

# 建信中小盘先锋股票型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：招商证券股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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 2020 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	5
2.4 信息披露方式	5
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	6
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<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 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
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	44

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.....	44
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	48
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</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 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信中小盘先锋股票型证券投资基金
基金简称	建信中小盘先锋股票
基金主代码	000729
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 20 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	100,760,753.97 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	85%×中证 500 指数收益率+15%×中债综合全价（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金，混合型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

### 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	招商证券股份有限公司
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	95565
传真	010-66228001	0755-82960794
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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	100033	518000
法定代表人	孙志晨	霍达

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
----------------	---------

登载基金中期报告正文的基金管理人互联网网址	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(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	42,797,930.17
本期利润	54,774,905.75
加权平均基金份额本期利润	0.4793
本期加权平均净值利润率	30.29%
本期基金份额净值增长率	34.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	38,262,836.93
期末可供分配基金份额利润	0.3797
期末基金资产净值	189,380,129.17
期末基金份额净值	1.880
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	88.00%

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	13.60%	0.98%	7.02%	0.75%	6.58%	0.23%
过去三个月	31.38%	1.29%	13.59%	0.96%	17.79%	0.33%
过去六个月	34.86%	2.06%	9.96%	1.51%	24.90%	0.55%
过去一年	51.98%	1.63%	16.22%	1.24%	35.76%	0.39%
过去三年	28.77%	1.49%	-1.99%	1.24%	30.76%	0.25%
自基金合同生效起至今	88.00%	1.71%	30.84%	1.53%	57.16%	0.18%

注：本基金为股票型证券投资基金，投资范围主要包括 A 股、债券类资产、货币市场投资品种以及现金等金融工具。其中投资于股票的基金资产占基金资产比例为 80%-95%，在实际投资运作中，本基金股票投资比例均值约为 85%，故本基金采取 85% 作为复合业绩比较基准中衡量股票投资部分业绩表现的权重，相应将 15% 作为衡量债券投资部分业绩表现的权重。中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的中小盘股票，综合反映了沪深证券市场内中小市值公司的整体情况。因此，基金管理人选择中证 500 指数作为本基金股票部分的比较基准。

中债综合全价（总值）指数由中央国债登记结算公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成份券种包括除资产支持债券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

由此可见，上述两个指数的发布主体在证券市场上具有较高的市场代表性、权威性和中立性，适合作为本基金的业绩比较基准。

### 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

建信中小盘先锋股票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，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、基础设施投资部、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、内控合规部和审计部，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、石家庄六个营销中心，并在上海设立了子公



司——建信资本管理有限责任公司以及在香港设立建信资产管理（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”。

截至 2020 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、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、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、建信富时 100 指数型证券投资基金、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、建信灵活配置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、建信短债债券型证券投资基金、建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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 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）、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、建信高股息主题股票型证券投资基金、建信科技创新混合型证券投资基金、建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金共计 126 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 4939.77 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		
许杰	本基金的基金经理	2017年3月22日	2020年7月20日	18年	许杰先生，权益投资部资深基金经理，硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员，2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职，2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理；2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理；2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011年10月加入我公司，历任权益投资部副总经理、基金经理、资深基金经理。2012年3月21日至2017年1月24日任建信恒稳价值混合型证券投资基金的基金经理；2012年8月14日至2019年11月28日任建信社会责任混合型证券投资基金的基金经理；2014年9月10日至2020年7月20日任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的基金经理；2015年2月3日至2020年7月20日任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015年5月26日至2020年7月20日任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017年3月22日至2020年7月20日任建信中小盘先锋股票型证券投资基金的基金经理。

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证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

③许杰的管理日期为2017年3月22日至2020年7月20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

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》、《公开募集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

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 2 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

2020 年上半年是复杂而又跌宕的。年初，在整体经济稳步运行的情况下，突如其来的疫情导致国内经济出现一定程度的停滞，3 月份海外疫情的扩散又进一步打击了出口需求。在这种情况下，权益市场也出现了调整。截止到一季度末，上证指数下跌 9.83%，深成指下跌 4.49%，沪深 300 下跌 10.03%，创业板指上涨 4.10%。分行业来看，除了农林牧渔、医药、计算机等少数几个行业外，石油石化、家电、非银金融等行业跌幅均超过 15%，反映了资本市场对经济形势的悲观预期，一季度-6.8%的 GDP 数据也印证了这一点。不过，由于政府及时采取了有效的政策，在控制疫情的前提下，宽裕的流动性使得大量企业迅速复苏：先期复苏的基建和地产投资迅速带动相关产业链加速生产；由于海外疫情导致一些国内企业的市占率也迅速提升，同时海外疫情也导致居家办公等一些子行业需求旺盛，这两个因素共同导致出口恢复好于预期；只有内需方面依然处于较低的

