建信周盈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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	建信周盈安心理财	
基金主代码	530030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年9月17日	
报告期末基金份额总额	373,294,870.22份	
投资目标	在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127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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信周盈安心理财A	建信周盈安心理财B
下属分级基金的交易代码	530030	531030
报告期末下属分级基金的份额总额	363,995,019.55份	9,299,850.67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)
	建信周盈安心理财A	建信周盈安心理财B
1.本期已实现收益	2,864,189.40	104,293.83
2.本期利润	2,864,189.40	104,293.83
3. 期末基金资产净值	363,995,019.55	9,299,850.67

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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

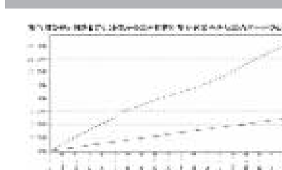
建信周盈安心理财A

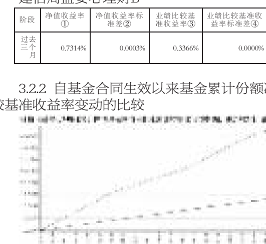
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6583%	0.0003%	0.3366%	0.0000%	0.3217%	0.0003%

建信周盈安心理财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	0.7314%	0.0003%	0.3366%	0.0000%	0.3948%	0.0003%

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		
先轲宇	本基金的基金经理	2018年3月26日	-	7年	先轲宇先生,硕士。2009年7月至2016年5月在中国建设银行金融市场部工作,曾从事绩效管理,2012年起任债券交易员。2016年7月加入我公司,历任固定收益投资部基金经理助理、基金经理,2017年7月7日起任建信现金增利货币市场基金和建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理;2018年3月26日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2019年1月25日起任建信天添益货币市场基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金的基金经理。

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《建信周盈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

宏观经济方面,二季度经济运行稳中略降。PMI指数在6月份录得49.4%,持平5月水平,已经连续两个月低于枯荣线水平,显示企业生产经营活动步伐有所放缓。从需求端上看,前5个月固定资产投资累计增速较一季度末小幅回落0.5个百分点至5.6%。其中制造业投资增速继续下滑,5月末维持在2.7%的低位,基建投资增速相对平稳,房地产投资名义增长虽较一季度末回落了0.8个百分点,但仍维持在较高水平。前5月社会消费品零售总额同比增长8.1%,增速较一季度末下行0.2个百分点,其中网上零售占比继续提高,消费增速在二季度整体保持平稳,而在贸易摩擦加强的背景下,前5月进出总额同比仍然保持了4.1%的正增长。总体看,今年二季度经济生产需求虽较一季度有所回落,但保持总体平稳,国内外各种不确定性因素的影响仍然不容忽视。

通胀方面,二季度居民消费价格涨势温和,前5月CPI累计同比上涨2.2%,涨幅比一季度末上行0.4个百分点,其中食品项目中鲜果和猪肉价格涨幅明显,非食品价格基本保持稳定。由于国际大宗商品价格回落导致输入性因素压力减少,前5月PPI同比上涨0.4%,其中5月当月PPI同比走势从4月的0.9%回落到0.6%,涨幅有所回落。

二季度资金面除部分时点因事件冲击出现阶段性紧张外,整体维持合理适度水平。5月下旬受包商银行被接管影响,全市场质押式回购利率出现明显上行,非银机构融资成本显著抬升。随着监管机构陆续采取多种有效措施对市场预期进行合理引导后,流动性紧张和分层局面有所缓解。从人民币汇率上看,二季度人民币汇率先贬后升,6月末人民币兑美元中间价收于6.8747,较一季度末贬值2.1%。

债券市场方面,二季度债券市场收益率先上后下,整体收益率维持区间震荡。4月受到一季度经济金融数据好转影响,收益率显著上行,5月之后贸易战风波重燃,国内经济数据出现反复,收益率又再度回落。二季度末1年国开债收益率报收2.73%,较一季度末2.55%的位置上行18BP。

报告期内,本基金继续强化信用风险和流动性风险的防范,适当减少同业存单持仓比重,加大对利率债的配置力度,努力回避信用债持仓,保持流动性资产的较高比例,维持组合较强的备付能力,并努力通过参与短期逆回购配置增厚组合收益。

