

# 建信裕利灵活配置混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43

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 .....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	43
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 .....	43
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 .....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	44
7.12 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信裕利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	建信裕利灵活配置混合
基金主代码	002281
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 11 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	44,982,766.28 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金自上而下积极、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	65%×沪深 300 指数收益率+35%×中债总财富（总值）指数收益率
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。

### 2.3 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533；010-66228000	95559
传真	010-66228001	021-62701216
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	100033	200336
法定代表人	刘军	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,202,416.96
本期利润	4,426,182.29
加权平均基金份额本期利润	0.0980
本期加权平均净值利润率	5.07%
本期基金份额净值增长率	5.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	43,883,397.51
期末可供分配基金份额利润	0.9756
期末基金资产净值	88,866,163.79
期末基金份额净值	1.9756
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	90.69%

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

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

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

### 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

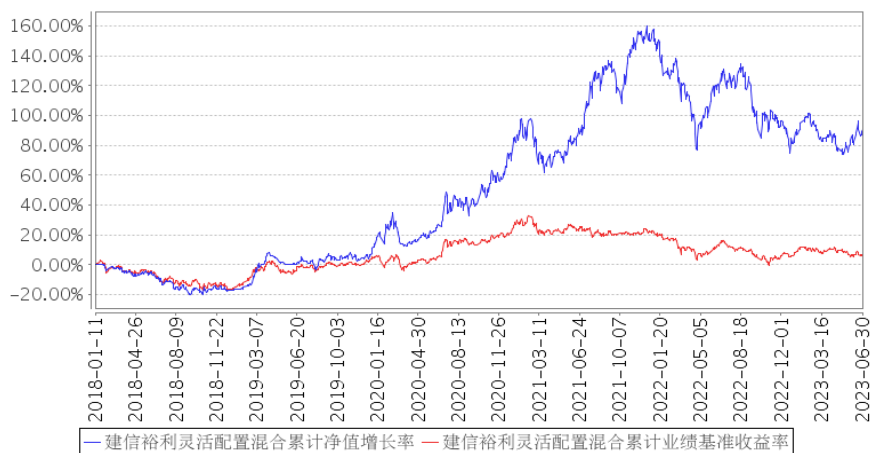
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.08%	1.37%	0.95%	0.56%	3.13%	0.81%
过去三个月	2.23%	1.26%	-2.70%	0.53%	4.93%	0.73%
过去六个月	5.23%	1.14%	0.49%	0.54%	4.74%	0.60%
过去一年	-16.16%	1.35%	-7.93%	0.64%	-8.23%	0.71%

过去三年	48.98%	1.61%	0.12%	0.78%	48.86%	0.83%
自基金合同生效起至今	90.69%	1.39%	6.58%	0.82%	84.11%	0.57%

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

建信裕利灵活配置混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，由中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司合资设立，注册资本2亿元。

公司拥有公开募集证券投资基金、私募资产管理计划、QDII、保险资金受托等业务资格，总

部设在北京，下设北京、上海、广州、成都、深圳五家分公司，并分别在上海和香港设立了子公司——建信资本管理有限责任公司、建信资产管理（香港）有限公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家，资产管理行业的领跑者”。

公司以持续优秀的管理能力、完善周到的服务，为超过 7000 万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至 2023 年 6 月 30 日，公司管理运作 161 只公开募集证券投资基金以及多个私募资产管理计划，资产管理规模 1.11 余万亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
江映德	权益投资部高级基金经理，本基金的基金经理	2021 年 2 月 1 日	-	12	江映德先生，权益投资部高级基金经理，硕士。曾任德勤会计师事务所高级审计员、中银国际证券有限公司高级研究员。2015 年 6 月加入建信基金，历任研究部研究员、研究主管、总经理助理、副总经理兼权益投资部基金经理助理、权益投资部基金经理。2021 年 2 月 1 日起任建信裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2021 年 10 月 20 日起任建信弘利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 12 月 27 日起任建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，该基金在 2023 年 3 月 27 日起更名为建信优享科技创新混合型证券投资基金（LOF），江映德继续担任该基金的基金经理；2023 年 4 月 11 日起任建信电子行业股票型证券投资基金的基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规