恢复水平。复苏导致二季度 GDP 增速迅速转正，回到了 3.2% 的水平。在这种经济走势以及未来经济持续恢复的预期当中，权益市场迅速反弹，二季度上证指数上涨 8.52%，深成指上涨 20.38%，沪深 300 上涨 12.96%，创业板指上涨 30.25%。分行业来看，只有建筑、纺织服装、采掘等少数几个行业下跌，休闲服务、电子、医药、食品饮料等行业涨幅均超过 20%。

本基金重点投资了这些行业中竞争力突出、业绩确定性增长的公司，因此，报告期内，本基金重点投资了传媒、食品饮料等消费类行业以及同时具备消费和创新属性的医药行业中的中小市值公司；另外，继续围绕高质量发展这条中国未来经济发展的主线，重点投资了电子、计算机、新能源等科技创新类行业的中小盘企业。这些公司整体表现较好，基金净值因此也出现了一定幅度的上涨。

#### 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 34.86%，波动率 2.06%，业绩比较基准收益率 9.96%，波动率 1.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2020 年下半年，中国经济仍然在调整中前行。全球经济依然受疫情冲击，同时，贸易摩擦依然是一个不确定的因素。对于国内经济，由于目前恢复水平已经较好，因此我们认为，在疫情不出现重大冲击的情况下，复苏速率将会出现放缓。流动性方面，预计货币宽松情况将会适度收紧，这会在一定程度上降低市场的风险偏好。但中国经济长期发展的潜力仍然较大，中国股市的吸引力仍然存在。海外资金通过沪港通、深港通等渠道持续进入中国 A 股市场，会继续成为 A 股市场流动性的重要推动力量。我国经济正在由高速增长阶段转向高质量发展阶段，经济的增长动能正从要素驱动转向创新驱动，从中国制造转向中国创造，从人口红利向工程师红利。本基金将继续发掘优质的中小公司，希冀随着公司长大，从而获得投资回报。

#### 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、投资风险管理部和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

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

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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。

## § 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：建信中小盘先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	34,762,665.35	23,341,180.61
结算备付金		1,257,531.60	735,016.39
存出保证金		460,917.74	402,077.66
交易性金融资产	6.4.7.2	170,150,561.34	163,143,347.34
其中：股票投资		170,150,561.34	163,143,347.34
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	11,006.36	11,058.73
应收股利		-	-
应收申购款		381,852.22	69,513.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		207,024,534.61	187,702,193.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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		13,464,125.50	2,425,179.86
应付赎回款		1,908,590.51	294,174.20
应付管理人报酬		227,215.61	230,996.68
应付托管费		37,869.28	38,499.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,830,307.63	765,593.22
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	176,296.91	414,724.14
负债合计		17,644,405.44	4,169,167.54
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	100,760,753.97	131,692,309.43
未分配利润	6.4.7.10	88,619,375.20	51,840,716.84
所有者权益合计		189,380,129.17	183,533,026.27
负债和所有者权益总计		207,024,534.61	187,702,193.81

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.880 元，基金份额总额 100,760,753.97 份。

。

## 6.2 利润表

会计主体：建信中小盘先锋股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		58,861,467.11	28,464,831.26
1. 利息收入		210,747.12	244,806.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	210,747.12	244,806.81
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		46,626,642.84	15,336,789.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	45,070,239.40	13,949,005.72
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,556,403.44	1,387,784.18
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,976,975.58	12,831,137.74



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	47,101.57	52,096.81
减：二、费用		4,086,561.36	3,562,165.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,351,299.52	1,394,248.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	225,216.61	232,374.78
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,416,509.87	1,752,579.30
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	93,535.36	182,963.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		54,774,905.75	24,902,665.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		54,774,905.75	24,902,665.31

