

# 建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

## 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 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	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<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	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
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	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45

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.....	45
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.....	46
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12	投资组合报告附注.....	46
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1	基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4	基金投资策略的改变.....	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8	其他重大事件.....	50
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</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.....	51
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录.....</b>	<b>51</b>
12.1	备查文件目录.....	51
12.2	存放地点.....	51
12.3	查阅方式.....	51

## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	建信鑫荣回报灵活配置混合
基金主代码	001498
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 23 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	188,102,253.46 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	力争每年获得较高的绝对回报
投资策略	本基金以自上而下的投资策略，灵活配置大类资产，动态控制组合风险，力争长期、稳定的绝对回报。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：6%/年
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

### 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	广发证券股份有限公司
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	95575
传真	010-66228001	020-87555129
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	广东省广州市黄埔区中新广州 知识城腾飞一街 2 号 618 室
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	广州市天河区马场路 26 号广发 证券大厦 34 楼
邮政编码	100033	510627
法定代表人	孙志晨	孙树明

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	7,670,153.28
本期利润	13,690,755.56
加权平均基金份额本期利润	0.1672
本期加权平均净值利润率	12.77%
本期基金份额净值增长率	15.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	66,887,323.25
期末可供分配基金份额利润	0.3556
期末基金资产净值	254,989,576.71
期末基金份额净值	1.3556
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	35.56%

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

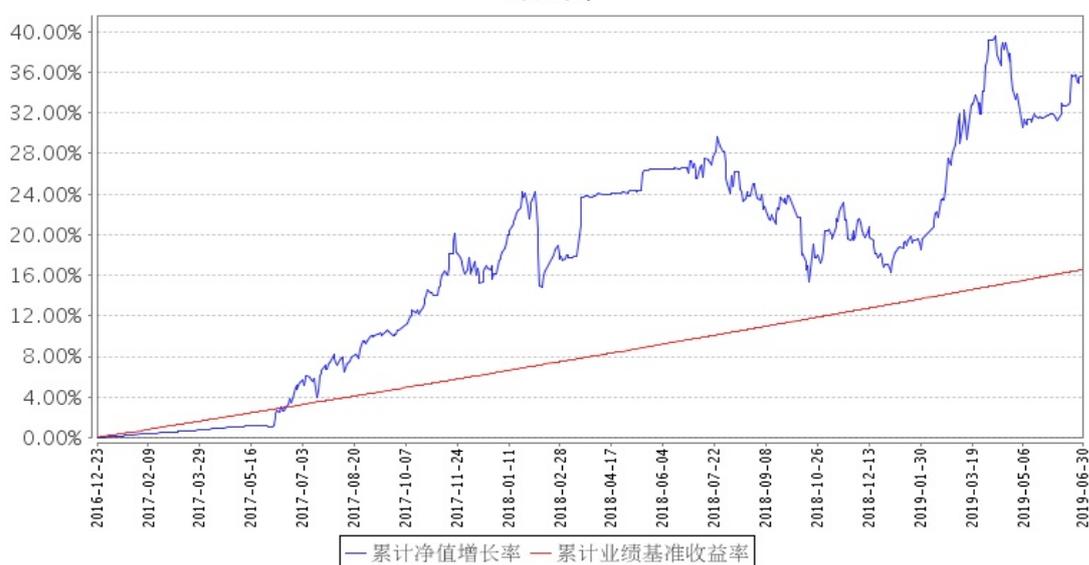
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.82%	0.44%	0.50%	0.02%	2.32%	0.42%
过去三个月	1.05%	0.66%	1.53%	0.02%	-0.48%	0.64%

过去六个月	15.80%	0.72%	3.06%	0.02%	12.74%	0.70%
过去一年	6.51%	0.71%	6.27%	0.02%	0.24%	0.69%
自基金合同生效起至今	35.56%	0.56%	16.57%	0.02%	18.99%	0.54%

### 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

建信鑫荣回报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



注:本报告期,本基金投资组合比例符合基金合同要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日,注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司,其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%,信安金融服务公司出资额占注册资本的25%,中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、

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

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

叶乐天	金融工程及指数投资部副总经理，本基金的基金经理	2017 年 5 月 22 日	-	11 叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理，硕士。2008 年 5 月至 2011 年 9 月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。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 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；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 日起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 日起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 日起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 日起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。
--	--	--	--	--	---