定和《建信裕利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2023 年上半年，中国经济经历了疫后复苏脉冲修复、地产拖累复苏预期不断下修、下行压力持续增大背景下衰退/通缩悲观预期不断发酵等几个阶段。往后看我们认为最悲观的时刻已经过去，随着制造业 PMI 回升，各行业高频数据逐步好转，美联储加息周期接近尾声缓解人民币贬值压力，叠加 7 月政治局会议的积极定调，后续有望进入缓慢复苏的进程。

上半年，股票市场随着对经济修复的预期变化走出了 M 型走势，3 月两会前在疫后复苏的预期下出现了整体上行，但随着复苏预期下修逐步走弱。股票市场从前半段的经济修复逻辑，转向后半段的主题炒作阶段，尤其是 ChatGPT 持续发酵，人工智能相关的产业创新持续推进，并引发全球关注和资本的大量涌入，国内相关公司快速跟进，带动 TMT 板块持续大涨，而传统成长板块和价值板块则持续调整。

本基金组合管理方面，组合操作上维持部分低估值成长型个股的配置，新能源和汽车零部件尽管面临较强的下行贝塔，但对于长期竞争优势强、成长性突出的个股仍然保持仓位，并抓住板

块回调的机会进一步加仓。TMT 方向看好硬科技的中长期成长，进一步加仓了国产替代持续强化和基本面改善的电子领域个股，包括半导体设备和部分消费电子。

本基金的配置思路，主要是自下而上选股，结合对宏观周期阶段和行业景气度的判断，通过寻找和筛选高景气行业内的优质个股，把握基本面趋势，争取实现组合超额收益，同时对回撤和波动性加以控制。

#### 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 5.23% 波动率 1.14% 业绩比较基准收益率 0.49% 波动率 0.54%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，我们认为国内经济最悲观的时候已经过去，随着政治局会议定调以及后续政策的陆续落地，国内经济有望逐步修复，可能存在的扰动因素在于地产恢复情况以及海外衰退程度可能给出口带来的拖累。结合经济见底预期、上市公司盈利见底回升趋势以及市场估值水平，我们认为市场有望逐步走出底部。

在此基础上，我们对市场保持乐观，看好中国具有国家竞争优势的高景气行业，看好中国具有全球竞争力的产业，制造业升级、科技创新、国产替代的逻辑不断演绎并兑现，催生出大量的投资机会。下半年，继续坚持自下而上的选股策略，不断寻找和筛选高景气行业内的优质个股，实现持续稳健的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在建信裕利灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，建信基金管理有限责任公司在建信裕利灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由建信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关建信裕利灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：建信裕利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,016,586.51	6,060,432.98
结算备付金		349,955.54	618,507.60
存出保证金		86,197.68	102,848.02
交易性金融资产	6.4.7.2	81,321,241.63	79,735,343.15
其中：股票投资		81,321,241.63	79,735,343.15
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		2,811,609.16	853,957.85
应收股利		-	-
应收申购款		1,331.01	115,023.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		91,586,921.53	87,486,112.84
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		816,499.63	412,695.36
应付赎回款		22,942.54	8,850.29
应付管理人报酬		107,595.98	113,866.14
应付托管费		17,932.65	81,526.62
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,755,786.94	1,529,018.55
负债合计		2,720,757.74	2,145,956.96
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	44,982,766.28	45,454,857.21
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	43,883,397.51	39,885,298.67
净资产合计		88,866,163.79	85,340,155.88
负债和净资产总计		91,586,921.53	87,486,112.84

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.9756 元 基金份额总额 44,982,766.28

