

建信全球资源混合型证券投资基金 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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	建信全球资源混合(QDII)
基金主代码	539003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月26日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	28,608,055.80份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过全球化的资产配置和组合管理,优选资源类相关行业的股票进行投资,在控制风险的同时,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在投资策略方面,将采取自上而下的资产配置与自下而上的证券选择相结合、定量研究与定性研究相结合、组合构建与风险控制相结合等多种方式进行投资组合的构建。
业绩比较基准	50%×MSCI全球能源行业净总收益指数收益率(MSCI ACWI Energy Net Total Return Index)+50%×MSCI全球原材料行业净总收益指数收益率(MSCI ACWI Material Net Total Return Index)。
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	王永民
	联系电话	010-66228888	010-66594896
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95566
传真		010-66228001	010-66594942

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	中文	信安环球投资有限公司	布朗兄弟哈里曼银行
	英文	Principal Global Investors, LLC.	Brown Brothers Harriman & Co.
注册地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	140 Broadway New York

办公地址	801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	140 Broadway New York
邮政编码	IA 50392-0490	NY 10005

2.5 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	414,435.99
本期利润	2,912,566.88
加权平均基金份额本期利润	0.0955
本期基金份额净值增长率	11.93%
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	-0.1135
期末基金资产净值	25,498,471.32
期末基金份额净值	0.891

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、汇兑损益、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、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、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）。

3.2 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	6.83%	0.64%	7.64%	0.62%	-0.81%	0.02%

过去三个月	3.13%	0.76%	3.50%	0.73%	-0.37%	0.03%
过去六个月	11.93%	0.81%	14.04%	0.77%	-2.11%	0.04%
过去一年	-1.87%	0.95%	-0.38%	0.88%	-1.49%	0.07%
过去三年	25.49%	0.85%	32.53%	0.78%	-7.04%	0.07%
自基金合同 生效起至今	-8.07%	1.01%	39.05%	0.98%	-47.12 %	0.03%

注:本基金的业绩比较基准为: 50%×MSCI 全球能源行业净总收益指数收益率 (MSCI ACWI Energy Net Total Return Index) + 50%×MSCI 全球原材料行业净总收益指数收益率 (MSCI ACWI Material Net Total Return Index)。MSCI 是全球领先的指数公司, 具有超过 40 年的计算编制国际股票指数的丰富经验, MSCI 全球指数系列自编制以来, 已经成为国际大型机构投资者及各种媒体广泛使用的业绩比较基准。MSCI 全球能源行业净总收益指数和 MSCI 全球原材料行业净总收益指数是 MSCI 全球指数系列中的两个行业指数, MSCI 全球指数系列的编制方法遵循客观、规则为本和自由流通市值加权的原则, 从而使该指数系列能够捕捉到更为广泛的投资机会, 指数的维护和调整公开透明, 满足了投资者在使用该指数系列时的不同需求; MSCI 全球指数系列具有全面翔实的历史数据, 包括指数层面数据、成份股层面数据和各种估值数据, 为分析研究全球市场提供了有力支持; MSCI 全球指数系列能及时反映公司事件和市场变化, 每年 4 次的指数审核及每日的公司事件审议保证了指数及时准确反映市场变化。

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

建信全球资源混合(QDII)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		
李博涵	海外投资部副经理，本基金基金经理	2013年8月5日	-	14	李博涵先生，海外投资部副总经理，硕士，加拿大籍华人。曾就职于美国联邦快递北京分公司、美国联合航空公司北京分公司和美国万事达卡国际组织北京分公司。2005年2月起加入加拿大蒙特利尔银行，任全球资本市场投资助理；2006年8月起加入加拿大帝国商业银行，任全球资本市场投资顾问；2008年8月加入我公司海外投资部，历任高级研究员兼基金经理助

					理、基金经理，2018年5月起兼任部门副总经理；2013年8月5日起任建信全球资源混合型证券投资基金的基金经理；2017年11月13日起任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的基金经理；2018年12月13日起任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的基金经理。
--	--	--	--	--	--

