

# 建信双利策略主题分级股票型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                 |              |                |
|-----------------|-----------------|--------------|----------------|
| 基金简称            | 建信双利分级股票        |              |                |
| 场内简称            | 建信双利            |              |                |
| 基金主代码           | 165310          |              |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式          |              |                |
| 基金合同生效日         | 2011 年 5 月 6 日  |              |                |
| 基金管理人           | 建信基金管理有限责任公司    |              |                |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司      |              |                |
| 报告期末基金份额总额      | 75,878,508.33 份 |              |                |
| 基金合同存续期         | 不定期             |              |                |
| 基金份额上市的证券交易所    | 深圳证券交易所         |              |                |
| 上市日期            | 2011 年 6 月 8 日  |              |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 建信双利分级股票        | 建信稳健         | 建信进取           |
| 下属分级基金的场内简称     | 建信双利            | 建信稳健         | 建信进取           |
| 下属分级基金的交易代码     | 165310          | 150036       | 150037         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 73,509,296.33 份 | 947,684.00 份 | 1,421,528.00 份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。               |
| 投资策略 | 本基金将通过自上而下的方式，通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题，在前述主题筛选和主题配置的基础上， |

|               |  |  |   |
|---------------|--|--|---|
|               | 本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。  |  |   |
| 业绩比较基准        | 本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。  |  |   |
| 风险收益特征        | 本基金属于采用高仓位操作的股票型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。<br>从本基金所分离的两类基金份额来看，建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额；建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征，其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。 |  |   |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 本基金属于采用高仓位操作的股票型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。   | 建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额。 | 建信进取份额将表现出高风险、高预期收益的显著特征，其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                     | 基金托管人                  |
|-------------|------|---------------------------|------------------------|
| 名称          |      | 建信基金管理有限责任公司              | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 吴曙明                       | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 010-66228888              | 0755—83199084          |
|             | 电子邮箱 | xinxipilu@ccbfund.cn      | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 400-81-95533 010-66228000 | 95555                  |
| 传真          |      | 010-66228001              | 0755—83195201          |

### 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的住所  |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年1月1日-2019年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 10,720,147.97             |
| 本期利润          | 22,583,364.54             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2876                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 22.62%                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日)          |

|              |                |
|--------------|----------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6624         |
| 期末基金资产净值     | 114,862,835.33 |
| 期末基金份额净值     | 1.514          |

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

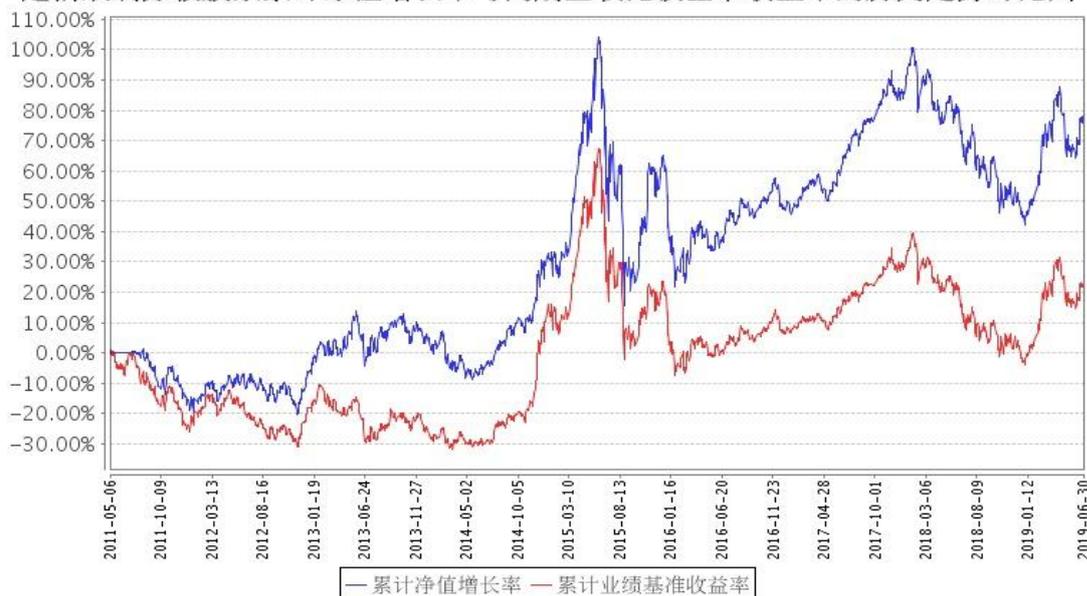
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 6.32%    | 1.16%       | 5.13%      | 1.10%         | 1.19%  | 0.06%  |
| 过去三个月      | 0.53%    | 1.46%       | -1.11%     | 1.45%         | 1.64%  | 0.01%  |
| 过去六个月      | 22.62%   | 1.44%       | 25.65%     | 1.47%         | -3.03% | -0.03% |
| 过去一年       | 5.48%    | 1.41%       | 8.66%      | 1.45%         | -3.18% | -0.04% |
| 过去三年       | 25.93%   | 1.02%       | 20.45%     | 1.05%         | 5.48%  | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 77.75%   | 1.43%       | 22.60%     | 1.40%         | 55.15% | 0.03%  |