份。

## 6.2 利润表

会计主体：建信裕利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		5,265,645.43	-12,575,526.82
1. 利息收入		29,274.57	35,451.78
其中：存款利息收入	6.4.7.13	29,274.57	35,451.78
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,398,726.74	-12,536,891.62
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,628,903.31	-12,297,895.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-795,702.38
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	230,176.57	556,706.73
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	8,628,599.25	-146,253.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	6,498.35	72,166.24
<b>减：二、营业总支出</b>		839,463.14	1,049,845.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	650,366.62	811,559.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	108,394.45	135,259.93
3. 销售服务费		-	-

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	3.47
8. 其他费用	6.4.7.23	80,702.07	103,022.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,426,182.29	-13,625,372.38
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,426,182.29	-13,625,372.38
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		4,426,182.29	-13,625,372.38

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：建信裕利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	45,454,857.21	-	39,885,298.67	85,340,155.88
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	45,454,857.21	-	39,885,298.67	85,340,155.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-472,090.93	-	3,998,098.84	3,526,007.91
（一）、综合收益总额	-	-	4,426,182.29	4,426,182.29
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-472,090.93	-	-428,083.45	-900,174.38
其中：1. 基金申	1,283,059.41	-	1,251,513.22	2,534,572.63

购款				
2. 基金赎回款	-1,755,150.34	-	-1,679,596.67	-3,434,747.01
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	44,982,766.28	-	43,883,397.51	88,866,163.79
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	45,201,017.99	-	75,074,238.34	120,275,256.33
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	45,201,017.99	-	75,074,238.34	120,275,256.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,732,092.45	-	-8,700,614.76	-4,968,522.31
(一)、综合收益总额	-	-	-13,625,372.38	-13,625,372.38
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	3,732,092.45	-	4,924,757.62	8,656,850.07
其中: 1. 基金申购款	11,594,588.83	-	15,121,945.83	26,716,534.66
2. 基金赎回款	-7,862,496.38	-	-10,197,188.21	-18,059,684.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净	-	-	-	-

值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	48,933,110.44	-	66,373,623.58	115,306,734.02

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

张力铮

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

建信裕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三号混合型证券投资基金转型而来。根据原建信安心保本三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《建信安心保本三号混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为建信裕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 1 月 11 日。原建信安心保本三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“建信裕利灵活配置混合型证券投资基金”，建信安心保本三号混合型证券投资基金份额转换为建信裕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 1 日起《建信裕利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《建信裕利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》生效，原《建信安心保本三号混合型证券投资基金基金合同》、《建信安心保本三号混合型证券投资基金托管协议》自同一日起失效。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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信裕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、存托凭证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。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。本基金的业绩比较基准为  $65\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+35\% \times$  中债总财富（总值）指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）

交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

#### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、

债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	7,016,586.51
等于：本金	7,015,160.99
加：应计利息	1,425.52

减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	7,016,586.51

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	77,025,091.78	-	81,321,241.63	4,296,149.85
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	77,025,091.78	-	81,321,241.63	4,296,149.85

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	31.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,629,577.81
其中：交易所市场	1,629,577.81
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	126,177.89
合计	1,755,786.94

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,454,857.21	45,454,857.21
本期申购	1,283,059.41	1,283,059.41
本期赎回（以“-”号填列）	-1,755,150.34	-1,755,150.34
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	44,982,766.28	44,982,766.28

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

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	52,889,834.31	-13,004,535.64	39,885,298.67
本期利润	-4,202,416.96	8,628,599.25	4,426,182.29
本期基金份额交易产生的变动数	-593,328.76	165,245.31	-428,083.45
其中：基金申购款	1,421,163.87	-169,650.65	1,251,513.22
基金赎回款	-2,014,492.63	334,895.96	-1,679,596.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,094,088.59	-4,210,691.08	43,883,397.51

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	23,910.92
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,579.35
其他	784.30
合计	29,274.57

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,628,903.31
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-3,628,903.31

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	453,979,569.50
减：卖出股票成本总额	456,330,392.23
减：交易费用	1,278,080.58
买卖股票差价收入	-3,628,903.31

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。



## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	230,176.57
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	230,176.57

