

建信润利增强债券型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

重要提示及目录

1.1 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。本半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 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、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 3 月 26 日起至 6 月 30 日止。

目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 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	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 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贵金属投资明细	48

7.9 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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.11 投资组合报告附注.....	49
§ 8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	50
§ 9 开放式基金份额变动.....	51
§ 10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
§ 11 备查文件目录.....	54
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	55
11.3 查阅方式.....	55

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信润利增强债券型证券投资基金	
基金简称	建信润利增强债券	
基金主代码	006500	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 26 日	
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	
报告期末基金份额总额	428,831,092.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信润利增强债券 A	建信润利增强债券 C
下属分级基金的交易代码	006500	006501
报告期末下属分级基金的份额总额	393,053,453.33 份	35,777,639.44 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率
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、混合型基金，高于货币市场基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	陆志俊
	联系电话	010-66228888	95559
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95559
传真		010-66228001	021-62701216
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路 188 号
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号

邮政编码	100033	200336
法定代表人	孙志晨	彭纯

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街7号 英蓝国际金融中心16层

§ 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	报告期(2019年3月26日(基金合同生效日)-2019年6月30日)		
	建信润利增强债券 A	建信润利增强债券 C	
本期已实现收益	152,740.18	-22,676.67	
本期利润	-1,438,614.43	-285,237.23	
加权平均基金份 额本期利润	-0.0032	-0.0058	
本期加权平均净 值利润率	-0.32%	-0.58%	
本期基金份额净 值增长率	-0.29%	-0.43%	
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2019年6月30日)		
	期末可供分配利 润	-1,159,494.82	-152,637.19
	期末可供分配基 金份额利润	-0.0029	-0.0043
	期末基金资产净 值	391,893,958.51	35,625,002.25

期末基金份额净值	0.9971	0.9957
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-0.29%	-0.43%

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正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;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期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分)。

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金基金合同自2019年3月26日生效,截至报告期末未满六个月。

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

建信润利增强债券 A

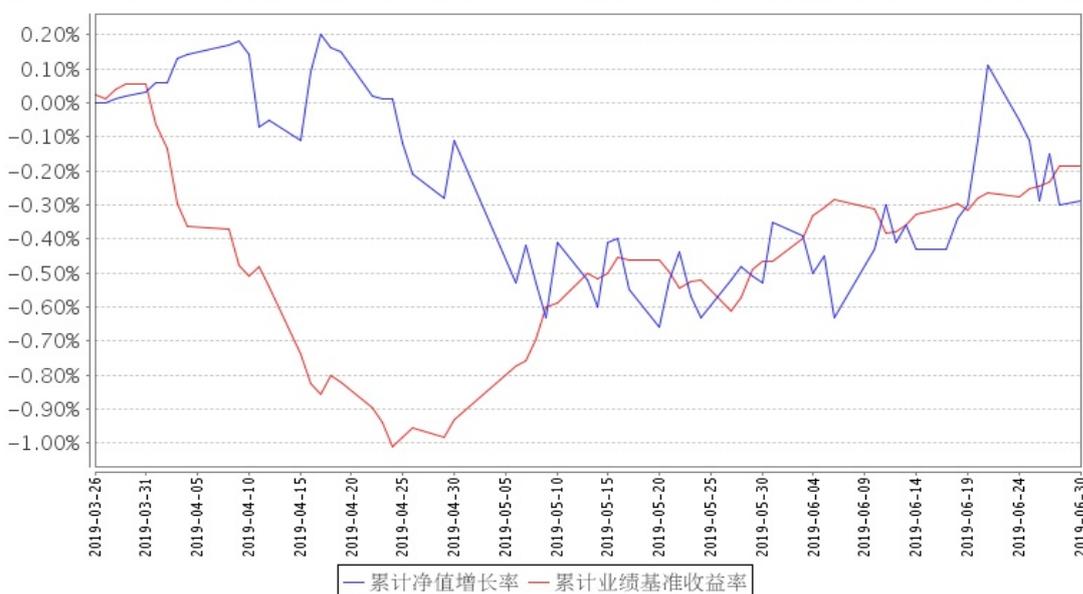
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.06%	0.13%	0.28%	0.03%	-0.22%	0.10%
过去三个月	-0.32%	0.13%	-0.24%	0.06%	-0.08%	0.07%
自基金合同生效起至今	-0.29%	0.12%	-0.18%	0.06%	-0.11%	0.06%

