

# 建信灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

## § 1 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。本中期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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
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	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
11.1 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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信灵活配置混合型证券投资基金	
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	
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	73,118,758.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信灵活配置混合 A	建信灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	000270	020726
报告期末下属分级基金的份额总额	42,967,902.53 份	30,150,856.27 份

### 2.2 基金产品说明

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	中证 2000 指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%
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。

注：本基金管理人于 2024 年 5 月 31 日发布《关于建信灵活配置混合型证券投资基金调整业绩比较基准并修改基金合同的公告》，为维护基金份额持有人权益，使建信灵活配置混合型证券投资基金的业绩比较基准更好的反映基金的投资策略，更科学、合理地评价基金的业绩表现，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定和《建信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金管理人决定对该基金基金合同中涉及业绩比较基准的相关内容进行修改。将原业绩比较基准“55%×沪深 300 指数+45%×中国债券总指数”调整为“中证 2000 指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%”。上述修改内容自公告发布之日起生效执行。详情请参见基金管理人相关公告。

## 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
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	袁耀光
	联系电话	010-66228888	010-58560666
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533; 010-66228000	95568
传真		010-66228001	010-57093382
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	北京市西城区复兴门内大街 2 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	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100033	100031
法定代表人		生柳荣	高迎欣

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金中期报告备置地点	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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	2024 年 2 月 7 日 (基金合同生效日) -2024 年 6 月 30 日
	建信灵活配置混合 A	建信灵活配置混合 C
本期已实现收益	-10,371,749.14	-134,515.31
本期利润	-12,979,457.24	-1,218,645.95
加权平均基金份 额本期利润	-0.2687	-0.0525
本期加权平均净 值利润率	-29.67%	-5.90%
本期基金份额净	-20.92%	35.15%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	8,995,384.67	-4,141,781.32
期末可供分配基金份额利润	0.2094	-0.1374
期末基金资产净值	37,404,710.51	26,224,022.44
期末基金份额净值	0.8705	0.8698
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-17.80%	35.15%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、本基金于 2024 年 2 月 7 日起新增 C 类份额，原有份额转换为 A 类份额。

## 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

建信灵活配置混合 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	-7.42%	2.14%	-8.24%	1.67%	0.82%	0.47%
过去三个月	-2.91%	2.27%	-6.32%	1.04%	3.41%	1.23%
过去六个月	-20.92%	2.86%	-3.78%	0.84%	-17.14%	2.02%
过去一年	-15.34%	2.13%	-8.64%	0.67%	-6.70%	1.46%

过去三年	-21.58%	1.53%	-18.92%	0.63%	-2.66%	0.90%
自基金合同生效起 至今	-17.80%	1.24%	-0.70%	0.67%	-17.10%	0.57%

## 建信灵活配置混合 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	-7.44%	2.14%	-8.24%	1.67%	0.80%	0.47%
过去三个月	-3.00%	2.26%	-6.32%	1.04%	3.32%	1.22%
自基金合同生效起 至今	35.15%	2.48%	-2.89%	0.89%	38.04%	1.59%

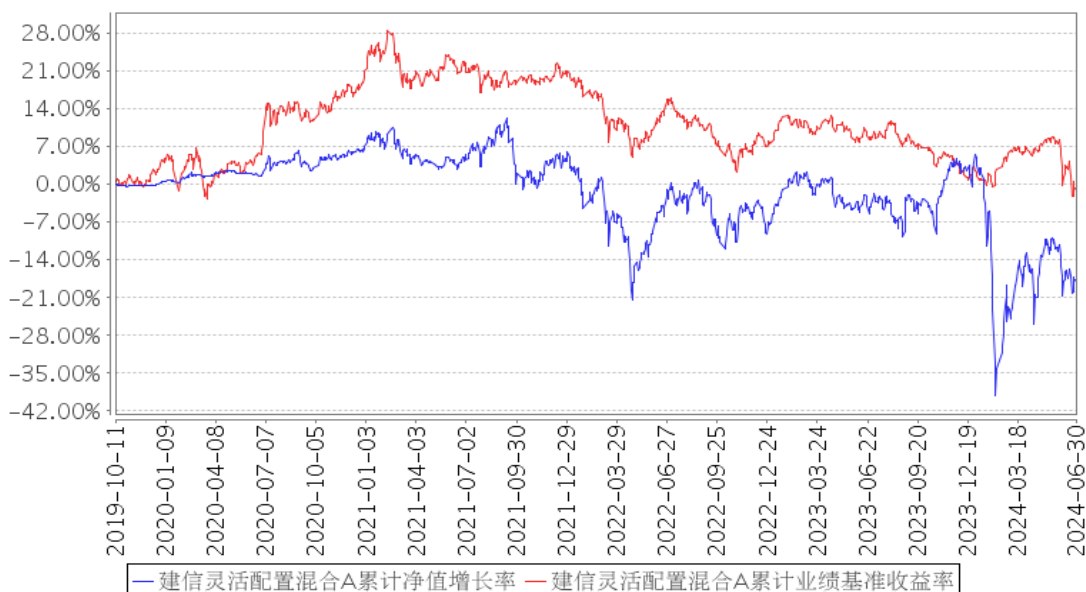
注：

本基金管理人于 2024 年 5 月 31 日发布《关于建信灵活配置混合型证券投资基金调整业绩比较基准并修改基金合同的公告》，为维护基金份额持有人权益，使建信灵活配置混合型证券投资基金的业绩比较基准更好的反映基金的投资策略，更科学、合理地评价基金的业绩表现，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定和《建信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金管理人决定对该基金基金合同中涉及业绩比较基准的相关内容进行修改。将原业绩比较基准“55%×沪深 300 指数+45%×中国债券总指数”调整为“中证 2000 指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%”。上述修改内容自公告发布之日起生效执行。详情请参见基金管理人相关公告。

