

建信汇利灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 26 日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	建信汇利灵活配置混合
基金主代码	002573
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 9 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	218,314,046.88 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	建信安心保本六号混合
基金主代码	002573
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 28 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	499,388,985.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金自上而下积极、动态地配置大类资产，同时通过合理的证券选择，在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整大类资产配置比例，同时将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，运用自上而下和自下而上相结合的个股、个券投资策略，在大类资产配置和证券选择两个层面上实现投资组合的双重优化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中债总财富（总值）指数收益率×35%。
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高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金的资产包括风险资产和安全资产，本基金投资策略分为两个层次：一层为基金在风险资产和安全资产两大类资产上的配置策略；另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。
业绩比较基准	2 年期银行定期存款收益率（税前）。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属于证券投资基金中的中低风险品种。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	吴玉婷
	联系电话	010-66228888	021-52629999-212052
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	015289@cib.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95561
传真		010-66228001	021-62159217

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-16,320,978.59
本期利润	-21,431,168.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0806
本期基金份额净值增长率	-8.83%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	-0.0509
期末基金资产净值	207,203,493.52
期末基金份额净值	0.9491

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。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 日	2017 年	2016 年
本期已实现收益	63,833,282.31	17,924,519.15	60,954,221.55
本期利润	71,572,485.01	49,349,248.64	21,963,681.44
加权平均基金份额本期利润	0.0206	0.0120	0.0047
本期基金份额净值增长率	2.36%	1.29%	0.40%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 5 月 8 日	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0410	0.0175	0.0042
期末基金资产净值	519,954,318.04	3,757,892,221.24	4,557,324,040.12
期末基金份额净值	1.041	1.017	1.004

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（转型后）

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
过去三个月	-7.96%	1.02%	-7.01%	1.06%	-0.95%	-0.04%
过去六个月	-8.76%	0.76%	-7.81%	0.97%	-0.95%	-0.21%
自基金合同生效起至今	-8.83%	0.67%	-13.10%	0.92%	4.27%	-0.25%

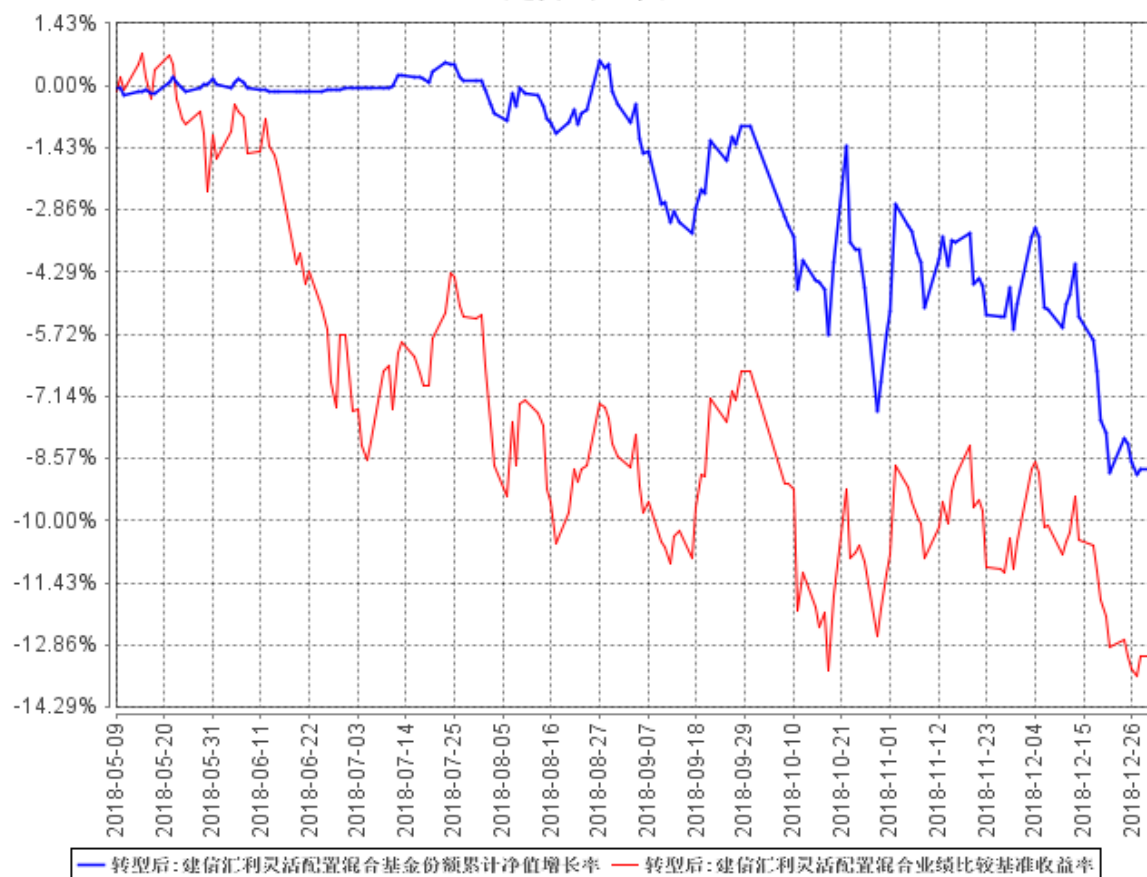
本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中债总财富（总值）指数收益率×35%。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制的，从上海和深圳股票市场中选取的 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。该指数为具有良好的市场代表性、能够反映 A 股市场整体走势的指数。