建信润利增强债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.00%	0.13%	0.28%	0.03%	-0.28%	0.10%
过去三个月	-0.46%	0.13%	-0.24%	0.06%	-0.22%	0.07%
自基金合同生效起至今	-0.43%	0.12%	-0.18%	0.06%	-0.25%	0.06%

3.2.2 自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

建信润利增强债券A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



建信润利增强债券C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：本基金基金合同于 2019 年 3 月 26 日生效，截至报告期末仍处于建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的

65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金会计部、注册登记部、财务管理部、金融科技部、投资风险管理部门和内控合规部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家 资产管理行业的领跑者”。

截至 2019 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、

建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金（LOF）、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金（LOF）、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF），共计 110 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 5,725.25 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
牛兴华	本基金的基金经理	2019年3月26日	-	8	牛兴华先生，硕士，2008年毕业于英国卡迪夫大学国际经济、银行与金融学专业，同年进入神州数码中国有限公司，任投资专员；2010年9月，加入中诚信国际信用评级有限责任公司，担任高级分析师；2013年4月加入本公司，历任债券研究员、基金经理。2014年12月2日至2017年6月30日任建信稳定得利债券型证券投资基金的基金经理；2015年4月17日起任建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015年5月13日起任建信回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015年5月14日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015年6月16日至2018年1月23日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；2015年7月2日至2015年11月25日任建信鑫裕回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015年10月29日至2017年7月12日任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理；2016年2月22日至2018年1月23日任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理；2016年10月25日至2017年12月6日任建信瑞盛添利混合型证券投资基金的基金经理；2016年12月2日至2018年4月2日任建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016年12月23日至2017年12月29日任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017年3月1日起任建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年4月20日起任建信安心保本混合型证券投资基金的基金经理；2019年3月26日起任建信润利增强债券型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平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，制定并严格遵守相应的制度和流程，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。

4.3.2 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年经济运行保持平稳，GDP 累计同比增长 6.3%，增速较 18 年全年回落 0.3 个百分点。从需求端看，1-6 月固定资产投资累计同比增长 5.8%，其中房地产投资增速维持高位，上半年累计同比增长 10.9%，显著高于 2018 年全年的 9.5%，表现出一定的韧性；制造业投资累计同比增长 3%，基建（不含电力）投资累计同比增长 4.1%。上半年社会消费品零售总额同比增长 8.4%，汽车促销对消费有一定支撑，整体需求仍较弱。进出口方面，1-6 月进出总额同比增长 3.9%，保持正增长。从生产端上看，1-6 月全国规模以上工业增加值累计同比实际增长 6.0%，其中高技术制造业仍保持较快增长。价格方面，2019 年上半年居民消费价格涨势温和，工业生产者价格涨幅回落，1-6 月 CPI 累计同比上涨 2.2%，涨幅比去年同期扩大 0.2 个百分点，1-6 月全国工业生产者出厂价格同比上涨 0.3%，涨幅比去年同期回落 3.6 个百分点。总体看，上半年经济总体保持平稳，但是制造业投资和需求仍然偏弱，叠加外部不确定性因素的增多，经济仍面临一定的下行压力。

货币政策方面维持稳健，央行 1 月份下调金融机构存款准备金率 1 个百分点，2019 年一季度到期的中期借贷便利（MLF）不再续做，净释放长期资金约 8000 亿元；此外央行在 4 月 24 日开展定向中期借贷便利（TMLF）操作 2674 亿元，5 月 15 日开始对中小银行实行较低存款准备金率释放长期资金约 2800 亿元，货币市场流动性整体保持合理充裕。上半年人民币兑美元小幅贬值，中间价从年初的 6.8632 贬值到二季度末的 6.8747。

债券市场方面，2019 年上半年信用债收益率整体陡峭化下行，低等级下行幅度大于高等级，利率债收益率维持区间震荡，10 年国开债收益率相比于去年年末 3.64% 的位置下行 3BP 到

