

建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金
金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 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 2023 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	8
§ 4 管理人报告	8
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	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	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	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（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	建信鑫安回报灵活配置混合	
基金主代码	001304	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 14 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	145,570,831.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信鑫安回报灵活配置混合 A	建信鑫安回报灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001304	018541
报告期末下属分级基金的份额总额	136,630,474.19 份	8,940,357.45 份

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	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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	罗菲菲
	联系电话	010-58560666
	电子邮箱	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	95568
传真	010-66228001	010-57093382
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	100033	100031
法定代表人	刘军	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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(2023年1月1日-2023年6月30日)	2023年5月22日(基金合同生效日)-2023年6月30日
	建信鑫安回报灵活配置混合 A	建信鑫安回报灵活配置混合 C
本期已实现收益	5,580,068.12	17,545.37
本期利润	1,547,218.59	93,905.67
加权平均基金份额本期利润	0.0118	0.1410
本期加权平均净值利润率	1.03%	12.57%
本期基金份额净值增长率	2.18%	1.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	17,840,331.05	1,166,842.92
期末可供分配基金份额利润	0.1306	0.1305
期末基金资产净值	154,470,805.24	10,107,200.37
期末基金份额净值	1.1306	1.1305
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净	36.35%	1.66%

值增长率		
------	--	--

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

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

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

4、本基金于 2023 年 5 月 22 日起新增 C 类份额，原有份额转换为 A 类份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信鑫安回报灵活配置混合 A

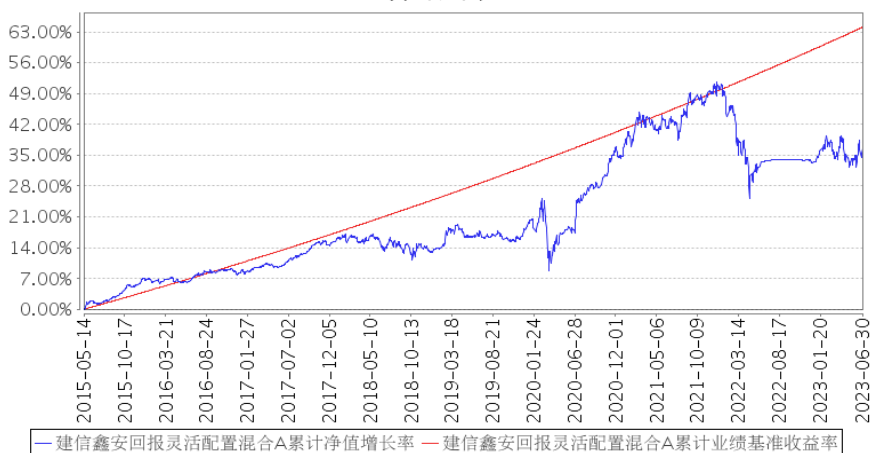
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.69%	0.76%	0.50%	0.02%	1.19%	0.74%
过去三个月	0.34%	0.66%	1.53%	0.02%	-1.19%	0.64%
过去六个月	2.18%	0.60%	3.06%	0.02%	-0.88%	0.58%
过去一年	1.91%	0.41%	6.27%	0.02%	-4.36%	0.39%
过去三年	15.94%	0.52%	20.02%	0.02%	-4.08%	0.50%
自基金合同生效起至今	36.35%	0.42%	64.03%	0.02%	-27.68%	0.40%

建信鑫安回报灵活配置混合 C

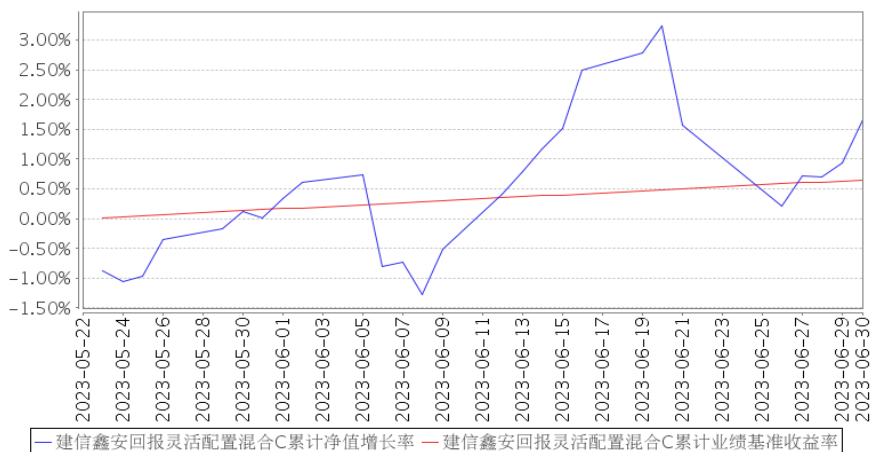
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.65%	0.76%	0.50%	0.02%	1.15%	0.74%
自基金合同生效起至今	1.66%	0.69%	0.65%	0.02%	1.01%	0.67%