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0.6583%,波动率0.0003%,本基金B净值收益率0.7314%,波动率0.0003%;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	257,313,830.39	63.44
	其中:债券	257,313,830.39	63.44
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	134,434,526.65	33.15
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	12,704,226.71	3.13
4	其他资产	1,128,818.66	0.28
5	合计	405,581,402.41	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		7.35
	其中:买断式回购融资		0.00
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	31,815,784.09	8.52
	其中:买断式回购融资	-	0.00

注:报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

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	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	122
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	92

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2019-04-26	122	应对赎回	1个工作日

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	42.10	8.52
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)—60天	0.00	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)—90天	18.61	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)—120天	0.00	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	120天(含)—397天(含)	47.64	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	108.35	8.52

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	40,165,707.44	10.76
	其中:政策性金融债	40,165,707.44	10.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	217,148,122.95	58.17
8	其他	-	-
9	合计	257,313,830.39	68.93
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	111870197	18长沙银行CD215	500,000	49,405,337.69	13.23
2	111991545	19贵州银行CD005	500,000	49,031,535.89	13.13
3	111872529	18成都银行CD289	300,000	29,750,039.90	7.97
4	111918043	19华夏银行CD043	300,000	29,684,295.68	7.95
5	170205	17国开05	200,000	20,159,951.90	5.40
6	180209	18国开09	200,000	20,005,755.54	5.36
7	111885452	18长沙银行CD181	200,000	19,844,105.76	5.32
8	111992471	19贵州银行CD018	200,000	19,574,074.03	5.24
9	111884706	18郑州银行CD120	100,000	9,940,415.93	2.66
10	111885099	18洛阳银行CD059	100,000	9,918,318.07	2.66

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	0.1124%
报告期内偏离度的最低值	-0.0566%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0362%

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	1,128,818.66
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,128,818.66

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	建信周盈安心理财A	建信周盈安心理财B
报告期期初基金份额总额	545,282,788.27	28,544,741.05
报告期期间基金总申购份额	7,766,110.09	106,065.82
报告期期间基金总赎回份额	189,053,878.81	19,350,956.20
报告期期末基金份额总额	363,995,019.55	9,299,850.67

注:申购份额含红利再投和因份额升降级导致的强制调增份额,赎回份额含因份额升降级导致的强制调减份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信周盈安心理财债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信周盈安心理财债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信周盈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。

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

建信转债增强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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	建信转债增强债券	
基金主代码	530020	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年5月29日	
报告期末基金份额总额	52,793,644.31份	
投资目标	通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置,并充分利用可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,实施对大类资产的配置,在控制风险并保持良好流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的超额收益。	
投资策略	本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置,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,综合股市估值水平和债市收益率情况及风险分析,进行灵活的大类资产配置进而在固定收益类资产、权益类资产以及货币类资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。	
业绩比较基准	60%×中证可转换债券指数收益率+30%×中国债券总指数收益率+10%×沪深300指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,债券型基金的风险高于货币市场基金,低于混合型和股票型基金,属于中低风险收益的品种。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信转债增强债券A	建信转债增强债券C
下属分级基金的交易代码	530020	531020
报告期末下属分级基金的份额总额	22,110,035.15份	30,683,609.16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)
	建信转债增强债券A	建信转债增强债券C
1.本期已实现收益	28,433.17	63,593.31
2.本期利润	-3,975,400.64	-5,953,863.19
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1737	-0.1802
4.期末基金资产净值	51,010,969.27	68,985,379.10
5.期末基金份额净值	2.307	2.248

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

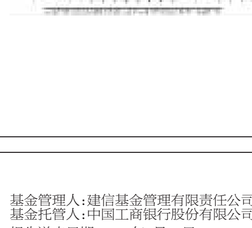
建信转债增强债券A

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	-7.01%	0.74%	-2.08%	0.61%	-4.93%	0.13%

建信转债增强债券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	-7.11%	0.74%	-2.08%	0.61%	-5.03%	0.13%

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		
朱建华	本基金的基金经理	2016年6月1日	-	11年	朱建华先生,硕士。曾任大连博达系统工程公司职员、中诚信国际信用评级公司项目组长,2007年10月起任中诚信证券评估有限公司公司评级部总经理助理,2008年8月起任国泰基金管理公司高级研究员。朱建华于2011年6月加入本公司,历任高级债券研究员、基金经理助理、基金经理。2012年8月28日至2015年8月11日任建信双周安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2012年11月15日至2014年3月6日任建信纯债债券型证券投资基金的基金经理;2012年12月20日至2014年3月27日任建信周盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理;2013年5月14日至2019年1月29日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;2013年12月10日起任建信稳定添利债券型证券投资基金的基金经理;2016年3月14日起任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2016年4月28日至2018年5月3日任建信安心保本六号混合型证券投资基金的基金经理,2016年6月1日起任建信转债增强债券型证券投资基金的基金经理,2016年11月1日起任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理;2018年4月20日起任建信稳定增利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

