

# 建信灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告

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

报告送出日期：2020 年 1 月 21 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 1 月 17 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	建信灵活配置混合
基金主代码	000270
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 11 日
报告期末基金份额总额	102,010,497.01 份
投资目标	本基金自上而下积极、动态地配置大类资产，同时通过合理的证券选择，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整大类资产配置比例，同时将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，运用自上而下和自下而上相结合的个股、个券投资策略，在大类资产配置和证券选择两个层面上实现投资组合的双重优化。
业绩比较基准	55%×沪深 300 指数+45%×中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
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

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	建信安心保本混合
基金主代码	000270
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 9 月 3 日

报告期末基金份额总额	194,476,469.66 份
投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，寻求组合资产的稳定增长和本周期收益的最大化。
投资策略	本基金投资策略分为两个层次：一层为基金在风险资产和安全资产两大类资产上的配置策略；另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率（税前）。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的中低风险品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年10月11日-2019年12月31日）
1. 本期已实现收益	-204,718.55
2. 本期利润	99,003.40
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0008
4. 期末基金资产净值	108,224,876.79
5. 期末基金份额净值	1.0609

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。

#### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年10月1日-2019年10月10日）
1. 本期已实现收益	1,734,819.22
2. 本期利润	343,254.01
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0010
4. 期末基金资产净值	205,855,225.99
5. 期末基金份额净值	1.0590

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。

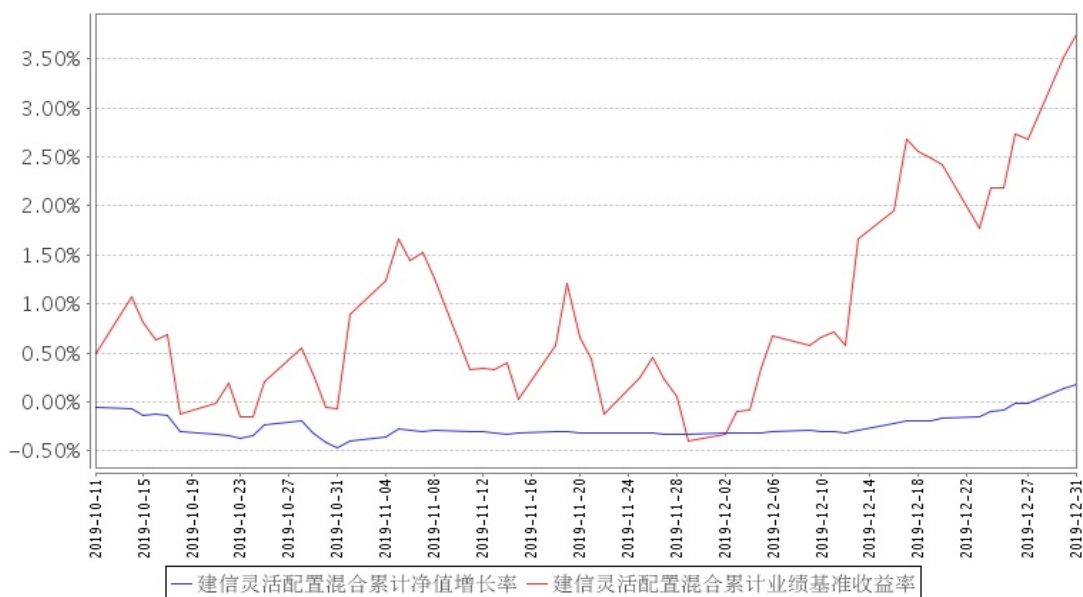
### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 3.2.1 自基金转型以来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
自 2019-10-11 至 2019-12-31	0.18%	0.05%	3.75%	0.41%	-3.57%	-0.36%