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	8,628,599.25
股票投资	8,628,599.25
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	8,628,599.25

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	6,385.22
基金转换费收入	113.13
合计	6,498.35

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	115.00
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	80,702.07

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	650,366.62	811,559.60
其中：支付销售机构的客户维护费	232,328.02	301,722.68

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	108,394.45	135,259.93

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

无。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

## 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
基金合同生效日（2018年1月11日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	6,411,305.91	1,981,486.65
报告期间申购/买入总份额	-	4,429,819.26
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	6,411,305.91	6,411,305.91
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.25%	13.10%

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

无。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

交通银行-活期	7,016,586.51	23,910.92	7,230,525.26	29,232.81
---------	--------------	-----------	--------------	-----------

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程  
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督  
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理与内控合规委员会、督察长、风险与合规管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和风险与合规管理部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

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

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

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,016,586.51	-	-	-	7,016,586.51
结算备付金	349,955.54	-	-	-	349,955.54
存出保证金	86,197.68	-	-	-	86,197.68
交易性金融资产	-	-	-	81,321,241.63	81,321,241.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,811,609.16	2,811,609.16
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,331.01	1,331.01
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,452,739.73	-	-	84,134,181.80	91,586,921.53
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	816,499.63	816,499.63
应付赎回款	-	-	-	22,942.54	22,942.54
应付管理人报酬	-	-	-	107,595.98	107,595.98
应付托管费	-	-	-	17,932.65	17,932.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,755,786.94	1,755,786.94
负债总计	-	-	-	2,720,757.74	2,720,757.74



利率敏感度缺口	7,452,739.73	-	-	81,413,424.06	88,866,163.79
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,060,432.98	-	-	-	6,060,432.98
结算备付金	618,507.60	-	-	-	618,507.60
存出保证金	102,848.02	-	-	-	102,848.02
交易性金融资产	-	-	-	79,735,343.15	79,735,343.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	853,957.85	853,957.85
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	115,023.24	115,023.24
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,781,788.60	-	-	80,704,324.24	87,486,112.84
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	412,695.36	412,695.36
应付赎回款	-	-	-	8,850.29	8,850.29
应付管理人报酬	-	-	-	113,866.14	113,866.14
应付托管费	-	-	-	81,526.62	81,526.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,529,018.55	1,529,018.55
负债总计	-	-	-	2,145,956.96	2,145,956.96
利率敏感度缺口	6,781,788.60	-	-	78,558,367.28	85,340,155.88

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	81,321,241.63	91.51	79,735,343.15	93.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	81,321,241.63	91.51	79,735,343.15	93.43

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	5,230,800.31	5,969,570.02
	业绩比较基准下降5%	-5,230,800.31	-5,969,570.02

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	81,321,241.63	79,735,343.15
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	81,321,241.63	79,735,343.15

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具

有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	81,321,241.63	88.79
	其中：股票	81,321,241.63	88.79
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	7,366,542.05	8.04
8	其他各项资产	2,899,137.85	3.17
9	合计	91,586,921.53	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	74,775,068.91	84.14
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	1,784,496.00	2.01
J	金融业	2,878,798.72	3.24
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	1,882,878.00	2.12
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	81,321,241.63	91.51

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002371	北方华创	17,200	5,463,580.00	6.15
2	688012	中微公司	25,641	4,011,534.45	4.51
3	688036	传音控股	26,339	3,871,833.00	4.36
4	002475	立讯精密	112,200	3,640,890.00	4.10
5	688072	拓荆科技	8,251	3,514,678.47	3.96
6	601702	华峰铝业	253,400	3,466,512.00	3.90
7	603596	伯特利	43,300	3,431,958.00	3.86
8	603662	柯力传感	92,400	3,400,320.00	3.83
9	600933	爱柯迪	138,200	3,218,678.00	3.62
10	603305	旭升集团	108,804	3,032,367.48	3.41
11	300033	同花顺	16,424	2,878,798.72	3.24
12	300881	盛德鑫泰	86,620	2,854,129.00	3.21
13	002965	祥鑫科技	47,400	2,639,232.00	2.97
14	688017	绿的谐波	16,134	2,620,161.60	2.95
15	600600	青岛啤酒	25,200	2,611,476.00	2.94
16	002920	德赛西威	15,500	2,415,055.00	2.72
17	688503	聚和材料	22,415	2,185,462.50	2.46

