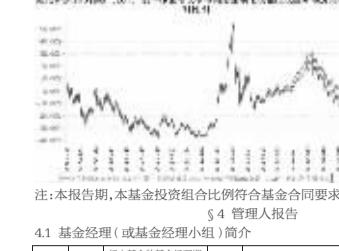


## 建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

## 2019年第二季度报告



注:本报告期,本基金投资组合比例符合基金合同要求。

## § 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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告书经基金财务资料未经审计。

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	建信沪深300指数(LOF)
基金代码	160909
基金运作方式	上市契约型开放式

基金合同生效日 2009年3月16日

报告期末基金资产总额 420,513,722.09

投资目标 本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资纪律和数量化风险管理手段,力求在跟踪偏离度方面取得最佳化。

投资策略 本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资纪律和数量化风险管理手段,力求在跟踪偏离度方面取得最佳化。

业绩比较基准 65%×沪深300指数收益率+35%×业绩比较基准

风险收益特征 本基金为股票型基金,其风险收益特征与沪深300指数相似,属于较高风险、较高收益品种。

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	2,083,024.02	
2.本期利润	1,496,100.53	
3.加权平均基金份额本期利润	0.0032	
4.期末基金份额净值	0.798,438.7611	
5.期末基金资产净值	1,229.4	

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,费用影响会导致实际收益水平低于所列数字。

## 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(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.07%	1.46%	-11.15%	1.46%	1.15%

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: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,费用影响会导致实际收益水平低于所列数字。

## 3.3 主要财务指标和基金净值表现

3.3.1 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(%)	净值增长(%)	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.07%	1.46%	-11.15%	1.46%	1.15%

3.3.2 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: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,费用影响会导致实际收益水平低于所列数字。

## 3.4 基金产品概况

3.4.1 基金基本情况

3.4.2 基金主要投资品种

3.4.3 报告期末基金资产净值

3.4.4 报告期末基金份额净值

3.4.5 报告期末基金份额总额

3.4.6 报告期末机构投资者持

3.4.7 报告期末个人投资者持

3.4.8 报告期末未知持有人持

3.4.9 报告期末机构投资者持

3.4.10 报告期末个人投资者持

3.4.11 报告期末未知持有人持

3.4.12 报告期末机构投资者持

3.4.13 报告期末个人投资者持

3.4.14 报告期末未知持有人持

3.4.15 报告期末机构投资者持

3.4.16 报告期末个人投资者持

3.4.17 报告期末未知持有人持

3.4.18 报告期末机构投资者持

3.4.19 报告期末个人投资者持

3.4.20 报告期末未知持有人持

3.4.21 报告期末机构投资者持

3.4.22 报告期末个人投资者持

3.4.23 报告期末未知持有人持

3.4.24 报告期末机构投资者持

3.4.25 报告期末个人投资者持

3.4.26 报告期末未知持有人持

3.4.27 报告期末机构投资者持

3.4.28 报告期末个人投资者持

3.4.29 报告期末未知持有人持

3.4.30 报告期末机构投资者持

3.4.31 报告期末个人投资者持

3.4.32 报告期末未知持有人持

3.4.33 报告期末机构投资者持

3.4.34 报告期末个人投资者持

3.4.35 报告期末未知持有人持

3.4.36 报告期末机构投资者持

3.4.37 报告期末个人投资者持

3.4.38 报告期末未知持有人持

3.4.39 报告期末机构投资者持

3.4.40 报告期末个人投资者持

3.4.41 报告期末未知持有人持

3.4.42 报告期末机构投资者持

3.4.43 报告期末个人投资者持

3.4.44 报告期末未知持有人持

3.4.45 报告期末机构投资者持

3.4.46 报告期末个人投资者持

3.4.47 报告期末未知持有人持

3.4.48 报告期末机构投资者持

3.4.49 报告期末个人投资者持

3.4.50 报告期末未知持有人持

3.4.51 报告期末机构投资者持

3.4.52 报告期末个人投资者持

3.4.53 报告期末未知持有人持

3.4.54 报告期末机构投资者持

3.4.55 报告期末个人投资者持

3.4.56 报告期末未知持有人持

3.4.57 报告期末机构投资者持

3.4.58 报告期末个人投资者持

3.4.59 报告期末未知持有人持

3.4.60 报告期末机构投资者持

3.4.61 报告期末个人投资者持

3.4.62 报告期末未知持有人持

3.4.63 报告期末机构投资者持

3.4.64 报告期末个人投资者持

3.4.65 报告期末未知持有人持

3.4.66 报告期末机构投资者持

3.4.67 报告期末个人投资者持

3.4.68 报告期末未知持有人持

3.4.69 报告期末机构投资者持

3.4.70 报告期末个人投资者持

3.4.71 报告期末未知持有人持

3.4.72 报告期末机构投资者持

3.4.73 报告期末个人投资者持

3.4.74 报告期末未知持有人持

3.4.75 报告期末机构投资者持

3.4.76 报告期末个人投资者持

3.4.77 报告期末未知持有人持

3.4.78 报告期末机构投资者持

3.4.79 报告期末个人投资者持

3.4.80 报告期末未知持有人持

3.4.81 报告期末机构投资者持

3.4.82 报告期末个人投资者持

3.4.83 报告期末未知持有人持

3.4.84 报告期末机构投资者持

3.4.85 报告期末个人投资者持

3.4.86 报告期末未知持有人持

3.4.87 报告期末机构投资者持

3.4.88 报告期末个人投资者持

3.4.89 报告期末未知持有人持

3.4.90 报告