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

建信鑫安回报灵活配置混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信鑫安回报灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，由中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本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、深圳五家分公司，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 7000 万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至 2023 年 6 月 30 日，公司管理运作 161 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 1.11 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		
徐文琪	本基金的基金经理	2023 年 6 月 1 日	-	13	徐文琪女士，硕士。曾任国信证券股份有限公司机构销售经理、民生通惠资产管理有限公司权益投资部投资经理、民生基金管理有限公司专户投资部投资经理、民生加银基金管理有限公司专户理财部投资经理等职务。2021 年 11 月加入建信基金，任多元资产投资部投资经理。2023 年 6 月 1 日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
江源	多元资产投资部副总经理，本基金的基金经理	2022 年 11 月 25 日	-	18	江源女士，多元资产投资部副总经理，硕士。曾任中国建设银行金融市场部业务经理。2012 年 11 月加入建信基金，历任专户投资部投资经理、总经理助理、副总经理等职务。2022 年 11 月 25 日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
袁蓓	多元资产投资部总经理，本基金的基金经理	2022 年 11 月 25 日	-	22	袁蓓女士，多元资产投资部总经理，硕士。曾任中国平安保险（集团）股份有限公司投资管理中心债券投资部交易员、交易室主任、债券投资室副主任；华安基金管理有限公司基金投资部基金经理；泰康资产管理有限责任公司年金投资部投资总监、负责人。2014 年 5 月加入建信基金，历任专户投资部总经理职务。2022 年 11 月 25 日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
袁蓓	公募基金	1	164,578,005.61	2022年11月25日
	私募资产管理计划	6	4,230,515,708.32	2014年7月1日
	其他组合	-	-	-
	合计	7	4,395,093,713.93	-

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《建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 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

上半年，全球地缘政治风险持续演绎，美欧等发达经济体大幅加息，但经济基本面有所分化，

美国经济保持韧性，欧洲经济略显疲态。美元指数和美债收益率宽幅震荡，黄金震荡偏强，全球股市科技股表现较强。国内经济经历了一季度的平稳复苏后，二季度出现了显著的边际走弱。整体看，疫情影响淡化后消费复苏持续，服务业景气度修复，工业生产修复较为温和，但受出口和房地产拖累，固定资产投资增速持续回落。政策方面，经济下行压力加大后，以货币政策为代表的稳增长政策逐步出台，货币政策延续宽松。

上半年，A 股行情一波三折，表现出较强的轮动和分化特征。年初受疫后复苏、联储宽松预期等因素影响，各板块普遍上涨。随后，因内生需求不足引发市场预期从弱复苏转向弱衰退，数字经济、中特估等主题行情轮番演绎。持续到二季度末，弱复苏叠加弱预期，市场普遍下跌。整体来看，上证指数上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，中证 500 上涨 2.29%，科创 50 上涨 4.71%，创业板指下跌 5.61%，中证转债指数上涨 3.37%。债券市场收益率先上后下，年初疫后复苏强劲，长端收益率快速抬升；之后经济逐步走弱、货币政策转向宽松，债券市场持续走强，十年期国债收益率逼近去年利率低点。

回顾上半年基金管理工作，权益方面，以绝对收益率为目标，坚持价值投资理念。年初结合市场全面上涨行情，迅速提高权益资产配置比例，注重成长性和均衡配置；在随后的市场震荡下行行情中，控制权益资产配置比重，通过积极选股获取超额收益。债券方面主要采用杠杆票息策略，以中短久期信用债为主要配置方向，并适当参与波段交易。另外，积极参与新股及转债的一级申购以增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 2.18%，波动率 0.60%，业绩比较基准收益率 3.06%，波动率 0.02%。本报告期本基金 C 净值增长率 1.66%，波动率 0.69%，业绩比较基准收益率 0.65%，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

展望下半年，预计海外通胀继续降温，加息周期逐渐接近尾声，美国经济韧性仍在，软着陆概率上升。日银 YCC 政策调整，对美股、美债或有冲击，但对中国外溢效应有限。国内方面，受 7 月政治局会议表态提振，会议提出“加大宏观政策调控力度”、“加强逆周期调节和政策储备”，经济悲观预期有所扭转。近期企业盈利数据、库存数据、PMI 数据均指向经济有企稳迹象，后续关键变量在于政策力度和效能。物价方面，CPI 与 PPI 有望经过短暂磨底后上行。政策方面，经济下行压力加大后，稳增长政策逐步出台，货币政策将延续宽松，财政政策加快推进，地产政策进一步放松，产业政策加快出台。