18	002079	苏州固锟	149,000	2,175,400.00	2.45
19	600129	太极集团	33,200	1,975,068.00	2.22
20	601689	拓普集团	23,800	1,920,660.00	2.16
21	000888	峨眉山 A	164,300	1,882,878.00	2.12
22	301266	宇邦新材	26,600	1,870,246.00	2.10
23	603728	鸣志电器	22,300	1,790,690.00	2.02
24	002401	中远海科	67,800	1,784,496.00	2.01
25	688458	美芯晟	18,358	1,765,488.86	1.99
26	300274	阳光电源	14,500	1,691,135.00	1.90
27	300969	恒帅股份	17,100	1,507,365.00	1.70
28	603997	继峰股份	95,900	1,371,370.00	1.54
29	688680	海优新材	10,704	1,303,961.28	1.47
30	688153	唯捷创芯	17,470	1,278,105.20	1.44
31	300130	新国都	44,600	1,263,518.00	1.42
32	688326	经纬恒润	7,213	1,041,485.07	1.17
33	603501	韦尔股份	8,100	794,124.00	0.89
34	002139	拓邦股份	49,700	648,585.00	0.73

## 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	002965	祥鑫科技	9,483,851.00	11.11
2	300274	阳光电源	9,064,079.00	10.62
3	300033	同花顺	7,246,340.00	8.49
4	688680	海优新材	6,897,398.73	8.08
5	002371	北方华创	5,962,211.00	6.99
6	002401	中远海科	5,530,227.00	6.48
7	603305	旭升集团	5,451,081.00	6.39
8	601186	中国铁建	5,310,862.00	6.22
9	688012	中微公司	5,282,326.29	6.19
10	300881	盛德鑫泰	5,243,032.00	6.14
11	600129	太极集团	5,216,988.00	6.11
12	002475	立讯精密	5,125,673.00	6.01
13	000065	北方国际	4,837,147.09	5.67
14	601857	中国石油	4,786,209.00	5.61
15	600933	爱柯迪	4,693,857.00	5.50
16	300750	宁德时代	4,672,030.80	5.47
17	300058	蓝色光标	4,639,039.00	5.44
18	600754	锦江酒店	4,634,463.00	5.43
19	688111	金山办公	4,602,273.68	5.39
20	300586	美联新材	4,508,141.00	5.28
21	603596	伯特利	4,463,409.00	5.23