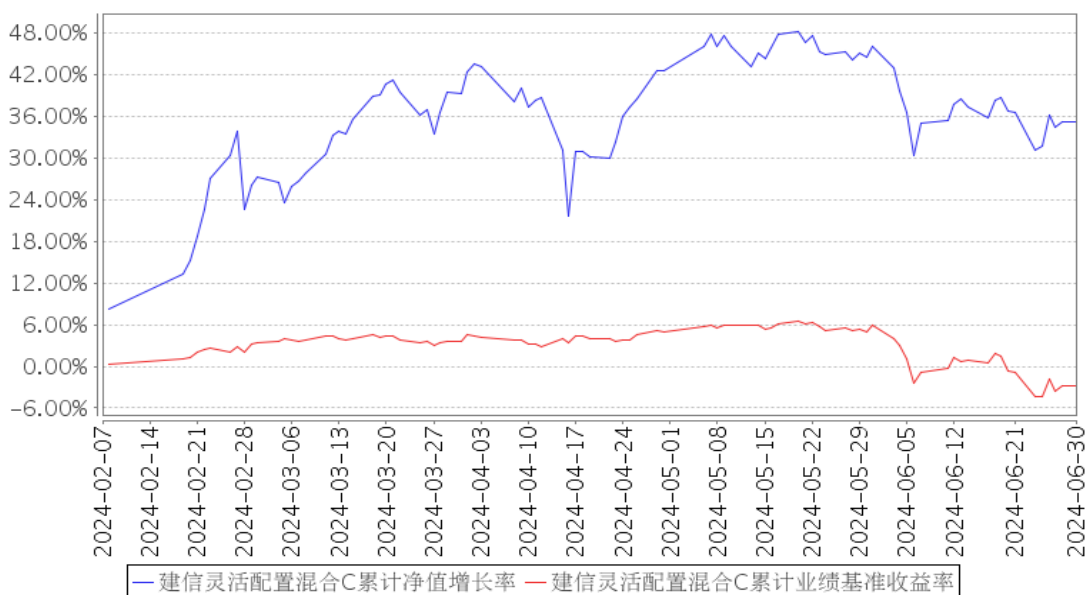


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信灵活配置混合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



建信灵活配置混合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：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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，由中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团产融控股有限公司合资设立，注册资本 2 亿元。

公司拥有公开募集证券投资基金、私募资产管理计划、QDII、保险资金受托等业务资格，总部设在北京，下设北京、上海、广州、成都、深圳、南京、武汉七家分公司，并分别在上海和香港设立了子公司——建信资本管理有限责任公司、建信资产管理（香港）有限公司。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”。

公司以持续优秀的管理能力、完善周到的服务，为超过 8000 万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至 2024 年 6 月 30 日，公司管理运作 166 只公开募集证券投资基金以及多个私募资产管理计划，资产管理规模 1.12 余万亿元。

#### 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 10 月 11 日	2024 年 5 月 17 日	13	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。2008 年 10 月至 2009 年 12 月任神州数码中国有限公司任投资专员；2010 年 9 月至 2013 年 4 月任中诚信国际信用评级有限责任公司高级分析师；2013 年 4 月加入建信基金，历任债券研究员、基金经理等职务。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 日至 2020 年 8 月 6 日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 日至 2019 年 1 月 21 日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 日至 2022 年 12 月 27 日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

					<p>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 日至 2023 年 9 月 26 日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，牛兴华于 2019 年 10 月 11 日至 2024 年 5 月 17 日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 日至 2020 年 12 月 15 日任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 8 月 6 日至 2021 年 3 月 9 日任建信稳定添利债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 10 日起任建信兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2021 年 1 月 25 日起任建信转债增强债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 30 日起任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 5 月 17 日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理。</p>
郭志腾	本基金的基金经理	2023 年 12 月 7 日	-	6	<p>郭志腾先生，硕士。2017 年 7 月毕业于北京大学金融专业，同年 7 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理、数量投资部投资经理等职务。2023 年 12 月 7 日起任建信灵活配置混合型证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信沪深 300 红利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。</p>
叶乐天	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2021 年 9 月 15 日	-	16	<p>叶乐天先生，数量投资部副总经理，博士。曾任中国国际金融有限公司市场风险管理分析员、量化分析经理。2011 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理。2012 年 3 月 21</p>