海外紧缩周期接近尾声，国内政策落地窗口期，不确定性消除有利于市场风险偏好回归，未

来重点关注政策的具体推进与经济基本面的边际变化。对于股票市场而言，市场流动性偏宽松，在较低的市场估值下，可能带来前期悲观情绪的缓解，有望开启新一轮上涨行情。对于债券市场而言，超预期的地产政策和积极的财政政策可能导致利率短期内面临一定的调整压力，而一揽子化债方案的制定实施能在一定程度缓解投资者对城投债务风险的担忧，预计下半年利率中枢略有抬升压力。在此背景下，本基金将本着稳健运营的理念，继续提高权益资产配置比重，通过积极选股获取超额收益，争取为投资者获得较好的回报。债券方面，以信用债票息策略和杠杆策略为主，关注政策及数据变化带来的交易性机会，择机参与利率品的波段交易。此外，还将积极参与新股及转债的一级申购以增厚组合收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

根据法律法规及本基金基金合同中关于收益分配相关条款的规定，本基金于 2023 年 3 月 27 日向基金份额持有人每 10 份基金份额分配 0.20 元，共发放红利人民币 1,913,612.00 元（包含现金和红利再投资形式）元，达到基金合同约定的利润分配要求。

根据法律法规及本基金基金合同中关于收益分配相关条款的规定，本基金于 2023 年 6 月 27 日向基金 A 类及 C 类份额持有人每 10 份基金份额分配 0.20 元，共发放红利人民币 3,543,731.17 元（包含现金和红利再投资形式）元，达到基金合同约定的利润分配要求。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,053,199.64	435,617.30
结算备付金		888,759.16	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	175,318,629.57	51,512,811.12
其中：股票投资		108,675,093.13	5,397,098.00
基金投资		-	-
债券投资		66,643,536.44	46,115,713.12
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-2,029.12	2,355,021.92
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		6,736,043.68	540,735.56
应收股利		-	-
应收申购款		19,970.04	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		191,014,572.97	54,844,185.90
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		26,011,294.70	-
应付清算款		1,319.00	541,457.60
应付赎回款		953.96	-
应付管理人报酬		98,419.99	18,732.18
应付托管费		24,605.04	4,683.03
应付销售服务费		221.77	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,460.38	138.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	293,292.52	191,213.39
负债合计		26,436,567.36	756,224.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	145,570,831.64	47,181,240.36
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	19,007,173.97	6,906,721.08
净资产合计		164,578,005.61	54,087,961.44
负债和净资产总计		191,014,572.97	54,844,185.90

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 145,570,831.64 份，其中建信鑫安回报灵活配置混合 A 基金份额总额 136,630,474.19 份，基金份额净值人民币 1.1306 元；建信鑫安回报灵活配置混合 C 基金份额总额 8,940,357.45 份，基金份额净值人民币 1.1305 元。

6.2 利润表

会计主体：建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,583,491.97	-28,555,486.31
1. 利息收入		113,219.57	84,918.62
其中：存款利息收入	6.4.7.13	21,983.27	84,918.62
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		91,236.30	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,031,475.36	-26,008,414.57
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,695,283.63	-27,276,343.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,736,253.71	1,237,478.04
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	599,938.02	30,451.35
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-3,956,489.23	-3,070,731.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	395,286.27	438,740.80
减：二、营业总支出		942,367.71	1,515,981.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	446,172.28	603,541.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	111,543.04	150,885.34
3. 销售服务费		221.85	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		296,549.09	657,580.70

其中：卖出回购金融资产支出		296,549.09	657,580.70
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3,559.65	-
8. 其他费用	6.4.7.23	84,321.80	103,974.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,641,124.26	-30,071,467.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,641,124.26	-30,071,467.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,641,124.26	-30,071,467.92

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	47,181,240.36	-	6,906,721.08	54,087,961.44
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	47,181,240.36	-	6,906,721.08	54,087,961.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	98,389,591.28	-	12,100,452.89	110,490,044.17
（一）、综合收益总额	-	-	1,641,124.26	1,641,124.26
（二）、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）	98,389,591.28	-	15,916,671.80	114,306,263.08
其中：1. 基金申购款	192,680,520.16	-	28,188,332.22	220,868,852.38
2. 基金赎回	-94,290,928.88	-	-12,271,660.42	-106,562,589.30