3.61%，10 年国债收益率则持平在 3.22%。具体看，一季度债券市场随着社融增速企稳回升、贸易摩擦阶段性缓和以及资本市场风险偏好回升等因素影响，收益率底部区域震荡明显；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 月之后贸易谈判风波重燃，国内经济数据出现反复，收益率有一定回落。权益方面，上半年股市先上后下，转债受到正股驱动涨幅较好，中证转债指数整体上行 13.3%，其中二季度转债下跌 3.56%有一定回撤。

回顾上半年基金管理工作，组合于二季度初期完成了基金的建仓配置，在债券方面积极采用杠杆票息策略增厚票息收益。考虑到经济增速放缓以及外部风险增加等因素，二季度末组合增加了中长久期利率债的配置比例。权益方面，组合建仓期整体保持相对较低的权益仓位，坚持自下而上、精选各股策略，在二季度市场风险偏好大幅下行的过程中有效地规避了组合净值的大幅回撤。考虑到贸易摩擦有缓和迹象以及全球宽松预期增加等因素，组合在二季度末增加了权益资产的配置比例，并看好三季度货币政策宽松叠加风险事件缓和带来的阶段性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率-0.29%，波动率 0.12%，本报告期本基金 C 净值增长率-0.43%，波动率 0.12%；业绩比较基准收益率-0.18%，波动率 0.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，虽然上半年经济数据整体表现平稳，但制造业投资仍较为疲弱，地方债对基建的拉动也较为有限，经济仍有一定的下行压力；后期在财政政策空间较小，以及监管对于地产融资政策的收紧或进一步降低融资需求的情况下，社融年内高点短期或现，刚兑事件引发的中小银行同业信用收缩或使社融结构变差。货币政策大概率维持总量合理充裕，强调精准滴灌，继续推进降低实际融资成本，同时美联储在三季度开始降息，中国货币政策利率的空间也在打开。因此从基本面和资金面角度，下半年债券市场有一定的交易机会。权益市场方面，由于市场对经济企稳预期越发谨慎态度和贸易谈判的不确定性，下半年需要更多的从自下而上的角度筛选各股。本基金将本着稳健运营的理念，维持当前的债券投资策略，适度参与二级市场股票投资，积极参与一级市场股票申购增厚组合收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2017]13 号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、投资风险管理部门和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责

人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

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。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）；对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣，对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2019 年上半年度，托管人在建信润利增强债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2019 年上半年度，建信基金管理有限责任公司在建信润利增强债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

2019 年上半年度，由建信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关建信润利

增强债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信润利增强债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	17,517,098.29
结算备付金		113,261.20
存出保证金		46,474.51
交易性金融资产	6.4.7.2	553,963,035.20
其中：股票投资		78,826,044.20
基金投资		-
债券投资		475,136,991.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		153.19
应收利息	6.4.7.5	3,117,022.52
应收股利		-
应收申购款		1,122.83
递延所得税资产		-

其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		574,758,167.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		140,049,149.92
应付证券清算款		5,120,545.08
应付赎回款		1,224,765.63
应付管理人报酬		265,776.00
应付托管费		75,935.99
应付销售服务费		11,868.59
应付交易费用	6.4.7.7	304,579.78
应交税费		30,662.54
应付利息		49,599.15
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	106,324.30
负债合计		147,239,206.98
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	428,831,092.77
未分配利润	6.4.7.10	-1,312,132.01
所有者权益合计		427,518,960.76
负债和所有者权益总计		574,758,167.74

注:1、报告截止日 2019 年 6 月 30 日, 基金份额总额 428,831,092.77 份, 其中建信润利增强债

券 A 基金份额总额为 393,053,453.33 份，基金份额净值 0.9971 元；建信润利增强债券 C 基金份额总额为 35,777,639.44 份，基金份额净值 0.9957 元。

2、本财务报表的实际编制期间为 2019 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：建信润利增强债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2019 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		205,846.48
1. 利息收入		3,219,651.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	152,080.08
债券利息收入		2,259,990.63
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		807,580.70
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,259,199.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,458,203.37
基金投资收益	-	-
债	6.4.7.13	4,152.72

券投资收益		
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	194,851.20
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-1,853,915.17
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.18	99,309.69
减：二、费用		1,929,698.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	925,615.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	264,461.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	51,281.86
4. 交易费用	6.4.7.19	451,056.60
5. 利息支出		123,397.10
其中：卖出回购金融资产支出		123,397.10
6. 税金及附加		7,158.21
7. 其他费用	6.4.7.20	106,726.93
三、利润总		-1,723,851.66

