建信双月安心理财债券型证券投资基金

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:招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。

基金托管人招商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	建信双月安心理财	
基金主代码	530029	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月29日	
报告期末基金份额总额	8,068,794,438.54份	
投资目标	严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报,并力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金通过积极主动的组合管理,充分运用各种短期投资工具,力争为持有人创造低风险基础上的投资收益。 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)	
风险收益特征	本基金属于债券基金,长期风险收益水平低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信双月安心理财A	建信双月安心理财B
下属分级基金的交易代码	530029	531029
报告期末下属分级基金的份额总额	63,149,946.77份	7,995,644,491.77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4月1日－2019年6月30日)	报告期(2019年4月1日－2019年6月30日)
	建信双月安心理财A	建信双月安心理财B
1. 本期已实现收益	414,319.86	57,038,587.12
2.本期利润	414,319.86	57,038,587.12
3. 期末基金资产净值	63,149,946.77	7,995,644,491.77

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(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加入本期公允价值变动收益,由于该基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

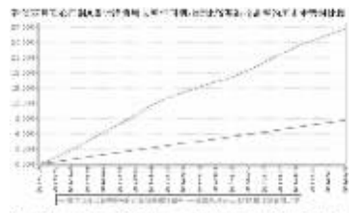
建信双月安心理财A

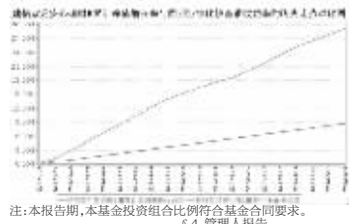
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6262%	0.0002%	0.3366%	0.0000%	0.2896%	0.0002%

建信双月安心理财B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6990%	0.0002%	0.3366%	0.0000%	0.3624%	0.0002%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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		
刘思	本基金的基金经理	2018年3月26日	－	10年	刘思女士,硕士。2009年5月加入建信基金管理公司,历任助理交易员、初级交易员、交易员、交易主管、基金经理助理、基金经理。2016年7月19日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月8日至2018年1月15日任建信睿享纯债债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月22日至2017年8月31日建信恒丰纯债债券型证券投资基金的基金经理;2016年11月25日起任建信睿源纯债债券型证券投资基金的基金经理;2017年8月9日起任建信中证政策性金融债1-3年指数证券投资基金(LOF)、建信中证政策性金融债8-10年指数证券投资基金(LOF)的基金经理;2017年8月9日至2018年4月11日任建信中证政策性金融债3-5年指数证券投资基金(LOF)基金经理;2017年8月16日至2018年4月11日任建信中证政策性金融债5-8年指数证券投资基金(LOF);2017年8月16日至2018年5月31日任建信睿源纯债债券型证券投资基金的基金经理;2018年3月26日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2019年3月25日起任建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理;2019年4月26日起任建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理;2019年4月26日起任建信睿兴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

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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信双月安心理财债券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

今年2季度以来,全球贸易、投资、工业生产等活动放缓态势更加明显,保护主义、单边主义和逆全球化对全球经济活动的干扰加大,主要经济体都面临程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸谈判、英国脱欧推迟、美国经济衰退风险、美联储货币政策转向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定产生较大影响。美国经济虽仍然相对强劲,但非农就业增速放缓,长短期国债收益率出现倒挂,经济放缓趋势明显,美联储已停止加息,并将于9月停止缩表。发达国家的货币政策普遍宽松,部分新兴经济体出现金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

国内方面、整体而言,2季度经济增速相比1季度增速放缓。二季度消费增速有所下行,特别是4月份社会消费品零售总额同比出现大幅下滑。制造业投资也有所疲乏,在消费与建安工程投资均有所回落的情况下,6月制造业投资缺乏动力。综合起来,预计6月固定资产投资增速从5.6%下行至5.4%。此外,4-5月工业增加值同比数据继续回落,显示工业生产依然疲弱。5月份工业增加值增速继续回落至5%(4月为5.4%),PMI生产指数也出现小幅回落。6月份PMI生产指数进一步下行至51.3(5月为51.7),显示6月工业生产依然偏弱。5月工业企业利润有所反弹,可能是减税效果显现,但利润到投资之间存在传导时滞,年内制造业投资仍将维持低位。工业产出可能稍有好转,但是地产开工需求出现进一步走弱迹象,下游制造需求仍然不佳,周期大概率旺季不旺。地产销售增速继续探底,汽车销售跌幅重新扩大。

随着制造业投资、房地产投资、消费、出口数据的恶化,基本面下行压力较大,保基建的重要性逐渐提升。6月初,中共中央办公厅、国务院办公厅印发了《关于做好地方政府专项债券发行及项目配套融资工作的通知》,此文件在基建基调,地方债使用,城投定位这三大方面做出了调整,文件目的清晰而明确。而减税降负和隐性债务的控制又在负债端使得地方政府无法施展,因而继续扩大政府负债是有迫切需求的。

