放灵活配置混合
基金主代码	004546
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年8月24日
报告期末基金份额总额	212,984,224.63份
投资目标	本基金在严格控制风险并保持资产流动性的前提下,充分利用量化投资策略,力争为投资者提供持续、稳定的回报。
投资策略	封闭期运作期内,本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;然后,进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略五个部分组成。开放运作期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。
业绩比较基准	50%*中证500指数收益率+50%*中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高预期收益/预期风险特征的基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§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4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	2,255,671.56
2.本期利润	-5,190,367.07
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0244
4.期末基金资产净值	221,081,762.71
5.期末基金份额净值	1.0380

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。

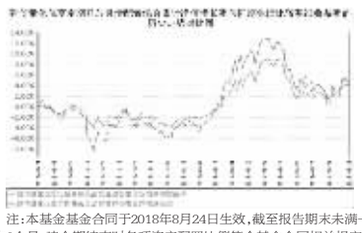
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-2.30%	0.80%	-4.99%	0.89%	2.69%	-0.09%

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:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§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16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总经理,本基金的基金经理	2018年8月24日	-	11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20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《建信量化优享定期开放灵活配置混合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

本报告期内未出现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。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期间,本基金投资运作稳定。本基金的核心策略为量化资产配置模型。报告期间,权益市场震荡明显,小幅收跌,本基金严格按照模型进行权益资产的配置。具体来说,权益资产部分,本基金主要通过精选股票组合和股指期货的方式灵活跟踪业绩基准中证500指数。固定收益配置方面,本基金综合考虑投资操作空间,潜在收益、流动性以及利率波动,同时配置了久期相对较短的政策性金融债品种、货币市场工具以及银行存款。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率-2.30%,波动率0.80%,业绩比较基准收益率-4.99%,波动率0.89%。

§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	108,154,682.11	48.63
	其中:股票	108,154,682.11	48.63
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	9,201,000.90	4.14
	其中:债券	9,201,000.90	4.14
	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	60,900,000.00	27.38
	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	40,762,011.05	18.33
8	其他资产	3,393,881.44	1.53
9	合计	222,411,575.50	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	1,866,917.00	0.84
B	采矿业	6,018,659.87	2.72
C	制造业	51,430,000.34	23.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,130,530.60	2.32
E	建筑业	2,523,257.00	1.14
F	批发和零售业	5,929,430.00	2.68
G	交通运输、仓储和邮政业	8,431,302.00	3.81
H	住宿和餐饮业	2,164,737.00	0.98
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,109,025.76	3.22
J	金融业	5,001,154.94	2.26
K	房地产业	5,023,940.00	2.27
L	租赁和商务服务业	977,030.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	234,036.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	397,250.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	884,940.00	0.40
R	文化、体育和娱乐业	4,833,427.60	2.19
S	综合	199,044.00	0.09
	合计	108,154,682.11	48.92

注:以上行业分类以2019年6月30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	601666	平煤股份	508,700	2,126,366.00	0.96
2	601021	春秋航空	46,100	2,074,500.00	0.94
3	601933	永辉超市	201,900	2,061,399.00	0.93
4	000999	华润三九	69,800	2,047,932.00	0.93
5	000524	岭南控股	244,500	2,046,465.00	0.93
6	600611	大众交通	430,600	2,002,290.00	0.91
7	600764	中国海防	71,660	1,997,880.80	0.90
8	600497	驰宏锌锗	389,300	1,977,644.00	0.89
9	601900	南方传媒	206,450	1,961,275.00	0.89
10	600887	伊利股份	53,300	1,780,753.00	0.81

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	9,201,000.90	4.16
	其中:政策性金融债	9,201,000.90	4.16
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,201,000.90	4.16

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	108602	国开1704	91,090	9,201,000.90	4.16

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
IC1907	IC1907	20	19,625,600.00	651,840.00	-
IF1907	IF1907	-14	-15,981,000.00	-696,960.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-45,120.00
股指期货投资本期收益(元)					-625,567.48
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-1,204,856.00

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的主要目的是套期保值,力争灵活使用股指期货的多头和空头仓位有效调节产品的风险暴露,同时降低频繁交易股票带来的成本。本基金综合考虑不同合约的标的指数、期限和基差的情况并配置于流动性较好的合约。本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响较小,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	2,400,555.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	993,326.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,393,881.44

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	212,984,224.63
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	212,984,224.63

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量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信量化优享定期开放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7月17日

建信龙头企业股票型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信龙头企业股票
基金主代码	005259
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年1月24日
报告期末基金份额总额	345,974,363.82份
投资目标	在严格控制风险的前提下,积极挖掘A股市场和港股市场(通过港股通)所蕴含的投资机会,重点投资沪港深股票市场各细分行业中的龙头公司,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	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,力争获得与所承担的风险相匹配的收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×20%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	9,483,885.79
2.本期利润	7,213,470.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0203
4.期末基金资产净值	349,792,988.23
5.期末基金份额净值	1.0110

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。

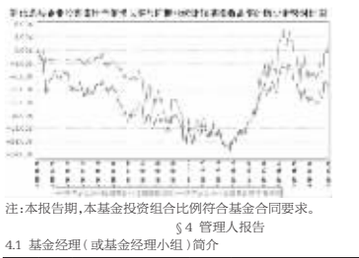
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.61%	1.60%	-0.48%	1.05%	2.09%	0.55%

