

建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF) 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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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

§ 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
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40

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	40
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	40
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	40
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	40
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12	本报告期投资基金情况	41
7.13	投资组合报告附注	50
§ 8	基金份额持有人信息	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9	开放式基金份额变动	52
§ 10	重大事件揭示	52
10.1	基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4	基金投资策略的改变	52
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	53
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.9	其他重大事件	55
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12	备查文件目录	56
12.1	备查文件目录	56
12.2	存放地点	56
12.3	查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)	
基金简称	建信福泽裕泰混合(FOF)	
基金主代码	005925	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年6月5日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	56,689,141.92份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信福泽裕泰混合(FOF)A	建信福泽裕泰混合(FOF)C
下属分级基金的交易代码	005925	005926
报告期末下属分级基金的份额总额	40,060,189.21份	16,628,952.71份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以多元资产配置为核心驱动力，通过优化配置各类资产实现投资组合的风险分散和长期稳健增长。同时本基金通过精选各类基金并构造分散的基金组合，力求实现投资组合的稳健超额收益和风险再分散。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的一类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的基金筛选。具体由大类资产配置策略、基金筛选策略、股票/债券投资策略、资产支持证券投资策略四部分组成。
业绩比较基准	80%×中证800指数收益率+20%×中债综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。同时，本基金为目标风险系列基金中基金中风险收益特征相对进取的基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	95558
传真	010-66228001	010-85230024
注册地址	北京市西城区金融大街7号英蓝	北京市朝阳区光华路10号院1

	国际金融中心 16 层	号楼 6-30 层、32-42 层
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	100033	100020
法定代表人	生柳荣	方合英

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	http://www.ccbfund.cn
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)	
	建信福泽裕泰混合(FOF)A	建信福泽裕泰混合(FOF)C
本期已实现收益	-3,877,883.02	-1,616,020.75
本期利润	-1,461,053.11	-622,150.44
加权平均基金份 额本期利润	-0.0352	-0.0356
本期加权平均净 值利润率	-3.24%	-3.38%
本期基金份额净 值增长率	-3.00%	-3.20%
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	1,852,898.27	221,299.04
期末可供分配基 金份额利润	0.0463	0.0133
期末基金资产净 值	43,324,493.52	17,410,731.52

期末基金份额净值	1.0815	1.0470
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	8.15%	4.70%

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。

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

建信福泽裕泰混合 (FOF) 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	-2.56%	0.48%	-3.22%	0.45%	0.66%	0.03%
过去三个月	-0.64%	0.61%	-2.25%	0.66%	1.61%	-0.05%
过去六个月	-3.00%	0.86%	-0.58%	0.82%	-2.42%	0.04%
过去一年	-10.50%	0.75%	-8.49%	0.74%	-2.01%	0.01%
过去三年	-23.78%	0.83%	-24.27%	0.83%	0.49%	0.00%
自基金合同生效起至今	8.15%	0.87%	4.00%	0.91%	4.15%	-0.04%

建信福泽裕泰混合 (FOF) 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	-2.60%	0.48%	-3.22%	0.45%	0.62%	0.03%
过去三个月	-0.74%	0.61%	-2.25%	0.66%	1.51%	-0.05%
过去六个月	-3.20%	0.86%	-0.58%	0.82%	-2.62%	0.04%

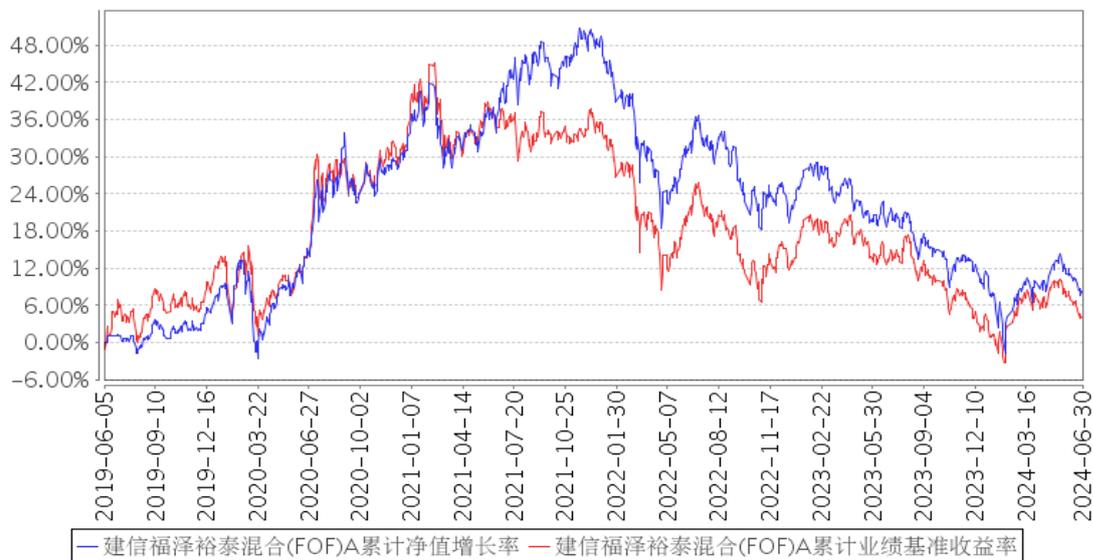
过去一年	-10.86%	0.75%	-8.49%	0.74%	-2.37%	0.01%
过去三年	-24.69%	0.83%	-24.27%	0.83%	-0.42%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.70%	0.87%	4.00%	0.91%	0.70%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准为 80%×中证 800 指数收益率+20%×中债综合财富指数收益率。

