建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金

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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
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。

基金托管人中国邮政储蓄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	建信中债1-3年国开行债券指数	
基金主代码	007026	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年3月25日	
报告期末基金份额总额	2,099,171,243.09份	
投资目标	本基金通过指数化投资,争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。	
投资策略	本基金为指数基金,主要采用抽样复制和动态最优化的方法,投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。	
业绩比较基准	中债1-3年国开行债券指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%	
风险收益特征	本基金为债券型指数基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。 本基金为指数型基金,主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数,以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信中债1-3年国开行债券指数A	建信中债1-3年国开行债券指数C
下属分级基金的交易代码	007026	007027
报告期末下属分级基金的份额总额	2,098,620,631.09份	550,612.00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)
	建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金A	建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金C
1.本期已实现收益	16,714,563.90	2,552.37
2.本期利润	21,968,190.27	3,297.83
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0093	0.0091
4.期末基金资产净值	2,119,918,119.60	556,060.64
5.期末基金份额净值	1.0101	1.0099

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上本期公允价值变动收益。

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

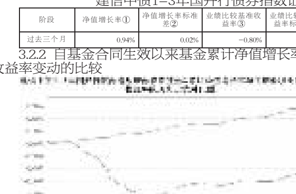
建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金A

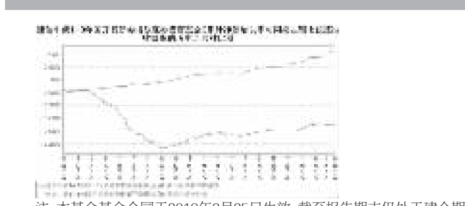
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.96%	0.02%	-0.80%	0.07%	1.76%	-0.05%

建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金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	0.94%	0.02%	-0.80%	0.07%	1.74%	-0.05%

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2019年3月25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		
刘思	本基金的基金经理	2019年3月25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3日任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日起任建信睿富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日起任建信睿兴纯债债券型证券投资基金的基金经理。
闫晗	本基金的基金经理	2019年3月25日	-	6年	闫晗先生,硕士。2012年10月至今历任建信基金管理公司交易员、交易主管、基金经理助理,2017年11月3日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理,该基金在2018年9月19日转型为建信睿怡纯债债券型证券投资基金,闫晗继续担任该基金的基金经理;2018年4月20日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2018年4月20日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理,该基金自2019年4月25日转型为建信安心回报6个月定期开放债券型证券投资基金,闫晗继续担任该基金的基金经理;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30日起任建信中债3-5年国开行债券指数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《建信中债1-3年国开行债券指数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。政策导向上,6月10日,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季度里波动较大。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逆转,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%。

本指数基金在今年3月底成立,追踪标的是"中债1-3年国开行债券指数"。建仓初期主要关注指数组合中的标的券,在收益高点逐步建仓。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净值增长率0.96%,波动率0.02%,本报告期本基金C净值增长率0.94%,波动率0.02%;业绩比较基准收益率-0.80%,波动率0.07%。

§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	-	0.00
	其中:股票	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	1,963,356,874.70	88.26
	其中:债券	1,963,356,874.70	88.26
	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	163,000,000.00	7.33
	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	60,918,041.66	2.74
8	其他资产	37,249,458.99	1.67
9	合计	2,224,524,375.35	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

无。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

无。

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

无。

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

无。

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	1,963,356,874.70	92.59
	其中:政策性金融债	1,963,356,874.70	92.59
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	1,963,356,874.70	92.59

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	180212	18国开12	5,040,000	509,644,800.00	24.03
2	180208	18国开08	4,000,000	407,040,000.00	19.20
3	190202	19国开02	2,700,000	269,109,000.00	12.69
4	180204	18国开04	2,000,000	208,980,000.00	9.86
5	108604	国开1805	1,997,910	202,128,554.70	9.53

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

基金投资的前十名证券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	17,409.73
2	应收证券清算款	3,135,116.82
3	应收股利	-
4	应收利息	33,881,763.99
5	应收申购款	215,168.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,249,458.99

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

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	建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金A	建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金C
报告期期初基金份额总额	3,100,204,359.67	151,140.36
报告期期间基金总申购份额	198,529,717.50	961,994.63
减:报告期期间基金总赎回份额	1,200,113,446.08	562,522.99
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	2,098,620,631.09	550,612.00

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 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05月07日-2019年06月30日	499,999,000.00	-	-	499,999,000.00	23.82
机构	2	2019年05月07日-2019年05月09日	499,999,000.00	-	499,999,000.00	0.00	0.00
机构	3	2019年05月07日-2019年06月30日	499,999,000.00	-	-	499,999,000.00	23.82
产品	1	2019年05月07日-2019年06月30日	500,021,500.00	-	-	500,021,500.00	23.82
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。							

§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中债1-3年国开行债券指数证券投资基金设立的文件;

2、《建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金合同》;

3、《建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金招募说明书》;

4、《建信中债1-3年国开行债券指数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

建信中债3-5年国开行债券指数证券投资基金

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:上海银行股份有限公司
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。