					<p>日至 2016 年 7 月 20 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；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理，该基金自 2021 年 1 月 1 日起转型为建信央视财经 50 指数证券投资基金（LOF），叶乐天继续担任该基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 4 月 18 日至 2023 年 11 月 17 日任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 22 日至 2024 年 2 月 5 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；2018 年 1 月 10 日至 2022 年 8 月 9 日任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 8 月 24 日至 2022 年 11 月 17 日任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日起任建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日起任建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 15 日起任建信灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2022 年 12 月 23 日起任建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

③牛兴华的管理日期为 2019 年 10 月 11 日至 2024 年 5 月 17 日。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，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，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。

### 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

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》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。

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

本基金为灵活配置型基金。在报告期内，本基金主要以指数增强的方式运作，风格保持偏小盘成长。基金管理人以量化模型研究为基础，利用量化方法构建投资组合并进行风险管理。本基金在暴露小盘风格的同时，通过量化模型来识别风险并精选个股，以争取获得较为稳定的超额收益。

#### 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-20.92%，波动率 2.86%，业绩比较基准收益率-3.78%，波动率 0.84%。本报告期本基金 C 净值增长率 35.15%，波动率 2.48%，业绩比较基准收益率-2.89%，波动率 0.89%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，A 股市场在经历了一季度的波动后，在二季度的振幅有所降低。市场出现了一定的分化，以银行、煤炭等为代表的高股息资产表现较佳。

展望未来，我们认为随着国内改革政策的不断深化，新兴产业的结构性机会将有望增加。受下半年复杂多变的国际形势等因素影响，A 股市场的波动可能会加剧，市场结构仍将维持分化，基金管理人将继续使用量化策略，不断地完善风险模型和选股模型，充分发挥量化方法论的优势，尽可能地为投资者带来更好的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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、风险与合规管理部、投资风险管理部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。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

## § 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：建信灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	4,986,556.50	4,050,981.84
结算备付金		504,936.32	215,368.75
存出保证金		56,588.23	41,373.53
交易性金融资产	6.4.7.2	55,897,021.35	55,019,220.27
其中：股票投资		55,897,021.35	55,019,220.27
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,000,623.84	2,001,980.84
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,000,420.96	-
应收股利		-	-
应收申购款		357,723.78	158,980.44

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		64,803,870.98	61,487,905.67
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	-
应付清算款		173.40	-
应付赎回款		626,142.51	489,914.87
应付管理人报酬		55,498.48	49,739.28
应付托管费		11,099.70	9,947.87
应付销售服务费		9,478.37	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	472,745.57	369,585.59
负债合计		1,175,138.03	919,187.61
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	58,259,919.54	35,993,423.63
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	5,368,813.41	24,575,294.43
净资产合计		63,628,732.95	60,568,718.06
负债和净资产总计		64,803,870.98	61,487,905.67

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 73,118,758.80 份，其中建信灵活配置混合 A 基金份额总额 42,967,902.53 份，基金份额净值人民币 0.8705 元；建信灵活配置混合 C 基金份额总额 30,150,856.27 份，基金份额净值人民币 0.8698 元。

## 6.2 利润表

会计主体：建信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-13,736,689.07	7,771,912.49
1. 利息收入		53,279.93	61,236.07
其中：存款利息收入	6.4.7.13	32,787.22	48,471.75
债券利息收入		-	-



资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,492.71	12,764.32
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,374,584.54	3,955,970.12
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-11,040,035.48	2,969,563.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	665,450.94	986,406.69
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-3,691,838.74	3,406,013.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	276,454.28	348,693.13
<b>减：二、营业总支出</b>		461,414.12	924,934.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	292,558.43	657,653.55
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	58,511.72	164,413.37
3. 销售服务费		30,923.88	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	79,420.09	102,867.33
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-14,198,103.19	6,846,978.24
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-14,198,103.19	6,846,978.24
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-

六、综合收益总额		-14,198,103.19	6,846,978.24
----------	--	----------------	--------------

### 6.3 净资产变动表

会计主体：建信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	35,993,423.63	-	24,575,294.43	60,568,718.06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	35,993,423.63	-	24,575,294.43	60,568,718.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	22,266,495.91	-	-19,206,481.02	3,060,014.89
（一）、综合收益总额	-	-	-14,198,103.19	-14,198,103.19
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	22,266,495.91	-	-5,008,377.83	17,258,118.08
其中：1. 基金申购款	91,928,412.57	-	-4,980,221.36	86,948,191.21
2. 基金赎回款	-69,661,916.66	-	-28,156.47	-69,690,073.13
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	58,259,919.54	-	5,368,813.41	63,628,732.95

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	102,086,171.24	-	51,344,909.58	153,431,080.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	102,086,171.24	-	51,344,909.58	153,431,080.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-76,458,029.30	-	-36,691,361.02	-113,149,390.32
(一)、综合收益总额	-	-	6,846,978.24	6,846,978.24
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-76,458,029.30	-	-43,538,339.26	-119,996,368.56
其中：1. 基金申购款	3,106,306.82	-	1,797,800.37	4,904,107.19
2. 基金赎回款	-79,564,336.12	-	-45,336,139.63	-124,900,475.75
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	25,628,141.94	-	14,653,548.56	40,281,690.50