回款				
(三)、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)	-	-	-5,457,343.17	-5,457,343.17
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	145,570,831.64	-	19,007,173.97	164,578,005.61
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022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(基金净值)	204,135,893.49	-	60,063,720.46	264,199,613.95
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	204,135,893.49	-	60,063,720.46	264,199,613.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-157,786,882.59	-	-53,179,869.04	-210,966,751.63
(一)、综合收益总额	-	-	-30,071,467.92	-30,071,467.92
(二)、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)	-157,786,882.59	-	-23,108,401.12	-180,895,283.71
其中: 1. 基金申购款	110,831.88	-	23,199.60	134,031.48
2. 基金赎回款	-157,897,714.47	-	-23,131,600.72	-181,029,315.19
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	46,349,010.90	-	6,883,851.42	53,232,862.32

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：

<u>张军红</u>	<u>张力铮</u>	<u>丁颖</u>
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

建信鑫安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]790号《关于准予建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《建信鑫安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 201,376,891.08 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（2015）第 488 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 201,376,911.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 19.92 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》并报证监会备案，本基金于 2023 年 5 月 22 日起根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式等不同，将本基金基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别。2023 年 5 月 22 日前原有的基金份额全部转换为建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

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、存托凭证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%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。

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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	8,053,199.64
等于：本金	8,052,204.57
加：应计利息	995.07
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	8,053,199.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	112,735,727.10	-	108,675,093.13	-4,060,633.97	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	18,513,584.06	387,252.82	18,667,730.52	-233,106.36
	银行间市场	47,334,575.44	422,105.92	47,975,805.92	219,124.56
	合计	65,848,159.50	809,358.74	66,643,536.44	-13,981.80
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	178,583,886.60	809,358.74	175,318,629.57	-4,074,615.77	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-2,029.12	-
银行间市场	-	-
合计	-2,029.12	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	167,114.63
其中：交易所市场	157,622.68
银行间市场	9,491.95
应付利息	-
预提费用	126,177.89
合计	293,292.52

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信鑫安回报灵活配置混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,181,240.36	47,181,240.36
本期申购	183,740,142.71	183,740,142.71
本期赎回（以“-”号填列）	-94,290,908.88	-94,290,908.88
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	136,630,474.19	136,630,474.19

建信鑫安回报灵活配置混合 C

项目	本期 2023年5月22日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	8,940,377.45	8,940,377.45
本期赎回（以“-”号填列）	-20.00	-20.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	8,940,357.45	8,940,357.45

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

建信鑫安回报灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,312,478.92	-405,757.84	6,906,721.08
本期利润	5,580,068.12	-4,032,849.53	1,547,218.59
本期基金份额交易产生的变动数	13,846,362.83	997,146.56	14,843,509.39
其中：基金申购款	28,343,179.45	-1,228,012.93	27,115,166.52
基金赎回款	-14,496,816.62	2,225,159.49	-12,271,657.13
本期已分配利润	-5,457,118.01	-	-5,457,118.01
本期末	21,281,791.86	-3,441,460.81	17,840,331.05

建信鑫安回报灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	17,545.37	76,360.30	93,905.67
本期基金份额交易产生的变动数	1,374,670.94	-301,508.53	1,073,162.41
其中：基金申购款	1,374,674.21	-301,508.51	1,073,165.70
基金赎回款	-3.27	-0.02	-3.29
本期已分配利润	-225.16	-	-225.16
本期末	1,391,991.15	-225,148.23	1,166,842.92

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
活期存款利息收入		12,789.67
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		6,048.43
其他		3,145.17
合计		21,983.27

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		3,695,283.63
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		3,695,283.63

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
卖出股票成交总额		38,328,329.04
减：卖出股票成本总额		34,417,880.31
减：交易费用		215,165.10
买卖股票差价收入		3,695,283.63

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
债券投资收益——利息收入		1,087,802.20
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		648,451.51

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	1,736,253.71

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	133,249,703.92
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	131,408,373.06
减：应计利息总额	1,184,740.07
减：交易费用	8,139.28
买卖债券差价收入	648,451.51

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	599,938.02
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	599,938.02

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,956,489.23
股票投资	-3,982,917.98

债券投资	26,428.75
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
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	-3,956,489.23

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	395,286.01
基金转换费收入	0.26
合计	395,286.27

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,734.73
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	84,321.80

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	基金托管人

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	446,172.28	603,541.54
其中：支付销售机构的客户维护费	50,623.60	454.81

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 0.60%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×0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	111,543.04	150,885.34

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	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		
	建信鑫安回报灵活配置 混合 A	建信鑫安回报灵活配置 混合 C	合计
建信基金	-	219.99	219.99
合计	-	219.99	219.99
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信鑫安回报灵活配置 混合 A	建信鑫安回报灵活配置 混合 C	合计
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 5 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
	建信鑫安回报灵活配置混合 A	建信鑫安回报灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 14 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	19,392,206.72	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	19,392,206.72	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.19%	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 -
	建信鑫安回报灵活配置混合 A	建信鑫安回报灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 14 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	1,972,293.22	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,972,293.22	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.26%	-