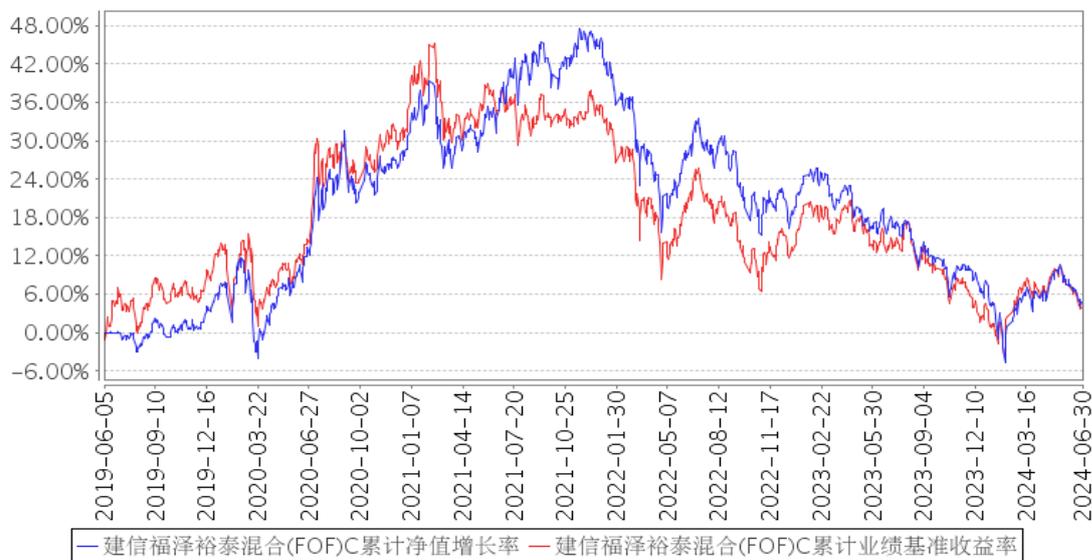
本基金主要投资于证券投资基金，重仓配置权益类资产。上述业绩比较基准能够较好地衡量本基金的投资策略及其投资业绩，也较好地体现了本基金的投资目标与产品定位，并易于被投资者理解与接受。

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

建信福泽裕泰混合(FOF)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



建信福泽裕泰混合(FOF)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		
孙悦萌	数量投资部总经理助理，本基金的基金经理	2023年3月29日	-	12	孙悦萌女士，数量投资部总经理助理，博士。曾任美国银行梅林证券定量分析师、正信嘉华顾问管理公司高级咨询师。2014年8月加入建信基金，历任创新发展部初级研究员、资产配置及量化投资部研究员、投资经理、资深投资经理、总经理助理等职务。2023年3月29日起任建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）、建信普泽养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。

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。

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合规守信情况的说明

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《建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)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

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

2024年上半年，权益市场经历了由大幅波动转为震荡的格局。1月市场在悲观预期不断发酵的背景下，市场的微观结构因素导致市场调整加剧，成长风格和小微盘风格出现了较为明显的回调。2月随着优化资本市场的政策的不断强化，微观结构的失衡有所修复，市场开启了超跌反弹的行情，成长风格领涨。随着新经济产业趋势密集催化，新质生产力发展、大规模设备更新和消费品以旧换新等产业政策利好释放，市场在2-3月延续反弹行情。4月高股息大盘蓝筹股延续了

一季度的强势，“新国九条”系列政策进一步助推大盘价值和红利风格的走强，叠加 5 月中旬四部委联合推出一揽子针对房地产行业的支持政策，沪深 300 和上证指数在市场情绪提振下创出上半年新高，地产板块也大幅上涨。但在 5 月下旬随着海外降息预期有所减弱、国内 PMI 数据不及预期、A 股资金面趋于平稳等背景下，行情重回震荡修整。行至 5 月末，受退市政策影响，绩差和涉嫌业绩作假的个股表现疲软，市场整体下跌。6 月小盘股仍然呈现高波动形态，红利股出现补跌迹象，但以科创 50 为代表的成长风格受到事件催化的影响上半月表现强势。从整体权益市场的成交活跃度角度看，市场成交量持续萎缩，波动率处于历史较低水平。