额（亏损总额以“-”号填列）		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,723,851.66

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信润利增强债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	539,436,849.74	-	539,436,849.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,723,851.66	-1,723,851.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-110,605,756.97	411,719.65	-110,194,037.32
其中：1. 基金申购款	748,611.50	-3,715.80	744,895.70
2. 基金赎回款	-111,354,368.47	415,435.45	-110,938,933.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	428,831,092.77	-1,312,132.01	427,518,960.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

吴曙明

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信润利增强债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1505号《关于准予建信润利增强债券型证券投资基金注册的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信润利增强债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 539,286,122.62 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2019)验字第 61490173_A05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信润利增强债券型证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 539,436,849.74 份基金份额,其中认购资金利息折合 150,727.12 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信润利增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、资产支持证券、银行存款、国债期货、同业存单、债券回购等金融工具,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相关规定)。基金的投资组合比例为:债券的投资比例不低于基金资产的 80%;权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%;本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中债综合全价(总值)指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下

简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信润利增强债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 3 月 26 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 3 月 26 日至 2019 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融

负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行

调整并确定公允价值

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗

交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税

[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	17,517,098.29
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-

存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	17,517,098.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	81,107,269.90	78,826,044.20	-2,281,225.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,790,331.52	3,609,991.00
	银行间市场	470,919,348.95	471,527,000.00
	合计	474,709,680.47	475,136,991.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	555,816,950.37	553,963,035.20	-1,853,915.17

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,946.32
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	51.00
应收债券利息	3,110,004.30

应收资产支持证券利息	
应收买入返售证券利息	
应收申购款利息	
应收黄金合约拆借孳息	
其他	20.90
合计	3,117,022.52

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	297,850.34
银行间市场应付交易费用	6,729.44
合计	304,579.78

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,160.99
预提费用	102,163.31
合计	106,324.30

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

建信润利增强债券 A

项目	本期 2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	472,612,825.92	472,612,825.92
本期申购	164,784.37	164,784.37
本期赎回（以“-”号填列）	-79,724,156.96	-79,724,156.96
—基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	393,053,453.33	393,053,453.33

建信润利增强债券 C

项目	本期 2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	66,824,023.82	66,824,023.82
本期申购	583,827.13	583,827.13
本期赎回（以“-”号填列）	-31,630,211.51	-31,630,211.51
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	35,777,639.44	35,777,639.44

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2019 年 3 月 4 日至 2019 年 3 月 22 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 539,286,122.62 元，折合为 539,286,122.62 份基金份额(其中 A 类基金份额 472,474,611.74 份，C 类基金份额 66,811,510.88 份)。根据《建信润利增强债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 150,727.12 元在本基金成立后，折合为 150,727.12 份基金份额(其中 A 类基金份额 138,214.18 份，C 类基金份额 12,512.94 份)，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《建信润利增强债券型证券投资基金基金合同》、《建信润利增强债券型证券投资基金招募说明书》及《建信润利增强债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告》的相关规定，本基金于 2019 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2019 年 4 月 25 日止期间暂不向投资人开放，基金交易申购业务、赎回业务和转换业务自 2019 年 4 月 26 日起开始办理。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

建信润利增强债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	152,740.18	-1,591,354.61	-1,438,614.43
本期基金份额交易产生的变动数	-75,914.37	355,033.98	279,119.61
其中：基金申购款	140.53	-841.40	-700.87
基金赎回款	-76,054.90	355,875.38	279,820.48

本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,825.81	-1,236,320.63	-1,159,494.82
建信润利增强债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-22,676.67	-262,560.56	-285,237.23
本期基金份额交易产生的变动数	-16,448.74	149,048.78	132,600.04
其中：基金申购款	-158.18	-2,856.75	-3,014.93
基金赎回款	-16,290.56	151,905.53	135,614.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-39,125.41	-113,511.78	-152,637.19

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日
活期存款利息收入	125,892.40
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	26,086.03
其他	101.65
合计	152,080.08

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日
卖出股票成交总额	120,181,051.37
减：卖出股票成本总额	121,639,254.74
买卖股票差价收入	-1,458,203.37

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月

	30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	4,152.72
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	4,152.72

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年 6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	143,191.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	138,998.17
减：应收利息总额	40.21
买卖债券差价收入	4,152.72

