

建信优势动力混合型证券投资基金（LOF） 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	建信优势动力混合（LOF）
场内简称	建信优势
基金主代码	165313
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2013 年 3 月 19 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	251,495,201.89 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	2013 年 4 月 3 日

2.2 基金产品说明

投资目标	采取定量和定性相结合的方法，寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力、但是价值被低估的优势上市公司，通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产来获取超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人根据经济环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析，作出投资决策。
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数收益率+25%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	陆志俊
	联系电话	010-66228888	95559
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95559
传真		010-66228001	021-62701216

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	http://www.ccbfund.cn
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	28,029,780.38
本期利润	74,250,028.95
加权平均基金份额本期利润	0.2871
本期基金份额净值增长率	25.13%
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	0.4043
期末基金资产净值	353,186,525.63
期末基金份额净值	1.404

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、上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	5.17%	0.99%	4.21%	0.86%	0.96%	0.13%
过去三个月	-1.34%	1.51%	-0.67%	1.14%	-0.67%	0.37%
过去六个月	25.13%	1.44%	20.47%	1.15%	4.66%	0.29%
过去一年	8.42%	1.38%	8.83%	1.14%	-0.41%	0.24%

过去三年	4.00%	1.03%	19.39%	0.83%	-15.39%	0.20%
自基金合同生效起至今	50.32%	1.34%	51.79%	1.14%	-1.47%	0.20%

注:本基金业绩比较基准为 75%×沪深 300 指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。沪深 300 指数是由中证指数公司编制的,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。中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于 2001 年 12 月 31 日推出的债券指数。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。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势,测算债券投资回报率水平,判断债券供求动向提供了很好的依据。

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

建信优势动力混合（LOF）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）、建信短债纯债债券型证券投资基金、建信中证 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、建信中证 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		
姜锋	本基金的基金经理	2013 年 3 月 19 日	-	11	姜锋先生，硕士，权益投资部执行投资官。2007 年 7 月加入本公司，历任研究员、基金经理、资深基金经理、权益投资部执行投资官。2011 年 7 月 11 日起任建信优势动力股票型证券投资基金的基金经理，该基金于 2013 年 3 月 19 日起转型为建信优势动力混合型证券投资基金（LOF），姜锋继续担任该基金的基金经理；2014 年 3 月 21 日起任建信健康民生混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 4 月 22 日起任建信环保产业股票型证券投资基金的基金经理。

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

2019 年上半年市场普涨，一季度受益于中美贸易谈判利好及流动性较为宽松，股票市场风险偏好快速修复，增量资金大举入场。二季度股市受到中美贸易波折影响有所回调。风格上价值表现好于成长。上证综指上涨 19.45%，沪深 300 上涨 27.07%，中证 500 上涨 18.77%，中小板指上涨 20.75%，创业板指上涨 20.87%。行业层面，食品饮料（61.01%）、非银金融（43.83%）、农林牧渔（41.96%）、家用电器（37.82%）、计算机（32.77%）领涨；建筑（4.16%）、钢铁（5.04%）、传媒（7.79%）、纺织服装（9.27%）、汽车（10.03%）涨幅靠后。

上半年经济运行态势良好，但下行压力逐步增大。一季度 GDP 增速稳在 6.4%，二季度 GDP 增速回落至 6.2%。分项来看，投资方面制造业投资增速快速下行至 3% 以下，基建的支撑力度不及预期，房地产投资相对保持强劲，但基建和房地产的投资增速数据在 5 月份均出现下滑。消费方面，汽车销售大幅负增长，空调销售表现疲弱。出口方面，在贸易摩擦加剧和全球经济下行压力增大的背景下，上半年出口月度波动较大，累计出口与去年持平。通胀方面，由于猪肉及鲜菜价格的上涨，上半年物价指数震荡上行，5 月和 6 月均达到 2.7% 较高位置。需要注意的是，上半年宏观事件也对股票市场形成了阶段冲击。国际方面，5 月份贸易谈判中止和华为事件升级，6 月底两国元首会谈重启了谈判；国内方面，包商银行事件使得信用分层愈加显著，中小企业和金融机构的信用风险进一步上升；此外，科创板启动上市询价并于 7 月份正式开板。政策方面，国际上多国纷纷加入降息行列，美国也在 7 月份首次下调了基准利率；国内货币政策保持稳健，一季度的货币和信贷投放力度超出预期，二季度数据有所回调，但在包商银行托管之后，央行的宽松力度有所加大。财政政策持续发力，降税减费对财政收入造成一定约束，非税收入是上半年财政收入的支撑项，同时财政支出前置，地方债发行情况也超出市场预期，整体体现了财政政策的积极态度。本基金 1 季度提升了整体权益比例，2 月份加仓券商，灵活参与科技股的反弹，3 月份优化了持仓结构，加大了消费和化工板块的配置比例。2 季度降低了整体权益比例，减持了部分科技股和成长股，加仓了消费股和金融股。