注：本基金投资业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。其中：沪深 300 指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准，商业银行活期存款利率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，它是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。指数样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值。成份股为市场中市场代表性好，流动性高，交易活跃的主流投资

股票，能够反映市场主流投资的收益情况。

### 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

建信双利分级股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本报告期,本基金投资组合比例符合基金合同要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金会计部、注册登记部、财务管理部、金融科技部、投资风险管理部和内控合规部,以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心,并在上海设立了子公司—建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观,恪守“持有人利益重于

泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家 资产管理行业的领跑者”。

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                     | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|------------------------|-----------------|------|--------|---|
|     |                        | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 梁洪昀 | 金融工程及指数投资部总经理，本基金的基金经理 | 2015 年 3 月 25 日 | -    | 16     | 梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师 (CFA)，博士。2003 年 1 月至 2005 年 8 月就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005 年 8 月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、高级研究员、 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。</p> <p>2009 年 11 月 5 日起任建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理; 2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理; 2011 年 9 月 8 日至 2016 年 7 月 20 日任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金 (ETF) 及其联接基金的基金经理; 2012 年 3 月 16 日起任建信深证 100 指数增强型证券投资基金的基金经理; 2015 年 3 月 25 日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理; 2015 年 7 月 31 日至 2018 年 7 月 31 日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理; 2015 年 8 月 6 日至 2016 年 10 月 25 日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理; 2018 年 2 月 6 日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 2018 年 2 月 7 日起任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理; 2018 年 4 月 19 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 2018 年 5 月 16 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理; 2018 年 6 月 13 日起任建信创业板交</p> |
|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |                            |
|--|--|--|--|--|----------------------------|
|  |  |  |  |  | 易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|----------------------------|

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期初期，投资者一扫之前的悲观预期，转向全面乐观，市场因而发生了急剧变化，短期内出现了大幅反弹。在这个过程中，投资组合超额收益出现回撤，主要缘于对市场上涨过程中高弹性品种的配置有所不足，组合整体仍偏向防御。

二季度开始，受国际经济政治因素影响，A 股市场冲高回落，出现了较明显的波动，管理人对组合构建策略进行了适当的调整，在一定程度上修复了超额收益。

在整个报告期内，基金按照基金合同规定，保持了 90% 以上的仓位，并进行了比较均衡的行业配置和适度分散的持股，同时辅以新股申购等其他策略，努力增厚投资收益。管理人始终积极吸收投研团队的研究成果，通过更为精细的个股选择策略，努力提升基金收益水平。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 22.62%，波动率 1.44%，业绩比较基准收益率 25.65%，波动率 1.47%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年下半年，国际贸易摩擦、防控风险、提振经济等多种因素交织在一起，将对市场产生复杂而深刻的影响。市场在 2019 年一季度大幅反弹，基本修复了 2018 年因过度悲观预期而引发的大幅下跌。二季度市场冲高回落，但随后缓慢回升。投资者逐渐意识到，无论贸易摩擦的解决，还是保持宏观经济持续稳健增长，都是长期、艰苦的过程。在经历了一年多以来的大起大落后，预计股票市场总体波动将趋于缓和，投资者会更加看重个股基本面表现，而不是过多地被情绪所主导。此外，下半年仍需要关注一些重要经济政治事件对于市场发展变化趋势的影响。

本基金属于高仓位、主动投资的股票型基金，基金管理人将继续保持对各种影响市场发展变化的因素的高度关注，努力将投研团队的研究成果转化为投资决策，以股票选择为主，持续不断地优化组合配置，力争给持有人带来理想收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、投资风险管理部和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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，本基金不进行收益分配，也不单独对建信稳健份额与建信进取份额进行收益分配。