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Mohammed Zaidi	投资组合经理	16	Mohammed Zaidi 是信安环球股票的基金经理。他在新加坡办公，担任全球新兴市场股票策略的共同基金经理及新兴亚洲股票策略负责人。Mohammed 的职业生涯开始于1997年，在全球宏观对冲基金管理人 VZB Capital 担任新兴市场分析师及基金经理。他在2001年作为新兴市场股票分析师加入信安，专注于基础选股工作，并且是负责信安内部研发的全球研究平台（GRP）初始搭建的核心分析师之一。他专注于将 GRP 调整适用于新兴市场和亚洲股票。在2006年离开公司后，他曾经担任 Martin Currie 投资管理公司新兴市场基金经理和分析师。在那之前服务于该团队的前任雇主 Scottish Widows 投资合伙公司。他持有

			麻省理工学院斯隆管理学院 MBA 学位，宾夕法尼亚大学沃顿学院经济学学士学位。
--	--	--	---

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年 1 季度基本面改善，货币政策转向驱动全球风险资产全面反弹，石油 1 季度反弹超过 32%。基本上全球央行集体鸽派发声，美联储停止加息，缩表年内暂停；中国央行降准，金融去杠杆边际宽松，社会融资规模企稳；中国等新兴市场国家 PMI 率先反弹，美国就业数据良好，核心通胀符合预期；中美贸易战不断缓和，英国“硬脱欧”风险逐步缓解；石油供给方面，OPEC 国家主要产油国沙特严格遵守限产协议，并在 1 季度不断减产，3 月份 OPEC 原油产量为 3040 万桶/日，为 2015 年以来新低，俄罗斯也表示将遵守去年 12 月份 OPEC+ 的减产协议。但由于美国钻井数量在 1 季度有所增加，原油产量处于近年高位，全球原油供需基本平衡。美元在 1 季度受益于美国经济基本面的相对强势基本维持稳定，对油价影响不大。

全球流动性和风险偏好改善行情处于后半场，未来油价和大宗商品走势将主要受全球经济基本面数据的确定性企稳影响。虽然美国经济数据良好，但其它发达国家经济领先指标仍未企稳；

中国 1 季度社融数据大超预期，但受季节性和短期票据、短期贷款影响较大，结构质量仍有待观察，因此我们预计在市场关注点重回经济基本面和企业盈利等数据。

2019 年 5 月份之后基本面指标恶化，货币政策保持宽松，新西兰、澳大利亚等央行降息，欧央行主席和美联储发言也相继宽松。但基本面数据疲软，加之 1 季度市场风险偏好上升较快，2 季度风险资产普遍出现回调。布伦特原油价格 2 季度下调接近 11%，最大调整幅度接近 20%；大宗商品受中国地产投资超预期、巴西淡水河谷矿难事故以及中国结构性去杠杆拉动一路走高；石油供给方面，OPEC 国家主要产油国沙特严格遵守限产协议，并最终延长减产协议至 2020 年 3 月，美国与伊朗的紧张关系进一步也对油价有所支撑；但全球需求不振，PMI 持续下行，主导了油价下跌。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 11.93%，波动率 0.81%，业绩比较基准收益率 14.04%，波动率 0.77%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面确定性放缓和风险偏好下修主导了 2 季度风险资产的走势。未来短期市场可能主要在宽松和经济数据变化之间震荡，中长期主要看美联储的宽松政策是否能够持续并有效遏制经济陷入衰退。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规及本基金基金合同中关于收益分配相关条款的规定，本基金本报告期末达到利润分配条件，未进行利润分配。

4.9 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

本报告期内，自2019年1月1日至2019年6月30日，本基金基金资产净值低于五千万元超过连续20个工作日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》（2014年8月8日生效）第四十一条的要求，现将该情况在本次报告中予以披露。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对建信全球资源混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金

融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信全球资源混合型证券投资基金

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：			
银行存款		4,901,082.18	4,850,167.23
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		20,190,366.82	20,699,845.17
其中：股票投资		18,243,132.25	19,036,786.81
基金投资		1,947,234.57	1,663,058.36
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		-	-
应收利息		97.96	587.21
应收股利		69,174.12	42,007.29
应收申购款		9,030.62	19,367.64
递延所得税资产		-	-
其他资产		687,470.00	-
资产总计		25,857,221.70	25,611,974.54
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		113,266.11	104,455.23
应付管理人报酬		34,890.71	35,374.50
应付托管费		6,784.29	6,878.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		-	-

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		203,809.27	602,441.13
负债合计		358,750.38	749,149.26
所有者权益：			
实收基金		28,608,055.80	31,232,079.78
未分配利润		-3,109,584.48	-6,369,254.50
所有者权益合计		25,498,471.32	24,862,825.28
负债和所有者权益总计		25,857,221.70	25,611,974.54