22	300339	润和软件	4,354,206.00	5.10
23	688017	绿的谐波	4,264,894.38	5.00
24	301155	海力风电	4,243,864.00	4.97
25	600079	人福医药	4,221,545.00	4.95
26	688153	唯捷创芯	3,975,481.95	4.66
27	600600	青岛啤酒	3,892,378.00	4.56
28	688368	晶丰明源	3,848,367.32	4.51
29	002315	焦点科技	3,816,655.00	4.47
30	002129	TCL 中环	3,785,094.04	4.44
31	603997	继峰股份	3,718,478.00	4.36
32	601111	中国国航	3,677,770.00	4.31
33	688036	传音控股	3,615,508.82	4.24
34	688362	甬矽电子	3,577,483.99	4.19
35	601800	中国交建	3,503,701.00	4.11
36	600536	中国软件	3,501,514.00	4.10
37	300896	爱美客	3,475,684.00	4.07
38	300129	泰胜风能	3,432,718.00	4.02
39	300229	拓尔思	3,323,376.00	3.89
40	600602	云赛智联	3,273,359.00	3.84
41	300161	华中数控	3,122,003.00	3.66
42	301266	宇邦新材	3,040,015.00	3.56
43	600763	通策医疗	2,969,700.00	3.48
44	688500	*ST 慧辰	2,942,382.53	3.45
45	601390	中国中铁	2,926,534.00	3.43
46	605499	东鹏饮料	2,914,788.18	3.42
47	301269	华大九天	2,889,262.00	3.39
48	002063	远光软件	2,870,802.00	3.36
49	603348	文灿股份	2,694,817.00	3.16
50	300567	精测电子	2,694,579.00	3.16
51	000998	隆平高科	2,647,133.00	3.10
52	603662	柯力传感	2,619,245.30	3.07
53	605259	绿田机械	2,595,019.54	3.04
54	603688	石英股份	2,593,722.00	3.04
55	001311	多利科技	2,583,394.38	3.03
56	600266	城建发展	2,556,942.00	3.00
57	002850	科达利	2,550,832.00	2.99
58	688072	拓荆科技	2,538,893.12	2.98
59	688498	源杰科技	2,529,212.62	2.96
60	603138	海量数据	2,406,385.00	2.82
61	002409	雅克科技	2,398,967.00	2.81
62	300212	易华录	2,389,430.00	2.80
63	688496	清越科技	2,379,336.94	2.79
64	002487	大金重工	2,340,277.00	2.74

65	000032	深桑达 A	2,325,905.00	2.73
66	688778	厦钨新能	2,314,702.42	2.71
67	002549	凯美特气	2,286,280.00	2.68
68	002079	苏州固锟	2,284,232.00	2.68
69	002043	兔宝宝	2,250,418.35	2.64
70	600588	用友网络	2,225,073.00	2.61
71	605305	中际联合	2,218,908.00	2.60
72	300598	诚迈科技	2,218,469.00	2.60
73	603306	华懋科技	2,175,420.00	2.55
74	601137	博威合金	2,159,618.00	2.53
75	300113	顺网科技	2,158,678.00	2.53
76	002920	德赛西威	2,094,661.00	2.45
77	000933	神火股份	2,046,209.00	2.40
78	002153	石基信息	2,012,495.00	2.36
79	000888	峨眉山 A	1,992,250.00	2.33
80	301299	卓创资讯	1,974,002.00	2.31
81	300601	康泰生物	1,965,579.00	2.30
82	002624	完美世界	1,954,835.00	2.29
83	688503	聚和材料	1,943,409.42	2.28
84	300474	景嘉微	1,892,152.00	2.22
85	601702	华峰铝业	1,888,203.00	2.21
86	600362	江西铜业	1,848,304.00	2.17
87	601689	拓普集团	1,846,055.00	2.16
88	600546	山煤国际	1,841,310.00	2.16
89	601699	潞安环能	1,839,538.00	2.16
90	600188	兖矿能源	1,833,432.28	2.15
91	002532	天山铝业	1,820,109.00	2.13
92	003022	联泓新科	1,818,401.00	2.13
93	600230	沧州大化	1,803,222.00	2.11
94	002045	国光电器	1,782,690.00	2.09
95	000681	视觉中国	1,760,867.00	2.06
96	301322	绿通科技	1,749,316.00	2.05
97	688099	晶晨股份	1,745,485.08	2.05
98	300226	上海钢联	1,733,517.40	2.03
99	600325	华发股份	1,724,737.00	2.02
100	000063	中兴通讯	1,723,113.00	2.02
101	000050	深天马 A	1,722,166.00	2.02
102	002236	大华股份	1,718,047.00	2.01
103	688248	南网科技	1,709,260.80	2.00
104	300566	激智科技	1,708,047.00	2.00