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信中小盘先锋股票型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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）	131,692,309.43	51,840,716.84	183,533,026.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	54,774,905.75	54,774,905.75
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）	-30,931,555.46	-17,996,247.39	-48,927,802.85
其中：1. 基金申购款	9,485,960.63	5,883,082.48	15,369,043.11
2. 基金赎回款	-40,417,516.09	-23,879,329.87	-64,296,845.96
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）	100,760,753.97	88,619,375.20	189,380,129.17
项目	上年度可比期间 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）	152,116,274.10	12,051,536.77	164,167,810.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,902,665.31	24,902,665.31
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）	-6,849,072.27	-2,482,589.39	-9,331,661.66
其中：1. 基金申购款	12,648,278.25	3,542,984.47	16,191,262.72
2. 基金赎回款	-19,497,350.52	-6,025,573.86	-25,522,924.38
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）	145,267,201.83	34,471,612.69	179,738,814.52

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

吴灵玲

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

建信中小盘先锋股票型证券投资基金(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[2014]495号《关于核准建信中小盘先锋股票型证券投资基金募集的批复》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《建信中小盘先锋股票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759,552,595.20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(2014)第464号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》于2014年8月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为759,776,341.92份基金份额,其中认购资金利息折合223,746.72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,基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中小盘先锋股票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A股股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、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:股票资产占基金资产的80%-95%,债券等固定收益类资产合计市值占基金资产净值的0-20%,权证投资合计市值占基金资产净值的0-3%,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。本基金将不低于80%的非现金基金资产投资于具有较高成长性的中小盘股票。本基金的业绩比较基准为85%X中证500指数收益率+15%X中债综合全价(总值)指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本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、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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2号《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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

本基金 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	34,762,665.35
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	34,762,665.35

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	148,593,151.44	170,150,561.34	21,557,409.90
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	148,593,151.44	170,150,561.34	21,557,409.90

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	10,233.06
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	565.90
应收债券利息	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	207.40
合计	11,006.36

## 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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,830,307.63
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,830,307.63

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	495.32
应付证券出借违约金	-
预提费用	175,801.59
合计	176,296.91

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	131,692,309.43	131,692,309.43
本期申购	9,485,960.63	9,485,960.63
本期赎回（以“-”号填列）	-40,417,516.09	-40,417,516.09
- 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	100,760,753.97	100,760,753.97

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。

## 6.4.7.10 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	454,265.44	51,386,451.40	51,840,716.84
本期利润	42,797,930.17	11,976,975.58	54,774,905.75
本期基金份额交易产生的变动数	-4,989,358.68	-13,006,888.71	-17,996,247.39
其中：基金申购款	1,626,697.06	4,256,385.42	5,883,082.48
基金赎回款	-6,616,055.74	-17,263,274.13	-23,879,329.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,262,836.93	50,356,538.27	88,619,375.20

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	198,714.26
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	8,548.62

其他	3,484.24
合计	210,747.12

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	45,070,239.40
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	45,070,239.40

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	810,781,040.34
减：卖出股票成本总额	765,710,800.94
买卖股票差价收入	45,070,239.40

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 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

无。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。



## 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

## 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,556,403.44
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	1,556,403.44

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	11,976,975.58
股票投资	11,976,975.58
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	11,976,975.58

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	40,578.27
基金转换费收入	6,523.30
合计	47,101.57

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	2,416,509.87
银行间市场交易费用	-
合计	2,416,509.87

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	9,000.00

合计	93,535.36
----	-----------

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,351,299.52	1,394,248.70
其中：支付销售机构的客户维护费	544,894.67	554,264.07

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 1.50% 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 × 1.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	225,216.61	232,374.78

注：支付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% / 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 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

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

无。

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(2020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
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新发未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新发未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新发未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新发未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新发未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新发未上市	36.18	36.18	2,311	83,611.98	83,611.98	-
688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新发未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新发未上市	16.42	16.42	5,262	86,402.04	86,402.04	-
688520	神州细胞	2020年6月11日	2020年12月22日	新发未上市	25.64	58.82	4,528	116,097.92	266,336.96	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2021年01月04日	新发未上市	11.33	11.33	8,076	91,501.08	91,501.08	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新发未上市	15.50	15.50	5,240	81,220.00	81,220.00	-

#### 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、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----	------	------	------	-----	----