中债总财富（总值）指数是由中央国债登记结算有限责任公司推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中债总财富（总值）指数为掌握我国债券市场价格波动幅度和变动趋势、测算债券投资回报率水平提供了很好的依据。

3.2.2 自基金转型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

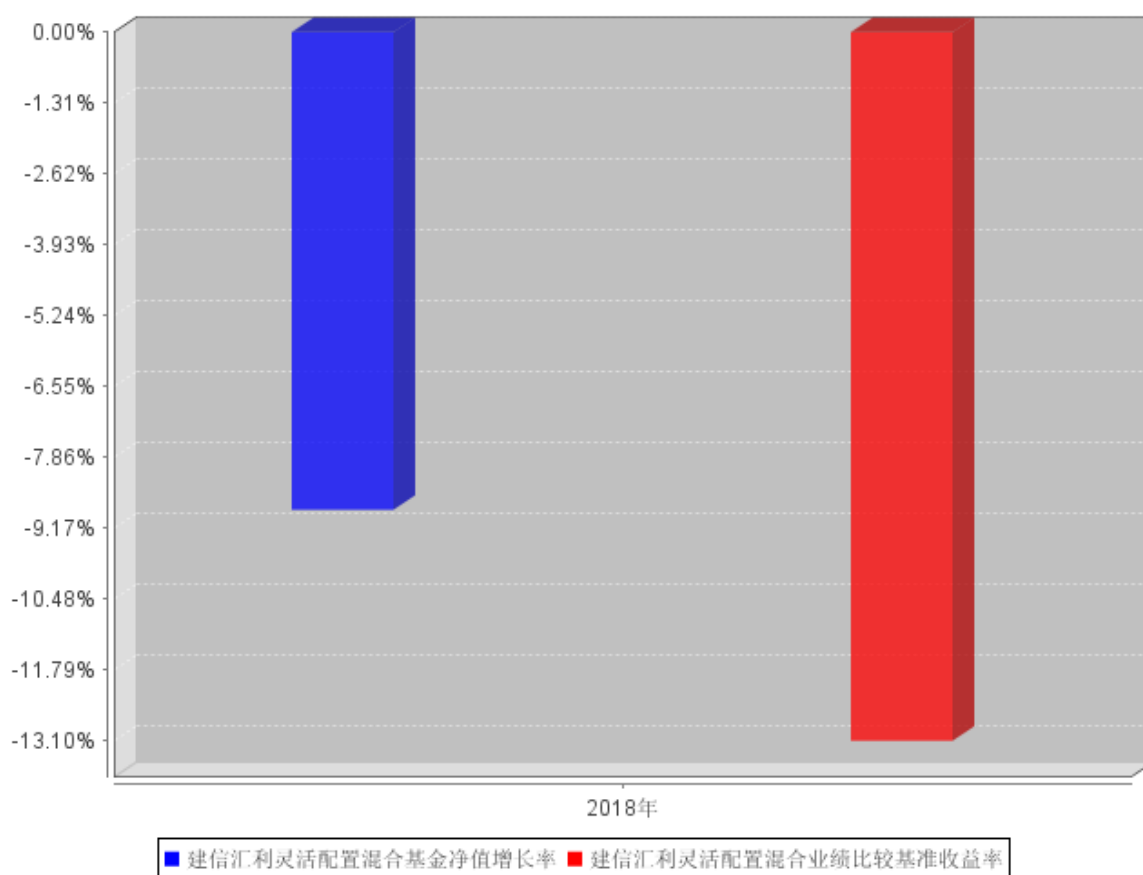
建信汇利灵活配置混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信汇利灵活配置混合自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