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

基金管理人负责人

张力铮

主管会计工作负责人

丁颖

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）是由原建信安心保本混合型证券投资基金转型而来。根据原建信安心保本混合型证券投资基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司发布的《建信安心保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为建信灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》，基金合同生效日为 2019 年 10 月 11 日。原建信安心保本混合型证券投资基金转型为非避险策略基金，基金名称相应变更为“建信灵活配置混合型证券投资基金”，建信安心保本混合型证券投资基金份额转换为建信灵活配置混合型证券投资基金份额。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2019 年 10 月 11 日起《建信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《建信灵活配置混合型证券投资基金托管协议》生效，原《建信安心保本混合型证券投资基金基金合同》、《建信安心保本混合型证券投资基金托管协议》自同一起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《建信灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》并报证监会备案，本基金于 2024 年 2 月 7 日起根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式等不同，将本基金基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别。2024 年 2 月 7 日前原有的基金份额全部转换为建信灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信灵活配置混合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，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板、存托凭证，以及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、银行存款、货币市场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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票等权益类资产的投资占基金资产的比例为 0%-95%，其中，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券合计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。本基金业绩比较基准： $55\% \times$  沪深 300 指数  $+45\% \times$  中国债券总指数。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，

自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	4,986,556.50
等于：本金	4,985,308.84
加：应计利息	1,247.66
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,986,556.50

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	59,769,049.99	-	55,897,021.35	-3,872,028.64
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	59,769,049.99	-	55,897,021.35	-3,872,028.64

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,623.84	-



银行间市场	-	-
合计	2,000,623.84	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

无。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	59.23
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	364,014.00
其中：交易所市场	364,014.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	108,672.34

合计	472,745.57
----	------------

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 建信灵活配置混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,020,055.39	35,993,423.63
本期申购	17,198,298.88	11,250,797.64
本期赎回（以“-”号填列）	-29,250,451.74	-19,135,158.00
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	42,967,902.53	28,109,063.27

## 建信灵活配置混合 C

项目	本期 2024 年 2 月 7 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	80,677,614.93	80,677,614.93
本期赎回（以“-”号填列）	-50,526,758.66	-50,526,758.66
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	30,150,856.27	30,150,856.27

注：1、如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

2、本基金于 2024 年 2 月 7 日起新增 C 类份额，原有份额转换为 A 类份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 建信灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,891,231.93	1,684,062.50	24,575,294.43
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	22,891,231.93	1,684,062.50	24,575,294.43
本期利润	-10,371,749.14	-2,607,708.10	-12,979,457.24

本期基金份额交易产生的变动数	-3,524,098.12	1,223,908.17	-2,300,189.95
其中：基金申购款	4,908,729.96	-521,463.44	4,387,266.52
基金赎回款	-8,432,828.08	1,745,371.61	-6,687,456.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,995,384.67	300,262.57	9,295,647.24

## 建信灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-134,515.31	-1,084,130.64	-1,218,645.95
本期基金份额交易产生的变动数	-4,007,266.01	1,299,078.13	-2,708,187.88
其中：基金申购款	-10,729,018.91	1,361,531.03	-9,367,487.88
基金赎回款	6,721,752.90	-62,452.90	6,659,300.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,141,781.32	214,947.49	-3,926,833.83

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	28,935.47
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	3,440.76
其他	410.99
合计	32,787.22

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-11,040,035.48
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-11,040,035.48

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	262,147,706.08
减：卖出股票成本总额	272,547,535.01
减：交易费用	640,206.55
买卖股票差价收入	-11,040,035.48

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	665,450.94
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	665,450.94

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,691,838.74
股票投资	-3,691,838.74
债券投资	-
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	-3,691,838.74

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日

基金赎回费收入	264,997.04
基金转换费收入	11,457.24
合计	276,454.28

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,147.75
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	79,420.09

#### 6.4.7.24 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（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	292,558.43	657,653.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	102,625.26	105,737.50
应支付基金管理人的净管理费	189,933.17	551,916.05

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 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 × 1.00% / 当年天数。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	58,511.72	164,413.37

注：支付基金托管人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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信灵活配置混合 A	建信灵活配置混合 C	合计
建信基金	-	240.43	240.43
合计	-	240.43	240.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信灵活配置混合 A	建信灵活配置混合 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

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，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.4%。销售服务费的计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}$$

#### 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	本期 2024 年 2 月 7 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日
		建信灵活配置混合 A
基金合同生效日(2019 年 10	-	-



月 11 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	8,160,877.85	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	8,160,877.85	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.99%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 -
	建信灵活配置混合 A	建信灵活配置混合 C
基金合同生效日( 2019 年 10 月 11 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注: 分级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。

#### 6.4.10.5.2 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

无。

#### 6.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行-活期	4,986,556.50	28,935.47	2,485,908.75	42,775.60

注: 本基金的银行存款由基金托管人保管, 按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 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（2024 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

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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  
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督  
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、由风险管理与内控合规委员  
会、督察长、风险与合规管理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风险与合规管理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同责任，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**