回顾报告期内的运作，权益基金方面，1 月下旬随着市场小盘风格的快速回调，管理人降低了组合中量化及指数增强基金的仓位，增加价值类基金的持仓占比。在 2 月中旬市场企稳之后，由于红利风格阶段相对收益较为可观，进行了部分止盈运作；同时考虑到市场风险偏好的提升，增加了高质量成长类基金标的，以增加组合的均衡度。在行业选择上，延续去年年度末的判断，金融、周期等板块从筹码结构、经营质量和确定性等角度占优。4 月份，权益资产中的大小盘风格分化显著，出于年度以大盘类风格占优的判断，在月度月上旬调低了小盘类基金的权重，增加大盘平衡类基金以博弈经济基本面的改善。行至月度尾声，考虑到价值类风格演绎得已经较为极致，小幅增加科技成长类标的获取弹性。5 月份，观察到自春节以来的反弹已经超 3 个月，指数上方筹码较为密集，叠加成交逐渐清淡，市场波动率大幅下降，指数波动加大的概率显著增加，有必要进行阶段性规避，因此下旬边际下调了权益资产的仓位。而在结构上，以有色行业为代表的资源类标的前期涨幅较大，出于拥挤度和估值过热风险控制，小幅减持相关标的。6 月份，月初持续降低权益资产的仓位，并对业绩不及预期的基金进行了替换。在结构上，维持大盘价值风格的基金为底仓，同时辅以行业 ETF 轮动阶段性地参与了成长科技类题材的博弈。接近 6 月末，考虑到指数的调整已经持续一段时间，下探动能有所趋缓，小幅加仓宽基指数 ETF 以博弈市场的反弹。

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-3.00%，波动率 0.86%，业绩比较基准收益率-0.58%，波动率 0.82%。本报告期本基金 C 净值增长率-3.20%，波动率 0.86%，业绩比较基准收益率-0.58%，波动率 0.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，宏观方面，当前经济内生动能和微观主体活力延续弱势，尽管近期一线城市二手房市场成交有所企稳，但持续性有待观察；后续需要观察价格预期企稳、收入预期改善等积极指标释放，判断居民融资需求的拐点是否出现。

股市方面，整体来看市场仍处于修复期，股票市场流动性温和修复。6月北向资金转为净流出，叠加融资资金的普遍回落，在市场震荡调整背景下，不排除增量资金再度入场的可能性。从市场情绪角度看，成交和波动水平均处于较低水平，根据经验，上述状态往往以指数向某一个方向大幅突破的形式终结。因此在组合层面应做好波动率放大的准备，做好仓位的应对。风格层面，从资本市场负债端观察，市场仍未出现明显的趋势性增量资金，价值风格有望维持。从政策的角度看，“新国九条”加强企业上市的监管、收紧退市指标、“削减壳资源价值”等政策也将引导大盘价值、红利行情贯穿全年。5月22日以来中证红利指数阶段性回调使其股息率水平已经重回具备比价优势的水平。行业层面，经过过去几年的强劲表现，资源股已经证明了较高的盈利潜力，但其中的节奏会根据市场的供需情况有所起伏，6月以有色为代表的资源类标的出现调整也与此有关，但在全球合作模式重构的背景下，我们仍然看好资源类标的的机会。此外，引领新质生产力发展的科技制造板块随着“科创板八条”、“创投17条”等政策支持，也有望进一步受益，但考虑到目前仍未看到市场有持续的增量资金，上述机会的持续性存疑，目前仍然以主题投资的思路进行参与。

操作上，权益资产方面，计划继续维持大盘价值为底仓、阶段参与主题投资的配置思路。在相关标的的回调后，红利板块吸引力有所提升，适合逢低布局。以有色为代表的资源类标的会以更为积极的交易思维参与，力求降低其高波动对于组合的影响。此外适时捕捉前期超跌反弹机会和积极参与科技的博弈机会，精选优质成长类基金持有。

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 and 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)2024年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司在福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2024年中期报告的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)

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	上年度末
----	-----	-----	------

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
资产:			
货币资金	6.4.7.1	4,129,748.28	3,978,307.18
结算备付金		42,126.88	22,502.87
存出保证金		8,278.45	5,847.50
交易性金融资产	6.4.7.2	56,055,469.73	65,015,610.90
其中: 股票投资		-	-
基金投资		56,055,469.73	65,015,610.90
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	-	-
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		1,468,159.49	695,356.67
应收股利		204.09	298.23
应收申购款		3,046.34	3,605.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	177.02	1,016.03
资产总计		61,707,210.28	69,722,544.56
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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		-	-
应付清算款		747,118.45	200,008.00
应付赎回款		53,726.13	136,307.50
应付管理人报酬		56,089.72	61,206.80
应付托管费		5,025.66	5,880.69
应付销售服务费		5,852.94	6,892.88
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	104,172.34	174,690.82