基金托管人上海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30日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信中债3-5年国开行债券指数	
基金主代码	007094	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年4月30日	
报告期末基金份额总额	850,700,381.14份	
投资目标	本基金通过指数化投资,争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。	
投资策略	本基金为指数基金,主要采用抽样复制和动态最优化的方法,投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。	
业绩比较基准	中债3-5年国开行债券指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%	
风险收益特征	本基金为债券型指数基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。 本基金为指数型基金,主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数,以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信中债3-5国开行债券指数A	建信中债3-5国开行债券指数C
下属分级基金的交易代码	007094	007095
报告期末下属分级基金的份额总额	850,310,103.21份	390,277.93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30日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年4月30日 - 2019年6月30日)
	建信中债3-5国开行债券指数A	建信中债3-5国开行债券指数C
1.本期已实现收益	5,076,515.61	1,067.22
2.本期利润	9,382,015.21	1,943.97
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0082	0.0091
4.期末基金资产净值	857,557,418.98	393,537.66
5.期末基金份额净值	1.0085	1.0084

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上本期公允价值变动收益。

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

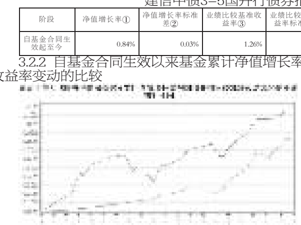
建信中债3-5国开行债券指数A

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
自基金合同生效起至今	0.85%	0.03%	1.26%	0.07%	-0.41%	-0.04%

建信中债3-5国开行债券指数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
自基金合同生效起至今	0.84%	0.03%	1.26%	0.07%	-0.42%	-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:本基金基金合同于2019年4月30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		
闫晗	本基金的基金经理	2019年4月30日	-	6年	闫晗先生,硕士。2012年10月至今历任建信基金管理公司交易员、交易主管、基金经理助理,2017年11月3日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理,该基金在2018年9月19日转型为建信睿怡纯债债券型证券投资基金,闫晗继续担任该基金的基金经理;2018年4月20日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理;2018年4月20日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理,该基金自2019年4月25日转型为建信安心回报6个月定期开放债券型证券投资基金,闫晗继续担任该基金的基金经理;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30日起任建信中债3-5年国开行债券指数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《建信中债3-5年国开行债券指数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,世界经济下行风险加大。

国内方面,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。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。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。政策导向上,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。

债券收益率在2季度里波动较大。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。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逆转,收益率重新掉头向下。

5月下旬,包商银行事件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。非银面临着较大的去杠杆的压力,融资成本显著抬升。后续央行为平稳市场情绪,通过多种方式来投放资金,市场情绪才得以缓和。

本指数基金在今年4月底成立,追踪标的是"中债3-5年国开行债券指数"。建仓初期主要关注指数标的中的成分券,按照成分券权重逐步建仓,截止季末时点,组合与追踪标的指数拟合状况良好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A净值增长率0.85%,波动率0.03%,本报告期本基金C净值增长率0.84%,波动率0.03%;业绩比较基准收益率1.26%,波动率0.07%。

§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	-	0.00
	其中:股票	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	932,599,108.84	91.84
	其中:债券	932,599,108.84	91.84
	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	65,755,353.67	6.48
8	其他资产	17,078,938.51	1.68
9	合计	1,015,433,401.02	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

无。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

无。

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

无。

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

无。

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	932,599,108.84	108.70
	其中:政策性金融债	932,599,108.84	108.70
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	932,599,108.84	108.70

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	180204	18国开04	4,300,000	449,307,000.00	52.37
2	180211	18国开11	2,600,000	263,120,000.00	30.67
3	190203	19国开03	1,300,000	129,168,000.00	15.06
4	190402	19农发02	500,000	49,915,000.00	5.82
5	190202	19国开02	300,000	29,901,000.00	3.49

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

基金投资的前十名证券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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,943,500.57
5	应收申购款	135,437.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,078,938.51

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

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	建信中债3-5国开行债券指数A	建信中债3-5国开行债券指数C
报告期期初基金份额总额	1,200,260,224.82	201,624.37
报告期期间基金总申购份额	48,998.38	195,372.92
减:报告期期间基金总赎回份额	349,999,119.99	6,719.36
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	850,310,103.21	390,277.93

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 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

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06月21日-2019年06月30日	-	199,999,000.00	-	199,999,000.00	23.51
机构	2	2019年04月30日-2019年06月20日	-	349,999,000.00	349,999,000.00	0.00	0.00
机构	3	2019年04月30日-2019年06月30日	-	349,999,000.00	-	349,999,000.00	41.14
机构	4	2019年04月30日-2019年06月30日	-	299,999,000.00	-	299,999,000.00	35.26
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。							

§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中债3-5年国开行债券指数证券投资基金设立的文件;

2、《建信中债3-5年国开行债券指数证券投资基金基金合同》;

3、《建信中债3-5年国开行债券指数证券投资基金招募说明书》;