无。

#### **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**

无。

#### **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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,986,556.50	-	-	-	4,986,556.50
结算备付金	504,936.32	-	-	-	504,936.32
存出保证金	56,588.23	-	-	-	56,588.23
交易性金融资产	-	-	-	55,897,021.35	55,897,021.35
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	2,000,623.84	-	-	-	2,000,623.84
应收清算款	-	-	-	1,000,420.96	1,000,420.96
债权投资	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	357,723.78	357,723.78
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,548,704.89	-	-	57,255,166.09	64,803,870.98
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	173.40	173.40
应付赎回款	-	-	-	626,142.51	626,142.51
应付管理人报酬	-	-	-	55,498.48	55,498.48
应付托管费	-	-	-	11,099.70	11,099.70
应付销售服务费	-	-	-	9,478.37	9,478.37
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	472,745.57	472,745.57
负债总计	-	-	-	1,175,138.03	1,175,138.03
利率敏感度缺口	7,548,704.89	-	-	56,080,028.06	63,628,732.95
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
货币资金	4,050,981.84	-	-	-	4,050,981.84
结算备付金	215,368.75	-	-	-	215,368.75
存出保证金	41,373.53	-	-	-	41,373.53
交易性金融资产	-	-	-	55,019,220.27	55,019,220.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	2,001,980.84	-	-	-	2,001,980.84
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	158,980.44	158,980.44
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,309,704.96	-	-	55,178,200.71	61,487,905.67
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	489,914.87	489,914.87
应付管理人报酬	-	-	-	49,739.28	49,739.28
应付托管费	-	-	-	9,947.87	9,947.87

应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	369,585.59	369,585.59
负债总计	-	-	919,187.61	919,187.61
利率敏感度缺口	6,309,704.96	-	54,259,013.10	60,568,718.06

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

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

#### 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。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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	55,897,021.35	87.85	55,019,220.27	90.84
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	55,897,021.35	87.85	55,019,220.27	90.84

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	4,303,843.41	3,558,541.85
业绩比较基准下降5%	-4,303,843.41	-3,558,541.85	

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	55,897,021.35	55,019,220.27
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	55,897,021.35	55,019,220.27

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

**§ 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	55,897,021.35	86.26
	其中：股票	55,897,021.35	86.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,000,623.84	3.09
	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	5,491,492.82	8.47
8	其他各项资产	1,414,732.97	2.18
9	合计	64,803,870.98	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	45,322,410.50	71.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,240,194.00	1.95
E	建筑业	1,190,370.00	1.87
F	批发和零售业	1,167,111.00	1.83
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	4,082,478.36	6.42
J	金融业	-	-
K	房地产业	94,000.00	0.15
L	租赁和商务服务业	155,760.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	862,004.49	1.35
N	水利、环境和公共设施管理业	645,187.00	1.01
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	1,137,506.00	1.79
S	综合	-	-
	合计	55,897,021.35	87.85

### 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	688077	大地熊	46,000	728,180.00	1.14
2	300897	山科智能	39,464	727,716.16	1.14
3	301053	远信工业	36,200	722,552.00	1.14
4	300371	汇中股份	85,900	718,983.00	1.13
5	002826	易明医药	90,200	715,286.00	1.12
6	600333	长春燃气	194,100	710,406.00	1.12
7	688273	麦澜德	35,800	708,840.00	1.11
8	603637	镇海股份	116,100	708,210.00	1.11
9	002905	金逸影视	113,700	704,940.00	1.11
10	603041	美思德	70,300	703,000.00	1.10
11	603192	汇得科技	52,100	699,703.00	1.10
12	002066	瑞泰科技	87,700	697,215.00	1.10
13	603385	惠达卫浴	126,400	693,936.00	1.09

14	688662	富信科技	28,400	692,960.00	1.09
15	688078	龙软科技	30,000	690,900.00	1.09
16	688323	瑞华泰	68,400	688,788.00	1.08
17	603238	诺邦股份	69,000	687,240.00	1.08
18	603336	宏辉果蔬	227,000	683,270.00	1.07
19	603949	雪龙集团	60,600	682,356.00	1.07
20	688026	洁特生物	68,400	681,264.00	1.07
21	300865	大宏立	42,100	675,284.00	1.06
22	301125	腾亚精工	68,180	674,300.20	1.06
23	688310	迈得医疗	50,000	657,000.00	1.03
24	300915	海融科技	25,000	653,500.00	1.03
25	688028	沃尔德	39,300	645,699.00	1.01
26	300923	研奥股份	37,800	642,600.00	1.01
27	688109	品茗科技	23,276	636,598.60	1.00
28	300955	嘉亨家化	49,500	627,165.00	0.99
29	603976	正川股份	44,400	626,484.00	0.98
30	603790	雅运股份	65,200	625,920.00	0.98
31	300960	通业科技	41,200	620,884.00	0.98
32	300743	天地数码	45,100	610,654.00	0.96
33	688657	浩辰软件	16,456	608,213.76	0.96
34	603926	铁流股份	73,000	605,900.00	0.95
35	300892	品渥食品	44,400	605,616.00	0.95
36	688022	瀚川智能	43,600	597,756.00	0.94
37	301068	大地海洋	27,820	576,986.80	0.91
38	605100	华丰股份	47,900	557,077.00	0.88
39	300241	瑞丰光电	135,500	555,550.00	0.87
40	300658	延江股份	130,240	549,612.80	0.86
41	688179	阿拉丁	55,047	532,304.49	0.84
42	002286	保龄宝	96,300	530,613.00	0.83
43	603817	海峡环保	111,300	529,788.00	0.83
44	688680	海优新材	18,400	528,816.00	0.83
45	688678	福立旺	48,460	524,821.80	0.82
46	300907	康平科技	27,500	522,225.00	0.82
47	000985	大庆华科	41,300	520,380.00	0.82
48	001260	坤泰股份	37,300	519,589.00	0.82
49	688682	霍莱沃	17,600	516,384.00	0.81
50	300771	智莱科技	58,600	515,094.00	0.81
51	688092	爱科科技	23,920	510,692.00	0.80
52	688330	宏力达	25,000	509,750.00	0.80
53	688079	美迪凯	68,000	504,560.00	0.79
54	688201	信安世纪	41,600	491,296.00	0.77
55	688386	泛亚微透	17,200	482,632.00	0.76
56	002830	名雕股份	49,000	482,160.00	0.76