#### 3.2.2 自基金转型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

建信灵活配置混合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



### 3.2 基金净值表现（转型前）

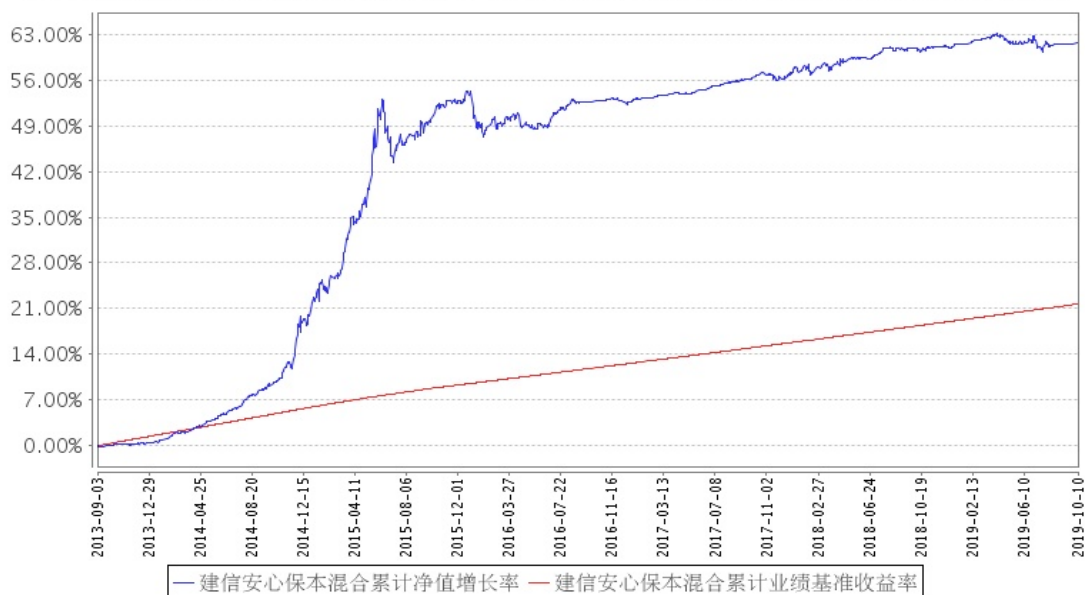
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自	0.09%	0.05%	0.08%	0.03%	0.01%	0.02%

2019-10-01						
至						
2019-10-10						

### 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

建信安心保本混合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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
牛兴华	本基金的基金经理	2019年10月11日	-	9年	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

				<p>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，该基金在 2019 年 10 月 11 日转型为建信灵活配置混合型证券投资基金，牛兴华继续担任该基金的基金经理；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；2019 年 8 月 6 日起任建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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		
牛兴华	本基金的基金经理	2018 年 4 月 20 日	2019 年 10 月 10 日	9 年	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

				<p>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，该基金在 2019 年 10 月 11 日转型为建信灵活配置混合型证券投资基金，牛兴华继续担任该基金的基金经理；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；2019 年 8 月 6 日起任建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

## 4.2 管理人对报告期内基金运作合规守信情况的说明

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《建信安心保本混合型证券投资基金基金合同》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

本报告期内未出现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。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年四季度宏观经济运行整体平稳并出现一定积极变化。12 月制造业采购经理指数 (PMI) 为 50.2%，连续两月位于荣枯线以上。需求端方面，1-11 月固定资产投资累计增速 5.2%，较三季度末下降 0.2 个百分点；其中房地产投资维持较强韧性，1-11 月累计同比增长 10.2%；1-11 月基建投资（不含电力）累计同比 4.0%，增速较三季度末回落 0.5 个百分点；1-11 月制造业投资增速持平在 2.5%。1-11 月份社会消费品零售总额同比增长 8.0%，增速相比于三季度末下行 0.2 个百分点。进出口方面，1-11 月进出口总额同比增长 2.4%，保持正增长，虽然中美经贸摩擦影响进一步显现，但与欧盟和东盟等主要贸易伙伴进出口增速维持较高水平，此外由于中美关于第一阶段的协议文本上双方达成了一致，对于后续贸易摩擦担忧有明显缓解。从生产端上看，1-11 月全国规模以上工业增加值累计同比实际增长 5.6%，与三季度持平，其中高技术制造业仍保持较快增长。总体看，四季度生产持续走强，需求相对稳定，经济韧性较强。

价格方面，1-11 月 CPI 累计同比上涨 2.8%，涨幅比 19 年三季度上升 0.3 个百分点，主要是受到猪肉供给收缩影响。1-11 月全国工业生产者出厂价格同比下降 0.3%，跌幅比三季度扩大 0.3 个百分点，其中 10、11 月当月 PPI 同比走势分别为 -1.6% 和 -1.4%，10 月 PPI 达到全年低位水平后降幅有所收窄，工业品价格在政策刺激和库存低位水平下有所回升。

政策层面，四季度资金面维持合理适度水平，货币政策维持稳健基调，继续下大力气疏通货币政策传导。央行于 11 月 5 日下调 MLF 操作利率 5bp 至 3.25%，11 月 18 日下调 7 天回购操作利率 5bp 至 2.50%，引导与 MLF 直接挂钩的 LPR1 年和 5 年期基准利率下行 5bp 至 4.15% 和 4.80%，并于 12



月末推动存量浮动利率贷款的定价基准转换为 LPR，完善贷款市场报价利率形成机制，推动实体经济融资成本的下降。从人民币汇率上看，12 月末人民币兑美元中间价收于 6.9762，较三季度末升值 1.37%。