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		
刘克飞	本基金的基金经理	2018年3月6日	-	7年	刘克飞先生,硕士。2012年6月毕业于中国人民大学金融工程专业,同年7月加入建信基金,历任助理研究员、初级研究员、研究员、研究部总经理助理。2018年3月6日起任建信龙头企业股票型证券投资基金的基金经理。
姚锦	权益投资部总经理,本基金的基金经理	2018年1月24日	-	15年	姚锦女士,权益投资部总经理,博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师,2004年5月至2011年5月任天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职,2009年3月17日至2011年3月3日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理;2009年12月17日至2011年5月5日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理。历任建信基金管理公司研究部首席策略分析师、权益投资部副总经理兼研究部首席策略分析师、权益投资部总经理。2012年2月17日起任建信优选成长混合型证券投资基金的基金经理;2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任股票型证券投资基金的基金经理;2014年1月20日起任建信保本混合型证券投资基金的基金经理,该基金于1月23日起转型为建信积极配置混合型证券投资基金。姚锦继续担任该基金的基金经理;2017年6月9日至2018年9月12日任建信核心精选混合型证券投资基金的基金经理;2018年1月24日起任建信龙头企业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,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《建信龙头企业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

本报告期内未出现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。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

市场方面,二季度A股整体、沪深300指数、创业板指数分别下跌4.6%、下跌1.2%、下跌10.8%,H股恒生指数下跌1.8%,比上个季度有所回调。其中食品饮料、餐饮旅游、银行、家电涨幅居前,传媒、轻工、基础化工等跌幅较大。板块表现的原因包括,消费品零售维持景气、中美贸易谈判遇冷、经济稳增长力度减弱等。

报告期内,本基金遵循行业景气、个股优质、估值合理的配置思路,致力于选取具有持续成长性的公司,提高组合表现的稳定性。

报告期内,股票仓位保持中性水平。持仓结构以消费类为主,降低周期、非银类比例,适当增加银行比例。重点配置方向包括白酒、家电、医药、银行、地产、免税、超市、体育等。其中免税、白酒、医药、超市、家电取得超额收益,地产表现平淡。6月以来,全球流动性趋于宽松、中美贸易谈判有所缓和、科创板首批公司开始询价,本基金将及时挖掘研究、不断优化组合,力求为持有人获取长期稳定回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率1.61%,波动率1.60%,业绩比较基准收益率-0.48%,波动率1.05%。

§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	297,157,927.35	84.35
	其中:股票	297,157,927.35	84.35
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	54,221,264.65	15.39
8	其他资产	902,593.59	0.26
9	合计	352,281,785.60	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	-	-
B	采矿业	193,038.35	0.06
C	制造业	170,717,661.85	48.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	15,381,079.12	4.40
G	交通运输、仓储和邮政业	3,470,828.46	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,787,035.81	0.51
J	金融业	34,921,044.94	9.98
K	房地产业	21,682,908.00	6.20
L	租赁和商务服务业	16,456,631.40	4.70
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、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	264,633,334.53	75.65

注:以上行业分类以2019年6月30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

行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
Materials材料	-	0.00
Consumer Discretionary非日常生活消费品	14,677,259.05	4.20
Consumer Staples日常消费品	7,519,228.12	2.15
Energy能源	-	0.00
Financials金融	-	0.00
Health Care医疗保健	-	0.00
Industrials工业	8,684,214.64	2.48
Information Technology信息技术	-	0.00
Telecommunication Services通讯服务	1,643,891.01	0.47
Utilities公用事业	-	0.00
Real Estate房地产	-	0.00
合计	32,524,592.82	9.30

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	000858	五粮液	276,100	32,801,895.00	9.38
2	601398	工商银行	4,713,100	27,760,159.00	7.94
3	000333	美的集团	528,690	27,417,863.40	7.84
4	000651	格力电器	431,793	23,748,615.00	6.79
5	000661	长春高新	67,500	22,815,000.00	6.52
6	000961	中南建设	2,503,800	21,682,908.00	6.20
7	601888	中国国旅	185,636	16,456,631.40	4.70
8	601933	永辉超市	1,506,472	15,381,079.12	4.40
9	300760	迈瑞医疗	94,199	15,373,276.80	4.39
10	02020	安踏体育	311,000	14,677,259.05	4.20

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	651,630.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	231,200.00
4	应收利息	9,383.40
5	应收申购款	10,379.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	902,593.59

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	405,142,901.54
报告期期间基金总申购份额	24,373,152.68
减:报告期期间基金总赎回份额	83,541,690.40
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	345,974,363.82

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龙头企业股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信龙头企业股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信龙头企业股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信龙头企业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7月17日

建信内生动力混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信内生动力混合
基金主代码	530011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月16日
报告期末基金份额总额	165,892,317.84份
投资目标	在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,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	本基金将采取积极、主动的资产配置策略,重点投资于消费性内生动力行业、投资性内生动力行业、服务性内生动力行业中具有持续竞争力优势的上市公司股票,力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为:75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,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,属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	13,003,328.72
2.本期利润	-4,458,790.95
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0265
4.期末基金资产净值	245,331,867.74
5.期末基金份额净值	1.479

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	-2.25%	1.53%	-0.67%	1.14%	-1.58%	0.39%

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		
吴尚伟	权益投资部总经理,本基金的基金经理	2014年11月25日	-	13年	吴尚伟先生,硕士,权益投资部联席投资官。2004年9月至2007年4月任长城伟业期货经纪有限公司深圳分公司投资顾问;2008年8月至2011年7月任银华基金管理公司研究员;2011年7月加入我公司,历任研究员、研究主管、研究部总监助理、权益投资部基金经理兼研究部总经理助理、权益投资部基金经理、权益投资部联席投资官,2014年11月25日起任建信内生动力混合型证券投资基金的基金经理,自2018年2月28日起该产品变更注册为建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金,吴尚伟继续担任该基金的基金经理;2018年1月30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,吴尚伟继续担任该基金的基金经理。

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《建信内生动力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