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为灵活配置型基金，基金管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型进行仓位控制、个股选择和风险管理。在报告期内，本基金的规模有所增加，权益仓位相应下降。受益于报告期内市场表现整体较好，基金净值也有了较明显的上涨。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 15.80%，波动率 0.72%，业绩比较基准收益率 3.06%，波动率 0.02%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在报告期间，市场波动较大。2019 年一季度，市场上涨较快，各主要指数均有 20% 以上的涨幅，但二季度受中美贸易摩擦的影响，指数快速回落，上证综指在 2900 点附近企稳，个股表现

差异较大。展望下半年，市场短期仍受中美贸易摩擦的较大影响，长期则主要取决于国内的改革力度以及经济发展情况。投资策略方面，未来个股差异仍会较大，精选个股仍是现阶段最重要的任务。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、投资风险管理部 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。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，

严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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规定进行。本报告期内，建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	20,951,518.19	1,227,323.50
结算备付金		3,741,788.87	2,015,291.35
存出保证金		1,573,831.94	29,932.68
交易性金融资产	6.4.7.2	239,991,448.93	48,659,066.57
其中：股票投资		81,250,736.93	26,060,066.57
基金投资		-	-
债券投资		158,740,712.00	22,599,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,410,120.56	653,538.11
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		269,668,708.49	52,585,152.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018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		-	-
应付证券清算款		13,927,512.19	3,004.75
应付赎回款		101,939.99	-
应付管理人报酬		165,486.44	36,156.14
应付托管费		41,371.62	9,039.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	235,352.74	17,951.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	207,468.80	239,288.21
负债合计		14,679,131.78	305,440.01
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	188,102,253.46	44,660,165.36
未分配利润	6.4.7.10	66,887,323.25	7,619,546.84
所有者权益合计		254,989,576.71	52,279,712.20
负债和所有者权益总计		269,668,708.49	52,585,152.21

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3556 元，基金份额总额 188,102,253.46 份。

## 6.2 利润表

会计主体：建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
一、收入		14,789,915.35	2,462,649.21
1. 利息收入		995,426.14	458,382.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	44,472.41	104,272.82
债券利息收入		873,095.37	134,290.25

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		77,858.36	219,819.87
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,761,528.05	5,124,189.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,195,941.94	4,837,495.52
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	108,758.98	27,005.60
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-110,833.98	283,495.14
股利收益	6.4.7.16	567,661.11	-23,807.10
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,020,602.28	-3,256,659.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	12,358.88	136,737.08
减：二、费用		1,099,159.79	558,503.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	418,718.86	213,569.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	104,679.67	53,392.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	401,062.25	162,434.97
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		30.48	1,020.58
7. 其他费用	6.4.7.20	174,668.53	128,086.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,690,755.56	1,904,145.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,690,755.56	1,904,145.72

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	44,660,165.36	7,619,546.84	52,279,712.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,690,755.56	13,690,755.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	143,442,088.10	45,577,020.85	189,019,108.95
其中：1. 基金申购款	145,199,733.57	46,163,562.04	191,363,295.61
2. 基金赎回款	-1,757,645.47	-586,541.19	-2,344,186.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	188,102,253.46	66,887,323.25	254,989,576.71
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	86,933,074.31	14,058,683.99	100,991,758.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,904,145.72	1,904,145.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-39,497,120.44	-3,023,962.80	-42,521,083.24
其中：1. 基金申购款	49,148,585.76	12,974,828.11	62,123,413.87

2. 基金赎回款	-88,645,706.20	-15,998,790.91	-104,644,497.11
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	47,435,953.87	12,938,866.91	60,374,820.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

吴曙明

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1157号《关于准予建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2016]2213号《关于建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,005,610.34元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1681号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,014,610.70份基金份额,其中认购资金利息折合9,000.36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,基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围为具有较好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他依法上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券)、股指期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证以及法律法规

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：股票投资占基金资产的比例为 0%–95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%–100%，其中权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，现金或者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。本基金的业绩比较基准为 6%/年。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

#### 6.4.6 税项

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

增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2019年6月30日
活期存款	20,951,518.19
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	20,951,518.19

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2019年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	77,315,791.02	81,250,736.93	3,934,945.91	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	158,215,319.25	158,740,712.00	525,392.75
	银行间市场	-	-	-
	合计	158,215,319.25	158,740,712.00	525,392.75
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	235,531,110.27	239,991,448.93	4,460,338.66	