2020 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	34,762,665.35	-	-	-	34,762,665.35
结算备付金	1,257,531.60	-	-	-	1,257,531.60
存出保证金	460,917.74	-	-	-	460,917.74
交易性金融资产	-	-	-	-170,150,561.34	170,150,561.34
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	-	-	-	11,006.36	11,006.36
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	381,852.22	381,852.22
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	36,481,114.69	-	-	-170,543,419.92	207,024,534.61
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	-	-	-	13,464,125.50	13,464,125.50
应付赎回款	-	-	-	1,908,590.51	1,908,590.51
应付管理人报酬	-	-	-	227,215.61	227,215.61
应付托管费	-	-	-	37,869.28	37,869.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,830,307.63	1,830,307.63
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	176,296.91	176,296.91
负债总计	-	-	-	17,644,405.44	17,644,405.44
利率敏感度缺口	36,481,114.69	-	-	-152,899,014.48	189,380,129.17
上年度末 2019 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	23,341,180.61	-	-	-	23,341,180.61
结算备付金	735,016.39	-	-	-	735,016.39
存出保证金	402,077.66	-	-	-	402,077.66
交易性金融资产	-	-	-	-163,143,347.34	163,143,347.34
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	-	-	-	11,058.73	11,058.73
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	69,513.08	69,513.08

其他资产	-	-	-	-
资产总计	24,478,274.66	-	-163,223,919.15	187,702,193.81
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	-	-	2,425,179.86	2,425,179.86
应付赎回款	-	-	294,174.20	294,174.20
应付管理人报酬	-	-	230,996.68	230,996.68
应付托管费	-	-	38,499.44	38,499.44
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	765,593.22	765,593.22
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	414,724.14	414,724.14
负债总计	-	-	4,169,167.54	4,169,167.54
利率敏感度缺口	24,478,274.66	-	-159,054,751.61	183,533,026.27

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。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%，债券等固定收益类资产合计市值占基金资产净值的 0-20%，权证投资合计市值占基金资产净值的 0-3%，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%。本基金将不低于 80%的非现金基金资产投资于具有较高成长性的中小盘股票。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 2020年6月30日		上年度末 2019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	170,150,561.34	89.85	163,143,347.34	88.89
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	170,150,561.34	89.85	163,143,347.34	88.89

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	11,352,080.31	9,415,114.71
	业绩比较基准下降	-11,352,080.31	-9,415,114.71

	5%		
--	----	--	--

#### 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

##### 6.4.14.1 公允价值

###### 6.4.14.1.1 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，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 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人民币 169,398,901.16 元，属于第二层次的余额为人民币 393,822.14 元，属于第三层次的余额为人民币 357,838.04 元(于 2019 年 6 月 30 日，属于第一层次的余额为 148,676,005.44 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元)。

###### 6.4.14.1.2.2 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可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为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。

###### 6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

##### 6.4.14.2 承诺事项

无。

##### 6.4.14.3 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	170,150,561.34	82.19
	其中：股票	170,150,561.34	82.19
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	-	-
	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	36,020,196.95	17.40
8	其他各项资产	853,776.32	0.41
9	合计	207,024,534.61	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	5,684,000.00	3.00
C	制造业	114,722,422.70	60.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,277,114.57	17.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,904,524.00	1.53
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,602,693.75	5.60
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	2,947,040.00	1.56
S	综合	-	-
	合计	170,150,561.34	89.85