本基金于 2018 年 5 月 9 日转型，2018 年净值增长率以实际存续期计算。

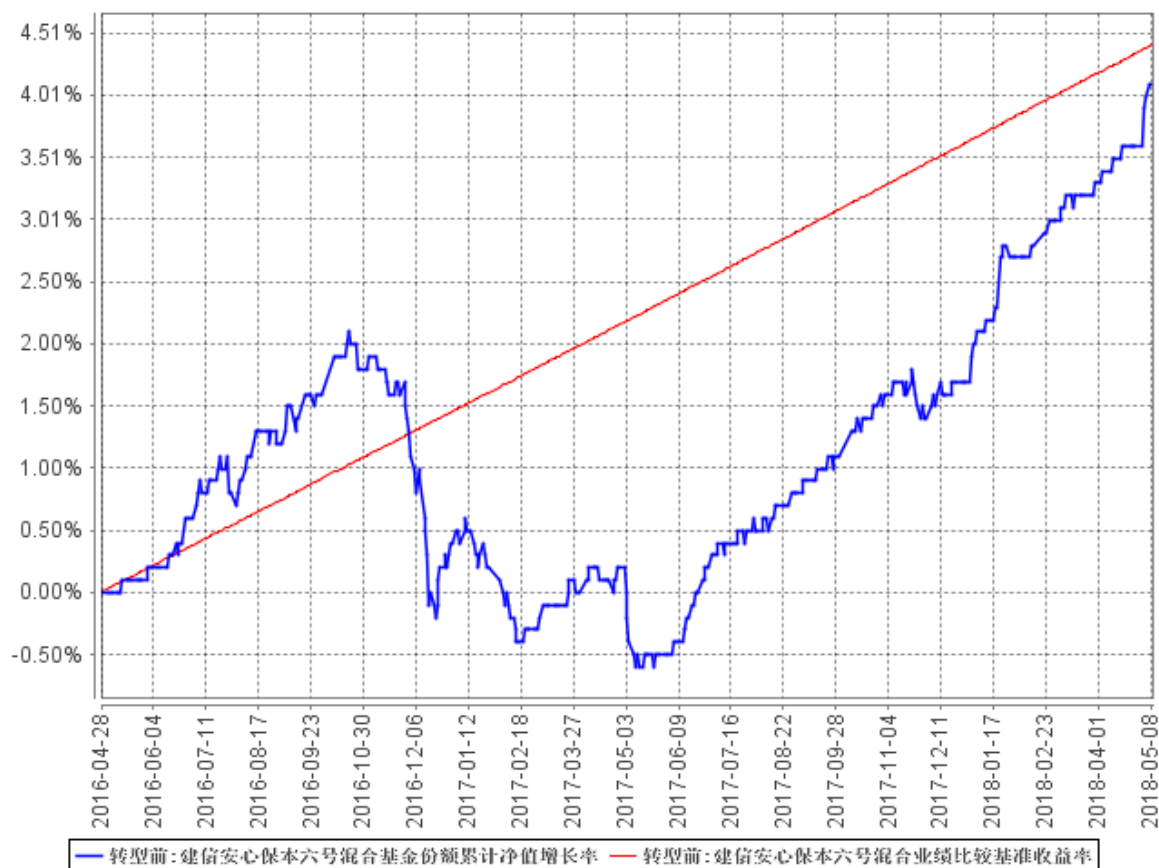
3.2 基金净值表现（转型前）

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
过去一年	2.36%	0.07%	0.74%	0.01%	1.62%	0.06%
自基金合同生效起至今	4.10%	0.08%	4.40%	0.01%	-0.30%	0.07%

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

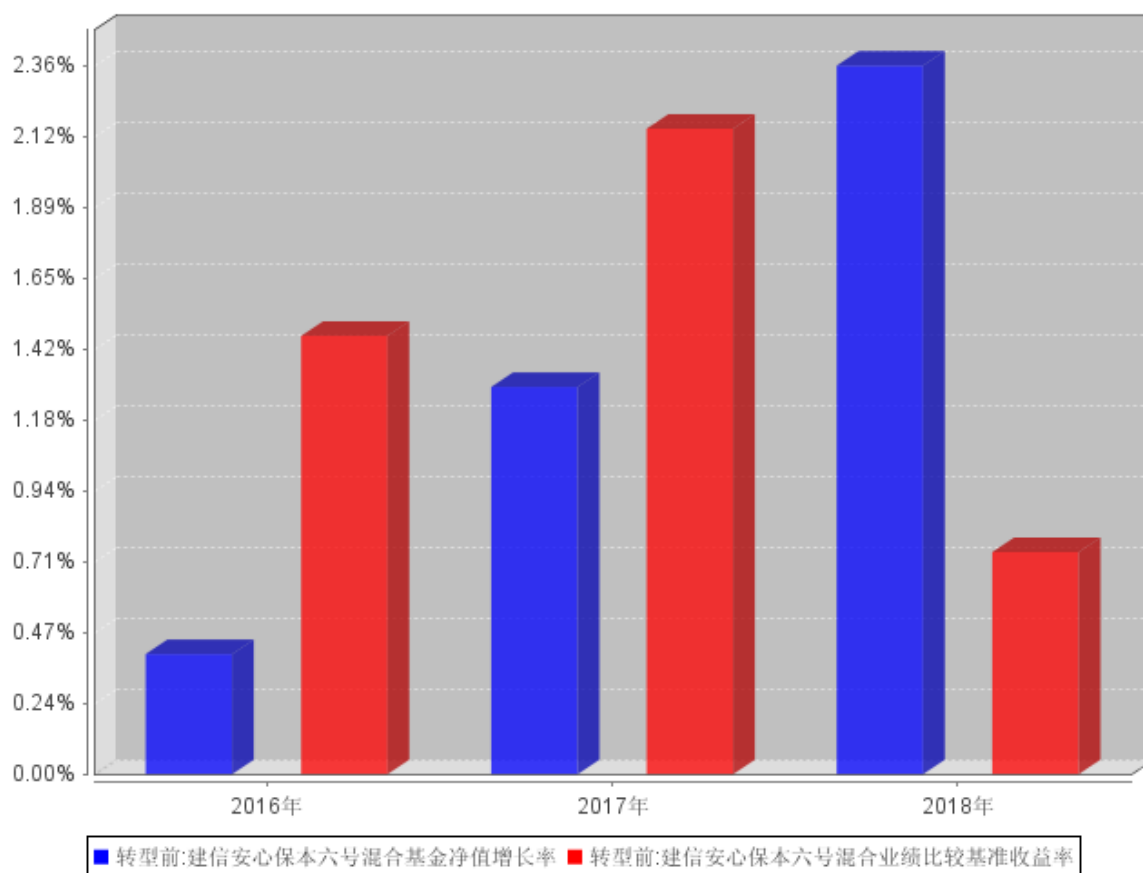
建信安心保本六号混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史
走势对比图



本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信安心保本六号混合自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



本基金合同自 2016 年 4 月 28 日生效，2016 年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

转型前

本基金基金合同自 2016 年 4 月 28 日起生效，基金合同生效以来未发生利润分配。

转型后

本基金自 2018 年 5 月 9 日起转型为非保本基金“建信汇利灵活配置混合型证券投资基金”。转型以来未发生利润分配。

§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、基金运营部、财务管理部、信息技术部、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 2018 年 12 月 31 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、建信安心回报两年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、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、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）基金、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金（LOF）基金、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，共计 104 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 6331.39 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（转型后）