债券收益率在2季度出现波动较大,4月,随着金融数据进一步企稳,降准预期落空,其他主要经济数据超预期,利率债和信用债利率均出现快速上行,长久期、高等级上行幅度最多,仅有1年期以内的各等级仍保存了年初以来的涨幅。但到了5月,贸易摩擦再度升级,国内工业生产和投资超预期回落,后期包商银行事件又引发市场风险情绪迅转,收益率重新掉头向下。截至季末,整个收益率曲线从高点已经大幅平坦化回落20-60bp。

5月下旬,个别金融机构的风险事件突然爆发,对非银结构化产品流动性冲击较大,债券的评级利差急速走扩,导致低评级的存单和信用债的市场需求迅速萎缩。随后几天,各评级同业存单发行成功率均有所降低,中小银行同业存单发行困难。6月初,事件冲击对AAA评级存单的影响消退,后续央行为平稳市场情绪,也通过多种方式来投放资金,才把中小银行相关的同业收缩带来的流动性缺口补上。但是,AA及以下评级存单的影响却愈演愈烈,发行成功率一直保持下降的趋势,中小银行融资渠道受阻,对同业链条造成了明显的冲击,流动性传导阻滞在中小银行向大行融资的这一环节,结构性分层现象较为明显。

今年地方债额度的提前下放,利率债发行节奏也提前,上半年供给规模大于往年。5月份财政部发布做好地方政府债券发行工作的意见,意见指出要6月底前完成提前下达新增地方债券额度的发行,争取在9月底前完成全年新增地方债券发行。为配合债券发行,国内整个货币政策进一步宽松应该是确定的,同时从趋势上看,不管是海外的经济数据、货币政策变化,还是考虑内部的经济数据和结构的变化,也都需要宽松的货币环境。从人民币汇率上看,二季度人民币汇率先贬后升,6月末美元中间价收于6.8747,较一季度末贬值2.1%。

综上所述,本基金在2019年二季度保持了一贯稳健的投资风格,由于此基金已经申报转型待审批,所以维持了中性的久期,在收益高点重点配置了9月内的优质债券和存单。截至季末时点,业绩表现良好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A净值收益率0.6262%,波动率0.0002%,本基金B净值收益率0.6990%,波动率0.0002%;业绩比较基准收益率0.3366%,波动率0.0000%。

§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	固定收益投资	8,076,741,203.22	98.37
	其中:债券	8,076,741,203.22	98.37
	资产支持证券	－	－
2	买入返售金融资产	100,000,000.00	1.22
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	－	－
3	银行存款和结算备付金合计	24,992,712.52	0.30
4	其他资产	9,176,986.15	0.11
5	合计	8,210,910,901.89	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.33
	其中:买断式回购融资	－

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	150,299,654.55	1.87
	其中:买断式回购融资	－	－

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

无。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	74
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	74

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

无。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	12.70	1.87
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
2	30天(含)—60天	35.74	－
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
3	60天(含)—90天	11.10	－
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
4	90天(含)—120天	33.47	－
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
5	120天(含)—397天(含)	8.76	－
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
合计		101.77	1.87

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

无。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	479,975,878.59	5.96
	其中:政策性金融债	479,975,878.59	5.96
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	回购存单	7,596,765,324.63	94.27
8	其他	－	－
9	合计	8,076,741,203.22	100.22
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	－	－

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111909097	19浦发银行CD097	9,000,000	892,998,946.86	11.08
2	111918137	19恒夏银行CD137	8,500,000	847,574,487.28	10.52
3	111910018	19兴业银行CD018	6,000,000	594,527,343.46	7.38
4	111908061	19中信银行CD061	5,000,000	495,760,013.54	6.15
5	111811311	18平安银行CD311	4,700,000	468,374,143.50	5.81
6	111918117	19恒夏银行CD117	4,500,000	446,464,951.24	5.54
7	111809325	18浦发银行CD325	4,000,000	399,353,234.42	4.96
8	111908033	19中信银行CD033	4,000,000	397,705,233.10	4.94
9	111907018	19招商银行CD018	3,500,000	348,488,839.38	4.32
10	111918138	19恒夏银行CD138	3,000,000	299,148,796.35	3.71

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	－
报告期内偏离度的最高值	0.1067%
报告期内偏离度的最低值	-0.0420%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0267%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

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十名资产支持证券投资明细

无。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	9,176,986.15
4	应收申购款	－
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	9,176,986.15

5.9.4 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	建信双月安心理财A	建信双月安心理财B
报告期期初基金份额总额	72,074,637.66	8,189,686,990.01
报告期期间基金总申购份额	414,319.86	57,038,587.12
报告期期间基金总赎回份额	9,339,010.75	251,081,085.36
报告期期末基金份额总额	63,149,946.77	7,995,644,491.77

注:上述总申购份额含红利再投资份额。

§7 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04月01日－2019年06月30日	8,169,767,383.17	58,363,667.82	250,000,000.00	7,978,131,050.99	99.00
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。							