债券市场方面，四季度债券市场收益率先上后下，曲线呈现陡峭化；10 月份通胀预期高企推动收益率上行，进入 11 月基本面数据较弱，叠加央行先后降低 MLF 和 OMO 利率 5bp，货币宽松预期升温，给债市带来小幅提振；随后进入 12 月份，经济数据有所改善，流动性宽松推动短端利率下行明显，长端保持窄幅振荡。四季度末 10 年国开债收益率相比于三季度末 3.53% 的位置上行 5BP 到 3.58%，10 年国债收益率较三季度末持平在 3.14%。权益市场方面，沪深 300 指数四季度涨幅为 7.39%，中证转债指数四季度上涨 6.59%。

回顾四季度的基金管理工作，组合持仓仍旧以短久期、高等级信用债为主要配置方向。四季度组合持续降低了杠杆的应用比例以保证产品进入转型期的流动性需求。权益方面，组合四季度大幅降低了权益资产的操作以避免产品在转型期间产生较大波动。另外，通过积极参与新发转债的一级申购以增厚组合收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金转型后净值增长率 0.18%，波动率 0.05%，业绩比较基准收益率 3.75%，波动率 0.41%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告（转型后）

#### 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	8,028,373.00	6.12
	其中：股票	8,028,373.00	6.12
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	115,935,461.64	88.42
	其中：债券	115,935,461.64	88.42
	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	5,525,961.96	4.21
8	其他资产	1,624,828.62	1.24
9	合计	131,114,625.22	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	-	-
B	采矿业	686,200.00	0.63
C	制造业	3,963,599.00	3.66
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	226,791.00	0.21
J	金融业	1,799,649.00	1.66
K	房地产业	-	-
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	1,027,532.00	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	324,602.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,028,373.00	7.42

### 5.2.2 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

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	603136	天目湖	38,600	1,027,532.00	0.95
2	601088	中国神华	37,600	686,200.00	0.63
3	601169	北京银行	100,600	571,408.00	0.53
4	601658	邮储银行	95,400	559,044.00	0.52
5	603218	日月股份	26,800	556,636.00	0.51
6	000661	长春高新	1,100	491,700.00	0.45
7	002601	龙蟒佰利	30,400	467,856.00	0.43
8	600600	青岛啤酒	8,600	438,600.00	0.41
9	002110	三钢闽光	37,400	350,064.00	0.32
10	600000	浦发银行	27,500	340,175.00	0.31

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,119,000.00	9.35
	其中：政策性金融债	10,119,000.00	9.35
4	企业债券	10,141,000.00	9.37
5	企业短期融资券	38,087,000.00	35.19
6	中期票据	57,409,900.00	53.05
7	可转债（可交换债）	178,561.64	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	115,935,461.64	107.12

## 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112461	16 龙控 02	100,000	10,141,000.00	9.37
2	170209	17 国开 09	100,000	10,119,000.00	9.35
3	011902152	19 镇江城建 SCP011	100,000	10,048,000.00	9.28
4	101901577	19 津城建 MTN011A	100,000	10,033,000.00	9.27
5	101901715	19 平高 MTN001	100,000	10,025,000.00	9.26

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 本基金投资的前十名证券的发行主体是否出现被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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,上海浦东发展银行股份有限公司(600000)于2019年10月14日发布公告,中国银行保险监督管理委员会(以下简称“中国银保监会”)对公司成都分行授信业务及整改情况严重失察、重大审计发现未向

监管部门报告、轮岗制度执行不力的违规行为依法查处，执行罚款 130 万元人民币（银保监罚决字【2019】7 号）。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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	462,478.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	708,015.42
5	应收申购款	454,334.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,624,828.62

### 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

无。

### 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。

## § 5 投资组合报告（转型前）

### 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	-	0.00
	其中：股票	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	129,997.44	0.05
	其中：债券	129,997.44	0.05

	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	277,238,896.13	99.67
8	其他资产	777,496.45	0.28
9	合计	278,146,390.02	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

### 5.2.2 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

无。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	129,997.44	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	129,997.44	0.06

## 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128075	远东转债	1,300	129,997.44	0.06

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 本基金投资的前十名证券的发行主体是否出现被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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是否超出基金合同规定的备选股票库。

基金投资的前十名证券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	585,544.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	191,951.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	777,496.45

#### 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

无。

#### 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（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2019年10月11日）持有的基金份额	194,476,469.66
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	667,091.77
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	93,133,064.42
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）	
报告期期末基金份额总额	102,010,497.01

## § 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

本报告期期初基金份额总额	572,406,826.08
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	377,930,356.42
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	194,476,469.66

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

### 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。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 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 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

投资	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金	期初	申购	赎回	持有份额	份额占比 (%)

者类别		份额比例达到或者超过 20%的时间区间	份额	份额	份额		
机构	1	2019 年 10 月 01 日 - 2019 年 10 月 07 日	200,057,365.18	-	200,057,365.18	0.00	0.00

注:本基金本报告期末不存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信灵活配置混合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。

### 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 9.3 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

2020 年 1 月 21 日