负债合计		971,985.24	584,986.69
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	56,689,141.92	62,565,630.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	4,046,083.12	6,571,927.16
净资产合计		60,735,225.04	69,137,557.87
负债和净资产总计		61,707,210.28	69,722,544.56

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 56,689,141.92 份，其中建信福泽裕泰混合 (FOF)A 基金份额总额 40,060,189.21 份，基金份额净值人民币 1.0815 元；建信福泽裕泰混合 (FOF)C 基金份额总额 16,628,952.71 份，基金份额净值人民币 1.0470 元。

6.2 利润表

会计主体：建信福泽裕泰混合型基金中基金 (FOF)

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
一、营业总收入		-1,599,234.50	52,632.65
1. 利息收入		16,521.16	24,580.19
其中：存款利息收入	6.4.7.13	16,521.16	24,580.19
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,029,159.53	-10,985,251.30
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益	6.4.7.15	-5,279,290.58	-10,978,267.27
债券投资收益	6.4.7.16	-	-6,984.03
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	250,131.05	-
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	6.4.7.21	3,410,700.22	11,008,029.50

失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.22	2,703.65	5,274.26
减: 二、营业总支出		483,969.05	718,797.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	345,566.60	505,404.66
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	31,417.33	52,615.44
3. 销售服务费		36,609.08	67,929.56
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	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.25	70,376.04	92,848.26
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,083,203.55	-666,165.27
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,083,203.55	-666,165.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,083,203.55	-666,165.27

6.3 净资产变动表

会计主体: 建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)

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	62,565,630.71	-	6,571,927.16	69,137,557.87
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	62,565,630.71	-	6,571,927.16	69,137,557.87

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,876,488.79	-	-2,525,844.04	-8,402,332.83
(一)、综合收益总额	-	-	-2,083,203.55	-2,083,203.55
(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)	-5,876,488.79	-	-442,640.49	-6,319,129.28
其中：1.基金申购款	262,213.32	-	20,440.30	282,653.62
2.基金赎回款	-6,138,702.11	-	-463,080.79	-6,601,782.90
(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	56,689,141.92	-	4,046,083.12	60,735,225.04
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	89,508,638.58	-	18,471,909.60	107,980,548.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	89,508,638.58	-	18,471,909.60	107,980,548.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,662,230.99	-	-2,287,416.06	-9,949,647.05
(一)、综合收益总额	-	-	-666,165.27	-666,165.27
(二)、本期基金份额交易产生的	-7,662,230.99	-	-1,621,250.79	-9,283,481.78

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	4,092,017.53	-	1,000,505.34	5,092,522.87
2. 基金赎 回款	-11,754,248.52	-	-2,621,756.13	-14,376,004.65
(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	81,846,407.59	-	16,184,493.54	98,030,901.13

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

张力铮

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

建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)(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]707号《关于准予建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)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《建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)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人民币214,325,471.95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_A14号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)基金合同》于2019年6月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为214,362,165.36份基金份额,其中认购资金利息折合36,693.41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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/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；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。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。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间可以互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)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，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（含QDII基金、公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募REITs”），以下简称“证券投资基金”）、股票（包含中小板、创业板及其他依法上市的股票）、债券（国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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的相关规定。本基金的投资组合比例为：投资证券投资基金占基金资产的比例不低于80%。本基金权益类资产（包括股票、股票型基金、混合型基金）的战略配置比例为80%，固定收益类资产（包括债券、债券型基金、货币市场基金等）的战略配置比例为20%。权益类资产的战术调整幅度不超过战略配置比例的正负10%。在极端市场情况下，可以将权益类资产占比最高调整到95%。现金或到期日在一年以内的政府债券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。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。本基金的业绩比较基准为80%×中证800指数收益率+20%×中债综合财富指数收益率。

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	4,129,748.28
等于：本金	4,128,917.04
加：应计利息	831.24
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	4,129,748.28

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	-	-	-	-
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	56,189,385.72	-	56,055,469.73	-133,915.99
其他	-	-	-	-
合计	56,189,385.72	-	56,055,469.73	-133,915.99

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	177.02
待摊费用	-
合计	177.02

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,172.34
合计	104,172.34

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信福泽裕泰混合 (FOF) 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	43,868,711.79	43,868,711.79
本期申购	56,471.41	56,471.41
本期赎回 (以“-”号填列)	-3,864,993.99	-3,864,993.99
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	40,060,189.21	40,060,189.21

建信福泽裕泰混合(FOF)C

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	18,696,918.92	18,696,918.92
本期申购	205,741.91	205,741.91
本期赎回(以“-”号填列)	-2,273,708.12	-2,273,708.12
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	16,628,952.71	16,628,952.71

注：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。

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

建信福泽裕泰混合(FOF)A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,088,973.84	-1,043,211.54	5,045,762.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,088,973.84	-1,043,211.54	5,045,762.30
本期利润	-3,877,883.02	2,416,829.91	-1,461,053.11
本期基金份额交易产生的变动数	-358,192.55	37,787.67	-320,404.88
其中：基金申购款	3,813.33	2,362.32	6,175.65
基金赎回款	-362,005.88	35,425.35	-326,580.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,852,898.27	1,411,406.04	3,264,304.31