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.891 元，基金份额总额 28,608,055.80 份。

6.2 利润表

会计主体：建信全球资源混合型证券投资基金

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 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		3,371,409.57	979,160.59
1. 利息收入		6,032.65	5,797.76
其中：存款利息收入		6,032.65	5,797.76
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）		845,357.36	170,456.51
其中：股票投资收益		260,723.62	-280,691.24
基金投资收益		29,666.89	16,728.52
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		554,966.85	434,419.23
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		2,498,130.89	802,629.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		17,830.06	-4,868.66
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		4,058.61	5,145.44
减：二、费用		458,842.69	460,461.06

1. 管理人报酬		234,134.73	234,749.23
2. 托管费		45,526.13	45,645.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		2,586.35	7,837.82
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		176,595.48	172,228.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,912,566.88	518,699.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,912,566.88	518,699.53

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信全球资源混合型证券投资基金

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 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）	31,232,079.78	-6,369,254.50	24,862,825.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	2,912,566.88	2,912,566.88
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）	-2,624,023.98	347,103.14	-2,276,920.84
其中：1. 基金申购款	1,499,896.62	-219,822.83	1,280,073.79
2. 基金赎回款	-4,123,920.60	566,925.97	-3,556,994.63
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)	28,608,055.80	-3,109,584.48	25,498,471.32
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)	29,055,968.49	-3,230,530.32	25,825,438.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	518,699.53	518,699.53
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)	1,389,236.86	-88,532.10	1,300,704.76
其中: 1. 基金申购款	7,276,495.14	-759,931.15	6,516,563.99
2. 基金赎回款	-5,887,258.28	671,399.05	-5,215,859.23
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)	30,445,205.35	-2,800,362.89	27,644,842.46

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

建信全球资源混合型证券投资基金(原名为建信全球资源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[2012]322号《关于核准建信全球资源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依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《建信全

球资源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 498,213,122.75 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(2012)第 211 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信全球资源股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 498,237,044.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 23,921.75 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为摩根大通银行香港分行(JP Morgan Chase Bank, National Association, HongKong Branch)，境外投资顾问为信安环球投资有限公司(Principal Global Investors, LLC.)。根据建信基金于 2012 年 10 月 17 日发布的公告及中国银行股份有限公司托管及投资者服务部《关于变更建信全球资源混合型基金境外托管人的函》(中银托(函)[2012]81 号)，中国银行股份有限公司决定自 2012 年 10 月 15 日起将本基金的境外托管人由摩根大通银行香港分行(JP Morgan Chase Bank, National Association, HongKong Branch)变更为德意志银行新加坡分行(Deutsche Bank AG, Singapore Branch)。根据建信基金于 2018 年 8 月 14 日发布的公告及中国银行股份有限公司托管业务部《关于变更建信全球资源混合型基金境外托管人的函》(中银托(函)[2018]213 号)，中国银行股份有限公司决定自 2018 年 8 月 10 日起将本基金的境外托管人由德意志银行新加坡分行(Deutsche Bank AG, Singapore Branch)变更为中国银行(香港)有限公司。根据建信基金于 2019 年 3 月 16 日发布的公告及中国银行股份有限公司托管业务部《关于变更建信全球资源混合型基金境外托管人的函》(中银托(函)[2019]54 号)，中国银行股份有限公司决定自 2019 年 3 月 13 日起将本基金的境外托管人由中国银行(香港)有限公司变更为布朗兄弟哈里曼银行。

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》，建信全球资源股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 8 日公告后更名为建信全球资源混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信全球资源混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括股票和其他权益类证券、现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具。其中，股票及其他权益类证券包括普通股、优先股、存托凭证、公募股票型基金等；现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具，中长期政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币市场基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券，以及中国证监会认可的金融衍生产品等。本基金为混合型基金，投资于股票的比例不低于

基金资产的 60%，现金和到期日在一年以内的政府债券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，股票资产中投资于资源类相关行业的比例不低于 80%。本基金的业绩比较基准为 $50\% \times \text{MSCI 全球能源行业净总收益指数收益率 (MSCI ACWI Energy Net Total Return Index)} + 50\% \times \text{MSCI 全球原材料行业净总收益指数收益率 (MSCI ACWI Material Net Total Return Index)}$ 。