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	194,851.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	194,851.20

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,853,915.17
股票投资	-2,281,225.70
债券投资	427,310.53
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,853,915.17

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月26日（基金合同生效日）至 2019年6月30日
基金赎回费收入	94,293.83
基金转换费收入	5,015.86
合计	99,309.69

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月 30日
交易所市场交易费用	446,681.60
银行间市场交易费用	4,375.00
合计	451,056.60

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年 6月30日
审计费用	22,438.04
信息披露费	79,725.27
银行划款手续费	4,563.62
合计	106,726.93

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基	基金销售机构、基金管理人、注册登记机构

金”)	
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司
交通银行股份有限公司 (“交通银行”)	基金销售机构、基金托管人
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司 (“中国建设银行”)	基金销售机构、基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	925,615.79
其中：支付销售机构的客户维护费	524,322.18

注：1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%的

年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.70% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	264,461.65

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.20%/ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信润利增强债券 A	建信润利增强债券 C	合计
建设银行	-	44,558.02	44,558.02
建信基金管理有限责任公司	-	8.18	8.18
交通银行	-	6,515.91	6,515.91
合计	-	51,082.11	51,082.11

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金管理有限责任公司，再由建信基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.40%。销售服务费的计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.40%/当年天数；

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年3月26日（基金合同生效日）至2019年6月 30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	17,517,098.29	125,892.40

注：1、本基金的活期银行存款及部分定期存款由基金托管人交通银行保管，按约定利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2019年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 140,049,149.92 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011901244	19 云能投 SCP005	2019 年 7 月 1 日	100.07	110,000	11,007,700.00
041900181	19 赣国资 CP001	2019 年 7 月 1 日	100.13	200,000	20,026,000.00
011900954	19 阳煤 SCP002	2019 年 7 月 4 日	100.22	295,000	29,564,900.00
011900957	19 首钢 SCP005	2019 年 7 月 4 日	100.23	200,000	20,046,000.00
011900975	19 阳煤 SCP003	2019 年 7 月 4 日	100.21	61,000	6,112,810.00
011901003	19 中航资本 SCP004	2019 年 7 月 4 日	100.35	200,000	20,070,000.00
041900166	19 华电江苏 CP001	2019 年 7 月 4 日	100.19	100,000	10,019,000.00
041900210	19 尧矿 CP002	2019 年 7 月 4 日	100.11	90,000	9,009,900.00
011900369	19 华发集团 SCP001	2019 年 7 月 5 日	100.13	220,000	22,028,600.00
合计				1,476,000	147,884,910.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程

和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、内控合规部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和内控合规部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日
A-1	90,098,000.00
A-1 以下	-
未评级	310,593,000.00
合计	400,691,000.00

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日
AAA	-
AAA 以下	3,609,991.00
未评级	-
合计	3,609,991.00

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券和买入返售金融资产等，本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,517,098.29	-	-	-	17,517,098.29
结算备付金	113,261.20	-	-	-	113,261.20
存出保证金	46,474.51	-	-	-	46,474.51
交易性	450,733,000.00	1,129,041.00	23,274,950.00	78,826,044.20	553,963,035.20

金融资产					
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	153.19	153.19
应收利息	-	-	-	3,117,022.52	3,117,022.52
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,122.83	1,122.83
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	468,409,834.00	1,129,041.00	23,274,950.00	81,944,342.74	574,758,167.74
负债					
卖出回购金融资产款	140,049,149.92	-	-	-	140,049,149.92
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	5,120,545.08	5,120,545.08
应付赎回款	-	-	-	1,224,765.63	1,224,765.63
应付管理人报酬	-	-	-	265,776.00	265,776.00
应付托管费	-	-	-	75,935.99	75,935.99
应付销售服务费	-	-	-	11,868.59	11,868.59

应付交易费用	-	-	-	304,579.78	304,579.78
应交税费	-	-	-	30,662.54	30,662.54
应付利息	-	-	-	49,599.15	49,599.15
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	106,324.30	106,324.30
负债总计	140,049,149.92	-	-	7,190,057.06	147,239,206.98
利率敏感度缺口	328,360,684.08	1,129,041.00	23,274,950.00	74,754,285.68	427,518,960.76

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	
分析	市场利率上升 25个基点	-1,453,206.48	
	市场利率下降 25个基点	1,508,124.68	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经