### § 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|------------|-----|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |     |                        |                          |
| 银行存款       |     | 9,682,045.28           | 8,035,916.62             |
| 结算备付金      |     | 493,698.25             | 369,596.44               |
| 存出保证金      |     | 35,126.66              | 25,750.02                |
| 交易性金融资产    |     | 107,057,760.25         | 93,423,954.32            |
| 其中：股票投资    |     | 107,057,760.25         | 93,423,954.32            |
| 基金投资       |     | -                      | -                        |
| 债券投资       |     | -                      | -                        |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产支持证券投资        |            | -                         | -                           |
| 贵金属投资           |            | -                         | -                           |
| 衍生金融资产          |            | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        |            | -                         | -                           |
| 应收证券清算款         |            | -                         | 3,985,150.24                |
| 应收利息            |            | 2,116.79                  | 1,979.82                    |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | 5,178.34                  | 15,763.79                   |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            |            | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 117,275,925.57            | 105,858,111.25              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2018年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                           |                             |
| 短期借款            |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                         | -                           |
| 衍生金融负债          |            | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                         | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 10,498.82                 | 3,273,831.16                |
| 应付赎回款           |            | 64,414.41                 | 161,671.34                  |
| 应付管理人报酬         |            | 135,805.92                | 131,711.57                  |
| 应付托管费           |            | 22,634.31                 | 21,951.95                   |
| 应付销售服务费         |            | -                         | -                           |
| 应付交易费用          |            | 1,935,859.70              | 1,571,009.15                |
| 应交税费            |            | -                         | -                           |
| 应付利息            |            | -                         | -                           |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            |            | 243,877.08                | 340,290.03                  |
| 负债合计            |            | 2,413,090.24              | 5,500,465.20                |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            |            | 64,601,962.20             | 69,176,542.06               |
| 未分配利润           |            | 50,260,873.13             | 31,181,103.99               |
| 所有者权益合计         |            | 114,862,835.33            | 100,357,646.05              |
| 负债和所有者权益总计      |            | 117,275,925.57            | 105,858,111.25              |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 75,878,508.33 份，其中建信双利分级股票基金份额总额为 73,509,296.33 份，基金份额净值 1.514 元；建信稳健基金份额总额为 947,684.00 份，基金份额净值 1.025 元；建信进取基金份额总额为 1,421,528.00 份，基金份额净值 1.840 元。

## 6.2 利润表

会计主体：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号       | 本期                                 | 上年度可比期间                            |
|------------------------|-----------|------------------------------------|------------------------------------|
|                        |           | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年<br>6 月 30 日 | 2018 年 1 月 1 日至 2018<br>年 6 月 30 日 |
| 一、收入                   |           | 25,091,962.67                      | -12,014,384.00                     |
| 1. 利息收入                |           | 38,296.85                          | 51,505.41                          |
| 其中：存款利息收入              |           | 38,296.85                          | 51,505.41                          |
| 债券利息收入                 |           | -                                  | -                                  |
| 资产支持证券利息收入             |           | -                                  | -                                  |
| 买入返售金融资产收入             |           | -                                  | -                                  |
| 其他利息收入                 |           | -                                  | -                                  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |           | 13,182,249.27                      | 2,454,488.29                       |
| 其中：股票投资收益              |           | 12,099,695.61                      | 735,971.35                         |
| 基金投资收益                 |           | -                                  | -                                  |
| 债券投资收益                 |           | -                                  | -                                  |
| 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                   |           | 1,082,553.66                       | 1,718,516.94                       |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） |           | 11,863,216.57                      | -14,530,407.29                     |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |           | -                                  | -                                  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     |           | 8,199.98                           | 10,029.59                          |
| 减：二、费用                 |           | 2,508,598.13                       | 2,404,429.95                       |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.8.2.1 | 829,810.62                         | 1,180,007.43                       |
| 2. 托管费                 | 6.4.8.2.2 | 138,301.75                         | 196,667.84                         |
| 3. 销售服务费               | 6.4.8.2.3 | -                                  | -                                  |
| 4. 交易费用                |           | 1,325,471.74                       | 803,163.89                         |
| 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                |           | 215,014.02                         | 224,590.79                         |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |           | 22,583,364.54                      | -14,418,813.95                     |
| 减：所得税费用                |           | -                                  | -                                  |
| 四、净利润（净亏损以“-”          |           | 22,583,364.54                      | -14,418,813.95                     |

|      |  |  |  |
|------|--|--|--|
| 号填列) |  |  |  |
|------|--|--|--|

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日      |                |                |
|--|--|----------------|----------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 69,176,542.06                              | 31,181,103.99  | 100,357,646.05 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -  | 22,583,364.54  | 22,583,364.54  |
| 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)      | -4,574,579.86                              | -3,503,595.40  | -8,078,175.26  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 2,171,724.08                               | 1,539,917.53   | 3,711,641.61   |
| 2. 基金赎回款                               | -6,746,303.94                              | -5,043,512.93  | -11,789,816.87 |
| 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)                        | 64,601,962.20                              | 50,260,873.13  | 114,862,835.33 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |                |                |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 89,233,632.39                              | 76,654,429.89  | 165,888,062.28 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -  | -14,418,813.95 | -14,418,813.95 |
| 三、本期基金份额                               | -4,864,031.33                              | -4,315,900.44  | -9,179,931.77  |