注：分级持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行-活期	8,053,199.64	12,789.67	7,216,033.81	37,134.34

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

建信鑫安回报灵活配置混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2023年3月27日	-	2023年3月27日	0.2000	1,856,771.09	56,840.91	1,913,612.00	-
2	2023年6月27日	-	2023年6月27日	0.2000	3,541,201.32	2,304.69	3,543,506.01	-
合计	-	-	-	0.4000	5,397,972.41	59,145.60	5,457,118.01	-
建信鑫安回报灵活配置混合 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2023年6月27日	-	2023年6月27日	0.2000	146.39	78.77	225.16	-
合计	-	-	-	0.2000	146.39	78.77	225.16	-

6.4.12 期末（2023 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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 26,011,294.70 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102000460	20 铁建房产 MTN002	2023 年 7 月 3 日	103.12	56,000	5,774,713.88
102000654	20 亦庄控股 MTN001	2023 年 7 月 3 日	101.56	50,000	5,077,801.64
102103191	21 陕煤化 MTN010	2023 年 7 月 3 日	102.77	120,000	12,332,363.84
102280612	22 首开 MTN004	2023 年 7 月 3 日	102.06	32,000	3,266,070.38
102281035	22 山东土地 MTN001	2023 年 7 月 3 日	100.85	34,000	3,428,854.30
合计				292,000	29,879,804.04

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	5,004,868.49
A-1 以下	-	-
未评级	-	16,040,126.14
合计	-	21,044,994.63

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	32,927,598.39	-
AAA 以下	3,728,344.07	-
未评级	20,253,651.37	-
合计	56,909,593.83	-

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等。

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。基金管理人对于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 2023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	8,053,199.64	-	-	-	8,053,199.64
结算备付金	888,759.16	-	-	-	888,759.16
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	10,223,425.94	56,039,621.25	380,489.25	108,675,093.13	175,318,629.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-2,029.12	-	-	-	-2,029.12
应收清算款	-	-	-	6,736,043.68	6,736,043.68
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	19,970.04	19,970.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	19,163,355.62	56,039,621.25	380,489.25	115,431,106.85	191,014,572.97
负债					

卖出回购金融资产款	26,011,294.70	-	-	-	26,011,294.70
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,319.00	1,319.00
应付赎回款	-	-	-	953.96	953.96
应付管理人报酬	-	-	-	98,419.99	98,419.99
应付托管费	-	-	-	24,605.04	24,605.04
应付销售服务费	-	-	-	221.77	221.77
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6,460.38	6,460.38
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	293,292.52	293,292.52
负债总计	26,011,294.70	-	-	425,272.66	26,436,567.36
利率敏感度缺口	-6,847,939.08	56,039,621.25	380,489.25	115,005,834.19	164,578,005.61
上年度末 2022 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	435,617.30	-	-	-	435,617.30
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	46,115,713.12	-	-	5,397,098.00	51,512,811.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	2,355,021.92	-	-	-	2,355,021.92
应收清算款	-	-	-	540,735.56	540,735.56
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	48,906,352.34	-	-	5,937,833.56	54,844,185.90
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	-	-	-	541,457.60	541,457.60
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	18,732.18	18,732.18
应付托管费	-	-	-	4,683.03	4,683.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	138.26	138.26
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	191,213.39	191,213.39

负债总计	-	-	756,224.46	756,224.46
利率敏感度缺口	48,906,352.34	-	5,181,609.10	54,087,961.44

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

假设	除市场利率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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-206,890.61	-62,002.51
市场利率下降25个基点	208,215.40	62,184.95	

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%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金

资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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 2023年6月30日		上年度末 2022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	108,675,093.13	66.03	5,397,098.00	9.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	66,643,536.44	40.49	46,115,713.12	85.26
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	175,318,629.57	106.53	51,512,811.12	95.24

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	3,188,492.36	-1,620,274.03
	业绩比较基准下降5%	-3,188,492.36	1,620,274.03

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	112,403,437.20	5,397,098.00
第二层次	62,915,192.37	46,115,713.12
第三层次	-	-
合计	175,318,629.57	51,512,811.12

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义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	108,675,093.13	56.89
	其中：股票	108,675,093.13	56.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	66,643,536.44	34.89
	其中：债券	66,643,536.44	34.89
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-2,029.12	-0.00
	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	8,941,958.80	4.68
8	其他各项资产	6,756,013.72	3.54
9	合计	191,014,572.97	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	71,842,302.77	43.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,525,000.00	2.14
E	建筑业	3,790,000.00	2.30
F	批发和零售业	1,351,912.00	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	2,472,000.00	1.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,074,957.26	9.77
J	金融业	1,725,000.00	1.05
K	房地产业	1,409,000.00	0.86
L	租赁和商务服务业	1,304,254.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	1,681,680.00	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	1,205,787.10	0.73
R	文化、体育和娱乐业	2,293,200.00	1.39
S	综合	-	-
	合计	108,675,093.13	66.03