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》、《建信全球资源混合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。

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 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]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》及其他相关境内外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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 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
布朗兄弟哈里曼银行 (Brown Brothers Harriman & Co.)	境外资产托管人
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、注册登记机构
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
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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
信安环球投资有限公司 (Principal Global Investors, LLC.) (“信安环球”)	境外投资顾问

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 债券交易

无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

无。

6.4.8.1.4 基金交易

无。

6.4.8.1.5 权证交易

无。

6.4.8.1.6 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	234,134.73	234,749.23
其中：支付销售机构的客户维护费	29,845.52	26,088.96

注：1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金

资产净值 1.80%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的管理人报酬,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=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 X 1.80%/ 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	45,526.13	45,645.80

注:支付基金托管人中国银行的托管费按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 0.35%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的托管费,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 X 0.35%/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（2012年6月26日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	17,454,372.30	17,454,372.30
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	17,454,372.30	17,454,372.30
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	61.01%	57.33%

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
中国银行	218,553.15	6,032.65	2,414,903.89	5,797.76
德意志银行新加坡分行	-	-	1,688,368.19	-
布朗兄弟哈里曼银行	4,682,529.03	-	-	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，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

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

无。

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 20,190,366.82 元，无属于第二层次或第三层次的余额（2018 年 06 月 30 日：第一层次 24,346,676.00 元，无第二层次或第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 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	18,243,132.25	70.55
	其中：普通股	10,207,207.17	39.48
	存托凭证	8,035,925.08	31.08
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	1,947,234.57	7.53
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	4,901,082.18	18.95
8	其他各项资产	765,772.70	2.96
9	合计	25,857,221.70	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	15,861,021.77	62.20
中国香港	2,382,110.48	9.34
合计	18,243,132.25	71.55

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
材料	8,908,867.08	34.94
能源	9,334,265.17	36.61
合计	18,243,132.25	71.55

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名	证券代码	所在证	所属国	数量(股)	公允价值	占基金
----	----------	-----	------	-----	-----	-------	------	-----

		称 (中文)		券 市 场	家 (地 区)			资 产 净 值 比 例 (%)
1	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	US30231G1022	纽约证券交易所	美国	2,368	1,247,481.96	4.89
2	ASIA CEMENT CHINA HOLDINGS	亚洲水泥(中国)	KYG0539C1069	香港联合交易所	中国香港	109,500	1,207,887.54	4.74
3	CHEVRON CORP	雪佛龙	US1667641005	纽约证券交易所	美国	885	757,106.59	2.97
4	BP PLC-SPONS ADR	碧辟公司	US0556221044	纽约证券交易所	美国	2,505	718,120.85	2.82
5	TOTAL SA-SPON ADR	道达尔	US89151E1091	纽约证券交易所	美国	1,832	702,644.39	2.76

				所				
6	ROYAL DUTCH SHELL-SPON ADR-B	荷兰 皇家 壳牌	US78025910 70	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,416	639,950.97	2.5 1
7	ANGLO AMERICAN PLC-SPON S ADR	英 美 公 司	US03485P30 01	美 国 证 券 交 易 所	美 国	6,164	605,124.29	2.3 7
8	MARATHON PETROLEUM CORP	马 拉 松 石 油 公 司	US56585A10 25	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,570	603,128.43	2.3 7
9	BASF SE-SPON ADR	巴 斯 夫 欧 洲 公 司	US05526250 57	美 国 证 券 交 易 所	美 国	4,600	577,131.07	2.2 6
10	FORTESCUE METALS-SPON A DR	FMG 集 团	US34959A20 69	美 国 证 券 交 易 所	美 国	6,518	569,078.04	2.2 3