|  |                |               |                |
|--|----------------|---------------|----------------|
| 额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）             |                |               |                |
| 其中：1. 基金申购款                            | 5,162,915.32   | 4,681,857.77  | 9,844,773.09   |
| 2. 基金赎回款                               | -10,026,946.65 | -8,997,758.21 | -19,024,704.86 |
| 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）                        | 84,369,601.06  | 57,919,715.50 | 142,289,316.56 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

吴曙明

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信双利策略主题分级股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]355号《关于核准建信双利策略主题分级股票型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司(以下简称“建信基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,973,543,800.59 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 5 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,974,508,248.97 份基金份额,其中认购资金利息折合 964,448.38 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额(以下简称“建信双利基金份额”)、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“建信稳健份

额”)及建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额(简称“建信进取份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售建信双利基金份额。投资人场外认购所得的建信双利基金份额,不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的建信双利基金份额,将按 4:6 的基金份额配比自动分离为建信稳健份额和建信进取份额。建信稳健份额和建信进取份额的数量保持 4:6 的比例不变。基金合同生效后,建信双利基金份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回,但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下,建信稳健份额和建信进取份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内建信双利基金份额与建信稳健份额和建信进取份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换,包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 10 份场内建信双利基金份额按照 4:6 的份额配比转换成 4 份建信稳健份额与 6 份建信进取份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 4 份建信稳健份额与 6 份建信进取份额按照 4:6 的基金份额配比转换成 10 份场内建信双利基金份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算:建信双利基金份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数,其中基金份额总数为建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额数量的总和。本基金每 4 份建信稳健份额与每 6 份建信进取份额构成一对份额组合,该份额组合的基金份额参考净值之和等于 10 份建信双利基金份额的基金份额净值之和。建信稳健份额的约定收益率为一年期同期银行定期存款利率+3.5%,建信稳健份额的份额净值每日按该约定年收益率逐日计算,计算出建信稳健份额的基金份额参考净值后,根据建信双利基金份额的基金份额净值与建信稳健份额、建信进取份额之间的基金份额参考净值关系,可以计算出建信进取份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日,本基金将进行基金的定期份额折算:定期份额折算后建信稳健份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元,基金份额折算基准日折算前建信稳健份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为场内建信双利基金份额分配给建信稳健份额持有人。建信双利基金份额持有人持有的每 10 份建信双利基金份额将按 4 份建信稳健份额获得新增建信双利基金份额的分配。持有场外建信双利基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外建信双利基金份额的分配;持有场内建信双利基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内建信双利基金份额的分配。经过上述份额折算后,建信双利基金份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后,建信稳健份额和建信进取份额的份额配比保持 4:6 的比例。建信进取份额不参与定期份额折算,每次定期份额折算不改变建信进取份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上定期份额折算外，当建信双利基金份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时，或当建信进取份额的基金份额参考净值小于或等于 0.200 元时，本基金将以该日后的次一交易日为本基金不定期折算基准日，进行不定期份额折算：份额折算后本基金将确保建信稳健份额和建信进取份额的比例为 4:6，份额折算后建信稳健份额的基金份额参考净值、建信进取份额的基金份额参考净值和建信双利基金份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当建信双利基金份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时，基金份额折算基准日折算前建信双利基金份额的基金份额净值及建信稳健份额、建信进取份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分均将折算为建信双利基金份额分别分配给建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额的持有人。当建信进取份额的基金份额参考净值小于或等于 0.200 元时，建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2011]168 号核准，本基金建信稳健份额 37,344,064.00 份基金份额与建信进取份额 56,016,098.00 份基金份额于 2011 年 6 月 8 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的建信双利基金份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为建信稳健份额和建信进取份额即可上市流通；对于托管在场外的建信双利基金份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为建信稳健份额和建信进取份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括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、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票投资比例范围为基金资产的 90%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的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沪深 300 指数收益率 $\times$ 95% + 商业银行活期存款利率 $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<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》、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业

协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 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。

##### 6.4.7.2 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”）   | 基金销售机构、基金管理人    |
| 建信资本管理有限责任公司           | 基金管理人的子公司       |
| 美国信安金融服务公司             | 基金管理人的股东        |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）     | 基金销售机构、基金托管人    |
| 中国华电集团资本控股有限公司         | 基金管理人的股东        |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金销售机构、基金管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.8.1.2 权证交易