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	002371	北方华创	15,000	4,764,750.00	2.90
2	688169	石头科技	12,000	3,848,160.00	2.34
3	601390	中国中铁	500,000	3,790,000.00	2.30
4	300161	华中数控	70,000	3,746,400.00	2.28
5	600406	国电南瑞	153,600	3,548,160.00	2.16
6	601985	中国核电	500,000	3,525,000.00	2.14
7	300253	卫宁健康	320,000	3,462,400.00	2.10
8	600132	重庆啤酒	36,000	3,317,760.00	2.02
9	688012	中微公司	20,000	3,129,000.00	1.90
10	601138	工业富联	120,000	3,024,000.00	1.84
11	600456	宝钛股份	80,000	2,707,200.00	1.64
12	601111	中国国航	300,000	2,472,000.00	1.50
13	600703	三安光电	140,000	2,413,600.00	1.47
14	603222	济民医疗	200,000	2,086,000.00	1.27
15	301052	果麦文化	42,000	2,071,440.00	1.26
16	300331	苏大维格	76,000	1,985,120.00	1.21
17	688531	日联科技	13,200	1,960,332.00	1.19
18	688522	纳睿雷达	35,000	1,873,200.00	1.14
19	603517	绝味食品	50,000	1,857,500.00	1.13
20	002568	百润股份	50,827	1,847,561.45	1.12
21	600399	抚顺特钢	180,000	1,836,000.00	1.12
22	002475	立讯精密	53,400	1,732,830.00	1.05
23	601229	上海银行	300,000	1,725,000.00	1.05
24	688167	炬光科技	16,000	1,720,800.00	1.05
25	300416	苏试试验	78,000	1,681,680.00	1.02
26	600031	三一重工	100,000	1,663,000.00	1.01
27	688082	盛美上海	15,000	1,656,000.00	1.01
28	600498	烽火通信	80,000	1,629,600.00	0.99
29	688368	晶丰明源	12,000	1,526,520.00	0.93
30	688521	芯原股份	21,000	1,510,320.00	0.92
31	600276	恒瑞医药	30,400	1,456,160.00	0.88

32	000063	中兴通讯	30,000	1,366,200.00	0.83
33	301015	百洋医药	48,700	1,351,912.00	0.82
34	000733	振华科技	14,000	1,341,900.00	0.82
35	300014	亿纬锂能	22,000	1,331,000.00	0.81
36	601888	中国中免	11,800	1,304,254.00	0.79
37	000989	九芝堂	93,700	1,296,808.00	0.79
38	001323	慕思股份	36,000	1,222,560.00	0.74
39	300015	爱尔眼科	65,002	1,205,787.10	0.73
40	688355	明志科技	39,596	1,204,510.32	0.73
41	002812	恩捷股份	12,000	1,156,200.00	0.70
42	600223	福瑞达	110,000	1,128,600.00	0.69
43	600536	中国软件	23,400	1,096,992.00	0.67
44	688777	中控技术	17,400	1,092,372.00	0.66
45	300957	贝泰妮	12,000	1,066,560.00	0.65
46	688262	国芯科技	25,254	1,027,585.26	0.62
47	002230	科大讯飞	15,000	1,019,400.00	0.62
48	688111	金山办公	2,000	944,440.00	0.57
49	002179	中航光电	20,800	943,280.00	0.57
50	000729	燕京啤酒	70,000	872,900.00	0.53
51	002216	三全食品	56,000	872,480.00	0.53
52	688072	拓荆科技	2,000	851,940.00	0.52
53	300525	博思软件	55,200	846,768.00	0.51
54	002384	东山精密	32,100	831,390.00	0.51
55	603595	东尼电子	19,000	813,580.00	0.49
56	300769	德方纳米	7,200	793,656.00	0.48
57	002008	大族激光	30,000	786,000.00	0.48
58	601231	环旭电子	50,000	748,000.00	0.45
59	002876	三利谱	22,000	729,740.00	0.44
60	603678	火炬电子	20,000	689,200.00	0.42
61	002049	紫光国微	7,000	652,750.00	0.40
62	000338	潍柴动力	50,000	623,000.00	0.38
63	600298	安琪酵母	15,000	543,150.00	0.33
64	000951	中国重汽	30,000	505,500.00	0.31
65	688271	联影医疗	2,500	345,025.00	0.21
66	000002	万科A	20,000	280,400.00	0.17
67	300860	锋尚文化	4,000	221,760.00	0.13

