

建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF） 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 22 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 10 月 18 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信沪深 300 指数 (LOF)
场内简称	建信 300
基金主代码	165309
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2009 年 11 月 5 日
报告期末基金份额总额	435,755,529.75 份
投资目标	本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。 原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，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，为证券投资基金中的较高风险、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 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	9,971,329.68
2. 本期利润	4,530,610.56
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0097
4. 期末基金资产净值	537,935,720.69
5. 期末基金份额净值	1.2345

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。

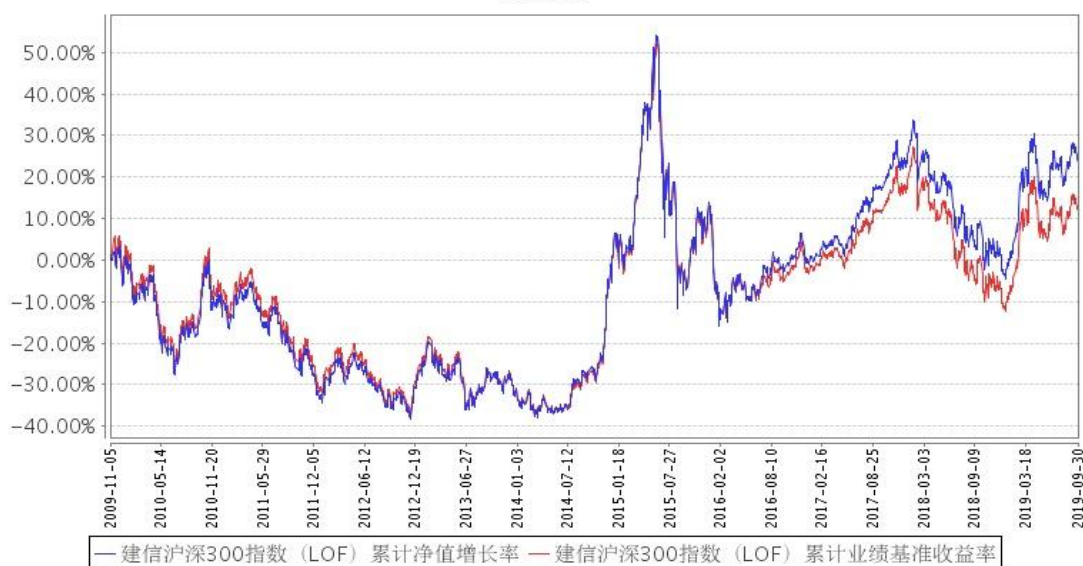
3.2 基金净值表现

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	0.41%	0.90%	-0.26%	0.91%	0.67%	-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

建信沪深300指数 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

第 3 页 共 11 页

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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理, 本基金的基金经理	2009年11月5日	-	16年	梁洪昀先生, 金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师 (CFA), 博士。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司, 历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司, 历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理; 2010年5月28日至2012年5月28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; 2011年9月8日至2016年7月20日任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金 (ETF) 及其联接基金的基金经理; 2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金的基金经理; 2015年3月25日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理; 2015年7月31日至2018年7月31日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理; 2015年8月6日至2016年10月25日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理; 2018年2月6日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 2018年2月7日起任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理; 2018年4月19日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 2018年5月16日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理; 2018年6月13日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

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《建信沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF) 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,本基金管理人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% 的情况有 1 次,原因是投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

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。

在报告期内,标的指数中工商银行和建设银行两只股票限于规定无法投资,而必须用其他股票进行替代,这是基金跟踪误差的重要来源之一。本基金管理人以量化分析研究为基础,制定及执行了相应的替代策略,并根据市场情况,对替代方案进行优化和调整,以尽可能降低这种不利影响。

在报告期内,部分停牌股票的估值调整使跟踪误差和偏离度有所增加。基金管理人已在投资限制范围内尽力予以克服。

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 0.41%,波动率 0.90%,业绩比较基准收益率-0.26%,波动率 0.91%。

§ 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	504,387,308.74	93.26
	其中: 股票	504,387,308.74	93.26
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	36,089,762.29	6.67
8	其他资产	390,864.92	0.07
9	合计	540,867,935.95	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	8,049,859.00	1.50
B	采矿业	15,264,261.31	2.84
C	制造业	209,820,678.97	39.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,523,700.46	2.14
E	建筑业	14,162,978.84	2.63
F	批发和零售业	6,495,050.56	1.21
G	交通运输、仓储和邮政业	14,640,497.83	2.72
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,286,130.88	3.59
J	金融业	171,097,140.68	31.81
K	房地产业	19,950,381.54	3.71
L	租赁和商务服务业	7,211,547.76	1.34
M	科学研究和技术服务业	523,668.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	518,246.85	0.10
O	居民服务、修理和其	-	0.00

	他服务业		
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	2,910,700.19	0.54
R	文化、体育和娱乐业	2,623,479.00	0.49
S	综合	-	0.00
	合计	504,078,321.87	93.71

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	-	0.00
C	制造业	46,372.26	0.01
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	78,198.64	0.01
J	金融业	184,415.97	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	308,986.87	0.06

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	442,432	38,509,281.28	7.16
2	600519	贵州茅台	20,545	23,626,750.00	4.39
3	600036	招商银行	450,483	15,654,284.25	2.91
4	000651	格力电器	196,612	11,265,867.60	2.09
5	601166	兴业银行	612,701	10,740,648.53	2.00
6	000858	五粮液	79,287	10,291,452.60	1.91
7	600276	恒瑞医药	126,528	10,208,279.04	1.90
8	000333	美的集团	198,340	10,135,174.00	1.88
9	601288	农业银行	2,145,699	7,424,118.54	1.38
10	600030	中信证券	321,490	7,227,095.20	1.34

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	601236	红塔证券	9,789	146,149.77	0.03
2	603927	中科软	884	78,198.64	0.01
3	002961	瑞达期货	1,260	38,266.20	0.01
4	603687	大胜达	1,462	24,430.02	0.00
5	603786	科博达	816	21,942.24	0.00

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	16,818.77
2	应收证券清算款	71,643.18
3	应收股利	-
4	应收利息	7,264.08
5	应收申购款	295,138.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	390,864.92

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	603786	科博达	21,942.24	0.00	新股未上市

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	470,513,773.97
报告期期间基金总申购份额	42,112,921.20
减: 报告期期间基金总赎回份额	76,871,165.42
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	435,755,529.75

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沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 设立的文件；
- 2、《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 4、《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 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 10 月 22 日