建信福泽裕泰混合(FOF)C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,965,170.69	-439,005.83	1,526,164.86
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,965,170.69	-439,005.83	1,526,164.86

本期利润	-1,616,020.75	993,870.31	-622,150.44
本期基金份额交易产生的变动数	-127,850.90	5,615.29	-122,235.61
其中：基金申购款	8,255.26	6,009.39	14,264.65
基金赎回款	-136,106.16	-394.10	-136,500.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	221,299.04	560,479.77	781,778.81

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	16,145.76	
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	323.90	
其他	51.50	
合计	16,521.16	

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

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出/赎回基金成交总额	71,815,032.41	
减：卖出/赎回基金成本总额	77,012,015.56	
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-	
减：交易费用	82,307.43	
基金投资收益	-5,279,290.58	

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 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	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	250,131.05
合计	250,131.05

6.4.7.21 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	3,410,700.22
股票投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	3,410,700.22
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	3,410,700.22

6.4.7.22 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	196.03
销售服务费返还收入	2,507.62
合计	2,703.65

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	35,699.04
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	296,842.59
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	51,800.95

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

无。

6.4.7.25 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	1,703.70
银行间账户维护费	9,000.00
合计	70,376.04

6.4.7.26 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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	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 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 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	345,566.60	505,404.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	122,729.15	182,088.61
应支付基金管理人的净管理费	222,837.45	323,316.05

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提，但基金财产中投资于本基金管理人管理的证券投资基金所对应的资产净值的部分不收取管理费。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值（除去本基金管理人管理的证券投资基金所对应的资产净值的部分；若为负数，则取0）

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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	31,417.33	52,615.44

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提，但基金财产中投资于由本基金托管人所托管的证券投资基金所对应的资产净值的部分不收取托管费。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值（除去由本基金托管人所托管的证券投资基金所对应的资产净值的部分；若为负数，则取 0）

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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		
	建信福泽裕泰混合 (FOF)A	建信福泽裕泰混合 (FOF)C	合计
建信基金	-	52.76	52.76
中信银行	-	1,959.15	1,959.15
合计	-	2,011.91	2,011.91
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		
	建信福泽裕泰混合 (FOF)A	建信福泽裕泰混合 (FOF)C	合计
中信银行	-	2,486.95	2,486.95
合计	-	2,486.95	2,486.95

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 0.40%。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自有资金投资本基金的情况

无。

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
中信银行-活期	4,129,748.28	16,145.76	5,766,683.70	24,450.93

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于2024年6月30日，本基金持有基金管理人建信基金所管理的公开募集证券投资基金合计4,266,549.95元，占本基金资产净值的比例为7.02%。（2023年6月30日，本基金持有基金管理人建信基金所管理的公开募集证券投资基金合计21,106,947.62元，占本基金资产净值的比例为21.53%）。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

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
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	3,109.41	4,083.88
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	2,507.62	5,104.05
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	16,149.92	126,181.01
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	3,520.89	27.11

当期交易基金产生的交易费 (元)	2.40	-
当期交易基金产生的转换费 (元)	993.30	3,297.40

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务费等销售费用。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

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

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	4,129,748.28	-	-	-	4,129,748.28
结算备付金	42,126.88	-	-	-	42,126.88
存出保证金	8,278.45	-	-	-	8,278.45
交易性金融资产	-	-	-	56,055,469.73	56,055,469.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,468,159.49	1,468,159.49
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	204.09	204.09
应收申购款	-	-	-	3,046.34	3,046.34
其他资产	-	-	-	177.02	177.02
资产总计	4,180,153.61	-	-	57,527,056.67	61,707,210.28
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	-	-	-	747,118.45	747,118.45
应付赎回款	-	-	-	53,726.13	53,726.13
应付管理人报酬	-	-	-	56,089.72	56,089.72
应付托管费	-	-	-	5,025.66	5,025.66
应付销售服务费	-	-	-	5,852.94	5,852.94
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	104,172.34	104,172.34
负债总计	-	-	-	971,985.24	971,985.24
利率敏感度缺口	4,180,153.61	-	-	56,555,071.43	60,735,225.04
上年度末 2023年12月31日					
资产					
货币资金	3,978,307.18	-	-	-	3,978,307.18
结算备付金	22,502.87	-	-	-	22,502.87
存出保证金	5,847.50	-	-	-	5,847.50
交易性金融资产	-	-	-	65,015,610.90	65,015,610.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	695,356.67	695,356.67
债权投资	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	298.23	298.23
应收申购款	-	-	-	3,605.18	3,605.18
其他资产	-	-	-	1,016.03	1,016.03
资产总计	4,006,657.55	-	-	65,715,887.01	69,722,544.56
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	-	-	-	200,008.00	200,008.00
应付赎回款	-	-	-	136,307.50	136,307.50
应付管理人报酬	-	-	-	61,206.80	61,206.80
应付托管费	-	-	-	5,880.69	5,880.69
应付销售服务费	-	-	-	6,892.88	6,892.88
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	174,690.82	174,690.82
负债总计	-	-	-	584,986.69	584,986.69
利率敏感度缺口	4,006,657.55	-	-	65,130,900.32	69,137,557.87