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		
邱宇航	权益投资部总经理助理、本基金的基金经理	2018 年 5 月 9 日	—	10	硕士，权益投资部总经理助理。2007 年 7 月加入本公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、权益投资部总经理助理。2011 年 7 月 11 日至 2014 年 3 月 27 日任建信恒久价值股票型证券投资基金的基金经理；2013 年 6 月 14 日起任建信消费升级混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 5 月 20 日起任建信优化配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 5 月 3 日起任建信安心保本六号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于 2018 年 5 月 9 日起转型为建信汇利灵活配置混合型证券投资基金，邱宇航继续担任该基金的基金经理。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
邱宇航	权益投资部总经理助理、本基金的基金经理	2018 年 5 月 3 日	2018 年 5 月 8 日	11	硕士，权益投资部总经理助理。2007 年 7 月加入本公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、权益投资部总经理助理。2011 年 7 月 11 日至 2014 年 3 月 27 日任建信恒久价值股票型证券投资基金的基金经理；2013 年 6 月 14 日起任建信消费升级

					混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 5 月 20 日起任建信优化配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 5 月 3 日起任建信安心保本六号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于 2018 年 5 月 9 日起转型为建信汇利灵活配置混合型证券投资基金，邱宇航继续担任该基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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 公平交易制度和控制方法

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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》，本基金管理人对过去四个季度不同时间

窗口下（日内、3 日内、5 日内）管理的不同投资组合（包括封闭式基金、开放式基金、资产管理计划等）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。经分析，本报告期内未出现公司管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

4.3.3 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 3 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

2018 年的 A 股市场，除 1 月份阶段性延续了 2017 年结构分化的龙头股行情外，整个全年呈现剧烈的震荡下挫行情；数次小的反弹行情都被随后的更加大幅的下跌所淹没。A 股各个主要指数全面下跌，所有行业均为负收益，餐饮旅游、银行和石油石化行业相对跌幅较少。

2018 年中国经济和 A 股市场同时面临多重挑战。首先，经济运行稳中有变，经济下行压力有所加大，部分企业经营困难较多，长期积累的风险隐患有所暴露；其次，去杠杆的信用紧缩环境对投资者的风险偏好形成明显压制；再次，贸易摩擦使投资者对未来经济增长不确定性的预期增强，从而有动力进一步缩小风险敞口；最后，行业极端事件频发，个股业绩大幅低于预期放大了投资者的担忧。

本基金在 2 季度顺利转型为灵活配置混合型基金。面对复杂的宏观经济环境和国际经济形势，本基金以持有人的利益为根本出发点，初期对基金持有的权益资产积极地进行获利了结，从而有效的规避了市场下跌风险；同时通过回购，投资债券等多种方式积极为组合获取收益。4 季度，随着稳定市场政策的陆续出台，本基金在严控风险的前提下，积极布局了若干优质资产，以期在市场回暖的情况下为持有人带来更多回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-8.83%，波动率 0.67%，业绩比较基准收益率-13.10%，波动率 0.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从 2018 年 4 季度起，领导层对稳定国内经济、就业，提振企业及资本市场信心采取了多重有力举措。直面民营经济在发展中遇到的困难，为民营企业吃了定心丸。重视资本市场作用，将金融定位为国家的核心竞争力。金融去杠杆进入新阶段，提出要深化金融供给侧结构性改革，平衡好稳增长和防风险的关系，精准有效处置重点领域风险，深化金融改革开放，增强金融服务实体经济能力，坚决打好防范化解包括金融风险在内的重大风险攻坚战，推动我国金融业健康发展。此外，中美贸易摩擦出现阶段性缓和，新旧经济动能逐渐转换，科创板有序推进，这些因素都预示着 2019 年的资本市场将步入良性循环的新阶段。

本基金在 2019 年将积极顺应资本市场的新变化，以稳定消费类龙头企业为基础配置，并集中力量投资于具有科技创新属性、代表未来产业发展方向的优秀企业，在企业的迅速成长中为投资者获取更具吸引力的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2018 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司内控合规部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总裁和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施：

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部

门自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备季度监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由内控合规部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司年度监察稽核工作计划，实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发违法违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的原则，秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障持有人的合法权益。

4.7 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、风险管理部和资产核算部门负责人组成。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定，本报告期内本基金未达到进行利润分配的条件，未进行利润分配。

§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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告（转型后）

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了建信汇利灵活配置混合型证券投资基金（原建信安心保本六号混合型证券投资基金，以下简称“建信汇利灵活配置混合基金”）的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。并出具了普华永道中天审字(2019)第 22632 号标准无保留意见的审计报告。投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§6 审计报告（转型前）

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了建信安心保本六号混合型证券投资基金（以下简称“建信安心保本六号混合基金”）的财务报表，包括 2018 年 5 月 8 日（基金合同失效前日）的资产负债表，2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 日（基金合同失效前日）止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。并出具了普华永道中天审字(2019)第 22613 号标准无保留意见的审计报告。投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：建信汇利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款		73,774,147.65
结算备付金		963,524.66
存出保证金		209,933.04
交易性金融资产		131,599,800.08
其中：股票投资		97,364,800.08
基金投资		-
债券投资		34,235,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		1,881,087.98
应收利息		1,216,309.86
应收股利		-
应收申购款		159.68
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		209,644,962.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		66,589.95
应付管理人报酬		273,297.81
应付托管费		45,549.66
应付销售服务费		-
应付交易费用		1,724,031.56
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		332,000.45
负债合计		2,441,469.43
所有者权益：		
实收基金		218,314,046.88
未分配利润		-11,110,553.36
所有者权益合计		207,203,493.52
负债和所有者权益总计		209,644,962.95

1. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9491 元，基金份额总额 218,314,046.88 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：建信汇利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		-16,669,399.72
1. 利息收入		2,987,056.93
其中：存款利息收入		1,522,668.22
债券利息收入		940,759.99
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		523,628.72
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-14,549,877.10
其中：股票投资收益		-12,801,982.62
基金投资收益		-
债券投资收益		-2,510,570.60
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		762,676.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-5,110,189.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）		3,610.16
减：二、费用		4,761,768.58
1. 管理人报酬	7.4.9.2.1	2,636,271.41
2. 托管费	7.4.9.2.2	439,378.49
3. 销售服务费	7.4.9.2.3	-
4. 交易费用		1,387,584.77
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		298,533.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-21,431,168.30
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-21,431,168.30

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信汇利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 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）	499,388,985.77	20,565,332.27	519,954,318.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-21,431,168.30	-21,431,168.30
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）	-281,074,938.89	-10,244,717.33	-291,319,656.22
其中：1. 基金申购款	516,068.52	15,523.91	531,592.43
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-281,591,007.41	-10,260,241.24	-291,851,248.65
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）	218,314,046.88	-11,110,553.36	207,203,493.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张军红</u>	<u>吴曙明</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信汇利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原建信安心保本六号混合型证券投资基金转型而来。根据原建信安心保本六号混合型证券投资基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司发布的《建信安心保本六号混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为建信汇利灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》，生效日为 2018 年 5 月 9 日。原建信安心保本六号混合型证券投资基金转型为非避险策略基金，基金名称相应变更为“建信汇利灵活配置混合型证券投资基金”，建信安心保本六号混合型证券投资基金份额转换为建信汇利灵活配置混合型证券投资基金份额。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2018 年 5 月 9 日起《建信汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《建信汇利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》生效，原《建信安心保本六号混合型证券投资基金基金合同》、《建信安心保本六号混合型证券投资基金托管协议》自同一起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(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(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、地方债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的 0%-95%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例不低于 5%，其中，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，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者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。

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中债总财富(总值)指数收益率×35%。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2019 年 3 月 21 日批准报出。

7.4.2 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<年度报告和半年度报告>》、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》、《建信汇利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 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收

款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产外，本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科目下。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。

对于单项金额重大的应收款项，单独进行减值测试。当存在客观证据表明本基金将无法按应收款项的原有条款收回款项时，根据其预计未来现金流量现值低于其账面价值的差额，计提坏账准备。

对于单项金额非重大的应收款项，与经单独测试后未减值的应收款项一起按信用风险特征划

分为若干组合，根据以前年度与之具有类似信用风险特征的应收账款组合的实际损失率为基础，结合现时情况确定应计提的坏账准备。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金

红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）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，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于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、可交换债券、资产支持

证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	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
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
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.9.1.1 股票交易**

无。

7.4.9.1.2 权证交易

无。

7.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.9.2 关联方报酬**7.4.9.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,636,271.41
其中：支付销售机构的客户维护费	1,051,261.68

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。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	439,378.49

支付基金托管人兴业银行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。

7.4.9.2.3 销售服务费

无。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

7.4.9.4.2 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。

7.4.9.5 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 2018 年 5 月 9 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行-活期存款	73,774,147.65	1,424,605.69

本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按约定利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.10 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.11 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

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 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 97,364,800.08 元，属于第二层次的余额为 34,235,000.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 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 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：建信安心保本六号混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 5 月 8 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 5 月 8 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		577,668,866.02	1,003,393,049.59
结算备付金		61,418,296.58	11,953,510.44
存出保证金		102,037.81	164,726.58
交易性金融资产		117,106,245.83	2,631,027,454.43
其中：股票投资		35,084,445.83	88,323,010.43
基金投资		-	-
债券投资		82,021,800.00	2,542,704,444.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	69,000,000.00
应收证券清算款		33,622,114.93	6,016,960.87
应收利息		2,782,589.97	48,659,334.69
应收股利		-	-
应收申购款		-	494.07
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		792,700,151.14	3,770,215,530.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 5 月 8 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		270,824,877.18	5,983,138.01
应付管理人报酬		231,990.63	3,846,902.02
应付托管费		38,665.10	641,150.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,128,879.91	1,271,228.70
应交税费		125,742.30	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		395,677.98	580,890.36
负债合计		272,745,833.10	12,323,309.43
所有者权益：			
实收基金		499,388,985.77	3,693,312,101.59
未分配利润		20,565,332.27	64,580,119.65
所有者权益合计		519,954,318.04	3,757,892,221.24
负债和所有者权益总计		792,700,151.14	3,770,215,530.67

1. 报告截止日 2018 年 5 月 8 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 1.0410 元，基金份额总额 499,388,985.77 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 日(基金合同失效前日)止期间。

7.2 利润表

会计主体：建信安心保本六号混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		78,252,175.99	159,828,409.48
1. 利息收入		56,614,545.08	162,665,544.37
其中：存款利息收入		11,575,859.21	43,008,917.18
债券利息收入		36,786,518.28	101,170,859.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,252,167.59	18,485,768.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,712,418.81	-37,828,906.69
其中：股票投资收益		6,271,250.81	13,278,262.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益		6,441,168.00	-51,628,894.20
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	521,724.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		7,739,202.70	31,424,729.49