无。

### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年<br>6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 829,810.62                               | 1,180,007.43                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 321,306.49                               | 388,334.16                                    |

注：1、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。

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

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 138,301.75                               | 196,667.84                                    |

注：支付基金托管人招商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。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

无。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

无。

## 6.4.8.5 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018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    |
| 招商银行-活期存款 | 9,682,045.28               | 32,066.60 | 11,916,831.41                   | 47,363.01 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

## 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

注：本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

## 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.9.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |           |        |       |        |          |           |           |    |
|---------------------|------|------------|-----------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日      | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 300788              | 中信出版 | 2019年6月27日 | 2019年7月5日 | 新发未上市  | 14.85 | 14.85  | 1,556    | 23,106.60 | 23,106.60 | -  |
| 601236              | 红塔证券 | 2019年6月26日 | 2019年7月5日 | 新发未上市  | 3.46  | 3.46   | 9,789    | 33,869.94 | 33,869.94 | -  |

## 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.10 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 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 107,000,783.71 元，属于第二层次的余额为 56,976.54 元，无属于第三层次的余额（2018 年 6 月 30 日：第一层次 128,506,658.81 元，第二层次 3,835,820.15 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

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### (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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2018 年 6 月 30 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。

## § 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              | 107,057,760.25 | 91.29         |
|    | 其中：股票             | 107,057,760.25 | 91.29         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -             |
|    | 其中：债券             | -              | -             |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 10,175,743.53  | 8.68          |
| 8  | 其他各项资产            | 42,421.79      | 0.04          |
| 9  | 合计                | 117,275,925.57 | 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         | 1,938,060.00  | 1.69          |
| B  | 采矿业              | 3,639,411.55  | 3.17          |
| C  | 制造业              | 41,936,875.55 | 36.51         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,545,640.00  | 3.09          |
| E  | 建筑业              | 3,393,257.70  | 2.95          |
| F  | 批发和零售业           | 456,183.00    | 0.40          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,918,751.64  | 3.41          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,811,528.00  | 1.58          |
| J  | 金融业              | 38,570,692.36 | 33.58         |
| K  | 房地产业             | 3,688,615.00  | 3.21          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,664,686.85  | 2.32          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 356,391.00    | 0.31          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -             |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 133,770.00     | 0.12  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 708,737.60     | 0.62  |
| S | 综合            | 295,160.00     | 0.26  |
|   | 合计            | 107,057,760.25 | 93.20 |

## 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（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 121,534 | 10,769,127.74 | 9.38         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 5,700   | 5,608,800.00  | 4.88         |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 225,792 | 4,129,735.68  | 3.60         |
| 4  | 600030 | 中信证券 | 170,300 | 4,054,843.00  | 3.53         |
| 5  | 000776 | 广发证券 | 200,500 | 2,754,870.00  | 2.40         |
| 6  | 601211 | 国泰君安 | 140,240 | 2,573,404.00  | 2.24         |
| 7  | 600606 | 绿地控股 | 369,900 | 2,526,417.00  | 2.20         |
| 8  | 601857 | 中国石油 | 354,100 | 2,436,208.00  | 2.12         |
| 9  | 601888 | 中国国旅 | 26,309  | 2,332,292.85  | 2.03         |
| 10 | 000858 | 五粮液  | 19,600  | 2,311,820.00  | 2.01         |

