

建信中证政策性金融债1-3年指数证券投资基(LOF) 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

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金管理人:建信基金管理有限责任公司根据本基金合同规定,于2019年8月27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、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招募说明书及其更新。

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

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	建信中证政策性金融债1-3年指数证券投资基(LOF)
场内简称	-
基金代码	061011
基金规模(万)	上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2017/8/10
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
报告期末基金份额总额	10,566,181.97份
基金合同终止日期	不定期
基金分级上市的证券交易所	上海证券交易所(尚未上市)

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于债券,力争在扣除各项费用之后获得与标的指数相类似的回报,追求资本增值。
投资策略	本基金主要采用量化复制和动态优化的方法,投资于标的指数所具有的代表性和流动性较好的成分券,通过适当的分析方法,构建与标的指数相似的债券组合,在严格控制跟踪误差的前提下,力求基金净值增长率与业绩基准收益率之间的差额在短期内不超过0.05%,将年化跟踪误差控制在2%以内。同时,根据数据变化对投资策略进行适时调整,以期在长期取得超越业绩基准的收益。
业绩比较基准	中证政策性金融债1-3年定期收息率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其风险和预期收益水平低于股票型基金,高于货币型基金。

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
姓名	吴晓明	罗非非
联系方式	010-66228880	010-56950066
电子邮箱	xinxiaoli@cbocfund.com	tqj@cbocfund.com
客户服务电话	400-81-06622-0000-066220000	95568
传真	010-66228001	010-56950708

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.cxitfund.cn
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	
报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)	
本期实现收益	183,460.77
本期利息收入	163,966.27
已扣税基金申购赎回费用	0.0148
本期申购赎回费用率	1.36%
报告期(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	0.0078
期末基金资产净值	11,268,669.06
期末基金总份额	1,002.1

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)扣减相关费用后的余额,本期利润为本期已实现的公允价值变动收益。

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,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的实现部分;如果期末未实现利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣减未实现部分)。

3. 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,计算时未考虑实际收益水平扣减所列费用。

4.2 简要财务指标

本报告期基金本期净增长率为1.35%,波动率为0.05%,业绩比较基准收益率为1.94%,波动率为0.03%。

4.3 管理人对报告期内基金业绩表现的简要展望

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 平等交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格执行相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人所管理的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%的情况有1次,原因是投资组合资金配置需要,未导致不公平交易利益输送。

4.4.3 管理人对报告期内基金投资组合运作分析

4.4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来,全球贸易、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.5 管理人对报告期内基金业绩表现的简要展望

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.6 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.7 管理人对报告期内基金投资组合运作分析

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.8 管理人对报告期内基金业绩表现的简要展望

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.9 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.10 管理人对报告期内基金投资组合运作分析

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.11 管理人对报告期内基金业绩表现的简要展望

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.12 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.13 管理人对报告期内基金投资组合运作分析

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.14 管理人对报告期内基金业绩表现的简要展望

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.15 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.16 管理人对报告期内基金投资组合运作分析

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.17 管理人对报告期内基金业绩表现的简要展望

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.18 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.19 管理人对报告期内基金投资组合运作分析

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.20 管理人对报告期内基金业绩表现的简要展望

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.21 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.22 管理人对报告期内基金投资组合运作分析

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.23 管理人对报告期内基金业绩表现的简要展望

今年以来,全球经济、投资、工业生产活动放慢速度更加明显,保护主义、单边主义对全球经济活动的干扰加大,主要经济体面临的程度不同的经济下行压力。从目前形势看,中美经贸推延、英镑欧股推延、美欧经济衰退风险、美联储货币政策走向等都将对今年世界经济走势和金融市场稳定性产生较大影响。美国经济虽然仍相对强劲,但失业率就业增速放缓、长期利率收益率出现倒挂,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宽松,部分新兴经济体也呈现出金融动荡,世界经济处于周期性见顶回落阶段,下行风险加大。

4.4.24 管理人对报告期内公平交易情况