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	688169	石头科技	4,666,080.00	8.63
2	601390	中国中铁	4,072,000.00	7.53

3	600132	重庆啤酒	3,896,468.00	7.20
4	601138	工业富联	3,717,132.00	6.87
5	002371	北方华创	3,663,494.00	6.77
6	300253	卫宁健康	3,512,129.22	6.49
7	688012	中微公司	3,385,940.00	6.26
8	301165	锐捷网络	3,192,705.00	5.90
9	002131	利欧股份	3,179,044.70	5.88
10	601111	中国国航	3,090,803.00	5.71
11	600456	宝钛股份	3,060,788.00	5.66
12	601985	中国核电	3,044,200.00	5.63
13	600703	三安光电	2,874,800.00	5.32
14	300161	华中数控	2,822,698.00	5.22
15	600399	抚顺特钢	2,617,440.00	4.84
16	603517	绝味食品	2,498,220.00	4.62
17	603222	济民医疗	2,495,992.00	4.61
18	600406	国电南瑞	2,493,991.00	4.61
19	688531	日联科技	2,229,764.93	4.12
20	002568	百润股份	2,097,677.60	3.88
21	601888	中国中免	2,095,841.00	3.87
22	301052	果麦文化	2,087,000.00	3.86
23	688522	纳睿雷达	1,983,933.61	3.67
24	601229	上海银行	1,942,399.00	3.59
25	688167	炬光科技	1,914,914.84	3.54
26	300014	亿纬锂能	1,819,236.00	3.36
27	688521	芯原股份	1,804,604.76	3.34
28	300331	苏大维格	1,803,337.00	3.33
29	300416	苏试试验	1,778,436.00	3.29
30	600188	兖矿能源	1,750,446.00	3.24
31	688368	晶丰明源	1,737,670.44	3.21
32	002812	恩捷股份	1,677,427.00	3.10
33	002475	立讯精密	1,670,791.00	3.09
34	001323	慕思股份	1,610,634.00	2.98
35	688082	盛美上海	1,574,900.00	2.91
36	600498	烽火通信	1,520,513.00	2.81
37	300015	爱尔眼科	1,453,356.00	2.69
38	000989	九芝堂	1,390,171.00	2.57
39	301015	百洋医药	1,389,487.00	2.57
40	600276	恒瑞医药	1,386,237.00	2.56
41	300957	贝泰妮	1,346,966.00	2.49
42	600031	三一重工	1,318,071.00	2.44
43	000733	振华科技	1,289,081.00	2.38
44	002876	三利谱	1,263,391.00	2.34
45	600536	中国软件	1,219,876.96	2.26

46	600223	福瑞达	1,199,368.00	2.22
47	000977	浪潮信息	1,186,943.00	2.19
48	603595	东尼电子	1,146,660.00	2.12
49	688777	中控技术	1,143,076.90	2.11
50	300769	德方纳米	1,099,948.00	2.03

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	301165	锐捷网络	3,946,833.00	7.30
2	002131	利欧股份	2,885,488.20	5.33
3	601138	工业富联	2,550,230.00	4.71
4	300660	江苏雷利	1,766,704.40	3.27
5	600188	兖矿能源	1,752,500.00	3.24
6	301052	果麦文化	1,719,440.00	3.18
7	000977	浪潮信息	1,658,340.00	3.07
8	300474	景嘉微	1,359,037.00	2.51
9	300161	华中数控	1,063,094.00	1.97
10	688169	石头科技	1,008,040.00	1.86
11	603507	振江股份	1,000,500.00	1.85
12	002957	科瑞技术	933,910.00	1.73
13	000063	中兴通讯	893,163.00	1.65
14	002338	奥普光电	840,722.00	1.55
15	002407	多氟多	697,387.80	1.29
16	300782	卓胜微	682,650.00	1.26
17	300773	拉卡拉	667,597.00	1.23
18	002373	千方科技	664,524.00	1.23
19	300759	康龙化成	596,866.00	1.10
20	688382	益方生物	588,279.10	1.09

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	141,678,793.42
卖出股票收入（成交）总额	38,328,329.04

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	6,311,469.21	3.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,422,473.40	2.08
	其中：政策性金融债	3,422,473.40	2.08
4	企业债券	5,205,443.84	3.16
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	47,975,805.92	29.15
7	可转债（可交换债）	3,728,344.07	2.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	66,643,536.44	40.49

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	102103191	21 陕煤化 MTN010	120,000	12,332,363.84	7.49
2	102000460	20 铁建房产 MTN002	100,000	10,311,989.07	6.27
3	102380884	23 六合国资 MTN001	100,000	10,107,983.61	6.14
4	019679	22 国债 14	62,000	6,311,469.21	3.83
5	155601	19 联发 02	50,000	5,205,443.84	3.16