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 25.13%，波动率 1.44%，业绩比较基准收益率 20.47%，波动率 1.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于经济的低迷和贸易前景的不确定性，全球开启以降息为代表的货币宽松进程，国内上半年也以各种数量化的方式维持整体流动性的充裕，考虑到国内外的需求形势，预计宏观将处于低

增长、低利率和高债务的环境当中。随着经济持续回落，企业整体的经营也面临一定的压力，上市公司的盈利也在触底的过程当中，虽然股票市场整体估值水平不高，但结构分化较为严重，综合基本面、估值和政策来看下半年股票市场预计将呈现震荡格局。

本基金来 3 季度一方面将紧密跟踪国内外政策的调整应对，关注经济结构转型、新一代通信技术的普及进度和消费政策的调整动向，另一方面将更加深入研究高质量增长背景下各行业内部企业竞争力和盈利的变化趋势。对应在投资策略上，在均衡配置行业龙头公司的同时，重点聚焦大消费领域的结构性机会、新一代通信技术升级衍生的机会和以养殖为代表的行业供需失衡的周期性机会，努力为持有人创造良好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

规定。

§ 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

2019 上半年度，托管人在建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）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

2019 上半年度，建信基金管理有限责任公司在建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）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、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2019 上半年度，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优势动力混合型证券投资基金（LOF）的半年度报告中财务指标、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：建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		46,198.48	15,054,423.73
结算备付金		96,943,579.20	79,650,224.76
存出保证金		351,043.16	311,262.08
交易性金融资产		261,014,986.37	188,121,781.87
其中：股票投资		261,014,986.37	188,121,781.87
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		-	19,226,085.52
应收利息		47,108.25	45,280.75
应收股利		-	-
应收申购款		3,989.44	10,109.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		358,406,904.90	302,419,167.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 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		190,411.64	233,374.47
应付管理人报酬		349,750.28	323,974.81
应付托管费		69,950.05	64,794.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,862,891.87	3,263,169.16
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		747,375.43	854,199.47
负债合计		5,220,379.27	4,739,512.88
所有者权益:			
实收基金		251,495,201.89	265,234,820.22
未分配利润		101,691,323.74	32,444,834.75
所有者权益合计		353,186,525.63	297,679,654.97
负债和所有者权益总计		358,406,904.90	302,419,167.85

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.404 元，基金份额总额 251,495,201.89 份。

6.2 利润表

会计主体：建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		79,001,275.45	-34,300,629.43
1. 利息收入		761,894.01	1,014,004.44

其中：存款利息收入		761,894.01	962,163.66
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		-	51,840.78
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		32,012,242.36	-29,473,214.39
其中：股票投资收益		30,618,423.30	-31,083,352.05
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		1,393,819.06	1,610,137.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		46,220,248.57	-5,847,430.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		6,890.51	6,011.36
减：二、费用		4,751,246.50	5,642,700.39
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	2,088,858.52	2,380,367.77
2. 托管费	6.4.8.2.2	417,771.70	476,073.53
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		2,030,356.21	2,562,649.10
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		214,260.07	223,609.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		74,250,028.95	-39,943,329.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		74,250,028.95	-39,943,329.82

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）

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 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)	265,234,820.22	32,444,834.75	297,679,654.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	74,250,028.95	74,250,028.95
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)	-13,739,618.33	-5,003,539.96	-18,743,158.29
其中：1. 基金申购款	1,230,449.08	440,899.54	1,671,348.62
2. 基金赎回款	-14,970,067.41	-5,444,439.50	-20,414,506.91
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)	251,495,201.89	101,691,323.74	353,186,525.63
项目	上年度可比期间 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)	289,838,487.13	127,483,032.78	417,321,519.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-39,943,329.82	-39,943,329.82
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)	-18,263,857.34	-7,416,851.36	-25,680,708.70
其中：1. 基金申购款	775,673.13	295,062.28	1,070,735.41
2. 基金赎回款	-19,039,530.47	-7,711,913.64	-26,751,444.11