57	300871	回盛生物	50,300	479,862.00	0.75
58	688020	方邦股份	14,200	473,712.00	0.74
59	688175	高凌信息	31,600	467,048.00	0.73
60	688377	迪威尔	33,400	437,540.00	0.69
61	603798	康普顿	51,700	435,314.00	0.68
62	300385	雪浪环境	128,700	433,719.00	0.68
63	688329	艾隆科技	29,145	433,094.70	0.68
64	688600	皖仪科技	32,200	430,514.00	0.68
65	688611	杭州柯林	15,800	421,070.00	0.66
66	300440	运达科技	78,500	412,125.00	0.65
67	300800	力合科技	37,000	383,320.00	0.60
68	603768	常青股份	33,700	382,158.00	0.60
69	300006	莱美药业	158,900	371,826.00	0.58
70	688080	映翰通	11,800	357,894.00	0.56
71	688117	圣诺生物	14,200	348,468.00	0.55
72	300816	艾可蓝	14,600	340,180.00	0.53
73	300752	隆利科技	25,000	339,500.00	0.53
74	001222	源飞宠物	27,000	330,750.00	0.52
75	688181	八亿时空	17,400	329,730.00	0.52
76	301365	矩阵股份	30,000	329,700.00	0.52
77	301056	森赫股份	42,600	326,742.00	0.51
78	002942	新农股份	27,600	325,404.00	0.51
79	603697	有友食品	55,700	323,060.00	0.51
80	605389	长龄液压	15,300	321,147.00	0.50
81	301130	西点药业	13,600	318,648.00	0.50
82	688551	科威尔	9,813	309,109.50	0.49
83	300920	润阳科技	20,000	300,800.00	0.47
84	300837	浙矿股份	14,100	292,716.00	0.46
85	688357	建龙微纳	12,400	288,920.00	0.45
86	301276	嘉曼服饰	13,600	285,056.00	0.45
87	300950	德固特	18,700	284,988.00	0.45
88	603096	新经典	16,700	282,230.00	0.44
89	301081	严牌股份	37,000	277,500.00	0.44
90	688557	兰剑智能	11,000	254,980.00	0.40
91	001234	泰慕士	14,700	249,753.00	0.39
92	301138	华研精机	10,000	238,900.00	0.38
93	603311	金海高科	27,500	234,300.00	0.37
94	003015	日久光电	24,900	226,092.00	0.36
95	600386	北巴传媒	72,500	202,275.00	0.32
96	301349	信德新材	6,900	190,716.00	0.30
97	300519	新光药业	17,500	189,875.00	0.30
98	300190	维尔利	67,700	186,175.00	0.29
99	301396	宏景科技	9,400	183,394.00	0.29