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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	56,055,469.73	92.29	65,015,610.90	94.04
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	56,055,469.73	92.29	65,015,610.90	94.04

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%	2,845,376.70	3,041,871.35
	业绩比较基准下降5%	-2,845,376.70	-3,041,871.35

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	56,055,469.73	63,811,510.06
第二层次	-	1,204,100.84
第三层次	-	-
合计	56,055,469.73	65,015,610.90

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的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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	56,055,469.73	90.84
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	-	-
	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	4,171,875.16	6.76
8	其他各项资产	1,479,865.39	2.40
9	合计	61,707,210.28	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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

无。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	000880	富国研究精选灵活配置混合 A	契约型开放式	1,795,303.46	4,522,369.42	7.45	否
2	260112	景顺长城能源基建混合 A	契约型开放式	1,771,092.50	4,312,610.24	7.10	否
3	531028	建信短债债券 A	契约型开放式	1,643,395.37	1,855,886.39	3.06	是
4	017043	汇添富品质价值混合	契约型开放式	1,570,370.39	1,733,374.84	2.85	否
5	016374	华泰柏瑞新金融地产混合 C	契约型开放式	1,038,604.25	1,400,350.11	2.31	否
6	000893	工银创新动力股票	契约型开放式	1,222,519.85	1,286,090.88	2.12	否

7	003185	建信货币B	契约 型开 放式	1,220,148.03	1,220,148.03	2.01	是
8	160613	鹏华盛世创 新混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	941,036.22	1,093,107.67	1.80	否
9	008481	永赢股息优 选混合C	契约 型开 放式	777,109.45	1,091,294.80	1.80	否
10	002170	东吴移动互 联混合C	契约 型开 放式	360,987.69	1,042,424.15	1.72	否
11	510300	华泰柏瑞沪 深300ETF	交易 型开 放式 (ETF)	284,700.00	992,748.90	1.63	否
12	510900	易方达恒生 国企 (QDII-ETF)	交易 型开 放式 (ETF)	1,214,400.00	992,164.80	1.63	否
13	009049	易方达高端 制造混合发 起式	契约 型开 放式	613,752.82	991,333.55	1.63	否
14	008269	大成睿享混 合A	契约 型开 放式	728,806.73	976,236.61	1.61	否
15	515260	华宝中证电 子50ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,340,400.00	944,982.00	1.56	否
16	011066	大成高新技 术产业股票 C	契约 型开 放式	230,925.55	935,895.07	1.54	否
17	260117	景顺长城支	契约	530,827.81	933,726.12	1.54	否

		柱产业混合	型开 放式				
18	016090	中泰玉衡价 值优选混合 C	契约 型开 放式	422,543.23	927,144.36	1.53	否
19	013074	银河沪深 300 价值指 数 C	契约 型开 放式	825,531.39	893,224.96	1.47	否
20	001097	华泰柏瑞积 极优选股票 A	契约 型开 放式	841,935.76	842,777.70	1.39	否
21	159949	创业板 50	交易 型开 放式 (ETF)	1,116,700.00	807,374.10	1.33	否
22	011424	汇添富外延 增长主题股 票 C	契约 型开 放式	476,550.30	767,245.98	1.26	否
23	518880	华安黄金易 (ETF)	交易 型开 放式 (ETF)	144,800.00	767,005.60	1.26	否
24	512880	国泰中证全 指证券公司 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	979,100.00	766,635.30	1.26	否
25	014106	融通成长 30 灵活配 置混合 C	契约 型开 放式	275,021.24	715,605.27	1.18	否
26	001577	嘉实低价策 略股票	契约 型开 放式	325,274.91	694,787.21	1.14	否
27	008856	华夏安泰对 冲策略 3 个 月定开混合	契约 型开 放式	557,110.10	693,602.07	1.14	否
28	519022	国泰金泰灵	契约	362,516.62	685,265.17	1.13	否

		活配置混合 C	型开放式				
29	007574	宝盈新价值混合 C	契约型开放式	233,553.24	673,100.44	1.11	否
30	163822	中银主题策略混合 A	契约型开放式	213,841.12	660,555.22	1.09	否
31	010024	广发沪港深新起点股票 C	契约型开放式	451,201.31	659,069.75	1.09	否
32	017607	华泰柏瑞轮动精选混合 C	契约型开放式	632,620.09	637,301.48	1.05	否
33	159781	科创创业	交易型开放式(ETF)	1,385,300.00	612,302.60	1.01	否
34	001291	大摩量化多策略股票	契约型开放式	584,809.75	596,505.95	0.98	否
35	008304	宝盈龙头优选股票 C	契约型开放式	508,116.50	566,803.96	0.93	否
36	007346	易方达科技创新混合	契约型开放式	258,145.99	561,906.38	0.93	否
37	005587	安信比较优势混合	契约型开放式	456,437.30	557,812.02	0.92	否
38	159940	金融地产 ETF	交易型开放式(ETF)	622,700.00	557,316.50	0.92	否
39	006025	诺安优化配置混合	契约型开	464,473.63	553,420.33	0.91	否