4、《建信中债3-5年国开行债券指数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

建信中证500指数增强型证券投资基金

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	3,061,267,050.41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	本基金为股票型指数增强型基金,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	2,954,182,136.62份	107,084,913.79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	142,905,028.04	12,083,786.88
2.本期利润	-472,484,338.35	-12,429,791.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1655	-0.0811
4.期末基金资产净值	5,744,163,631.07	206,784,005.94
5.期末基金份额净值	1.9444	1.9310

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上本期公允价值变动收益。

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

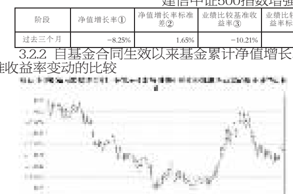
建信中证500指数增强A

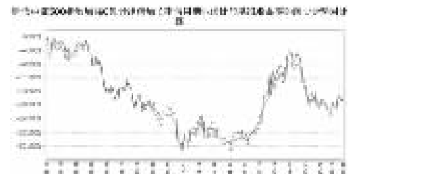
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.13%	1.64%	-10.21%	1.72%	2.08%	-0.08%

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	-8.25%	1.65%	-10.21%	1.72%	1.96%	-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





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	-	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

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严格控制与标的指数的行业偏离和风格偏离,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

本报告期本基金A净值增长率-8.13%,波动率1.64%,本报告期本基金C净值增长率-8.25%,波动率1.65%;业绩比较基准收益率-10.21%,波动率1.72%。

§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	5,304,389,978.89	88.29
	其中:股票	5,304,389,978.89	88.29
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	10,117.00	0.00
	其中:债券	10,117.00	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	669,359,036.56	11.14
8	其他资产	34,103,750.03	0.57
9	合计	6,007,862,882.48	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	39,049,279.32	0.66
B	采矿业	204,927,072.45	3.44
C	制造业	2,131,827,306.74	35.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	153,734,736.96	2.58
E	建筑业	61,151,820.34	1.03
F	批发和零售业	186,797,167.60	3.14
G	交通运输、仓储和邮政业	142,275,870.65	2.39
H	住宿和餐饮业	18,247,768.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	423,113,057.45	7.11
J	金融业	239,738,924.20	4.03
K	房地产业	193,509,612.05	3.25
L	租赁和商务服务业	72,549,122.42	1.22
M	科学研究和技术服务业	1,912,755.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	21,850,374.00	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	14,126,247.80	0.24
Q	卫生和社会工作	3,065,214.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	121,363,860.48	2.04
S	综合	63,977,638.29	1.08
	合计	4,093,217,827.75	68.78

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	1,187,901.00	0.02
B	采矿业	13,918,563.25	0.23
C	制造业	744,050,434.59	12.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,979,603.00	0.32
E	建筑业	4,408,420.00	0.07
F	批发和零售业	35,310,056.80	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	73,190,946.89	1.23
H	住宿和餐饮业	6,831,594.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	86,963,274.02	1.46
J	金融业	84,778,518.49	1.42
K	房地产业	49,550,745.86	0.83
L	租赁和商务服务业	24,834,157.41	0.42
M	科学研究和技术服务业	19,765,203.01	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	2,064,840.10	0.03
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	15,812,540.10	0.27
R	文化、体育和娱乐业	27,174,672.62	0.46
S	综合	2,350,680.00	0.04
	合计	1,211,172,151.14	20.35

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。

5.2.3 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	000027	深圳能源	10,130,226	62,807,401.20	1.06
2	000623	吉林敖东	3,736,623	61,243,250.97	1.03
3	300088	长信科技	10,185,978	51,541,048.68	0.87
4	000999	华润三九	1,628,442	47,778,488.28	0.80
5	002797	第一创业	7,236,800	45,881,312.00	0.77
6	000156	华数传媒	3,926,429	43,229,983.29	0.73
7	000997	新大陆	2,544,302	42,973,260.78	0.72
8	601717	郑煤机	6,661,987	38,039,945.77	0.64
9	002299	圣农发展	1,492,776	37,797,088.32	0.63
10	002500	山西证券	4,651,040	37,673,424.00	0.63

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	000596	古井贡酒	305,531	36,208,478.81	0.61
2	601166	兴业银行	1,815,779	33,210,597.91	0.56
3	600012	皖通高速	4,709,526	29,811,299.58	0.50
4	000895	双汇发展	1,043,100	25,962,759.00	0.44
5	000059	华锦股份	4,052,400	25,935,360.00	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	10,117.00	0.00
	其中:政策性金融债	10,117.00	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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,117.00	0.00

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	108604	国开1805	100	10,117.00	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
IC1907	IC1907	165	161,911,200.00	3,609,902.74	-
公允价值变动总额合计(元)					3,609,902.74
股指期货投资本期收益(元)					-26,255,671.88
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-10,077,146.45

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	22,463,715.88
2	应收证券清算款	335,642.91
3	应收股利	-
4	应收利息	176,649.62
5	应收申购款	11,127,741.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,103,750.03

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

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	2,740,175,506.46	310,609,544.52
报告期期间基金总申购份额	695,467,310.41	38,465,985.08
减:报告期期间基金总赎回份额	481,460,680.25	241,990,615.81
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	2,954,182,136.62	107,084,913.79

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7月17日