100	605488	福莱新材	13,200	171,600.00	0.27
101	600272	开开实业	19,800	170,280.00	0.27
102	603289	泰瑞机器	18,200	162,344.00	0.26
103	300153	科泰电源	27,100	161,245.00	0.25
104	002995	天地在线	11,800	155,760.00	0.24
105	688419	耐科装备	5,200	155,584.00	0.24
106	002420	毅昌科技	33,400	152,304.00	0.24
107	601999	出版传媒	28,800	150,336.00	0.24
108	300824	北鼎股份	20,600	149,350.00	0.23
109	300813	泰林生物	8,800	149,160.00	0.23
110	300553	集智股份	6,000	146,940.00	0.23
111	301209	联合化学	6,700	146,730.00	0.23
112	001212	中旗新材	7,200	146,160.00	0.23
113	688358	祥生医疗	5,582	144,964.54	0.23
114	001367	海森药业	6,100	142,374.00	0.22
115	603221	爱丽家居	15,900	141,033.00	0.22
116	605155	西大门	15,060	137,799.00	0.22
117	301067	显盈科技	6,700	132,057.00	0.21
118	603700	宁水集团	14,000	131,320.00	0.21
119	300254	仟源医药	16,100	126,546.00	0.20
120	688019	安集科技	1,000	125,800.00	0.20
121	300867	圣元环保	11,200	118,832.00	0.19
122	600148	长春一东	9,900	117,810.00	0.19
123	300991	创益通	7,300	115,997.00	0.18
124	301269	华大九天	1,500	115,575.00	0.18
125	603006	黎明股份	11,800	114,814.00	0.18
126	603115	海星股份	11,000	114,400.00	0.18
127	603005	晶方科技	5,500	112,090.00	0.18
128	688257	新锐股份	7,200	110,376.00	0.17
129	688508	芯朋微	3,000	109,110.00	0.17
130	300672	国科微	2,000	105,680.00	0.17
131	603160	汇顶科技	1,500	103,125.00	0.16
132	600584	长电科技	3,200	101,472.00	0.16
133	601616	广电电气	34,500	100,395.00	0.16
134	300346	南大光电	3,500	100,065.00	0.16
135	600703	三安光电	8,500	99,620.00	0.16
136	001287	中电港	6,000	99,180.00	0.16
137	002436	兴森科技	9,500	98,040.00	0.15
138	688591	泰凌微	5,000	97,750.00	0.15
139	688035	德邦科技	3,000	96,660.00	0.15
140	600460	士兰微	5,500	96,305.00	0.15
141	688479	友车科技	6,000	95,340.00	0.15
142	300456	赛微电子	6,000	95,220.00	0.15

143	300474	景嘉微	1,500	94,845.00	0.15
144	600641	万业企业	8,000	94,000.00	0.15
145	300655	晶瑞电材	13,000	93,600.00	0.15
146	688262	国芯科技	5,000	91,050.00	0.14
147	300567	精测电子	1,600	90,416.00	0.14
148	000701	厦门信达	24,000	89,760.00	0.14
149	688196	卓越新能	3,800	88,198.00	0.14
150	002156	通富微电	3,900	87,321.00	0.14
151	688182	灿勤科技	6,400	84,736.00	0.13
152	000021	深科技	5,600	84,672.00	0.13
153	002185	华天科技	10,000	81,500.00	0.13
154	301043	绿岛风	3,400	81,158.00	0.13
155	688549	中巨芯	12,000	81,000.00	0.13
156	688737	中自科技	4,800	77,760.00	0.12
157	688213	思特威	1,600	77,600.00	0.12
158	301308	江波龙	800	75,792.00	0.12
159	002409	雅克科技	1,200	75,492.00	0.12
160	688072	拓荆科技	600	72,066.00	0.11
161	603579	荣泰健康	4,200	64,932.00	0.10
162	002371	北方华创	200	63,978.00	0.10
163	002916	深南电路	600	63,462.00	0.10
164	002980	华盛昌	2,800	61,292.00	0.10
165	688702	盛科通信	1,200	48,600.00	0.08
166	688369	致远互联	400	6,292.00	0.01

## 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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	300865	大宏立	3,005,350.18	4.96
2	300321	同大股份	2,086,662.00	3.45
3	300923	研奥股份	2,011,451.52	3.32
4	688655	迅捷兴	1,714,102.74	2.83
5	000708	中信特钢	1,675,300.00	2.77
6	603151	邦基科技	1,646,655.00	2.72
7	000537	中绿电	1,610,146.00	2.66
8	603192	汇得科技	1,582,411.90	2.61
9	300816	艾可蓝	1,580,701.00	2.61
10	688469	芯联集成	1,538,292.32	2.54
11	301182	凯旺科技	1,493,232.00	2.47
12	688078	龙软科技	1,478,725.36	2.44
13	002736	国信证券	1,477,589.00	2.44
14	603090	宏盛股份	1,473,699.00	2.43

15	002826	易明医药	1,462,893.00	2.42
16	002942	新农股份	1,459,453.20	2.41
17	002963	豪尔赛	1,425,651.00	2.35
18	300822	贝仕达克	1,370,945.25	2.26
19	301032	新柴股份	1,339,731.00	2.21
20	002905	金逸影视	1,333,327.00	2.20
21	688020	方邦股份	1,322,935.89	2.18
22	301053	远信工业	1,307,632.00	2.16
23	603790	雅运股份	1,292,697.00	2.13
24	603221	爱丽家居	1,274,123.00	2.10
25	603926	铁流股份	1,272,268.00	2.10
26	603949	雪龙集团	1,269,249.00	2.10
27	300920	润阳科技	1,268,590.00	2.09
28	001218	丽臣实业	1,239,205.00	2.05
29	300658	延江股份	1,235,920.00	2.04
30	688109	品茗科技	1,234,419.51	2.04
31	688255	凯尔达	1,227,009.96	2.03
32	688227	品高股份	1,226,572.32	2.03