### 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	000967	盈峰环境	1,057,123	8,721,264.75	4.61
2	300315	掌趣科技	986,200	7,228,846.00	3.82
3	300031	宝通科技	285,700	7,153,928.00	3.78
4	300363	博腾股份	205,400	7,098,624.00	3.75
5	300395	菲利华	214,200	7,040,754.00	3.72
6	300122	智飞生物	70,100	7,020,515.00	3.71
7	603806	福斯特	137,200	6,847,652.00	3.62
8	300171	东富龙	408,300	6,606,294.00	3.49
9	601966	玲珑轮胎	321,150	6,487,230.00	3.43
10	000513	丽珠集团	131,400	6,308,514.00	3.33
11	002381	双箭股份	670,000	6,170,700.00	3.26
12	300702	天宇股份	56,900	6,049,608.00	3.19
13	002425	凯撒文化	342,300	6,010,788.00	3.17
14	300663	科蓝软件	216,800	6,007,528.00	3.17
15	603369	今世缘	147,800	5,880,962.00	3.11
16	600600	青岛啤酒	76,200	5,829,300.00	3.08
17	000661	长春高新	13,200	5,745,960.00	3.03
18	000975	银泰黄金	362,500	5,684,000.00	3.00
19	600183	生益科技	193,700	5,669,599.00	2.99
20	300769	德方纳米	56,120	5,464,965.60	2.89
21	603385	惠达卫浴	380,240	5,239,707.20	2.77
22	603881	数据港	46,100	4,982,027.00	2.63
23	600872	中炬高新	81,400	4,764,342.00	2.52
24	002332	仙琚制药	228,300	3,844,572.00	2.03
25	603916	苏博特	131,110	3,297,416.50	1.74
26	300274	阳光电源	206,200	2,967,218.00	1.57
27	300413	芒果超媒	45,200	2,947,040.00	1.56
28	002127	南极电商	137,200	2,904,524.00	1.53
29	002947	恒铭达	44,800	2,867,200.00	1.51
30	603596	伯特利	77,000	2,710,400.00	1.43

31	002410	广联达	27,000	1,881,900.00	0.99
32	603136	天目湖	77,745	1,881,429.00	0.99
33	688520	神州细胞	4,528	266,336.96	0.14
34	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.06
35	688528	秦川物联	8,076	91,501.08	0.05
36	688377	迪威尔	5,262	86,402.04	0.05
37	688027	国盾量子	2,311	83,611.98	0.04
38	688600	皖仪科技	5,240	81,220.00	0.04
39	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
40	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.01
41	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
42	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
43	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.01
44	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
45	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
46	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
47	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

#### 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	300122	智飞生物	24,171,734.82	13.17
2	002384	东山精密	21,303,827.00	11.61
3	603916	苏博特	19,062,247.50	10.39
4	603369	今世缘	16,925,453.00	9.22
5	688012	中微公司	16,132,967.38	8.79
6	000967	盈峰环境	15,521,115.57	8.46
7	000975	银泰黄金	14,836,011.98	8.08
8	300598	诚迈科技	14,311,899.00	7.80
9	600872	中炬高新	13,968,879.00	7.61
10	600183	生益科技	12,384,032.00	6.75
11	002425	凯撒文化	12,287,709.40	6.70
12	002332	仙琚制药	12,174,903.84	6.63
13	600720	祁连山	11,867,284.00	6.47
14	000513	丽珠集团	11,793,018.79	6.43
15	600161	天坛生物	11,432,662.20	6.23
16	688015	交控科技	11,350,235.60	6.18
17	300274	阳光电源	10,271,627.12	5.60
18	603589	口子窖	10,098,143.15	5.50
19	688008	澜起科技	10,095,857.87	5.50
20	300171	东富龙	10,004,581.00	5.45



21	603881	数据港	9,862,779.02	5.37
22	000401	冀东水泥	9,363,765.36	5.10
23	000661	长春高新	9,202,548.54	5.01
24	300379	东方通	9,180,836.00	5.00
25	688019	安集科技	9,116,547.28	4.97
26	300769	德方纳米	9,092,237.40	4.95
27	300395	菲利华	9,081,755.00	4.95
28	002174	游族网络	8,796,734.00	4.79
29	600466	蓝光发展	8,357,161.00	4.55
30	603239	浙江仙通	8,302,742.00	4.52
31	603596	伯特利	8,170,861.00	4.45
32	603018	中设集团	8,077,446.29	4.40
33	002127	南极电商	8,018,771.00	4.37
34	300315	掌趣科技	7,633,100.00	4.16
35	300655	晶瑞股份	7,570,244.20	4.12
36	002273	水晶光电	7,409,073.76	4.04
37	002158	汉钟精机	7,299,694.00	3.98
38	300397	天和防务	7,214,863.00	3.93
39	603136	天目湖	6,876,778.30	3.75
40	000823	超声电子	6,784,764.00	3.70
41	002381	双箭股份	6,590,557.00	3.59
42	002371	北方华创	6,447,493.00	3.51
43	601966	玲珑轮胎	6,422,550.73	3.50
44	600426	华鲁恒升	6,358,113.00	3.46
45	300604	长川科技	6,293,608.10	3.43
46	002733	雄韬股份	6,249,217.00	3.40
47	600536	中国软件	6,068,566.00	3.31
48	600298	安琪酵母	5,925,139.00	3.23
49	300031	宝通科技	5,897,456.00	3.21
50	300702	天宇股份	5,786,966.30	3.15
51	600584	长电科技	5,739,597.00	3.13
52	600373	中文传媒	5,676,747.00	3.09
53	300663	科蓝软件	5,631,627.00	3.07
54	603444	吉比特	5,615,576.00	3.06
55	002405	四维图新	5,502,995.00	3.00
56	000703	恒逸石化	5,476,583.80	2.98
57	603385	惠达卫浴	5,470,840.90	2.98
58	603806	福斯特	5,446,319.00	2.97
59	300363	博腾股份	5,411,219.00	2.95
60	600487	亨通光电	5,404,166.00	2.94
61	600600	青岛啤酒	5,391,361.00	2.94
62	300166	东方国信	5,355,510.00	2.92