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元



序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300274	阳光电源	9,619,543.83	11.27
2	300750	宁德时代	8,779,140.47	10.29
3	603305	旭升集团	8,500,258.14	9.96
4	601111	中国国航	7,631,939.44	8.94
5	300896	爱美客	6,435,556.00	7.54
6	688680	海优新材	6,404,899.48	7.51
7	002965	祥鑫科技	5,919,811.00	6.94
8	600536	中国软件	5,880,482.75	6.89
9	600079	人福医药	5,822,253.00	6.82
10	002315	焦点科技	5,396,053.00	6.32
11	688153	唯捷创芯	5,307,810.30	6.22
12	601186	中国铁建	5,229,053.57	6.13
13	300058	蓝色光标	5,169,968.00	6.06
14	300339	润和软件	5,057,357.00	5.93
15	002475	立讯精密	4,904,620.39	5.75
16	688111	金山办公	4,768,921.60	5.59
17	601857	中国石油	4,706,258.00	5.51
18	002401	中远海科	4,588,352.00	5.38
19	002850	科达利	4,528,322.97	5.31
20	000065	北方国际	4,528,182.00	5.31
21	600754	锦江酒店	4,509,881.00	5.28
22	300586	美联新材	4,366,224.51	5.12
23	301155	海力风电	4,275,748.00	5.01
24	688368	晶丰明源	4,053,631.29	4.75
25	603348	文灿股份	3,964,853.00	4.65
26	600129	太极集团	3,889,974.00	4.56
27	300033	同花顺	3,838,825.68	4.50
28	002129	TCL 中环	3,827,122.00	4.48
29	600487	亨通光电	3,778,965.00	4.43
30	300161	华中数控	3,773,350.48	4.42
31	601800	中国交建	3,661,859.00	4.29
32	300129	泰胜风能	3,644,984.00	4.27
33	600602	云赛智联	3,534,855.00	4.14
34	300229	拓尔思	3,340,891.00	3.91
35	688362	甬矽电子	3,305,119.49	3.87
36	688500	*ST 慧辰	3,269,418.56	3.83
37	301269	华大九天	3,252,642.00	3.81
38	002063	远光软件	3,147,208.88	3.69
39	603995	甬金股份	3,083,001.90	3.61
40	605499	东鹏饮料	3,065,399.70	3.59
41	600763	通策医疗	2,851,242.00	3.34
42	300881	盛德鑫泰	2,837,644.90	3.33

43	601390	中国中铁	2,782,861.90	3.26
44	600522	中天科技	2,743,295.00	3.21
45	300567	精测电子	2,673,203.00	3.13
46	688498	源杰科技	2,652,252.64	3.11
47	300413	芒果超媒	2,621,873.00	3.07
48	600266	城建发展	2,559,661.00	3.00
49	603639	海利尔	2,556,613.00	3.00
50	688800	瑞可达	2,525,583.96	2.96
51	688188	柏楚电子	2,482,924.99	2.91
52	003031	中瓷电子	2,477,335.00	2.90
53	605259	绿田机械	2,441,706.00	2.86
54	300212	易华录	2,416,843.00	2.83
55	603997	继峰股份	2,414,753.00	2.83
56	000998	隆平高科	2,411,272.00	2.83
57	300598	诚迈科技	2,404,777.00	2.82
58	688017	绿的谐波	2,395,077.48	2.81
59	002409	雅克科技	2,366,132.00	2.77
60	301168	通灵股份	2,330,122.00	2.73
61	001311	多利科技	2,324,324.85	2.72
62	300320	海达股份	2,295,462.00	2.69
63	603688	石英股份	2,261,401.00	2.65
64	605305	中际联合	2,209,018.00	2.59
65	002043	兔宝宝	2,190,126.00	2.57
66	600588	用友网络	2,186,150.00	2.56
67	603138	海量数据	2,185,973.65	2.56
68	688778	厦钨新能	2,185,094.54	2.56
69	300601	康泰生物	2,163,642.00	2.54
70	300474	景嘉微	2,145,166.00	2.51
71	601702	华峰铝业	2,142,988.00	2.51
72	000032	深桑达 A	2,140,047.00	2.51
73	688496	清越科技	2,138,659.51	2.51
74	002487	大金重工	2,114,348.27	2.48
75	002549	凯美特气	2,080,443.00	2.44
76	603867	新化股份	2,061,042.00	2.42
77	300113	顺网科技	2,011,057.00	2.36
78	000681	视觉中国	2,003,219.62	2.35
79	002153	石基信息	1,987,238.00	2.33
80	603306	华懋科技	1,979,787.00	2.32
81	601137	博威合金	1,967,478.75	2.31
82	600546	山煤国际	1,948,608.00	2.28
83	600230	沧州大化	1,944,172.00	2.28
84	601699	潞安环能	1,921,798.00	2.25
85	301185	鸥玛软件	1,907,382.00	2.24