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		1,186,009.40	3,567,042.31
减：二、费用		6,679,690.98	110,479,160.84
1. 管理人报酬	7.4.9.2.1	14,785,869.13	49,876,544.08
2. 托管费	7.4.9.2.2	2,464,311.54	8,312,757.32
3. 销售服务费	7.4.9.2.3	-	-
4. 交易费用		168,822.68	1,618,637.80
5. 利息支出		17,305.47	679,016.34
其中：卖出回购金融资产支出		17,305.47	679,016.34
6. 税金及附加		97,158.16	-
7. 其他费用		-10,853,776.00	49,992,205.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		71,572,485.01	49,349,248.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		71,572,485.01	49,349,248.64

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信安心保本六号混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 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）	3,693,312,101.59	64,580,119.65	3,757,892,221.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	71,572,485.01	71,572,485.01
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）	-3,193,923,115.82	-115,587,272.39	-3,309,510,388.21
其中：1. 基金申购款	1,146,966.81	37,784.59	1,184,751.40
2. 基金赎回款	-3,195,070,082.63	-115,625,056.98	-3,310,695,139.61
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）	499,388,985.77	20,565,332.27	519,954,318.04
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	4,538,205,275.40	19,118,764.72	4,557,324,040.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	49,349,248.64	49,349,248.64
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）	-844,893,173.81	-3,887,893.71	-848,781,067.52
其中：1. 基金申购款	514,313.82	4,060.85	518,374.67
2. 基金赎回款	-845,407,487.63	-3,891,954.56	-849,299,442.19
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）	3,693,312,101.59	64,580,119.65	3,757,892,221.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张军红</u>	<u>吴曙明</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信安心保本六号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[2016]484号《关于准予建信安心保本六号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《建信安心保本六号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 4,776,941,905.76 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 524 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信安心保本六号混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,778,343,752.47 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,401,846.71 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《建信安心保本六号混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为建信汇利灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》,本基金于 2018 年 5 月 9 日转型为混合型证券投资基金,基金名称变更为“建信汇利灵活配置混合型证券投资基金”。《建信汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《建信汇利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》自 2018 年 5 月 9 日起生效,原《建信安心保本六号混合型证券投资基金基金合同》、《建信安心保本六号混合型证券投资基金托管协议》自同一日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信安心保本六号混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,本基金可以投资于股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、可交换债券、可分离交易债券、短期融资券、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证及中国证监会允许投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金根据投资组合保险机制对安全资产即固定收益类资产(包括各类债券、银行存款、债券回购等)和风险资产即权益类资产(股票、权证等)的投资比例进行动态调整。本基金的投资组合比例为:权益类资产占基金资产的比例不高于 40%;固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为 2 年期银行定期存款收益率(税前)。

本基金第一个保本周期到期日,如按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额,则基金管理人应补足该差额(即保本赔付差额),并在保本周期到期日后二十个工作日内(含)将该差额支付给基金份额持有人,保证人对此提供不可撤销的连带责任保证。本基金第一个保本周期由北京首创融资担保有限公司作为保证人。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2019 年 3 月 21 日批准报出。

7.4.2 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<年度报告和半年度报告>》、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》、《建信安心保本六号混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

经中国证监会批准,基金管理人建信基金管理有限责任公司将本基金于基金合同失效日转型为建信汇利灵活配置混合型证券投资基金并相应延长存续期至不定期,因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 日(基金合同失效前日)止期间的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 2018 年 5 月 8 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 日(基金合同失效前日)。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图

和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产外，本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科目下。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。

对于单项金额重大的应收款项，单独进行减值测试。当存在客观证据表明本基金将无法按应收款项的原有条款收回款项时，根据其预计未来现金流量现值低于其账面价值的差额，计提坏账准备。

对于单项金额非重大的应收款项，与经单独测试后未减值的应收款项一起按信用风险特征划分为若干组合，根据以前年度与之具有类似信用风险特征的应收账款组合的实际损失率为基础，

结合现时情况确定应计提的坏账准备。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金在保本期内收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）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，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）于2017年11月13日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一

股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 11 月 13 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于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、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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
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
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.9.1.1 股票交易**

无。

7.4.9.1.2 权证交易

无。

7.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.9.2 关联方报酬**7.4.9.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,785,869.13	49,876,544.08
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	2,614,091.53	10,565,311.79

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 1.20%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.20%/ 当年天数。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,464,311.54	8,312,757.32

支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.20%/ 当年天数。

7.4.9.2.3 销售服务费

无。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.9.4.2 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。

7.4.9.5 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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 8 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行：活期存款	577,668,866.02	1,935,372.46	3,393,049.59	526,246.66
兴业银行：定期存款	-	1,641,250.00	150,000,000.00	4,394,652.85

本基金的活期存款和部分定期存款由基金托管人兴业银行保管，按约定利率计息

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.10 期末（2018 年 5 月 8 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌股票

无。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.11 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****(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具**(i) 各层次金融工具公允价值**

于 2018 年 5 月 8 日(基金合同失效前日)，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 35,084,445.83 元，属于第二层次的余额为 82,021,800.00 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 146,978,593.42 元，

第二层次 2,484,048,861.01 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 5 月 8 日(基金合同失效前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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。

§8 投资组合报告（转型后）

8.1 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	97,364,800.08	46.44
	其中：股票	97,364,800.08	46.44
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	34,235,000.00	16.33
	其中：债券	34,235,000.00	16.33
	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	74,737,672.31	35.65
8	其他各项资产	3,307,490.56	1.58
9	合计	209,644,962.95	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	58,656,258.04	28.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	651,654.00	0.31
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,583,998.00	1.73
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	18,712,203.74	9.03
J	金融业	4,068,210.00	1.96
K	房地产业	6,256,387.50	3.02
L	租赁和商务服务业	2,335,760.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,100,328.80	1.50
S	综合	-	-
	合计	97,364,800.08	46.99