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《建信转债增强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

二季度,国内宏观经济整体依然处于筑底阶段。虽然一季度经济数据出现一定超预期,并导致宏观杠杆率的小幅抬升,但是进入四月以来,经济数据再次低于市场预期,经济仍处于底部的反复确认中。从最新的高频数据与PMI指数看,发电耗煤量同比小幅负增长,高炉开工率月度均值同比增速也小幅转负,PMI指数继续处于荣枯线以下,同时工业增加值增速二季度也较一季度回落近1个百分点,但继续下滑趋势减缓。投资方面,二季度制造业投资增速继续回落,基建投资增略有下行;房地产投资名义增长虽然仍维持较高水平但从五月份开始已经出现增速下滑迹象。目前支撑经济的消费数据在二季度基本保持平稳,经济转型的压力依然较大。社融方面,经历了年初的高增长后,二季度社融增速一度低于市场预期。从最新情况看,M2增速维持在8.5%左右的稳定水平,随着地方债和转向债的加速发行社融再次进入稳步回升的通道。通胀方面,虽然蔬果猪肉等价格在二季度出现较快增长,但油价的高位回落对通胀的上行的形成了一定对冲,目前整体通胀水平处于可控范围也符合市场预期,这也给央行的货币政策留出了一定空间。此外汇率方面,虽然五月份以来中美之间贸易摩擦再度升级导致人民币兑美元出现短期贬值,外资流出,但从短期美元指数看,多头美元的交易因过于拥挤,在联储降息预期再起后,资金选择纷纷撤离美元多头,这也极大稳定了人民币汇率。另外,从中期看无论从经济周期还是绝对利率水平比较,人民币兑美元短期的继续贬值压力不大,人民币资产的相对价值正逐渐得到外资的更多青睐。今年以来,市场最大的逻辑是从去年的信用紧缩再次进入信用扩张阶段,体现在社融增速的回升以及全社会融资成本的下降,同时信用扩张也导致市场对企业盈利预期的改善。但另一方面,因经济企稳和盈利改善的预期在二季度再次出现反复加上中美贸易摩擦再起以及包商银行等一系列事件的影响导致市场在短期内对信用扩张的逻辑能否持续增加担忧。从央行接下来的一系列维稳措施和国家出台的专项债计入资本金等表态看,虽然盈利预期的企稳并不确定,但信用扩张的逻辑依然未变。货币政策方面,二季度资金面整体维持合理适度水平,部分时点出现阶段性紧张,受包商银行被接管影响,非银机构融资成本曾一度显著抬升,但流动性危机很快缓解。在金融去杠杆的大背景下,表外的加速回表加之机构对信用风险的担忧,目前金融机构资产端出现欠配现象,这也导致二季度末银行间回购利率一度跌破1%的水平,资金利率整体上较宽松。此外,在全球进入降息以及降低国内企业融资成本的大背景下,市场对降息预期在而季度末再次增加。

债券方面,二季度债券市场收益率先上后下,整体收益率区间震荡。其中利率债的表现主要跟随市场经济数据以及权益市场的表现,同时五月份受中美贸易摩擦再次升级的影响出现一波收益率的下行,而包商银行事件的发生则在短期内改变了市场的风险偏好,利率债成为债券中性价比最高的品种。信用债中,低等级信用债再度被抛弃,长期限低等级信用债收益率走阔。转债方面,因一季度转债整体涨幅较大加上二季度权益市场的下跌和部分含转债类基金的大幅赎回影响,转债在二季度出现一轮明显调整,跌破100元转债再次大幅出现。进入六月份,随着市场短期悲观情绪的释放以及仓位的降低,转债进入明显低成交区间,其防御性逐步体现。权益资产方面,二季度A股由于受前期获利盘抛售以及一季度盈利下滑的影响,中小盘股票率先调整,而大盘股也在中美贸易摩擦升级后也出现较大调整。进入六月份,外资首先大幅加仓A股,其后权益市场逐步企稳回升。大盘股的二季度表现整体好过中小盘股票,市场风险偏好转向大盘价值。