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末			备注
	合同/名义金额	2019年6月30日		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-11,183,580.00	-	-	
其中：股指期货投资	-11,183,580.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-11,183,580.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，

结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC1909	中证 500 指数 期货 1909 合约	-12	-11,552,640.00	-369,060.00
总额合计	-	-12	-11,552,640.00	-369,060.00
减：可抵销期 货暂收款	-	-	-	-369,060.00
期货投资净额	-	-	-	-

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,962.08
应收定期存款利息	-

应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	7,211.71
应收债券利息	3,400,914.37
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	32.40
合计	3,410,120.56

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	235,352.74
银行间市场应付交易费用	—
合计	235,352.74

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	128.06
预提费用	207,340.74
合计	207,468.80

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,660,165.36	44,660,165.36
本期申购	145,199,733.57	145,199,733.57
本期赎回（以“-”号填列）	-1,757,645.47	-1,757,645.47
- 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	188,102,253.46	188,102,253.46

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,703,983.95	-6,084,437.11	7,619,546.84
本期利润	7,670,153.28	6,020,602.28	13,690,755.56
本期基金份额交易产生的变动数	57,512,662.67	-11,935,641.82	45,577,020.85
其中：基金申购款	58,225,855.75	-12,062,293.71	46,163,562.04
基金赎回款	-713,193.08	126,651.89	-586,541.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,886,799.90	-11,999,476.65	66,887,323.25

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	38,940.49
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	5,363.39
其他	168.53
合计	44,472.41

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	117,422,494.13
减：卖出股票成本总额	110,226,552.19
买卖股票差价收入	7,195,941.94

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	108,758.98
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	108,758.98

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	105,711,425.19
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	102,684,385.02
减：应收利息总额	2,918,281.19
买卖债券差价收入	108,758.98

## 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

## 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019年1月1日至2019年6月30日
股指期货投资收益	-110,833.98

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	567,661.11
基金投资产生的股利收益	-
合计	567,661.11

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	6,389,662.28
股票投资	5,939,869.53
债券投资	449,792.75
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-369,060.00
权证投资	-
期货	-369,060.00
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	6,020,602.28

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	12,358.88
合计	12,358.88

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	401,062.25
银行间市场交易费用	-
合计	401,062.25

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	25,286.82
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	616.00
合计	174,668.53

**6.4.7.21 分部报告**

无。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	基金托管人
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金销售机构、基金管理人、注册登记机构
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
广发证券	80,624,544.12	29.24	71,249,893.27	79.43

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
广发证券	186,049,895.30	56.61	21,923,551.80	36.56

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
广发证券	133,000,000.00	96.38	187,000,000.00	73.91

## 6.4.10.1.4 权证交易

无。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
广发证券	75,076.69	29.23	75,076.69	31.90
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
广发证券	66,352.10	79.43	-	-

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定, 以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	418,718.86	213,569.18
其中: 支付销售机构的客户维护费	0.82	-

注:1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为: 日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.80% / 当年天数。

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
----	--------------------------------	-------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	104,679.67	53,392.36
----------------	------------	-----------

注:支付基金托管人广发证券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 X 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新发未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新发未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

#### 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。

#### 6.4.13 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、由风险管理委员会、督察长、内  
控合规部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督  
察长和内控合规部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

##### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

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。

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

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,951,518.19	0.00			20,951,518.19
结算备付金	3,741,788.87				3,741,788.87
存出保证金	1,573,831.94				1,573,831.94
交易性金融资产	28,787,850.00	129,952,862.00	0.00	81,250,736.93	239,991,448.93
衍生金融资产					0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00			0.00
应收证券清算款					0.00
应收利息				3,410,120.56	3,410,120.56
应收股利				0.00	0.00
应收申购款				0.00	0.00
其他资产				0.00	0.00
资产总计	55,054,989.00	129,952,862.00	0.00	84,660,857.49	269,668,708.49
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	0.00			0.00
短期借款					0.00
交易性金融负债					0.00
衍生金融负债					0.00
应付证券清算款				13,927,512.19	13,927,512.19
应付赎回款				101,939.99	101,939.99
应付管理人报酬				165,486.44	165,486.44
应付托管费				41,371.62	41,371.62
应付销售服务费				0.00	0.00
应付交易费用				235,352.74	235,352.74
应交税费				0.00	0.00
应付利息				0.00	0.00
应付利润				0.00	0.00
其他负债				207,468.80	207,468.80
负债总计	0.00	0.00	0.00	14,679,131.78	14,679,131.78
利率敏感度缺口	55,054,989.00	129,952,862.00	0.00	69,981,725.71	254,989,576.71
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,227,323.50	-	-	-	1,227,323.50
结算备付金	2,015,291.35	-	-	-	2,015,291.35
存出保证金	29,932.68	-	-	-	29,932.68
交易性金融资产	22,599,000.00	-	-	26,060,066.57	48,659,066.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	653,538.11	653,538.11
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	25,871,547.53	-	26,713,604.68	52,585,152.21
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	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	3,004.75	3,004.75
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	36,156.14	36,156.14
应付托管费	-	-	9,039.03	9,039.03
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	17,951.88	17,951.88
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	239,288.21	239,288.21
负债总计	-	-	305,440.01	305,440.01
利率敏感度缺口	25,871,547.53	-	26,408,164.67	52,279,712.20

