

建信多因子量化股票型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

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
送出日期：2019年8月29日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签署同意，并由董事长签发。

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8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自基金半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况		
基金名称		
基金代码	002826	
基金类型	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年01月01日	
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	
基金份额总额	36,764,791.00份	
基金合同持续时间不定期		

2.2 基金产品说明

投资目标 在长期持有的基础上，力争实现超越行业平均水平的回报，实现基金资产的增值。

投资范围 在严格控制风险的前提下，通过量化选股模型，精选具有成长性、估值合理的股票进行投资，追求资本增值。

业绩比较基准 基金业绩比较基准为：85%×中证800指数收益率+15%×商业银行（报告期存续期）收益率，其风险报酬比预期均高于货币市场基金。

风险收益特征 中低风险、中低收益，具有一定的系统性风险，较货币市场基金的风险和收益高。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司
住所	北京市海淀区西三环中路26号院3号楼15层1501-1505	
信息披露负责人	欧阳晓军 010-62008800	010-62006000
客户服务电话	400-81-066301-010-62220000	95598
传真	010-62220001	010-5850798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址 <http://www.zzzqfund.com>

基金半年度报告备查地点 基金管理人和基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标				
本期实现收益				报告期2019年1月1日至2019年6月30日
本期已实现收益				3,494,216.01
本期未实现收益				7,326,401.00
本期已分配收益				0.00
本期末未分配收益				33,820.00
期初至报告期末基金累计净值				1.034
本期末基金净值				1.034
本期末基金资产净值				-0.163
本期末基金可供分配利润				34,721,602.04
本期末基金总资产				0.0439

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.期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的未实现部分为期末未分配利润；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为零。

3.所列基金业绩指标包括持有人认购或申购基金份额的各项费用，计算费用后实际收益水平将低于所列示。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 份额净值增长率为% 份额净值增长率为% 业绩比较基准收益率(同期基准收益率) ①-②

过去一个月 4.40% 1.10% 0.00% 0.00%

过去二个月 -0.06% 1.30% -2.00% 1.23% 2.11% 0.00%

过去六个月 23.04% 21.10% 2.10% 2.00% 0.00%

过去一年 -0.06% 1.20% 6.01% 1.21% -5.00% 0.02%

基金份额净值 -5.61% 1.00% 0.97% 0.90% -11.98% 0.12%

注：本基金业绩比较基准为：85%×中证800指数收益率+15%×商业银行活期存款利率（税前）。

本基金为股票型基金，所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约的平均价，合计（差价）计算基金资产的比例不低80%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的80%，现金或到期日在一年以内且政府债券不低于基金资产净值的5%。故本基金比较基准中给予标的指数收益率85%的权重，相对应将15%作为体现现金或到期日在一年以内的政府债券的投资权重。

本基金在中证800指数部分的业绩比较基准。中证800指数编制方法和样本构成透明，客观，能较好的反映市场的实际情况，在市场代表性、可投资性以及周转率方面能够满足本基金的要求。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额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

本公司参与估值流程的各方面不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据中国证监会《关于证券投资基金估值业务的指导意见》（以下简称“指导意见”）和《中国证监会公告[2017]13号文》关于中国证监会对证券投资基金估值业务的指导意见等有关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产评估委员会，主要负责审核和决定受托资产评估值相关事宜，确保受托资产评估值和结果公允。资产评估委员会由公司分管核算业务的高管、稽察长、内控合规部、投资风险管理部和基金计划部负责人组成，分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人及相关研究人员作为投资产品价值研究的专业成员出席资产评估委员会会议。

本公司基金经理均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理等工作，熟悉内外法律法规的专业型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信多因子量化股票型证券投资基金合同》（以下简称“本基金”）经中国证监会监督委员会批准，本基金的估值方法为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转债（含分离交易可转债）、中期票据、短期融资券等）、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的有关规定）。本基金的估值组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的80%；现金或到期日在一年以内且政府债券不低于基金资产净值的5%。故本基金比较基准中给予的指数收益率85%的权重，相对应将15%作为体现现金或到期日在一年以内的政府债券的投资权重。

本公司参与估值流程的各方面不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据中国证监会《关于证券投资基金估值业务的指导意见》和《中国证监会公告[2017]13号文》关于中国证监会对证券投资基金估值业务的指导意见等有关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产评估委员会，主要负责审核和决定受托资产评估值相关事宜，确保受托资产评估值和结果公允。资产评估委员会由公司分管核算业务的高管、稽察长、内控合规部、投资风险管理部和基金计划部负责人组成，分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人及相关研究人员作为投资产品价值研究的专业成员出席资产评估委员会会议。

本公司基金经理均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理等工作，熟悉内外法律法规的专业型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信多因子量化股票