本季度,建信转债增强债券型证券投资基金规模略有下降,在做好流动性管理的同时本基金的持仓随着权益和转债市场的下跌进行了调整。在经历了四月风险资产的快速回调后,为减少净值的进一步波动,本基金一方面大幅降低了股票的占比,另一方面对持仓转债也进行了适当调整增加了防御类转债的占比,而转债的整体仓位也一度降至相对较低水平。进入六月中下旬,随着转债市场逐步企稳加上权益市场的回暖,本基金再次增加了组合的杠杆比例和转债占比。在接下来的操作中,本基金继续看好部分银行和非银金融类转债的配置价值,同时对于部分总价不高的平衡性转债也值得加配。权益方面,权益市场已逐步进入可配置区间,本基金将重点关注大盘股的配置价值。

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-7.01%,波动率0.74%,本报告期本基金C净值增长率-7.11%,波动率0.74%;业绩比较基准收益率-2.08%,波动率0.61%。

§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	18,971,471.67	14.01
	其中:股票	18,971,471.67	14.01
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	108,406,646.56	80.06
	其中:债券	108,406,646.56	80.06
	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	7,617,607.35	5.63
8	其他资产	408,539.08	0.30
9	合计	135,404,264.66	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	411,700.00	0.34
C	制造业	6,401,503.00	5.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	556,000.00	0.46
E	建筑业	-	-
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	2,251,383.15	1.88
J	金融业	9,350,885.52	7.79
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,971,471.67	15.81

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	601328	交通银行	400,000	2,448,000.00	2.04
2	601288	农业银行	600,000	2,160,000.00	1.80
3	600690	青岛海尔	103,000	1,780,870.00	1.48
4	300059	东方财富	126,153	1,709,373.15	1.42
5	601398	工商银行	200,000	1,178,000.00	0.98
6	601688	华泰证券	50,000	1,116,000.00	0.93
7	601166	兴业银行	60,000	1,097,400.00	0.91
8	601231	环旭电子	90,000	1,084,500.00	0.90
9	002142	宁波银行	30,000	727,200.00	0.61
10	000568	泸州老窖	7,800	630,474.00	0.53

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	8,023,200.00	6.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	100,383,446.56	83.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	108,406,646.56	90.34

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	127010	平银转债	85,653	10,202,128.83	8.50
2	123016	洲明转债	57,363	7,059,090.78	5.88
3	019611	19国债01	70,000	6,994,400.00	5.83
4	132015	18中油EB	62,930	6,160,217.70	5.13
5	127005	长证转债	49,996	5,798,536.08	4.83

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	68,835.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	315,569.57
5	应收申购款	24,134.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	408,539.08

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123016	洲明转债	7,059,090.78	5.88
2	132015	18中油EB	6,160,217.70	5.13
3	127005	长证转债	5,798,536.08	4.83
4	113013	国君转债	5,095,800.00	4.25
5	127004	模塑转债	4,617,778.44	3.85
6	132009	17中油EB	3,955,600.00	3.30
7	110049	海尔转债	3,609,600.00	3.01
8	128013	洪涛转债	2,870,400.00	2.39
9	110033	国贸转债	2,240,145.00	1.87
10	113011	光大转债	2,195,100.00	1.83
11	123018	溢利转债	2,152,200.16	1.79
12	132004	15国盛EB	2,052,379.90	1.71
13	128020	水晶转债	1,984,200.00	1.65
14	110050	佳都转债	1,604,679.40	1.34
15	113522	旭升转债	1,557,000.00	1.30
16	128035	大族转债	1,550,400.00	1.29
17	128018	时达转债	1,537,442.54	1.28
18	113520	百合转债	1,240,600.00	1.03
19	128015	久其转债	1,148,089.50	0.96
20	128045	机电转债	1,097,600.00	0.91
21	123003	蓝思转债	1,056,147.78	0.88
22	113505	杭电转债	1,047,500.00	0.87
23	110034	九州转债	1,024,800.00	0.85
24	128023	亚太转债	1,014,886.68	0.85
25	113521	科森转债	1,009,000.00	0.84
26	123011	德尔转债	978,918.18	0.82
27	113502	嘉澳转债	953,000.00	0.79
28	128026	众兴转债	942,900.00	0.79
29	128024	宁行转债	669,098.30	0.56
30	113516	吴银转债	537,200.00	0.45
31	128037	岩土转债	382,958.97	0.32
32	110041	蒙电转债	378,832.50	0.32
33	128048	张行转债	222,115.64	0.19
34	128042	凯中转债	197,168.40	0.16
35	128017	金禾转债	102,868.33	0.09
36	128028	赣锋转债	40,609.66	0.03