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

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率上升 25个基点	-714,615.02	-14,753.15
	市场利率下降 25个基点	720,719.16	14,772.44

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-100%，其中权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	81,250,736.93	31.86	26,060,066.57	49.85
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	158,740,712.00	62.25	22,599,000.00	43.23
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	239,991,448.93	94.12	48,659,066.57	93.07

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	-2,724,073.81	5,177,070.94
	业绩比较基准下降 5%	2,724,073.81	-5,177,070.94

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 公允价值

##### (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。

##### (2) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (a) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 81,193,760.39 元，属于第二层次的余额为 158,797,688.54 元，无属于第三层次的余额（2018 年 06 月 30 日：第一层次的余额为 17,001,007.00 元，第二层次的余额为 27,102,600.00 元，无属于第三层次的余额）。

##### (b) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(c) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(3) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 06 月 30 日：同)。

(4) 不以公允价值计量的金融工具

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

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	81,250,736.93	30.13
	其中：股票	81,250,736.93	30.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	158,740,712.00	58.87
	其中：债券	158,740,712.00	58.87
	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	24,693,307.06	9.16
8	其他各项资产	4,983,952.50	1.85
9	合计	269,668,708.49	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	880,747.13	0.35
B	采矿业	2,584,931.60	1.01
C	制造业	33,448,221.61	13.12

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,682,062.00	1.05
E	建筑业	1,345,841.00	0.53
F	批发和零售业	1,619,776.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	2,492,404.85	0.98
H	住宿和餐饮业	319,610.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,272,590.56	0.50
J	金融业	29,888,712.70	11.72
K	房地产业	3,067,017.48	1.20
L	租赁和商务服务业	86,877.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	201,013.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	326,824.40	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	283,488.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	492,067.60	0.19
S	综合	258,552.00	0.10
	合计	81,250,736.93	31.86

### 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	601318	中国平安	147,240	13,046,936.40	5.12
2	600519	贵州茅台	5,700	5,608,800.00	2.20
3	600887	伊利股份	165,300	5,522,673.00	2.17
4	600036	招商银行	98,832	3,555,975.36	1.39
5	601601	中国太保	78,900	2,880,639.00	1.13
6	600276	恒瑞医药	38,190	2,520,540.00	0.99
7	601166	兴业银行	98,000	1,792,420.00	0.70
8	600048	保利地产	128,100	1,634,556.00	0.64
9	002007	华兰生物	50,850	1,550,416.50	0.61
10	000661	长春高新	4,200	1,419,600.00	0.56
11	600030	中信证券	56,300	1,340,503.00	0.53
12	601328	交通银行	198,200	1,212,984.00	0.48
13	603288	海天味业	6,804	714,420.00	0.28
14	600016	民生银行	105,700	671,195.00	0.26