注:本基金本报告期申购份额中包含了收益结转份额。

§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双月安心理财债券型证券投资基金设立的文件;
2、《建信双月安心理财债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信双月安心理财债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信双月安心理财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7月17日

建信双利策略主题分级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:招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。

基金托管人招商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	建信双利分级股票	
场内简称	建信双利	
基金主代码	165310	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年5月6日	
报告期末基金份额总额	75,878,508.33份	
投资目标	本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司,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	本基金将通过自上而下的方式,通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析,深入挖掘上述趋势可以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题,在前述主题筛选和主题配置的基础上,本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具,采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。	
风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。 从本基金所分离的两类基金份额来看,建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额;建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信双利分级股票	建信稳健	建信进取
下属分级基金的场内简称	建信双利	建信稳健	建信进取
下属分级基金的交易代码	165310	150036	150037
报告期末下属分级基金的份额总额	73,509,296.33份	947,684.00份	1,421,528.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。	建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额。	建信进取份额将表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。

§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04月01日－2019年06月30日)
1.本期已实现收益	562,797.47
2.本期利润	686,726.83
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0090
4. 期末基金资产净值	114,862,835.33
5. 期末基金份额净值	1.514

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

建信双月安心理财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	0.61%	0.09%	-0.33%	0.13%	0.94%	-0.04%

建信双月安心理财B

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	0.46%	0.09%	-0.33%	0.13%	0.79%	-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

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		
梁洪昀	金工及数量总监、融资总部总经理、基金经理	2015年3月25日	－	16年	梁洪昀先生,金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师(CFA),博士。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司,历任金融工程研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月1日起任建信沪深300指数证券投资基金(LOF)的基金经理;2010年5月28日至2012年5月28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;2011年9月8日至2016年7月20日任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金(ETF)及其联接基金的基金经理;2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金的基金经理;2015年3月25日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理;2015年7月31日至2018年7月31日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理;2015年8月6日至2016年10月25日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理;2018年2月6日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2018年2月7日起任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年4月19日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2018年5月16日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;2018年6月13日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

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《建信双利策略主题分级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

报告期内,受国际经济政治因素影响,A股市场冲高回落,出现了较明显的波动。

本基金按照基金合同规定,保持了90%以上的仓位,并进行了比较均衡的行业配置和适度分散的持股,同时辅以新股申购等其他策略,努力增厚投资收益。管理人在总结此前经验教训的基础上,对组合进行了适当调整,相对于业绩比较基准的超额收益得到了一定的修复。管理人将继续努力吸收投研团队的研究成果,通过更为精细的个股选择策略,力争进一步提升基金收益水平。

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0.53%,波动率1.46%,业绩比较基准收益率-1.11%,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	107,057,760.25	91.29
	其中:股票	107,057,760.25	91.29
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	10,175,743.53	8.68
8	其他资产	42,421.79	0.04
9	合计	117,275,925.57	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	1,938,060.00	1.69
B	采矿业	3,639,411.55	3.17
C	制造业	41,936,875.55	36.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,545,640.00	3.09
E	建筑业	3,393,257.70	2.95
F	批发和零售业	456,183.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	3,918,751.64	3.41
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,811,528.00	1.58
J	金融业	38,570,692.36	33.58
K	房地产业	3,688,615.00	3.21
L	租赁和商务服务业	2,664,686.85	2.32
M	科学研究和技术服务业	356,391.00	0.31
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	133,770.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	708,737.60	0.62
S	综合	295,160.00	0.26
	合计	107,057,760.25	93.20

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沪港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	601318	中国平安	121,534	10,769,127.74	9.38
2	600519	贵州茅台	5,700	5,608,800.00	4.88
3	601166	兴业银行	225,792	4,129,735.68	3.60
4	600030	中信证券	170,300	4,054,843.00	3.53
5	000776	广发证券	200,500	2,754,870.00	2.40
6	601211	国泰君安	140,240	2,573,404.00	2.24
7	600606	绿地控股	369,900	2,526,417.00	2.20
8	601857	中国石油	354,100	2,436,208.00	2.12
9	601888	中国国旅	26,309	2,332,292.85	2.03
10	000858	五粮液	19,600	2,311,820.00	2.01

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	35,126.66
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	2,116.79
5	应收申购款	5,178.34
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	42,421.79

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

项目	建信双利分级股票	建信稳健	建信进取
报告期期初基金份额总额	76,683,363.94	1,011,428.00	1,517,144.00
报告期期间基金总申购份额	1,342,965.42	－	－
减:报告期期间基金总赎回份额	4,676,393.03	－	－
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	159,360.00	-63,744.00	-95,616.00
报告期期末基金份额总额	73,509,296.33	947,684.00	1,421,528.00

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双利策略主题分级股票型证券投资基金设立的文件;
2、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》;
3、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信双利策略主题分级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

建信双息红利债券型证券投资基金

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