注：1、所有证券代码采用 ISIN 码。

2、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站 www.ccbfund.cn 的

半年报报告正文。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注:无。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位: 人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	EXXON MOBIL CORP	US30231G1022	232,735.57	0.94
2	ASIA CEMENT CHINA HOLDINGS	KYG0539C1069	168,424.57	0.68
3	BP PLC-SPONS ADR	US0556221044	136,672.67	0.55
4	CHEVRON CORP	US1667641005	136,300.07	0.55
5	TOTAL SA-SPON ADR	US89151E1091	128,685.60	0.52
6	ROYAL DUTCH SHELL-SPON ADR-B	US7802591070	120,074.05	0.48
7	BASF SE-SPON ADR	US0552625057	104,551.72	0.42
8	MARATHON PETROLEUM CORP	US56585A1025	104,512.32	0.42
9	ROYAL DUTCH SHELL-SPON ADR-A	US7802592060	103,852.58	0.42
10	ANGLO AMERICAN PLC-SPONS ADR	US03485P3001	100,660.63	0.40
11	FORTESCUE METALS-SPON ADR	US34959A2069	98,007.84	0.39
12	YANZHOU COAL MINING CO-H	CNE1000004Q8	92,552.78	0.37
13	RIO TINTO PLC-SPON ADR	US7672041008	90,974.31	0.37
14	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	CNE1000002Q2	88,619.60	0.36
15	LYONDELLBASELL INDU-CL A	NL0009434992	86,966.06	0.35
16	LUKOIL PJSC-SPON ADR	US69343P1057	84,240.50	0.34
17	VALERO ENERGY CORP	US91913Y1001	78,784.45	0.32
18	VALE SA-SP ADR	US91912E1055	78,299.64	0.31
19	PACKAGING CORP OF AMERICA	US6951561090	73,630.53	0.30
20	TECK RESOURCES	CA8787422044	73,036.62	0.29

	LTD-CLS B			
--	-----------	--	--	--

注:1、卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	-
卖出收入(成交)总额	3,301,179.69

注: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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

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

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	ISHARES CORE S&P 500 ETF	ETF 基金	交易型开放式指数	BlackRock Fund Advisors	1,823,686.04	7.15
2	ISHARES GLOBAL MATERIALS	ET	交	BlackRock Fund Advisors	42,570.82	0.17

	ETF	F 基金	易 型 开 放 式 指 数	rs		
3	ISHARES GLOBAL ENERGY ETF	ET F 基金	交 易 型 开 放 式 指 数	BlackRock Fund Adviso rs	41,742.42	0.16
4	ISHARES MSCI CHINA ETF	ET F 基金	交 易 型 开 放 式 指 数	BlackRock Fund Adviso rs	39,235.29	0.15

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	69,174.12
4	应收利息	97.96
5	应收申购款	9,030.62
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	687,470.00

9	合计	765,772.70
---	----	------------

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 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 (%)
1,540	18,576.66	17,454,372.30	61.01	11,153,683.50	38.99

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

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

基金合同生效日（2012年6月26日） 基金份额总额	498,237,044.50
本报告期期初基金份额总额	31,232,079.78
本报告期基金总申购份额	1,499,896.62
减：本报告期基金总赎回份额	4,123,920.60
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	28,608,055.80

§ 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。

2019年5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	
GOLDMAN SACH-ASIA PROGRAM		2,176,881.46	65.97%	800.80	39.56%	-
CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM		216,003.72	6.55%	108.06	5.34%	-
UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM		557,689.34	16.90%	279.04	13.79%	-
MERRILL LYNCH-ASIA PROGRAM		349,389.77	10.59%	836.31	41.32%	-
BANK OF NEW YORK		-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC		-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC-ASIA		-	-	-	-	-
BLOOMBERG TRADEBOOK-ASIA CREDIT		-	-	-	-	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC		-	-	-	-	-
CIMB-ASIA PROGRAM		-	-	-	-	-
CITIGROUP-ASIA ALGO		-	-	-	-	-
CITIGROUP-PROGRAM		-	-	-	-	-
CONVERGEX-ALGORITHMS		-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC-ASIA		-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE		-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE -ASIA		-	-	-	-	-
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.		-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK-ALGORITHMS		-	-	-	-	-

FIDELITY-ALGORITHMS		-	-	-	-	-
FOX RIVER(SUNGARD)		-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS&CO., INC		-	-	-	-	-
HOWARD WEIL LABOUISSSE FRIEDRICH INC		-	-	-	-	-
HSBC INC		-	-	-	-	-
HSBC INC-ASIA		-	-	-	-	-
ING BANK		-	-	-	-	-
INSTINET CORP, ASIA		-	-	-	-	-
ISI GROUP -PROGRAM		-	-	-	-	-
ITG-ASIA		-	-	-	-	-
ITG-CSA		-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO, INC-ASIA		-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO., INC		-	-	-	-	-
JP MORGAN -ASIA PROGRAMS		-	-	-	-	-
JP MORGAN SECURITIES, INC		-	-	-	-	-
KNIGHT SECURITIES		-	-	-	-	-
LIQUIDNET		-	-	-	-	-
LONGBOW SECURITIES, LLC		-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPITAL		-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPITAL-PROGRAM		-	-	-	-	-
MACQUARIE-ASIA ALOGRITHMS		-	-	-	-	-
MAQUARIE-ASIA PROGRAMS		-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH		-	-	-	-	-
MIZUHO		-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY		-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY-ALGORITHMS		-	-	-	-	-
NOMURA-PROGRAMS		-	-	-	-	-
RBC CAPITAL MARKETS-ALGORITHMS		-	-	-	-	-