以上行业分类以 2018 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

8.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	11,602	6,845,296.02	3.30
2	603288	海天味业	95,457	6,567,441.60	3.17
3	600570	恒生电子	121,300	6,305,174.00	3.04
4	000651	格力电器	146,882	5,242,218.58	2.53
5	000002	万科 A	172,625	4,111,927.50	1.98
6	300122	智飞生物	100,789	3,906,581.64	1.89
7	600276	恒瑞医药	73,100	3,856,025.00	1.86
8	600600	青岛啤酒	104,300	3,635,898.00	1.75
9	601933	永辉超市	455,400	3,583,998.00	1.73
10	600436	片仔癀	39,000	3,379,350.00	1.63

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.3 报告期内股票投资组合的重大变动**8.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	20,404,364.35	9.85
2	000001	平安银行	19,460,317.00	9.39
3	600036	招商银行	17,258,828.00	8.33
4	600519	贵州茅台	16,835,840.00	8.13
5	000002	万科 A	15,027,895.67	7.25
6	601398	工商银行	14,122,520.89	6.82
7	601318	中国平安	13,792,058.08	6.66
8	600887	伊利股份	12,770,788.75	6.16
9	601601	中国太保	11,533,754.00	5.57
10	603288	海天味业	11,194,602.00	5.40
11	601288	农业银行	11,147,110.00	5.38
12	600276	恒瑞医药	10,901,957.50	5.26

13	002456	欧菲科技	10,808,024.00	5.22
14	603986	兆易创新	9,804,721.00	4.73
15	002415	海康威视	9,671,786.48	4.67
16	001979	招商蛇口	9,148,809.00	4.42
17	601933	永辉超市	8,935,141.00	4.31
18	300122	智飞生物	8,027,140.05	3.87
19	603019	中科曙光	7,639,128.00	3.69
20	002475	立讯精密	7,531,160.95	3.63
21	600570	恒生电子	6,897,301.56	3.33
22	000783	长江证券	6,660,941.00	3.21
23	300059	东方财富	6,279,311.00	3.03
24	603899	晨光文具	6,218,231.00	3.00
25	601888	中国国旅	6,095,303.14	2.94
26	300010	立思辰	5,777,006.00	2.79
27	002343	慈文传媒	5,737,725.00	2.77
28	600030	中信证券	5,567,000.00	2.69
29	603228	景旺电子	5,380,422.00	2.60
30	600600	青岛啤酒	5,050,966.00	2.44
31	000792	盐湖股份	5,007,227.00	2.42
32	600028	中国石化	4,824,962.00	2.33
33	601919	中远海控	4,790,880.97	2.31
34	600436	片仔癀	4,512,651.06	2.18
35	300271	华宇软件	4,457,713.24	2.15
36	600362	江西铜业	4,377,581.00	2.11
37	002262	恩华药业	4,362,112.00	2.11
38	000977	浪潮信息	4,334,783.00	2.09
39	600309	万华化学	4,228,462.00	2.04

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。

8.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300232	洲明科技	20,084,126.32	9.69
2	600036	招商银行	16,945,882.38	8.18
3	000001	平安银行	16,669,930.70	8.05

4	002327	富安娜	14,360,660.00	6.93
5	601398	工商银行	14,282,692.05	6.89
6	000651	格力电器	13,734,671.00	6.63
7	000002	万科 A	11,311,759.00	5.46
8	601318	中国平安	11,218,734.07	5.41
9	601601	中国太保	11,047,704.14	5.33
10	601288	农业银行	11,045,470.00	5.33
11	600887	伊利股份	9,658,909.99	4.66
12	002456	欧菲科技	9,111,660.52	4.40
13	002415	海康威视	8,719,062.04	4.21
14	600519	贵州茅台	8,386,359.10	4.05
15	603986	兆易创新	8,063,579.20	3.89
16	001979	招商蛇口	6,816,890.00	3.29
17	002475	立讯精密	6,707,540.27	3.24
18	000783	长江证券	6,502,132.00	3.14
19	600276	恒瑞医药	6,490,224.34	3.13
20	300059	东方财富	6,082,213.88	2.94
21	600030	中信证券	5,591,800.00	2.70
22	603228	景旺电子	5,274,246.00	2.55
23	002343	慈文传媒	5,113,002.60	2.47
24	601933	永辉超市	5,000,305.38	2.41
25	603288	海天味业	4,983,995.61	2.41
26	600362	江西铜业	4,440,039.00	2.14
27	601919	中远海控	4,333,109.00	2.09
28	002262	恩华药业	4,188,228.00	2.02
29	600028	中国石化	4,182,690.00	2.02

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。

8.3.3 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	514,406,973.26
卖出股票收入（成交）总额	431,800,646.08

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。

8.4 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	34,235,000.00	16.52
	其中：政策性金融债	34,235,000.00	16.52
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	34,235,000.00	16.52

8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	180404	18 农发 04	300,000	30,075,000.00	14.51
2	130205	13 国开 05	40,000	4,160,000.00	2.01

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未投资于国债期货。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未披露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。

8.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	209,933.04
2	应收证券清算款	1,881,087.98
3	应收股利	—
4	应收利息	1,216,309.86
5	应收申购款	159.68
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,307,490.56

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

8.11.6 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 投资组合报告（转型前）

8.1 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	35,084,445.83	4.43
	其中：股票	35,084,445.83	4.43
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	82,021,800.00	10.35
	其中：债券	82,021,800.00	10.35
	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	639,087,162.60	80.62
8	其他资产	36,506,742.71	4.61
9	合计	792,700,151.14	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	35,084,445.83	6.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
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	—	—
J	金融业	—	—