63	002317	众生药业	5,316,921.00	2.90
64	603666	亿嘉和	5,178,793.00	2.82
65	002019	亿帆医药	5,006,635.00	2.73
66	000997	新大陆	4,724,311.00	2.57
67	002920	德赛西威	4,642,996.00	2.53
68	300413	芒果超媒	4,567,640.40	2.49
69	603885	吉祥航空	4,562,716.60	2.49
70	000100	TCL 科技	4,541,790.00	2.47
71	600409	三友化工	4,515,841.00	2.46
72	601689	拓普集团	4,231,093.00	2.31
73	688268	华特气体	4,178,936.83	2.28
74	000400	许继电气	4,080,848.00	2.22
75	002223	鱼跃医疗	4,023,876.20	2.19
76	002368	太极股份	3,876,508.00	2.11
77	300782	卓胜微	3,874,285.00	2.11
78	300383	光环新网	3,833,094.41	2.09
79	002555	三七互娱	3,703,239.30	2.02
80	601336	新华保险	3,692,240.00	2.01

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	002384	东山精密	26,203,296.92	14.28
2	603916	苏博特	21,825,452.00	11.89
3	300122	智飞生物	20,068,778.10	10.93
4	600183	生益科技	17,801,552.62	9.70
5	002127	南极电商	16,695,946.00	9.10
6	300598	诚迈科技	16,438,144.00	8.96
7	688012	中微公司	15,675,335.80	8.54
8	600466	蓝光发展	14,818,796.18	8.07
9	600872	中炬高新	14,647,958.58	7.98
10	002174	游族网络	13,634,304.70	7.43
11	600584	长电科技	12,959,608.76	7.06
12	688008	澜起科技	12,282,250.98	6.69
13	600720	祁连山	12,255,102.70	6.68
14	688015	交控科技	12,184,084.22	6.64
15	600161	天坛生物	11,686,233.65	6.37
16	603369	今世缘	11,294,252.00	6.15
17	002425	凯撒文化	11,071,090.80	6.03
18	300383	光环新网	10,958,366.76	5.97
19	002078	太阳纸业	10,880,074.00	5.93