SANFORD	BERNSTEIN-ALGORITHMS		-	-	-	-	-
SANFORD	BERNSTEIN-ASIA		-	-	-	-	-
STEPHENS, INC.			-	-	-	-	-
STIFEL	NICOLAUS -PROGRAM		-	-	-	-	-
UBS	ALGORITHMS		-	-	-	-	-
UBS	SECURITIES-ASIA PROGRAM		-	-	-	-	-
WELLS	FARGO SECURITIES ,LLC		-	-	-	-	-
中信证券			-	-	-	-	-

注:1、本基金管理人制定了服务券商的选择标准,具体如下:

(1) 交易执行能力:能够公平对待所有客户,实现最佳价格成交,可靠、诚信、及时成交,具备充分流动性,交易差错少等;

(2) 研究支持服务:能够针对本基金业务需要,提供高质量的研究报告和较为全面的服务,包括举办推介会、拜访公司、及时沟通市场情况、承接专项研究、协助交易评价等;

(3) 财务实力:净资产、总市值、受托资产等指标处于行业前列,或具有明显的安全边际;

(4) 后台便利性和可靠性:交易和清算支持多种方案,软件再开发的能力强,系统稳定安全等;

(5) 组织框架和业务构成:具有战略规划和定位,能够积极推动多边业务合作,最大限度地调动整体资源,为基金投资赢取机会;

(6) 其他有利于基金份额持有人利益的商业合作考虑。

海外投资部在根据以上标准进行评估后并结合海外投资顾问提供的建议,列出券商名单报海外投资决策委员会最终确定。

2、券商的服务评价

(1) 海外投资部每半年组织“服务总结”及评分。

(2) 若券商提供的研究报告及其他信息服务不符合要求,经海外投资决策委员会批准,公司将提前终止租用其交易席位。

3、本报告期内新增的服务券商 GOLDMAN SACH-ASIA PROGRAM、CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM、UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM,本报告期无剔除的服务券商。

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	债券回购	权证交易	基金交易
------	-----	------	------	------

	易		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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
GOLDMAN SACH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	491,467.11	45.52%
CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	588,230.99	54.48%
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
BLOOMBERG TRADEBOOK-ASIA CREDIT	-	-	-	-	-	-	-	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC	-	-	-	-	-	-	-	-
CIMB-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP-ASIA ALGO	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
CONVERGEX-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE -ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
FIDELITY-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
FOX RIVER (SUNGARD)	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS&CO., INC	-	-	-	-	-	-	-	-
HOWARD WEIL LABOUISSIE FRIEDRICHS INC	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC INC	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC INC-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
ING BANK	-	-	-	-	-	-	-	-

INSTINET CORP, ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
ISI GROUP -PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG-CSA	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO, INC-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO., INC	-	-	-	-	-	-	-	-
JP MORGAN -ASIA PROGRAMS	-	-	-	-	-	-	-	-
JP MORGAN SECURITIES, INC	-	-	-	-	-	-	-	-
KNIGHT SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-	-	-
Longbow SECURITIES, LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPITAL	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPITAL-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE-ASIA ALOGRITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
MAQUARIE-ASIA PROGRAMS	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	-	-
MIZUHO	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA-PROGRAMS	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC CAPITAL MARKETS-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
STEPHENS, INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
STIFEL NICOLAUS -PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
WELLS FARGO SECURITIES, LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

投 资	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金 情况
--------	----------------	----------------

者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2019 年 01 月 01 日-2019 年 06 月 30 日	17,454,372.30	0.00	0.00	17,454,372.30	61.01
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况,可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险,敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制,持续做好基金流动性风险的管控工作,审慎评估大额申赎对基金运作的影响,采取有效措施切实保护持有人合法权益。							

建信基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 29 日