回款			
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）	271,574,629.79	80,122,851.60	351,697,481.39

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

建信优势动力混合型证券投资基金(LOF) (原名为建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)，以下简称“本基金”)是根据原建信优势动力股票型证券投资基金(以下简称“建信优势动力基金”)基金份额持有人大会 2013 年 1 月 28 日决议通过的《关于建信优势动力股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，并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[2013]204 号《关于核准建信优势动力股票型证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》核准，由原建信优势动力基金转型而来。原建信优势动力基金为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市，存续期限为 5 年期，至 2013 年 3 月 18 日止。根据深交所深证上[2013]82 号《终止上市通知书》，原建信优势动力基金于 2013 年 3 月 15 日终止上市权利登记，于 2013 年 3 月 18 日终止上市。自 2013 年 3 月 19 日(基金合同生效日)起，原建信优势动力基金转型为上市契约型开放式基金，更名为建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)，原《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》失效，《建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于同一日生效。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。

建信优势动力基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 4,336,702,117.48 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值，并于 2013 年 3 月 19 日完成了变更登记。

经深交所深证上[2013]106 号审核同意，建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)2,348,989,482.00 份基金份额于 2013 年 4 月 3 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，建信优势动力股票型证券投资基金 (LOF) 于 2015 年 8 月 8 日公告后更名为建信优势动力混合型证券投资基金 (LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信优势动力混合型证券投资基金 (LOF) 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、银行存款、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 (但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的股票投资占基金资产净值的比例为 60%-95%，权证占基金资产净值的比例不超过 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资业绩比较基准为 75% X 沪深 300 指数收益率+25% X 中国债券总指数收益率。

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》、《建信优势动力混合型证券投资基金 (LOF) 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

本基金本报告期内未发生会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

(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) 对于内地投资者持有的基金类别，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。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，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该内地基金分配利息时按照 7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10%的税率代扣代缴所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金销售机构、基金托管人
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
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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,088,858.52	2,380,367.77
其中：支付销售机构的客户维护费	136,741.21	145,870.31

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 1.25%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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.25% / 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	417,771.70	476,073.53

注：支付基金托管人交通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

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2013 年 3 月 19 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	3,591,235.63	3,591,235.63
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	3,591,235.63	3,591,235.63
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.43%	1.32%

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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
交通银行	46,198.48	21,935.57	16,186,504.67	53,121.28

注：1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息；

2、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2019 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

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	-

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 06 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 260,991,879.77 元，第二层次的余额为 23,106.60 元，无属于第三层次的余额（2018 年 06 月 30 日：第一层次 238,493,271.19 元，无属于第二层或第三层次的余额）。

(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 2019 年 06 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 06 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	261,014,986.37	72.83
	其中：股票	261,014,986.37	72.83
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	96,989,777.68	27.06
8	其他各项资产	402,140.85	0.11
9	合计	358,406,904.90	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	4,803,143.00	1.36
B	采矿业	6,026,634.09	1.71
C	制造业	159,155,429.66	45.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	1,670,605.00	0.47
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	27,084,877.67	7.67

	务业		
J	金融业	22,591,095.00	6.40
K	房地产业	13,487,084.00	3.82
L	租赁和商务服务业	19,662,481.35	5.57
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	6,533,636.60	1.85
S	综合	—	—
	合计	261,014,986.37	73.90

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	000651	格力电器	492,024	27,061,320.00	7.66
2	000661	长春高新	70,129	23,703,602.00	6.71
3	601888	中国国旅	221,799	19,662,481.35	5.57
4	000858	五 粮 液	159,200	18,777,640.00	5.32
5	603886	元祖股份	693,432	18,369,013.68	5.20
6	002123	梦网集团	1,135,900	16,061,626.00	4.55
7	000961	中南建设	1,557,400	13,487,084.00	3.82
8	000063	中兴通讯	400,006	13,012,195.18	3.68
9	600030	中信证券	498,500	11,869,285.00	3.36
10	601318	中国平安	121,000	10,721,810.00	3.04