济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。债券的投资比例不低于基金资产的 80%；权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	78,826,044.20	18.44
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	475,136,991.00	111.14
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	553,963,035.20	129.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例如附注

6.4.13.4.3.1 所示，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 82,436,035.20 元，属于第二层次的余额为 471,527,000.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	78,826,044.20	13.71
	其中：股票	78,826,044.20	13.71

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	475,136,991.00	82.67
	其中：债券	475,136,991.00	82.67
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,630,359.49	3.07
8	其他各项资产	3,164,773.05	0.55
9	合计	574,758,167.74	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	218,648.00	0.05
B	采矿业	-	-
C	制造业	49,942,136.20	11.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	1,263,994.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,089,941.40	4.23
J	金融业	2,141,412.00	0.50
K	房地产业	7,068,811.60	1.65
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	101,101.00	0.02
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	78,826,044.20	18.44

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	002624	完美世界	442,100	11,410,601.00	2.67
2	000961	中南建设	816,260	7,068,811.60	1.65
3	000063	中兴通讯	136,200	4,430,586.00	1.04
4	000651	格力电器	79,500	4,372,500.00	1.02
5	600536	中国软件	79,600	4,272,132.00	1.00
6	600352	浙江龙盛	270,300	4,262,631.00	1.00
7	000932	华菱钢铁	892,460	4,257,034.20	1.00
8	002371	北方华创	60,900	4,217,325.00	0.99
9	300360	炬华科技	513,700	4,196,929.00	0.98
10	000157	中联重科	388,500	2,334,885.00	0.55
11	600132	重庆啤酒	46,400	2,188,224.00	0.51
12	000001	平安银行	155,400	2,141,412.00	0.50
13	002110	三钢闽光	229,850	2,137,605.00	0.50
14	002271	东方雨虹	93,900	2,127,774.00	0.50
15	002202	金风科技	170,100	2,114,343.00	0.49
16	300261	雅本化学	403,700	2,091,166.00	0.49
17	300146	汤臣倍健	106,500	2,066,100.00	0.48
18	603043	广州酒家	53,800	1,739,354.00	0.41
19	002796	世嘉科技	34,300	1,374,744.00	0.32
20	600845	宝信软件	45,630	1,299,542.40	0.30
21	002531	天顺风能	212,700	1,284,708.00	0.30
22	600760	中航沈飞	43,600	1,265,708.00	0.30
23	600258	首旅酒店	70,300	1,263,994.00	0.30
24	600038	中直股份	30,700	1,259,314.00	0.29
25	300232	洲明科技	124,700	1,207,096.00	0.28
26	002912	中新赛克	11,800	1,107,666.00	0.26
27	600990	四创电子	18,000	837,360.00	0.20
28	000998	隆平高科	15,100	218,648.00	0.05
29	002557	洽洽食品	7,000	176,750.00	0.04
30	300422	博世科	9,100	101,101.00	0.02

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002624	完美世界	12,651,852.38	2.96
2	000961	中南建设	10,086,733.50	2.36
3	000063	中兴通讯	8,607,258.99	2.01
4	601398	工商银行	7,833,472.00	1.83
5	000001	平安银行	6,436,468.81	1.51
6	002371	北方华创	5,883,342.58	1.38
7	601818	光大银行	5,396,245.00	1.26
8	601166	兴业银行	5,395,346.00	1.26
9	000858	五粮液	5,385,722.00	1.26
10	300360	炬华科技	4,846,776.00	1.13
11	002271	东方雨虹	4,612,649.00	1.08
12	600588	用友网络	4,442,513.00	1.04
13	000932	华菱钢铁	4,382,423.00	1.03
14	000157	中联重科	4,294,920.00	1.00
15	000651	格力电器	4,292,505.00	1.00
16	600536	中国软件	4,289,691.00	1.00
17	601336	新华保险	4,285,703.38	1.00
18	600352	浙江龙盛	4,269,475.05	1.00
19	300498	温氏股份	3,964,614.00	0.93
20	002299	圣农发展	3,772,681.00	0.88