			放式				
40	512800	华宝中证银行ETF	交易型开放式(ETF)	402,200.00	501,543.40	0.83	否
41	011507	建信高端装备股票C	契约型开放式	514,414.34	493,529.12	0.81	是
42	018003	南方兴盛先锋灵活配置混合C	契约型开放式	294,440.18	487,563.49	0.80	否
43	015727	中泰双利债券A	契约型开放式	453,071.56	479,984.01	0.79	否
44	519212	万家宏观择时多策略混合A	契约型开放式	180,226.77	468,463.44	0.77	否
45	013622	华安智能装备主题股票C	契约型开放式	241,899.32	451,142.23	0.74	否
46	002036	安信优势增长混合C	契约型开放式	202,975.51	444,252.50	0.73	否
47	513690	博时恒生高股息ETF	交易型开放式(ETF)	498,800.00	418,992.00	0.69	否
48	515880	国泰中证全指通信设备ETF	交易型开放式(ETF)	337,700.00	397,810.60	0.65	否
49	159611	电力ETF	交易型开放式(ETF)	376,700.00	393,274.80	0.65	否

50	003501	宏利睿智稳健混合 A	契约型开放式	389,904.56	378,909.25	0.62	否
51	159740	恒生科技	交易型开放式(ETF)	792,300.00	378,719.40	0.62	否
52	008923	建信医疗健康行业股票 A	契约型开放式	383,414.12	374,825.64	0.62	是
53	019894	天弘通利混合 C	契约型开放式	188,234.48	370,445.46	0.61	否
54	519183	万家双引擎灵活配置混合	契约型开放式	161,574.20	360,956.76	0.59	否
55	013486	尚正竞争优势混合发起 C	契约型开放式	310,286.50	355,153.93	0.58	否
56	015389	宝盈转型动力混合 C	契约型开放式	334,783.31	341,679.85	0.56	否
57	001382	易方达国企改革混合	契约型开放式	149,273.76	322,729.87	0.53	否
58	011135	广发价值优选混合 C	契约型开放式	346,460.33	316,907.26	0.52	否
59	516550	嘉实中证大农业 ETF	交易型开放式(ETF)	547,700.00	314,379.80	0.52	否
60	010841	华宝红利精选混合 C	契约型开放式	259,560.47	307,137.90	0.51	否
61	512660	国泰中证军	交易	342,400.00	300,969.60	0.50	否

		工 ETF	型开 放式 (ETF)				
62	003715	宝盈消费主 题混合	契约 型开 放式	156,775.35	299,958.28	0.49	否
63	690005	民生加银内 需增长混合	契约 型开 放式	184,452.38	291,619.21	0.48	否
64	001832	易方达瑞恒 混合	契约 型开 放式	114,043.40	282,371.46	0.46	否
65	588000	华夏上证科 创板 50 成 份 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	367,000.00	273,415.00	0.45	否
66	017787	万家宏观择 时多策略混 合 C	契约 型开 放式	98,009.37	253,011.19	0.42	否
67	159981	能源化工	交易 型开 放式 (ETF)	152,200.00	251,130.00	0.41	是
68	159865	养殖 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	436,600.00	250,608.40	0.41	否
69	001528	诺安先进制 造股票	契约 型开 放式	91,841.63	244,115.05	0.40	否
70	011133	鹏扬沪深 300 质量低 波指数 C	契约 型开 放式	263,766.40	243,350.88	0.40	否
71	001144	大成互联网 思维混合 A	契约 型开 放式	158,238.50	241,962.49	0.40	否

72	008270	大成睿享混合 C	契约型开放式	178,245.08	234,552.70	0.39	否
73	004605	富国新活力灵活配置混合 C	契约型开放式	102,743.36	221,206.45	0.36	否
74	000573	天弘通利混合	契约型开放式	104,881.99	206,722.40	0.34	否
75	015128	长城产业成长混合 C	契约型开放式	247,188.23	206,674.08	0.34	否
76	630008	华商策略精选灵活配置混合	契约型开放式	131,635.36	201,270.47	0.33	否
77	020155	长盛量化红利混合 C	契约型开放式	72,846.48	200,203.98	0.33	否
78	015775	景顺长城品质成长混合 C	契约型开放式	165,456.38	176,889.42	0.29	否
79	011741	博时成长精选混合 C	契约型开放式	200,360.96	171,709.34	0.28	否
80	000520	上银新兴价值成长混合	契约型开放式	170,034.95	161,533.20	0.27	否
81	159985	豆粕 ETF	交易型开放式(ETF)	71,000.00	154,922.00	0.26	否
82	001111	中欧瑾泉灵活配置混合 C	契约型开放式	102,570.85	152,933.14	0.25	否
83	516950	银华中证基建 ETF	交易型开	147,900.00	149,526.90	0.25	否