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	002384	东山精密	24,348,757.00	8.18
2	002373	千方科技	23,221,706.40	7.80
3	000651	格力电器	18,852,023.72	6.33

4	002567	唐人神	18,118,098.63	6.09
5	603886	元祖股份	15,977,793.73	5.37
6	000858	五 粮 液	14,934,970.00	5.02
7	000961	中南建设	13,364,957.00	4.49
8	000661	长春高新	13,042,922.98	4.38
9	600866	星湖科技	13,018,638.92	4.37
10	600163	中闽能源	12,763,318.86	4.29
11	002714	牧原股份	12,599,119.47	4.23
12	002123	梦网集团	12,593,759.00	4.23
13	002080	中材科技	12,448,688.60	4.18
14	603707	健友股份	12,001,113.25	4.03
15	002124	天邦股份	11,545,880.44	3.88
16	600760	中航沈飞	10,931,054.20	3.67
17	002548	金新农	10,883,093.33	3.66
18	600521	华海药业	10,816,326.00	3.63
19	002912	中新赛克	10,799,487.00	3.63
20	002508	老板电器	10,728,217.00	3.60
21	600352	浙江龙盛	10,606,850.00	3.56
22	002063	远光软件	10,527,362.28	3.54
23	600572	康恩贝	10,519,769.55	3.53
24	300498	温氏股份	10,469,374.00	3.52
25	603200	上海洗霸	10,347,881.00	3.48
26	601318	中国平安	10,193,849.00	3.42
27	603711	香飘飘	10,175,528.00	3.42
28	000001	平安银行	10,150,972.35	3.41
29	600837	海通证券	9,708,000.00	3.26
30	300015	爱尔眼科	9,025,501.98	3.03
31	601818	光大银行	8,989,098.00	3.02
32	601186	中国铁建	7,898,757.00	2.65
33	300398	飞凯材料	7,794,144.50	2.62
34	002157	正邦科技	7,618,603.00	2.56
35	000538	云南白药	7,587,084.00	2.55
36	002425	凯撒文化	7,519,012.38	2.53
37	600409	三友化工	7,505,052.00	2.52
38	603387	基蛋生物	7,439,607.80	2.50
39	002180	纳思达	7,420,950.00	2.49
40	300188	美亚柏科	7,415,552.00	2.49
41	000876	新 希 望	7,218,721.02	2.42
42	603517	绝味食品	7,193,081.67	2.42
43	600996	贵广网络	7,187,963.00	2.41
44	300443	金雷股份	6,971,746.00	2.34
45	600507	方大特钢	6,904,075.83	2.32

46	600030	中信证券	6,847,093.00	2.30
47	300285	国瓷材料	6,809,600.00	2.29
48	300014	亿纬锂能	6,751,590.00	2.27
49	300413	芒果超媒	6,745,792.00	2.27
50	300559	佳发教育	6,737,265.68	2.26
51	300059	东方财富	6,735,975.48	2.26
52	002299	圣农发展	6,700,822.00	2.25
53	603986	兆易创新	6,424,447.00	2.16
54	300463	迈克生物	6,423,049.00	2.16
55	600536	中国软件	6,273,382.00	2.11
56	002557	洽洽食品	6,227,590.72	2.09

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	002567	唐人神	21,923,196.00	7.36
2	002384	东山精密	20,866,785.00	7.01
3	002373	千方科技	20,409,596.00	6.86
4	300010	立思辰	20,089,825.00	6.75
5	000002	万科A	18,552,691.14	6.23
6	600352	浙江龙盛	17,274,704.39	5.80
7	600837	海通证券	17,266,886.00	5.80
8	600011	华能国际	16,722,998.00	5.62
9	600872	中炬高新	14,585,223.40	4.90
10	002063	远光软件	13,905,453.60	4.67
11	603711	香飘飘	13,163,478.00	4.42
12	000968	蓝焰控股	13,104,040.84	4.40
13	002080	中材科技	12,226,168.44	4.11
14	300059	东方财富	11,642,665.00	3.91
15	600760	中航沈飞	11,594,691.04	3.90
16	002508	老板电器	11,206,788.02	3.76
17	603707	健友股份	11,145,754.70	3.74
18	600572	康恩贝	11,074,665.00	3.72
19	300015	爱尔眼科	10,638,962.88	3.57
20	002912	中新赛克	10,526,295.00	3.54
21	300498	温氏股份	10,310,259.30	3.46
22	600163	中闽能源	10,305,419.16	3.46
23	603200	上海洗霸	10,269,219.50	3.45
24	600104	上汽集团	10,091,868.00	3.39
25	000001	平安银行	9,723,119.00	3.27
26	600866	星湖科技	9,716,750.55	3.26