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 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	300321	同大股份	2,734,597.00	4.51
2	688655	迅捷兴	2,138,911.91	3.53
3	300865	大宏立	2,130,293.00	3.52
4	600493	凤竹纺织	2,037,110.00	3.36
5	603221	爱丽家居	1,992,449.96	3.29
6	301182	凯旺科技	1,807,641.00	2.98
7	603320	迪贝电气	1,718,429.00	2.84
8	002963	豪尔赛	1,665,529.30	2.75
9	000708	中信特钢	1,629,309.00	2.69
10	000537	中绿电	1,626,181.00	2.68
11	688355	明志科技	1,617,453.35	2.67
12	603151	邦基科技	1,604,820.00	2.65
13	300822	贝仕达克	1,596,018.00	2.64
14	300906	日月明	1,557,379.00	2.57
15	301032	新柴股份	1,550,950.00	2.56
16	688227	品高股份	1,520,392.63	2.51
17	002736	国信证券	1,482,056.00	2.45
18	300658	延江股份	1,467,650.00	2.42
19	688469	芯联集成	1,467,525.50	2.42
20	603090	宏盛股份	1,418,986.00	2.34

21	300816	艾可蓝	1,409,070.00	2.33
22	603928	兴业股份	1,379,500.00	2.28
23	301314	科瑞思	1,373,333.96	2.27
24	003001	中岩大地	1,369,902.75	2.26
25	300923	研奥股份	1,314,472.00	2.17
26	301081	严牌股份	1,307,224.80	2.16
27	300753	爱朋医疗	1,305,352.00	2.16
28	001211	双枪科技	1,302,822.00	2.15
29	688109	品茗科技	1,294,606.58	2.14
30	301192	泰祥股份	1,261,518.00	2.08
31	300689	澄天伟业	1,252,816.00	2.07
32	300823	建科智能	1,222,643.00	2.02

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	277,117,174.83
卖出股票收入（成交）总额	262,147,706.08

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

无。

#### 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

无。

#### 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 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，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。

#### 7.12.2 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。

#### 7.12.3 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	56,588.23
2	应收清算款	1,000,420.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	357,723.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,414,732.97

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.12.6 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者



	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
建信灵活 配置混合 A	2,195	19,575.35	8,160,896.06	18.99	34,807,006.47	81.01
建信灵活 配置混合 C	1,719	17,539.77	0.00	0.00	30,150,856.27	100.00
合计	3,914	18,681.34	8,160,896.06	11.16	64,957,862.74	88.84

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 人员持有本基 金	建信灵活配置混合 A	80,733.02	0.19
	建信灵活配置混合 C	-	-
	合计	80,733.02	0.11

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研 究部门负责 人持有本开 放式基金	建信灵活配置混合 A	-
	建信灵活配置混合 C	-
	合计	-
本基金基金经 理持有本开 放式基金	建信灵活配置混合 A	0~10
	建信灵活配置混合 C	-
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信灵活配置混合 A	建信灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2019 年 10 月 11 日) 基金份额总额	194,476,469.66	-
本报告期期初基金份额总额	55,020,055.39	-
本报告期基金总申购份额	17,198,298.88	80,677,614.93
减: 本报告期基金总赎回份额	29,250,451.74	50,526,758.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	42,967,902.53	30,150,856.27

注: 1、如有相应情况, 申购含红利再投、转换入份额及金额, 赎回含转换出份额及金额。

2、本基金于 2024 年 2 月 7 日起新增 C 类份额, 原有份额转换为 A 类份额。

## § 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

本报告期内, 基金管理人于 2024 年 3 月 30 日发布公告, 自 2024 年 3 月 28 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司首席信息官。上述事项均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。

本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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财产、基金管理业务、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

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙), 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

## 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	建信基金管理有限责任公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 1 月 18 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	信息披露不及时
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改
其他	无

## 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

## 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 (%)	
招商证券	2	228,783,570.13	42.43	211,137.72	44.51	-
开源证券	1	125,693,054.19	23.31	89,663.07	18.90	-
东北证券	1	101,589,494.05	18.84	95,079.66	20.04	-
中信证券	3	80,151,990.19	14.86	75,816.80	15.98	-
长江证券	1	3,046,772.35	0.56	2,635.20	0.56	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-

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、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。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(%)
招商证券	-	-	6,800,000.00	7.73	-	-
开源证券	-	-	36,300,000.00	41.25	-	-
东北证券	-	-	44,900,000.00	51.02	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

华西证 券	-	-	-	-	-	-
华源证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-

## 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	关于新增宜信普泽（北京）基金销售有限公司为建信环保产业股票型证券投资基金等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 6 月 4 日
2	关于建信灵活配置混合型证券投资基金调整业绩比较基准并修改基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 5 月 31 日
3	建信灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 5 月 21 日
4	关于新增上海利得为公司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	2024 年 4 月 30 日
5	建信灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 2 月 7 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2024 年 5 月 31 日发布《关于建信灵活配置混合型证券投资基金调整业绩比较基准并修改基金合同的公告》，为维护基金份额持有人权益，使建信灵活配置混合型证券投资基金的业绩比较基准更好的反映基金的投资策略，更科学、合理地评价基金的业绩表现，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定和《建信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金管理人决定对该基金基金合同中涉及业绩比较基准的相关内容进行修改。将原业绩比较基准“55%×沪深 300 指数+45%×中国债券总指数”调整为“中证 2000 指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%”。上述修改内容自公告发布之日起生效执行。详情请参见基金管理人相关公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 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

2024 年 8 月 29 日