86	603000	人民网	1,905,409.00	2.23
87	002624	完美世界	1,891,085.00	2.22
88	000933	神火股份	1,849,391.28	2.17
89	600366	宁波韵升	1,849,151.00	2.17
90	600188	兖矿能源	1,843,073.00	2.16
91	603606	东方电缆	1,815,937.00	2.13
92	600362	江西铜业	1,797,024.00	2.11
93	603918	金桥信息	1,775,425.88	2.08
94	002803	吉宏股份	1,775,107.00	2.08
95	002236	大华股份	1,769,277.00	2.07
96	301322	绿通科技	1,761,962.00	2.06
97	301299	卓创资讯	1,753,858.00	2.06
98	688099	晶晨股份	1,741,706.84	2.04
99	300271	华宇软件	1,740,967.00	2.04
100	600325	华发股份	1,736,236.00	2.03
101	000063	中兴通讯	1,734,704.00	2.03
102	300559	佳发教育	1,727,090.00	2.02
103	688045	必易微	1,719,232.60	2.01

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	449,287,691.46
卖出股票收入（成交）总额	453,979,569.50

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

无。

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

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

**7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	86,197.68
2	应收清算款	2,811,609.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,331.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,899,137.85

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,686	26,680.17	6,411,305.91	14.25	38,571,460.37	85.75

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	196,471.10	0.44

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年1月11日) 基金份额总额	750,098,890.72
本报告期期初基金份额总额	45,454,857.21
本报告期基金总申购份额	1,283,059.41
减：本报告期基金总赎回份额	1,755,150.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	44,982,766.28

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

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2023年1月19日发布公告，自2023年1月17日起吴灵玲女

士不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起刘军先生不再担任建信基金管理有限责任公司董事长，暂由总裁张军红先生代为履行董事长职务；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 3 月 18 日发布公告，自 2023 年 3 月 17 日起聘任张力铮先生担任建信基金管理有限责任公司副总裁，张威威先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁、首席信息官。上述事项均已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	3	218,783,472.47	24.22	196,481.94	26.09	-
华创证券	1	158,099,222.05	17.50	147,238.75	19.55	-

中邮证券	1	117,173,074.10	12.97	85,689.02	11.38	-
东北证券	1	113,092,128.86	12.52	81,572.98	10.83	-
华泰证券	5	90,908,644.94	10.06	70,605.70	9.38	-
国泰君安	2	54,791,585.29	6.07	39,809.60	5.29	-
开源证券	1	38,884,160.45	4.31	28,435.92	3.78	-
海通证券	1	38,569,868.45	4.27	35,533.99	4.72	-
光大证券	1	28,099,967.73	3.11	25,888.08	3.44	-
东吴证券	1	24,152,070.04	2.67	22,493.03	2.99	-
太平洋证券	1	20,671,672.95	2.29	19,251.47	2.56	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为；

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；

(4) 佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人；

3、本基金本报告期内无剔除交易单元，新增中邮证券、开源证券、中信证券 3 个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
高华证	-	-	-	-	-	-



券						
国金证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增华西证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023年05月29日
2	关于增加上海陆亨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	2023年03月01日
3	关于增加博时财富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	2023年02月24日
4	关于更新建信基金旗下公募基金产品适当性风险等级评定结果的公告	指定报刊和/或公司网站	2023年02月15日
5	关于增加上海中欧财富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	2023年02月07日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信裕利灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信裕利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信裕利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信裕利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2023 年 8 月 30 日