15	601211	国泰君安	32,400	594,540.00	0.23
16	601988	中国银行	158,900	594,286.00	0.23
17	601398	工商银行	97,600	574,864.00	0.23
18	601766	中国中车	70,600	571,154.00	0.22
19	600585	海螺水泥	13,600	564,400.00	0.22
20	601169	北京银行	87,000	514,170.00	0.20
21	600028	中国石化	90,800	496,676.00	0.19
22	000027	深圳能源	76,900	476,780.00	0.19
23	601818	光大银行	114,600	436,626.00	0.17
24	601688	华泰证券	19,000	424,080.00	0.17
25	600269	赣粤高速	94,000	417,360.00	0.16
26	600019	宝钢股份	64,200	417,300.00	0.16
27	601566	九牧王	33,300	410,256.00	0.16
28	601158	重庆水务	72,000	403,200.00	0.16
29	601857	中国石油	57,800	397,664.00	0.16
30	601088	中国神华	19,200	391,296.00	0.15
31	601118	海南橡胶	75,300	387,795.00	0.15
32	600872	中炬高新	9,000	385,470.00	0.15
33	600398	海澜之家	41,800	379,126.00	0.15
34	600606	绿地控股	55,500	379,065.00	0.15
35	601898	中煤能源	78,000	374,400.00	0.15
36	601933	永辉超市	35,000	357,350.00	0.14
37	600837	海通证券	24,900	353,331.00	0.14
38	601390	中国中铁	53,100	346,212.00	0.14
39	601336	新华保险	6,100	335,683.00	0.13
40	002438	江苏神通	41,000	335,380.00	0.13
41	600688	上海石化	64,500	332,820.00	0.13
42	300190	维尔利	42,280	326,824.40	0.13
43	600350	山东高速	67,700	324,960.00	0.13
44	002142	宁波银行	12,700	307,848.00	0.12
45	000895	双汇发展	12,300	306,147.00	0.12
46	002311	海大集团	9,600	296,640.00	0.12
47	600201	生物股份	18,800	294,972.00	0.12
48	600863	内蒙华电	90,800	285,112.00	0.11
49	600763	通策医疗	3,200	283,488.00	0.11
50	601006	大秦铁路	35,000	283,150.00	0.11
51	601668	中国建筑	48,300	277,725.00	0.11
52	600315	上海家化	8,800	274,120.00	0.11
53	600426	华鲁恒升	18,400	273,424.00	0.11
54	600642	申能股份	44,200	265,642.00	0.10
55	600183	生益科技	17,200	258,860.00	0.10
56	600895	张江高科	12,600	258,552.00	0.10

57	600536	中国软件	4,800	257,616.00	0.10
58	600298	安琪酵母	8,000	253,040.00	0.10
59	600578	京能电力	72,600	235,224.00	0.09
60	600801	华新水泥	11,000	222,750.00	0.09
61	601998	中信银行	37,100	221,487.00	0.09
62	300498	温氏股份	6,100	218,746.00	0.09
63	600879	航天电子	35,200	216,832.00	0.09
64	000902	新洋丰	20,000	214,600.00	0.08
65	600325	华发股份	27,400	213,994.00	0.08
66	600460	士兰微	12,800	212,480.00	0.08
67	600161	天坛生物	8,400	212,100.00	0.08
68	600497	驰宏锌锗	41,200	209,296.00	0.08
69	600528	中铁工业	18,000	208,260.00	0.08
70	600886	国投电力	26,800	208,236.00	0.08
71	600745	闻泰科技	6,200	205,964.00	0.08
72	600848	上海临港	6,600	205,458.00	0.08
73	600908	无锡银行	36,200	204,168.00	0.08
74	600779	水井坊	4,000	203,280.00	0.08
75	603993	洛阳钼业	51,100	202,356.00	0.08
76	600584	长电科技	15,600	200,460.00	0.08
77	601872	招商轮船	45,800	199,688.00	0.08
78	600703	三安光电	17,600	198,528.00	0.08
79	002416	爱施德	31,600	197,500.00	0.08
80	600549	厦门钨业	13,800	197,478.00	0.08
81	600699	均胜电子	9,200	196,512.00	0.08
82	601168	西部矿业	30,800	196,504.00	0.08
83	002252	上海莱士	27,800	193,210.00	0.08
84	600820	隧道股份	30,600	193,086.00	0.08
85	601800	中国交建	16,900	191,308.00	0.08
86	600029	南方航空	24,700	190,684.00	0.07
87	600875	东方电气	17,800	189,036.00	0.07
88	600392	盛和资源	17,000	188,020.00	0.07
89	600376	首开股份	21,000	187,530.00	0.07
90	600236	桂冠电力	30,400	184,224.00	0.07
91	300517	海波重科	11,300	183,512.00	0.07
92	000156	华数传媒	16,500	181,665.00	0.07
93	600718	东软集团	14,000	179,480.00	0.07
94	000026	飞亚达A	23,000	178,710.00	0.07
95	600959	江苏有线	40,000	178,000.00	0.07
96	600755	厦门国贸	20,600	177,778.00	0.07
97	300606	金太阳	8,800	177,672.00	0.07
98	601333	广深铁路	55,000	177,650.00	0.07