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金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，北京首都开发股份有限公司（下简称“公司”）于 2023 年 7 月 12 日收到中国证券监督管理委员会下发的《立案告知书》（证监立案字 0142023014 号）。因公司涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会决定对公司立案。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	6,736,043.68
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	19,970.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,756,013.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113047	旗滨转债	745,227.20	0.45
2	128131	崇达转 2	709,864.67	0.43
3	110043	无锡转债	489,483.33	0.30
4	128132	交建转债	483,221.45	0.29
5	111010	立昂转债	380,489.25	0.23
6	127046	百润转债	331,833.70	0.20
7	123124	晶瑞转 2	329,961.72	0.20
8	127017	万青转债	258,262.75	0.16

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	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 (%)
建信鑫安回报灵活配置混合 A	406	336,528.26	129,738,835.69	94.96	6,891,638.50	5.04
建信鑫安回报灵活配置混合 C	11	812,759.77	8,928,571.43	99.87	11,786.02	0.13
合计	417	349,090.72	138,667,407.12	95.26	6,903,424.52	4.74

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	建信鑫安回报灵活配置混合 A	2,840,271.33	2.08
	建信鑫安回报灵活配置混合 C	1,148.41	0.01
	合计	2,841,419.74	1.95

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	建信鑫安回报灵活配置混合 A	>100

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信鑫安回报灵活配置混合 C	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	建信鑫安回报灵活配置混合 A	>100
	建信鑫安回报灵活配置混合 C	0~10
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信鑫安回报灵活配置混合 A	建信鑫安回报灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2015 年 5 月 14 日) 基金份额总额	201,376,911.00	-
本报告期期初基金份额总额	47,181,240.36	-
本报告期基金总申购份额	183,740,142.71	8,940,377.45
减：本报告期基金总赎回份额	94,290,908.88	20.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	136,630,474.19	8,940,357.45

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

2、本基金于 2023 年 5 月 22 日起新增 C 类份额，原有份额转换为 A 类份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2023 年 1 月 19 日发布公告，自 2023 年 1 月 17 日起吴灵玲女士不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起刘军先生不再担任建信基金管理有限责任公司董事长，暂由总裁张军红先生代为履行董事长职务；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 3 月 18 日发布公

告，自 2023 年 3 月 17 日起聘任张力铮先生担任建信基金管理有限责任公司副总裁，张威威先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁、首席信息官。上述事项均已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东北证券	1	59,199,423.14	32.92	54,541.15	33.53	-
中信证券	3	54,988,364.08	30.58	51,134.60	31.43	-
光大证券	2	19,793,067.29	11.01	18,353.06	11.28	-
华泰证券	1	19,251,484.26	10.71	13,886.32	8.54	-

中泰证券	2	18,215,503.80	10.13	16,963.88	10.43	-
招商证券	2	8,380,179.00	4.66	7,804.37	4.80	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
九州证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	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、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东北证券	18,039,676.85	37.09	663,293,000.00	81.25	-	-
中信证券	24,192,270.65	49.74	67,467,000.00	8.26	-	-
光大证	3,866,713.7	7.95	51,810,000.00	6.35	-	-

券	4		0			
华泰证 券	899,800.27	1.85	33,771,000.00	4.14	-	-
中泰证 券	1,635,473.59	3.36	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
九州证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金分红公告	指定报刊和/或公司网站	2023年06月27日
2	建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告	指定报刊和/或公司网站	2023年06月22日
3	建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定报刊和/或公司网站	2023年06月03日
4	关于新增华西证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023年05月29日
5	建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告	指定报刊和/或公司网站	2023年05月22日
6	关于建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金在直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023年03月31日
7	建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金分红公告	指定报刊和/或公司网站	2023年03月27日
8	关于建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金开展直销渠道赎回费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023年03月27日
9	建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金基金暂停大额申购、大额转换	指定报刊和/或公司网站	2023年03月24日

	转入、定期定额投资公告		
10	关于更新建信基金旗下公募基金产品适当性风险等级评定结果的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 15 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	2023 年 01 月 01 日-2023 年 03 月 28 日	19,392,206.72	-	-	19,392,206.72	13.32
	2	2023 年 01 月 09 日-2023 年 03 月 29 日, 2023 年 04 月 03 日-2023 年 06 月 27 日	-	87,030,724.96	87,030,724.96	-	-
	3	2023 年 03 月 29 日-2023 年 04 月 02 日	-	26,548,584.07	-	26,548,584.07	18.24

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。

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

2023 年 8 月 30 日