27	601818	光大银行	9,528,060.00	3.20
28	002548	金新农	9,329,306.78	3.13
29	600521	华海药业	9,180,764.80	3.08
30	600409	三友化工	9,113,865.00	3.06
31	300398	飞凯材料	8,900,334.73	2.99
32	300203	聚光科技	8,608,024.00	2.89
33	002531	天顺风能	8,402,473.00	2.82
34	002425	凯撒文化	8,384,968.95	2.82
35	002157	正邦科技	7,794,964.00	2.62
36	000876	新希望	7,724,312.87	2.59
37	002557	洽洽食品	7,635,051.74	2.56
38	002714	牧原股份	7,497,892.00	2.52
39	300443	金雷股份	7,294,499.00	2.45
40	000651	格力电器	7,290,948.00	2.45
41	002299	圣农发展	7,172,010.04	2.41
42	600536	中国软件	7,106,739.70	2.39
43	601186	中国铁建	7,036,423.00	2.36
44	300463	迈克生物	6,930,591.00	2.33
45	600996	贵广网络	6,701,277.00	2.25
46	601098	中南传媒	6,572,346.00	2.21
47	000538	云南白药	6,537,550.00	2.20
48	300251	光线传媒	6,229,098.00	2.09
49	603387	基蛋生物	6,207,784.35	2.09
50	300188	美亚柏科	6,161,090.10	2.07
51	002180	纳思达	6,059,778.00	2.04
52	603986	兆易创新	5,959,414.00	2.00

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	668,982,387.40
卖出股票收入（成交）总额	672,927,854.77

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，中兴通讯股份有限公司（000063）于 2018 年 6 月 12 日发布公告已与美国 BIS 达成《替代的和解协议》。根

据协议，中兴通讯将支付合计 14 亿美元的民事罚款。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	351,043.16
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	47,108.25
5	应收申购款	3,989.44
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	402,140.85

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 (%)
13,715	18,337.24	9,324,756.68	3.71	242,170,445.21	96.29

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	上海西上海投资发展	1,985,111.00	3.56

	有限公司		
2	张瑞平	1,380,772.00	2.48
3	肖正巧	994,001.00	1.78
4	淄博市自来水公司节水技术开发部	990,514.00	1.78
5	邓福灵	948,000.00	1.70
6	李雪梅	877,800.00	1.58
7	李志军	692,361.00	1.24
8	邓彬	600,336.00	1.08
9	徐满花	533,752.00	0.96
10	赵玉林	500,340.00	0.90

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

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

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（2013年3月19日） 基金份额总额	4,642,655,005.00
本报告期期初基金份额总额	265,234,820.22
本报告期基金总申购份额	1,230,449.08
减：本报告期基金总赎回份额	14,970,067.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	251,495,201.89

注：上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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	
安信证券	2	599,895,204.62	44.72%	557,389.83	45.01%	—
中泰证券	3	329,624,339.10	24.57%	300,384.40	24.26%	—
招商证券	2	180,653,623.85	13.47%	167,142.73	13.50%	—
华创证券	1	137,824,326.82	10.28%	128,356.25	10.36%	—

华泰证券	4	46,775,213.35	3.49%	42,625.88	3.44%	—
中投证券	3	31,370,132.55	2.34%	28,587.08	2.31%	—
光大证券	1	6,904,075.83	0.51%	6,291.08	0.51%	—
东吴证券	1	5,290,043.00	0.39%	4,926.62	0.40%	—
海通证券	1	2,998,313.00	0.22%	2,732.32	0.22%	—
长江证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
高华证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
瑞银证券	1	—	—	—	—	—
太平洋证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—
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、个股、个债等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人。能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

（4）佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内无新增或剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

建信基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 29 日