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半年度报告正文

## 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  | 600519 | 贵州茅台 | 8,200,983.00 | 8.17           |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 8,045,420.51 | 8.02           |
| 3  | 600887 | 伊利股份 | 6,810,254.89 | 6.79           |
| 4  | 600000 | 浦发银行 | 6,512,563.00 | 6.49           |
| 5  | 000776 | 广发证券 | 6,098,580.00 | 6.08           |
| 6  | 601601 | 中国太保 | 5,900,094.00 | 5.88           |
| 7  | 000002 | 万科A  | 5,582,153.00 | 5.56           |
| 8  | 601318 | 中国平安 | 4,825,769.00 | 4.81           |
| 9  | 601766 | 中国中车 | 4,787,001.56 | 4.77           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 10 | 600030 | 中信证券 | 4,659,433.05 | 4.64 |
| 11 | 601211 | 国泰君安 | 4,549,960.55 | 4.53 |
| 12 | 000651 | 格力电器 | 4,270,622.29 | 4.26 |
| 13 | 601668 | 中国建筑 | 4,201,365.00 | 4.19 |
| 14 | 601390 | 中国中铁 | 4,080,290.00 | 4.07 |
| 15 | 600481 | 双良节能 | 4,044,191.16 | 4.03 |
| 16 | 601186 | 中国铁建 | 3,976,289.70 | 3.96 |
| 17 | 601398 | 工商银行 | 3,966,372.99 | 3.95 |
| 18 | 600837 | 海通证券 | 3,800,663.70 | 3.79 |
| 19 | 600660 | 福耀玻璃 | 3,738,761.00 | 3.73 |
| 20 | 601888 | 中国国旅 | 3,732,169.63 | 3.72 |
| 21 | 601857 | 中国石油 | 3,700,202.00 | 3.69 |
| 22 | 002415 | 海康威视 | 3,642,568.40 | 3.63 |
| 23 | 600606 | 绿地控股 | 3,619,565.00 | 3.61 |
| 24 | 000166 | 申万宏源 | 3,532,594.42 | 3.52 |
| 25 | 601288 | 农业银行 | 3,485,399.67 | 3.47 |
| 26 | 600585 | 海螺水泥 | 3,460,042.00 | 3.45 |
| 27 | 600061 | 国投资本 | 3,454,281.96 | 3.44 |
| 28 | 603288 | 海天味业 | 3,431,519.88 | 3.42 |
| 29 | 600016 | 民生银行 | 3,338,184.00 | 3.33 |
| 30 | 601818 | 光大银行 | 3,335,597.00 | 3.32 |
| 31 | 601111 | 中国国航 | 3,280,060.00 | 3.27 |
| 32 | 600886 | 国投电力 | 3,164,604.00 | 3.15 |
| 33 | 002311 | 海大集团 | 3,153,022.60 | 3.14 |
| 34 | 600863 | 内蒙华电 | 3,086,173.00 | 3.08 |
| 35 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,045,238.40 | 3.03 |
| 36 | 601628 | 中国人寿 | 3,006,223.68 | 3.00 |
| 37 | 000001 | 平安银行 | 2,990,180.00 | 2.98 |
| 38 | 600104 | 上汽集团 | 2,976,900.00 | 2.97 |
| 39 | 600029 | 南方航空 | 2,846,877.00 | 2.84 |
| 40 | 601588 | 北辰实业 | 2,410,310.00 | 2.40 |
| 41 | 300276 | 三丰智能 | 2,385,360.00 | 2.38 |
| 42 | 600999 | 招商证券 | 2,309,399.00 | 2.30 |
| 43 | 601158 | 重庆水务 | 2,305,061.98 | 2.30 |
| 44 | 600269 | 赣粤高速 | 2,282,345.07 | 2.27 |
| 45 | 600161 | 天坛生物 | 2,275,936.08 | 2.27 |
| 46 | 601018 | 宁波港  | 2,269,405.00 | 2.26 |
| 47 | 002027 | 分众传媒 | 2,249,848.00 | 2.24 |
| 48 | 002475 | 立讯精密 | 2,218,778.57 | 2.21 |
| 49 | 600028 | 中国石化 | 2,127,268.70 | 2.12 |
| 50 | 300088 | 长信科技 | 2,102,481.00 | 2.09 |
| 51 | 601166 | 兴业银行 | 2,097,744.00 | 2.09 |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 52 | 600588 | 用友网络  | 2,069,602.40 | 2.06 |
| 53 | 000423 | 东阿阿胶  | 2,050,872.00 | 2.04 |
| 54 | 000418 | 小天鹅 A | 2,044,015.00 | 2.04 |
| 55 | 601800 | 中国交建  | 2,017,924.00 | 2.01 |