99	000899	赣能股份	33,700	177,262.00	0.07
100	600839	四川长虹	59,800	176,410.00	0.07
101	000524	岭南控股	21,000	175,770.00	0.07
102	601628	中国人寿	6,200	175,584.00	0.07
103	000538	云南白药	2,100	175,182.00	0.07
104	601866	中远海发	64,400	175,168.00	0.07
105	600885	宏发股份	7,200	174,960.00	0.07
106	600804	鹏博士	23,200	174,464.00	0.07
107	300092	科新机电	22,900	173,353.00	0.07
108	600521	华海药业	12,200	172,020.00	0.07
109	002204	大连重工	46,900	171,654.00	0.07
110	600881	亚泰集团	52,600	170,950.00	0.07
111	600000	浦发银行	14,500	169,360.00	0.07
112	600023	浙能电力	38,300	169,286.00	0.07
113	300088	长信科技	33,300	168,498.00	0.07
114	603939	益丰药房	2,400	167,976.00	0.07
115	002394	联发股份	17,000	165,410.00	0.06
116	600808	马钢股份	48,400	165,044.00	0.06
117	600486	扬农化工	3,000	164,100.00	0.06
118	300095	华伍股份	27,000	162,810.00	0.06
119	600968	海油发展	45,832	162,703.60	0.06
120	600037	歌华有线	15,800	161,950.00	0.06
121	600079	人福医药	15,400	161,700.00	0.06
122	300487	蓝晓科技	5,100	160,752.00	0.06
123	600260	凯乐科技	8,000	159,840.00	0.06
124	600160	巨化股份	22,200	157,842.00	0.06
125	600845	宝信软件	5,460	155,500.80	0.06
126	601699	潞安环能	19,400	154,036.00	0.06
127	300233	金城医药	8,100	153,252.00	0.06
128	600435	北方导航	17,000	152,830.00	0.06
129	600967	内蒙一机	13,600	152,320.00	0.06
130	600643	爱建集团	15,800	151,364.00	0.06
131	600388	龙净环保	12,200	151,158.00	0.06
132	600737	中粮糖业	17,400	151,032.00	0.06
133	600466	蓝光发展	24,200	150,524.00	0.06
134	600282	南钢股份	43,000	150,500.00	0.06
135	600064	南京高科	14,000	149,940.00	0.06
136	002714	牧原股份	2,547	149,738.13	0.06
137	603899	晨光文具	3,400	149,498.00	0.06
138	603517	绝味食品	3,800	147,858.00	0.06
139	600021	上海电力	17,000	147,560.00	0.06
140	601098	中南传媒	11,600	146,624.00	0.06

141	600266	北京城建	18,108	145,950.48	0.06
142	600026	中远海能	22,200	144,078.00	0.06
143	600258	首旅酒店	8,000	143,840.00	0.06
144	600373	中文传媒	11,200	140,672.00	0.06
145	002853	皮阿诺	7,400	137,788.00	0.05
146	002701	奥瑞金	29,000	135,430.00	0.05
147	601966	玲珑轮胎	7,800	132,600.00	0.05
148	601100	恒立液压	4,200	131,796.00	0.05
149	600008	首创股份	36,800	129,536.00	0.05
150	600782	新钢股份	25,800	129,000.00	0.05
151	300149	量子生物	8,500	128,775.00	0.05
152	600039	四川路桥	35,200	128,128.00	0.05
153	601231	环旭电子	10,600	127,730.00	0.05
154	600827	百联股份	13,000	127,530.00	0.05
155	600196	复星医药	5,000	126,500.00	0.05
156	603444	吉比特	600	125,976.00	0.05
157	600598	北大荒	11,600	124,468.00	0.05
158	601179	中国西电	33,200	122,840.00	0.05
159	601608	中信重工	28,200	121,824.00	0.05
160	002832	比音勒芬	2,550	121,558.50	0.05
161	002574	明牌珠宝	20,500	120,335.00	0.05
162	601919	中远海控	23,700	118,974.00	0.05
163	600120	浙江东方	9,200	117,208.00	0.05
164	002221	东华能源	13,600	117,096.00	0.05
165	002043	兔宝宝	19,300	116,572.00	0.05
166	002749	国光股份	9,860	115,066.20	0.05
167	002909	集泰股份	11,800	114,106.00	0.04
168	600155	华创阳安	8,400	112,812.00	0.04
169	300631	久吾高科	5,000	111,600.00	0.04
170	600548	深高速	11,600	108,924.00	0.04
171	600031	三一重工	8,200	107,256.00	0.04
172	002179	中航光电	3,200	107,072.00	0.04
173	002399	海普瑞	5,100	107,049.00	0.04
174	000999	华润三九	3,600	105,624.00	0.04
175	002489	浙江永强	31,600	105,544.00	0.04
176	600012	皖通高速	16,500	104,445.00	0.04
177	300205	天喻信息	6,900	103,224.00	0.04
178	000828	东莞控股	11,205	102,749.85	0.04
179	002534	杭锅股份	14,500	98,165.00	0.04
180	000028	国药一致	2,300	96,209.00	0.04
181	300519	新光药业	6,400	89,920.00	0.04
182	300446	乐凯新材	4,200	89,544.00	0.04