			放式 (ETF)				
84	011476	工银新蓝筹 股票 C	契约 型开 放式	56,853.93	142,817.07	0.24	否
85	159933	国投金融地 产 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	62,400.00	135,345.60	0.22	否
86	501219	华夏智胜先 锋股票 (LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	122,239.49	126,151.15	0.21	否
87	014377	东吴新能源 汽车股票 C	契约 型开 放式	103,251.89	107,206.44	0.18	否
88	001857	易方达现代 服务业混合	契约 型开 放式	57,951.38	95,387.97	0.16	否
89	159892	恒生生物	交易 型开 放式 (ETF)	227,800.00	93,853.60	0.15	否
90	516160	南方中证新 能源 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	145,600.00	76,585.60	0.13	否
91	015450	华泰柏瑞多 策略混合 C	契约 型开 放式	41,317.46	74,325.98	0.12	否
92	005596	建信战略精 选灵活配置 混合 A	契约 型开 放式	38,759.56	71,030.77	0.12	是
93	513060	博时恒生医 疗保健	交易 型开	196,600.00	67,237.20	0.11	否

		(QDII-ETF)	放式 (ETF)				
94	000006	西部利得量 化成长混合 A	契约 型开 放式	9,333.96	14,966.07	0.02	否

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

无。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	8,278.45
2	应收清算款	1,468,159.49
3	应收股利	204.09
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,046.34
6	其他应收款	177.02
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,479,865.39

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 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 (%)
建信福泽裕泰混合 (FOF) A	1,131	35,420.15	2,865,047.53	7.15	37,195,141.68	92.85
建信福泽裕泰混合 (FOF) C	1,085	15,326.22	0.00	0.00	16,628,952.71	100.00
合计	2,216	25,581.74	2,865,047.53	5.05	53,824,094.39	94.95

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	建信福泽裕泰混合 (FOF) A	18,014.65	0.04
	建信福泽裕泰混合 (FOF) C	-	-
	合计	18,014.65	0.03

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	建信福泽裕泰混合 (FOF) A	-
	建信福泽裕泰混合 (FOF) C	-
	合计	-

本基金基金经理持有 本开放式基金	建信福泽裕泰混合 (FOF) A	0~10
	建信福泽裕泰混合 (FOF) C	-
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信福泽裕泰混合 (FOF) A	建信福泽裕泰混合 (FOF) C
基金合同生效日 (2019年6月5日) 基金份额总额	147,725,240.30	66,636,925.06
本报告期期初基金份 额总额	43,868,711.79	18,696,918.92
本报告期基金总申购 份额	56,471.41	205,741.91
减：本报告期基金总 赎回份额	3,864,993.99	2,273,708.12
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	40,060,189.21	16,628,952.71

注：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。

§ 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

本基金管理人于2024年3月15日发布《建信基金管理有限责任公司关于旗下基金中基金可

投资于公开募集基础设施证券投资基金并修订基金合同等法律文件的公告》，本次修订自该日起正式生效，本基金本报告期内投资策略新增公募 REITs 投资策略。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 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

10.7.2 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未受到稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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 (%)	
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	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。

10.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	19,764,986.70	30.63
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	44,766,309.50	69.37
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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	关于新增腾安基金销售（深圳）有限公司为建信福泽裕泰混合型基金中基金 (FOF) 等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 4 月 1 日
2	关于新增恒泰证券股份有限公司为建信福泽裕泰混合型基金中基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 3 月 12 日
3	关于新增博时财富基金销售有限公司为建信睿盈灵活配置混合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 1 月 26 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 3 月 15 日发布《建信基金管理有限责任公司关于旗下基金中基金可投资于公开募集基础设施证券投资基金并修订基金合同等法律文件的公告》，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信息披露管理办法》《公开募集证券投资基金运作指引第 2 号-基金中基金指引》《公开募集基础设施证券投资基金指引（试行）》等法律法规规定及相关基金基金合同约定，经与各基金托管人协商一致，本基金管理人旗下 9 只基金中基金就可参与公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）投资事宜修订基金合同等法律文件，包括明确投资范围包含公募 REITs、增加公募 REITs 的投资策略、增加公募 REITs 的风险揭示等。本次修订将自 2024 年 3 月 15 日起正式生效，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福泽裕泰混合型基金中基金 (FOF) 设立的文件；
- 2、《建信福泽裕泰混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》；
- 3、《建信福泽裕泰混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书》；
- 4、《建信福泽裕泰混合型基金中基金 (FOF) 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