K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	35,084,445.83	6.75

以上行业分类以 2018 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	300232	洲明科技	1,299,731	22,004,445.83	4.23
2	002327	富安娜	1,200,000	13,080,000.00	2.52

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002327	富安娜	13,374,600.00	0.36
2	002925	盈趣科技	68,670.00	0.00
3	300733	西菱动力	21,839.70	0.00

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。

8.4.2 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	601398	工商银行	27,857,938.28	0.74
2	601633	长城汽车	16,833,385.70	0.45
3	000858	五粮液	16,568,051.67	0.44
4	300498	温氏股份	6,218,955.50	0.17
5	002444	巨星科技	3,003,022.33	0.08
6	002916	深南电路	288,577.04	0.01
7	002925	盈趣科技	248,218.96	0.01
8	002920	德赛西威	204,691.20	0.01
9	300735	光弘科技	109,156.00	0.00
10	002900	哈三联	63,138.72	0.00
11	300733	西菱动力	51,077.09	0.00
12	300684	中石科技	48,255.45	0.00
13	002922	伊戈尔	42,105.90	0.00
14	002915	中欣氟材	39,472.30	0.00
15	300730	科创信息	38,780.20	0.00
16	002863	今飞凯达	37,445.85	0.00
17	002919	名臣健康	34,379.83	0.00
18	002475	立讯精密	7,172.88	0.00
19	600315	上海家化	2,540.04	0.00
20	601211	国泰君安	1,190.00	0.00

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。

8.4.3 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	13,465,109.70
卖出股票收入（成交）总额	71,697,554.94

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。

8.5 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	82,021,800.00	15.77
	其中：政策性金融债	82,021,800.00	15.77

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	82,021,800.00	15.77

8.6 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160404	16 农发 04	400,000	38,196,000.00	7.35
2	180404	18 农发 04	300,000	30,096,000.00	5.79
3	150221	15 国开 21	100,000	9,713,000.00	1.87
4	130205	13 国开 05	40,000	4,016,800.00	0.77

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未投资于国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未披露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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	102,037.81
2	应收证券清算款	33,622,114.93
3	应收股利	—
4	应收利息	2,782,589.97
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	36,506,742.71

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 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
3,479	62,751.95	803.93	0.00%	218,313,242.95	100.00%

9.2 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	19.87	0.0000%

9.3 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的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、该只基金的基金经理未持有该只基金。

§9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 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
5,927	84,256.62	198,904.73	0.04%	499,190,081.04	99.96%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.3 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的情况

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。

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	499,388,985.77
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	516,068.52
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	281,591,007.41
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	218,314,046.88

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	4,778,343,752.47
本报告期期初基金份额总额	3,693,312,101.59
本报告期期间基金总申购份额	1,146,966.81
减:本报告期期间基金总赎回份额	3,195,070,082.63
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	499,388,985.77

上述总申购份额含转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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 2018 年第一次临时股东会和第五届董事会第一次会议审议通过，自 2018 年 4 月 18 日起，许会斌先生不再担任本公司董事长（法定代表人），由孙志晨先生担任本公司董事长（法定代表人）；孙志晨先生不再担任本公司总裁，由张军红先生担任本公司总裁。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 2018 年 4 月 20 日公告。

自 2019 年 1 月 22 日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为人民币 113,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 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	
华泰证券	2	512,978,367.81	54.21%	469,052.39	53.83%	-
国泰君安	1	377,604,185.70	39.91%	351,665.67	40.36%	-
中信证券	1	55,625,065.83	5.88%	50,692.95	5.82%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

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、本报告期新增华泰证券两个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金公用交易单元。

11.7.2 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
华泰证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	2,050,000,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 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	
中泰证券	1	44,695,054.02	52.54%	40,731.13	52.00%	-
国泰君安	1	40,377,100.92	47.46%	37,603.43	48.00%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

11.7.2 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	成交金额	占当期权证

		例		成交总额 的比例		成交总额 的比例
中泰证券	32,279,199.42	37.18%	24,596,000,000.00	100.00%	-	-
国泰君安	161,656.00	0.19%	-	-	-	-
中信证券	54,377,762.57	62.63%	-	-	-	-

11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 9 月 28 日
2	关于增加南京苏宁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	2018 年 9 月 18 日
3	建信基金管理有限责任公司关于增加上海挖财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	2018 年 9 月 12 日
4	关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 6 月 30 日
5	建信汇利灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 5 月 9 日

11.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于建信安心保本六号混合型证券投资基金基金经理变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 5 月 7 日
2	建信安心保本六号混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为建信汇利灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的第二次提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 4 月 25 日
3	建信安心保本六号混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为建信汇利灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的第一次提示	指定报刊和/或公司网站	2018 年 4 月 20 日
4	建信安心保本六号混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为建信汇利灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 4 月 17 日
5	关于修订建信安心保本六号混合型证券投资基金基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 4 月 17 日
6	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交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 3 月 31 日
7	关于建信基金管理有限责任公司旗下部分证券投资基金修改基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 3 月 23 日
8	关于公司旗下部分开放式基金参加光大银行电子渠道基金申购及定投费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2018 年 3 月 20 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2018 年 01 月 01 日 - 2018 年 05 月 02 日	1,400,062,000.00	0.00	1,400,062,000.00	0.00	0.00%

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。

建信基金管理有限责任公司

2019 年 3 月 26 日