183	600018	上港集团	13,000	88,660.00	0.03
184	601888	中国国旅	980	86,877.00	0.03
185	002318	久立特材	11,800	86,258.00	0.03
186	002594	比亚迪	1,700	86,224.00	0.03
187	000032	深桑达 A	8,300	82,419.00	0.03
188	601288	农业银行	22,800	82,080.00	0.03
189	002548	金新农	6,400	79,360.00	0.03
190	600085	同仁堂	2,700	78,300.00	0.03
191	300539	横河模具	8,900	77,786.00	0.03
192	002286	保龄宝	13,000	76,830.00	0.03
193	300668	杰恩设计	3,800	72,238.00	0.03
194	601138	工业富联	5,900	71,095.00	0.03
195	002437	誉衡药业	16,700	65,965.00	0.03
196	002378	章源钨业	8,900	65,682.00	0.03
197	600104	上汽集团	2,200	56,100.00	0.02
198	601066	中信建投	2,000	42,160.00	0.02
199	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
200	601111	中国国航	4,100	39,237.00	0.02
201	600309	万华化学	900	38,511.00	0.02
202	601229	上海银行	3,200	37,920.00	0.01
203	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
204	601989	中国重工	5,500	30,580.00	0.01
205	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
206	601186	中国铁建	2,600	25,870.00	0.01
207	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
208	601319	中国人保	2,300	21,827.00	0.01
209	600033	福建高速	5,100	16,677.00	0.01
210	603863	松炆资源	637	14,701.96	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	601318	中国平安	21,515,784.65	41.16
2	600519	贵州茅台	9,983,392.00	19.10
3	600036	招商银行	7,596,631.76	14.53
4	600887	伊利股份	6,993,669.00	13.38
5	600276	恒瑞医药	4,516,713.60	8.64
6	601601	中国太保	3,921,464.90	7.50
7	601328	交通银行	3,048,564.00	5.83
8	600030	中信证券	2,974,299.00	5.69
9	600048	保利地产	2,498,435.00	4.78

10	600016	民生银行	2,347,646.00	4.49
11	601398	工商银行	1,896,660.00	3.63
12	601225	陕西煤业	1,566,229.00	3.00
13	600837	海通证券	1,475,667.00	2.82
14	601988	中国银行	1,421,460.00	2.72
15	002007	华兰生物	1,415,809.00	2.71
16	601766	中国中车	1,409,923.00	2.70
17	600585	海螺水泥	1,388,290.00	2.66
18	601211	国泰君安	1,335,949.74	2.56
19	601166	兴业银行	1,294,906.00	2.48
20	000661	长春高新	1,279,822.00	2.45
21	600028	中国石化	1,253,320.00	2.40
22	601688	华泰证券	1,196,263.00	2.29
23	601818	光大银行	1,134,238.00	2.17
24	601288	农业银行	1,126,593.00	2.15

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	601318	中国平安	10,488,500.60	20.06
2	600519	贵州茅台	5,373,411.00	10.28
3	600036	招商银行	4,337,105.00	8.30
4	600276	恒瑞医药	2,202,119.70	4.21
5	600887	伊利股份	2,140,021.00	4.09
6	600030	中信证券	1,976,644.95	3.78
7	601328	交通银行	1,792,206.00	3.43
8	600016	民生银行	1,691,640.00	3.24
9	601225	陕西煤业	1,519,285.09	2.91
10	601398	工商银行	1,353,987.00	2.59
11	601601	中国太保	1,222,205.00	2.34
12	600837	海通证券	1,210,069.00	2.31
13	601857	中国石油	1,175,796.00	2.25
14	002373	千方科技	1,050,581.00	2.01
15	000656	金科股份	1,022,350.00	1.96
16	002394	联发股份	1,005,645.00	1.92
17	601288	农业银行	989,140.00	1.89
18	600585	海螺水泥	985,480.00	1.89
19	600048	保利地产	974,929.00	1.86
20	601988	中国银行	955,835.00	1.83