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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  | 600000 | 浦发银行 | 8,896,639.00 | 8.86           |
| 2  | 000166 | 申万宏源 | 7,650,317.82 | 7.62           |
| 3  | 000333 | 美的集团 | 7,629,199.36 | 7.60           |
| 4  | 601601 | 中国太保 | 6,674,516.28 | 6.65           |
| 5  | 601288 | 农业银行 | 6,124,473.00 | 6.10           |
| 6  | 600887 | 伊利股份 | 5,807,970.00 | 5.79           |
| 7  | 601390 | 中国中铁 | 5,566,544.00 | 5.55           |
| 8  | 600660 | 福耀玻璃 | 5,554,836.88 | 5.54           |
| 9  | 601398 | 工商银行 | 5,398,112.56 | 5.38           |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 5,231,633.00 | 5.21           |
| 11 | 000002 | 万科 A | 5,182,216.00 | 5.16           |
| 12 | 000651 | 格力电器 | 4,980,524.00 | 4.96           |
| 13 | 601988 | 中国银行 | 4,774,668.00 | 4.76           |
| 14 | 601766 | 中国中车 | 4,733,521.74 | 4.72           |
| 15 | 600519 | 贵州茅台 | 4,535,203.00 | 4.52           |
| 16 | 600886 | 国投电力 | 4,470,728.31 | 4.45           |
| 17 | 600481 | 双良节能 | 4,175,510.75 | 4.16           |
| 18 | 601166 | 兴业银行 | 3,821,694.92 | 3.81           |
| 19 | 002415 | 海康威视 | 3,796,560.24 | 3.78           |
| 20 | 002304 | 洋河股份 | 3,682,519.00 | 3.67           |
| 21 | 601186 | 中国铁建 | 3,666,450.00 | 3.65           |
| 22 | 603288 | 海天味业 | 3,512,517.77 | 3.50           |
| 23 | 601857 | 中国石油 | 3,505,528.00 | 3.49           |
| 24 | 000001 | 平安银行 | 3,447,238.92 | 3.43           |
| 25 | 601018 | 宁波港  | 3,396,673.00 | 3.38           |
| 26 | 002311 | 海大集团 | 3,386,475.78 | 3.37           |
| 27 | 601588 | 北辰实业 | 3,368,353.00 | 3.36           |
| 28 | 601818 | 光大银行 | 3,336,734.00 | 3.32           |
| 29 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,318,987.00 | 3.31           |
| 30 | 000776 | 广发证券 | 3,257,068.00 | 3.25           |
| 31 | 600585 | 海螺水泥 | 3,241,796.00 | 3.23           |
| 32 | 600863 | 内蒙华电 | 3,226,156.00 | 3.21           |
| 33 | 000656 | 金科股份 | 3,041,382.00 | 3.03           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 34 | 601888 | 中国国旅 | 3,002,400.00 | 2.99 |
| 35 | 600029 | 南方航空 | 2,998,499.00 | 2.99 |
| 36 | 600104 | 上汽集团 | 2,980,941.34 | 2.97 |
| 37 | 601607 | 上海医药 | 2,840,372.00 | 2.83 |
| 38 | 300276 | 三丰智能 | 2,823,752.00 | 2.81 |
| 39 | 601111 | 中国国航 | 2,816,706.00 | 2.81 |
| 40 | 601668 | 中国建筑 | 2,803,370.00 | 2.79 |
| 41 | 002475 | 立讯精密 | 2,788,473.98 | 2.78 |
| 42 | 600061 | 国投资本 | 2,782,788.00 | 2.77 |
| 43 | 300413 | 芒果超媒 | 2,633,925.00 | 2.62 |
| 44 | 600161 | 天坛生物 | 2,343,789.60 | 2.34 |
| 45 | 603609 | 禾丰牧业 | 2,315,461.77 | 2.31 |
| 46 | 002027 | 分众传媒 | 2,296,868.00 | 2.29 |
| 47 | 600837 | 海通证券 | 2,219,563.00 | 2.21 |
| 48 | 601669 | 中国电建 | 2,210,169.00 | 2.20 |
| 49 | 601088 | 中国神华 | 2,192,681.00 | 2.18 |
| 50 | 000418 | 小天鹅A | 2,142,486.84 | 2.13 |
| 51 | 600028 | 中国石化 | 2,108,431.00 | 2.10 |
| 52 | 600682 | 南京新百 | 2,097,017.00 | 2.09 |
| 53 | 002697 | 红旗连锁 | 2,045,980.00 | 2.04 |
| 54 | 300122 | 智飞生物 | 2,036,565.00 | 2.03 |
| 55 | 600588 | 用友网络 | 2,033,163.37 | 2.03 |
| 56 | 600016 | 民生银行 | 2,029,368.00 | 2.02 |
| 57 | 002705 | 新宝股份 | 2,028,804.40 | 2.02 |
| 58 | 601800 | 中国交建 | 2,027,539.00 | 2.02 |
| 59 | 601118 | 海南橡胶 | 2,023,490.00 | 2.02 |

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 | 434,043,679.60 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 444,372,785.85 |

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

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

无。

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

无。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

##### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中：

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

## 7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额        |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 35,126.66 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 2,116.79  |
| 5  | 应收申购款   | 5,178.34  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 42,421.79 |

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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(%) |
| 建信双利分 | 3,878    | 18,955.47 | 721,606.75 | 0.98      | 72,787,689.58 | 99.02     |

|      |       |           |            |      |               |        |
|------|-------|-----------|------------|------|---------------|--------|
| 级股票  |       |           |            |      |               |        |
| 建信稳健 | 179   | 5,294.32  | -          | -    | 947,684.00    | 100.00 |
| 建信进取 | 181   | 7,853.75  | -          | -    | 1,421,528.00  | 100.00 |
| 合计   | 4,238 | 17,904.32 | 721,606.75 | 0.95 | 75,156,901.58 | 99.05  |