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	建信转债增强债券A	建信转债增强债券C
报告期期初基金份额总额	23,951,569.49	36,948,500.41
报告期期间基金总申购份额	2,203,949.53	2,760,921.70
减:报告期期间基金总赎回份额	4,045,483.87	9,025,812.95
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	22,110,035.15	30,683,609.16

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转债增强债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信转债增强债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信转债增强债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信转债增强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。

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

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

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。

基金托管人中国工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	责任ETF
场内简称	责任ETF
基金主代码	510090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2010年5月28日
报告期末基金份额总额	58,081,114.00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最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	上证社会责任指数。
风险收益特征	本基金属于股票指数型基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,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	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	2,909,477.29
2.本期利润	2,332,535.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.0398
4.期末基金资产净值	102,715,885.24
5.期末基金份额净值	1.7685

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。

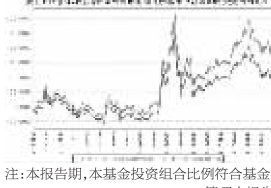
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.18%	1.53%	0.73%	1.54%	1.45%	-0.01%

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				

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《上证社会责任交易型开放式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

在报告期内,本基金根据基金合同规定,采取了对指数的被动复制策略,将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。

报告期内,本基金跟踪误差主要来自于所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。权重结构上的差异主要源自以下四个部分:第一,股票数量的舍入取整;第二,适当提高小权重股票便于提高基金可供申赎的篮子个数;第三,参与新股申购;第四,部分股票停牌导致无法交易。本基金管理人在量化分析基础上,采取了适当的组合调整策略,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

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2.18%,波动率1.53%,业绩比较基准收益率0.73%,波动率1.54%。

§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	102,233,449.88	99.17
	其中:股票	102,233,449.88	99.17
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	851,582.99	0.83
8	其他资产	1,082.36	0.00
9	合计	103,086,115.23	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	2,042,308.04	1.99
C	制造业	19,324,600.97	18.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	884,721.39	0.86
E	建筑业	7,747,970.17	7.54
F	批发和零售业	2,193,677.73	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	2,649,782.00	2.58
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,575,768.62	4.45
J	金融业	56,858,431.14	55.36
K	房地产业	5,261,863.71	5.12
L	租赁和商务服务业	183,078.63	0.18
M	科学研究和技术服务业	114,627.15	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
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	216,032.00	0.21
S	综合	-	0.00
	合计	102,052,861.55	99.35

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。

5.2.2 报告期末积极投资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	63,040.90	0.06
C	制造业	44,073.73	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
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	39,603.76	0.04
J	金融业	33,869.94	0.03
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	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
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	180,588.33	0.18

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	601318	中国平安	264,600	23,446,206.00	22.83
2	600036	招商银行	243,330	8,755,013.40	8.52
3	601166	兴业银行	335,475	6,135,837.75	5.97
4	601328	交通银行	685,953	4,198,032.36	4.09
5	600000	浦发银行	293,069	3,423,045.92	3.33
6	601668	中国建筑	523,970	3,012,827.50	2.93
7	601601	中国太保	78,425	2,863,296.75	2.79
8	600048	保利地产	178,171	2,273,461.96	2.21
9	600104	上汽集团	87,468	2,230,434.00	2.17
10	600309	万华化学	39,214	1,677,967.06	1.63

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	600968	海油发展	17,758	63,040.90	0.06
2	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.04
3	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.03
4	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.03
5	603863	松炀资源	741	17,102.28	0.02

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	892.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	189.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,082.36

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 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 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

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	601236	红塔证券	33,869.94	0.03	新发未上市

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	60,081,114.00
报告期期间基金总申购份额	500,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	2,500,000.00
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	58,081,114.00

§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(%)
建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2019年04月01日-2019年06月30日	58,000,000.00	-	2,000,000.00	56,000,000.00	96.42

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金募集设立的文件;

2、《上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3、《上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

4、《上证社会责任交易型开放式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