注:上述买入金额为买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	7,932,487.00	1.86
2	601166	兴业银行	5,636,063.00	1.32
3	601818	光大银行	5,543,681.00	1.30
4	000858	五粮液	4,912,269.10	1.15
5	600588	用友网络	4,655,149.93	1.09
6	000063	中兴通讯	4,496,152.00	1.05
7	601336	新华保险	4,323,901.00	1.01
8	000001	平安银行	4,313,525.00	1.01
9	002299	圣农发展	3,693,610.00	0.86
10	300498	温氏股份	3,281,703.00	0.77
11	601800	中国交建	2,905,209.84	0.68
12	600970	中材国际	2,824,759.50	0.66
13	600309	万华化学	2,772,240.00	0.65
14	002027	分众传媒	2,753,437.00	0.64
15	600584	长电科技	2,727,884.00	0.64
16	601601	中国太保	2,416,027.00	0.57

17	002271	东方雨虹	2,388,315.00	0.56
18	000961	中南建设	2,323,170.00	0.54
19	002230	科大讯飞	2,280,594.00	0.53
20	002557	洽洽食品	2,200,929.50	0.51

注:上述卖出金额为卖出成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	202,746,524.64
卖出股票收入(成交)总额	120,181,051.37

注:上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	20,794,000.00	4.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,042,000.00	11.71
	其中:政策性金融债	50,042,000.00	11.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	400,691,000.00	93.72
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	3,609,991.00	0.84
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	475,136,991.00	111.14

7.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	011900954	19 阳煤 SCP002	300,000	30,066,000.00	7.03
2	180312	18 进出 12	300,000	30,048,000.00	7.03
3	011900369	19 华发集团 SCP001	300,000	30,039,000.00	7.03
4	180024	18 付息国债 24	200,000	20,794,000.00	4.86
5	011901003	19 中航资本 SCP004	200,000	20,070,000.00	4.69

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 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贵金属投资明细

无。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.10.1 本期国债期货投资政策**

无。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.10.3 本期国债期货投资评价

无。

7.11 投资组合报告附注**7.11.1**

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，中兴通讯股份有限公司（000063）于2018年6月12日发布公告已与美国BIS达成《替代的和解协议》。根据协议，中兴通讯将支付合计14亿美元的民事罚款。

7.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	46,474.51
2	应收证券清算款	153.19
3	应收股利	-
4	应收利息	3,117,022.52

5	应收申购款	1,122.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,164,773.05

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
建信润利增强债券A	2,147	183,071.01	895,010.20	0.23	392,158,443.13	99.77
建信润利增强债券C	328	109,078.17	10,002,250.00	27.96	25,775,389.44	72.04
合计	2,475	173,265.09	10,897,260.20	2.54	417,933,832.57	97.46

注：注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业	建信润利增强债券A	510.15	0.00

人员持有本基金			
	合计	10,025.85	0.00

注:基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注:截至本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信润利增强债券 A	建信润利增强债券 C
基金合同生效日 (2019年3月26日) 基金份额总额	472,612,825.92	66,824,023.82
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	164,784.37	583,827.13
减:基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	79,724,156.96	31,630,211.51
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额(份额减少 以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额 总额	393,053,453.33	35,777,639.44

注:申购含转换入份额;赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期,本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经本基金管理人建信基金管理有限责任公司第五届董事会第五次临时会议审议通过，自 2019 年 3 月 13 日起，曲寅军不再担任建信基金管理有限责任公司首席投资官（副总裁）。上述事项本公司已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案并于 2019 年 3 月 16 日公告。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	3	127,394,771.30	39.45%	118,642.79	39.83%	-
中信证券	2	92,656,069.65	28.69%	84,437.37	28.35%	-

海通证券	1	51,874,218.92	16.06%	47,271.66	15.87%	-
招商证券	1	34,460,201.64	10.67%	32,092.70	10.77%	-
高华证券	1	16,542,314.50	5.12%	15,405.82	5.17%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注:1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

- （1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- （3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；
- （4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金基金合同于2019年3月26日生效，本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	2,615,283.30	100.00%	3,930,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增第一创业为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2019年6月20日
2	关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2019年6月12日
3	关于增加西藏东方财富证券股份有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2019年6月1日
4	关于增加北京百度百盈基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2019年5月14日
5	建信润利增强债券型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2019年4月25日

6	建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2019 年 3 月 29 日
7	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2019 年 3 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信润利增强债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信润利增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信润利增强债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信润利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。

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

11.3 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 8 月 29 日