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 期末上市基金前十名持有人

### 建信双利分级股票

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份）    | 占上市总份额比例（%） |
|----|-------|------------|-------------|
| 1  | 杨义云   | 116,133.00 | 14.63       |
| 2  | 官文举   | 116,058.00 | 14.62       |
| 3  | 赵建民   | 21,064.00  | 2.65        |
| 4  | 高其铭   | 20,366.00  | 2.56        |
| 5  | 王佐杰   | 20,151.00  | 2.54        |
| 6  | 张晓霞   | 17,449.00  | 2.20        |
| 7  | 白喆    | 11,877.00  | 1.50        |
| 8  | 孙晓燕   | 11,612.00  | 1.46        |
| 9  | 白锐    | 11,023.00  | 1.39        |
| 10 | 黄斌    | 11,022.00  | 1.39        |

### 建信稳健

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份）    | 占上市总份额比例（%） |
|----|-------|------------|-------------|
| 1  | 颜风云   | 131,200.00 | 13.84       |
| 2  | 孙亚    | 108,062.00 | 11.40       |
| 3  | 胡劲松   | 74,688.00  | 7.88        |
| 4  | 林云钦   | 72,500.00  | 7.65        |
| 5  | 高其铭   | 30,415.00  | 3.21        |
| 6  | 梁金花   | 27,600.00  | 2.91        |
| 7  | 白喆    | 22,400.00  | 2.36        |
| 8  | 许秀成   | 20,000.00  | 2.11        |
| 9  | 肖巧云   | 20,000.00  | 2.11        |
| 10 | 陈沛    | 18,000.00  | 1.90        |

## 建信进取

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份）    | 占上市总份额比例（%） |
|----|-------|------------|-------------|
| 1  | 纪嘉伦   | 200,000.00 | 14.07       |
| 2  | 刘新    | 121,900.00 | 8.58        |
| 3  | 高其铭   | 118,223.00 | 8.32        |
| 4  | 黄崇安   | 80,000.00  | 5.63        |
| 5  | 周旺余   | 68,600.00  | 4.83        |
| 6  | 都海英   | 52,900.00  | 3.72        |
| 7  | 尹德荣   | 49,000.00  | 3.45        |
| 8  | 单艳梅   | 48,700.00  | 3.43        |
| 9  | 王国光   | 46,800.00  | 3.29        |
| 10 | 许立军   | 44,400.00  | 3.12        |

注：持有人为场内持有人。

## 8.3 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 | 建信双利分级股票 | 22.35     | 0.00        |
|                  | 建信稳健     | 0.00      | 0.00        |
|                  | 建信进取     | 0.00      | 0.00        |
|                  | 合计       | 22.35     | 0.00        |

注：基金管理人的从业人员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）。

## 8.4 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

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 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                       | 建信双利分级股票         | 建信稳健          | 建信进取          |
|--------------------------|------------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日（2011年5月6日）基金份额总额 | 2,881,148,086.97 | 37,344,064.00 | 56,016,098.00 |
| 本报告期期初基金份额总额             | 77,418,958.67    | 1,007,168.00  | 1,510,754.00  |
| 本报告期基金总申购份额              | 2,550,609.34     | -             | -             |
| 减：本报告期                   | 7,921,471.13     | -             | -             |

|                                      |               |            |              |
|--------------------------------------|---------------|------------|--------------|
| 基金总赎回份<br>额                          |               |            |              |
| 本报告期基金<br>拆分变动份额<br>(份额减少以<br>“-”填列) | 1,461,199.45  | -59,484.00 | -89,226.00   |
| 本报告期期末<br>基金份额总额                     | 73,509,296.33 | 947,684.00 | 1,421,528.00 |

注:1、上述总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额;

2、拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期,本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内,本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

## 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 |    |
| 中信证券 | 1      | 258,143,072.58 | 29.50%       | 235,260.59 | 29.25%     | -  |
| 广发证券 | 1      | 192,976,793.83 | 22.05%       | 179,731.94 | 22.35%     | -  |
| 招商证券 | 1      | 169,599,980.06 | 19.38%       | 154,479.09 | 19.21%     | -  |
| 中投证券 | 1      | 143,683,346.99 | 16.42%       | 133,823.23 | 16.64%     | -  |
| 中信建投 | 1      | 110,740,484.99 | 12.65%       | 100,908.85 | 12.55%     | -  |
| 国泰君安 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 九州证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 银河证券 | 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、本基金本报告期末新增或剔除交易单元，与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

建信基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 29 日