20	002273	水晶光电	10,772,694.34	5.87
21	603589	口子窖	10,589,482.90	5.77
22	000401	冀东水泥	10,565,692.58	5.76
23	300604	长川科技	9,932,777.40	5.41
24	300655	晶瑞股份	9,850,996.00	5.37
25	000975	银泰黄金	9,514,996.00	5.18
26	002332	仙琚制药	9,449,540.40	5.15
27	603885	吉祥航空	9,321,866.00	5.08
28	300166	东方国信	9,298,476.00	5.07
29	688019	安集科技	8,806,716.95	4.80
30	603239	浙江仙通	8,670,593.00	4.72
31	300379	东方通	8,445,828.00	4.60
32	002371	北方华创	8,442,820.00	4.60
33	000967	盈峰环境	8,260,593.93	4.50
34	603018	中设集团	7,934,584.00	4.32
35	002373	千方科技	7,759,588.00	4.23
36	603881	数据港	7,519,275.34	4.10
37	300316	晶盛机电	7,364,907.70	4.01
38	300274	阳光电源	7,279,592.22	3.97
39	002158	汉钟精机	7,247,118.00	3.95
40	300395	菲利华	7,237,768.00	3.94
41	601233	桐昆股份	7,202,459.51	3.92
42	002013	中航机电	7,057,010.00	3.85
43	300596	利安隆	7,015,606.00	3.82
44	603444	吉比特	6,960,893.14	3.79
45	000513	丽珠集团	6,905,015.77	3.76
46	000988	华工科技	6,561,381.03	3.58
47	603063	禾望电气	6,457,767.30	3.52
48	601966	玲珑轮胎	6,334,416.00	3.45
49	000661	长春高新	6,317,300.00	3.44
50	600298	安琪酵母	6,308,306.00	3.44
51	002244	滨江集团	6,263,168.00	3.41
52	603596	伯特利	6,234,367.28	3.40
53	300397	天和防务	6,182,376.60	3.37
54	600426	华鲁恒升	6,160,562.00	3.36
55	600536	中国软件	6,116,176.00	3.33
56	000823	超声电子	5,979,610.00	3.26
57	002233	塔牌集团	5,593,852.00	3.05
58	002733	雄韬股份	5,579,442.28	3.04
59	002317	众生药业	5,535,655.00	3.02
60	002019	亿帆医药	5,489,035.03	2.99
61	002368	太极股份	5,461,106.00	2.98

62	000997	新大陆	5,395,932.00	2.94
63	000703	恒逸石化	5,359,666.50	2.92
64	300171	东富龙	5,298,965.00	2.89
65	002920	德赛西威	5,148,443.00	2.81
66	600487	亨通光电	5,143,362.00	2.80
67	603136	天目湖	5,059,565.95	2.76
68	600373	中文传媒	5,058,714.00	2.76
69	000725	京东方A	4,921,198.00	2.68
70	603666	亿嘉和	4,919,973.00	2.68
71	002405	四维图新	4,815,600.50	2.62
72	600967	内蒙一机	4,786,462.20	2.61
73	688268	华特气体	4,728,280.84	2.58
74	601689	拓普集团	4,709,659.00	2.57
75	300081	恒信东方	4,490,373.95	2.45
76	000100	TCL 科技	4,349,374.00	2.37
77	600409	三友化工	4,268,529.00	2.33
78	300769	德方纳米	4,167,842.00	2.27
79	000066	中国长城	4,160,162.00	2.27
80	000400	许继电气	4,127,209.00	2.25
81	600760	中航沈飞	4,030,003.00	2.20
82	300502	新易盛	3,919,462.00	2.14
83	603127	昭衍新药	3,868,111.51	2.11
84	002555	三七互娱	3,746,077.30	2.04
85	002223	鱼跃医疗	3,743,704.00	2.04

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	760,741,039.36
卖出股票收入（成交）总额	810,781,040.34

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 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

无。

##### 7.10.2 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 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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，重庆博腾制药科技股份有限公司（300363）于 2020 年 5 月 15 日发布公告，中国证券监督管理委员会重庆监管局下发了《行政处罚决定书》（[2020]1 号），因未及时披露关联方非经营性资金占用的关联交易情况、定期报告存在虚假记载和重大遗漏情况给予博腾股份警告，并处以 30 万元罚款。

##### 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	460,917.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,006.36
5	应收申购款	381,852.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	853,776.32

## 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 (%)
15,323	6,575.79	-	-	100,760,753.97	100.00

## 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	99.11	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

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（2014 年 8 月 20 日） 基金份额总额	759,776,341.92
本报告期期初基金份额总额	131,692,309.43
本报告期基金总申购份额	9,485,960.63
减：本报告期基金总赎回份额	40,417,516.09
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	100,760,753.97

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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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

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

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、基金业协会、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。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	
海通证券	2	794,380,055.36	50.59%	739,806.60	50.59%	-
申万宏源	2	775,946,783.70	49.41%	722,640.75	49.41%	-
西南证券	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、本基金本报告期内增加海通证券 2 个交易单元，无剔除交易单元。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

无。



## 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	建信基金管理有限责任公司关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-10
2	建信基金管理有限责任公司关于增加大连网金基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-30
3	建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加渤海银行基金申购、定投费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-26
4	建信基金管理有限责任公司关于增加华瑞保险销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-08

## § 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

无。

## § 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中小盘先锋股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中小盘先锋股票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

2020 年 8 月 28 日