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	159,477,353.02
卖出股票收入（成交）总额	117,422,494.13

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	158,740,712.00	62.25
	其中：政策性金融债	158,740,712.00	62.25
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	158,740,712.00	62.25

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018007	国开 1801	545,000	54,974,150.00	21.56
2	018006	国开 1702	423,950	43,285,295.00	16.98
3	108602	国开 1704	285,000	28,787,850.00	11.29
4	018008	国开 1802	197,100	20,058,867.00	7.87
5	108604	国开 1805	115,000	11,634,550.00	4.56

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1909	IC1909	-12	11,552,640.00	-369,060.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-369,060.00
股指期货投资本期收益(元)					-110,833.98
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-369,060.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃、与现货相关性高的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低主要由申购赎回带来的股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，以达到有效控制风险的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

## 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

## 7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

## 7.12.3 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	1,573,831.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,410,120.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,983,952.50

## 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

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 (%)
438	429,457.20	44,789,747.98	23.81	143,312,505.48	76.19

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	243.25	0.00

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2016年12月23日) 基金份额总额	200,014,610.70
本报告期期初基金份额总额	44,660,165.36
本报告期基金总申购份额	145,199,733.57
减:本报告期基金总赎回份额	1,757,645.47
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	188,102,253.46

注:上述总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期,本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内，本基金托管人受到监管部门的稽查和处罚如下：

1、2019年3月25日，基金托管人广发证券收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（广东证监局行政监管措施决定书[2019]20号），指出广发证券存在对境外子公司管控不到位，未有效督促境外子公司强化合规风险管理及审慎开展业务等问题，决定对广发证券采取责令改正的行政监管措施，要求广发证券应于2019年6月30日之前予以改正，并向广东局提交书面整改报告。

对此，广发证券高度重视，将切实进行整改，采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系，并及时向广东证监局报送了整改报告。

2、2019年4月19日，因基金托管人广发证券存在以低于成本价格参与公司债券项目投标的情形，广东证监局向广发证券下发了《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（广东证监局行政监管措施决定书【2019】28号），责成广发证券对相关问题予以改正，提交书面整改报告，并严格追究相关责任人员责任。

对此，广发证券高度重视，责令相关部门进行整改，组织对监管规定进行再学习，对相关人员进行内部问责，并及时向广东证监局报送了整改报告。

3、2019年8月5日，基金托管人广发证券收到《关于对广发证券股份有限公司采取限制业务活动措施的决定》（中国证券监督管理委员会行政监管措施决定书（2019）31号），因对广发控股（香港）有限公司风险管控缺失、合规管理存在缺陷、内部管控不足及未做好广发控股香港月度数据统计工作等问题，中国证券监督管理委员会对广发证券采取了限制增加场外衍生品业务规模6个月、限制增加新业务种类6个月的行政监管措施。

对此，广发证券高度重视，将切实进行整改，采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系。

## 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	
太平洋证券	1	131,937,050.70	47.84%	122,878.12	47.84%	-
广发证券	2	80,624,544.12	29.24%	75,076.69	29.23%	-
长江证券	1	63,214,869.88	22.92%	58,873.60	22.92%	-

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、本基金本报告期内未新增或剔除交易单元。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
太平洋证券	61,008,504.00	18.56%	5,000,000.00	3.62%	-	-

广发证券	186,049,895.30	56.61%	133,000,000.00	96.38%	-	-
长江证券	81,611,048.97	24.83%	-	-	-	-

## 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	关于建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金参加中信建投申购及定期定额申购投资手续费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2019年5月7日
2	关于新增中信建投为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2019年5月1日
3	关于新增北京肯特瑞财富为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2019年3月29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

单位：份

投资者类别	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	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2019年01月01日-2019年05月16日	15,809,486.17	0.00	0.00	15,809,486.17	8.40
	2	2019年01月01日-2019年05月16日	15,809,486.17	0.00	0.00	15,809,486.17	8.40

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。

## § 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鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信鑫荣回报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

2019年8月29日