建信内生动力混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018年8月25日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23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2018年1月1日起至6月30日止。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信内生动力混合
基金主代码	530011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月16日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	249,475,961.23份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略,重点投资于消费性内生动力行业、投资性内生动力行业、服务性内生动力行业中具有持续竞争力优势的上市公司股票,力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为:75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴剑明	郭明
	联系电话	010-66228888	(010)66105798
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	(010)66105799

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(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	22,002,139.11
本期利润	-35,095,135.18
加权平均基金份额本期利润	-0.1407
本期基金份额净值增长率	-9.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.4252
期末基金资产净值	355,562,475.66
期末基金份额净值	1.425

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.05%	1.61%	-5.53%	0.96%	-1.52%	0.65%
过去三个月	-3.59%	1.35%	-6.85%	0.85%	3.26%	0.50%
过去六个月	-9.11%	1.31%	-8.60%	0.86%	-0.51%	0.45%
过去一年	7.15%	1.21%	-1.95%	0.71%	9.10%	0.50%
过去三年	-5.41%	1.48%	-13.13%	1.12%	7.72%	0.36%
自基金合同生效起至今	68.87%	1.31%	16.78%	1.09%	52.09%	0.22%

本基金投资业绩比较基准为:75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。其中:沪深300指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准,中国债券总指数收益率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。

沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数,它是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。指数样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值。成份股为市场中市场代表性好,流动性高,交易活跃的主流投资股票,能够反映市场主流投资的收益情况。中债系列指数由一个总指数(即中国债券总指数),若干个分指数构成。中国债券总指数是全样本债券指数,包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券(如交易所和银行间国债、银行间金融债券等),理论上能客观反映中国债券总体情况。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§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、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部,以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心,并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观,恪守“持有人利益重于泰山”的原则,以“建设财富生活”为崇高使命,坚持规范运作,致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至2018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、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、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、建信目标收益一年期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、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、建信鑫利回报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、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、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,共计101只开放式基金,管理的基金净资产规模共计为6,342.88亿元。

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		
吴尚伟	权益投资部联席投资官、本基金的基金经理	2014年11月25日	-	12	硕士,权益投资部联席投资官。2004年9月至2007年4月任长城伟业期货经纪有限公司深圳分公司投资顾问;2006年8月至2011年7月任银华基金管理公司研究员;2011年7月加入我公司,历任研究员、研究主管、研究部总助理兼权益投资部基金经理兼研究部总经理助理,权益投资部基金经理,权益投资部联席投资官,2014年11月25日起任建信内生动力混合型证券投资基金的基金经理;2016年9月29日起任建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。该基金于2018年2月28日起改名为建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金。吴尚伟继续担任该基金的基金经理;2017年1月24日起任建信稳价值混合型证券投资基金的基金经理;2018年1月30日起任建信安心保本五号混合型证券投资基金的基金经理。该基金于2018年2月6日起转型为建信弘利灵活配置混合型证券投资基金,吴尚伟继续担任该基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 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

回顾2018年上半年宏观经济表现,总体继续保持稳中向好的态势,增速小幅回落。上半年实现国内生产总值418961亿元,同比增长6.8%,比17年同期小幅回落0.1个百分点。内需对于经济拉动的作用不断提高,其中最终消费支出对GDP增长的贡献率为78.5%,表明消费已经是拉动我国经济增长的最重要引擎;投资受到基建投资增速下滑的影响对经济的拉动有所减弱;受到贸易摩擦等因素影响,净出口对于GDP增长的贡献由正转负。整体看,虽然上半年外部环境不确定性增多,国内处于新旧动能转换的过程中,但是国民经济总体仍保持较为平稳增长态势。

上半年物价水平总体运行平稳,CPI温和上涨 ,PPI稳中有涨。上半年, 全国CPI上涨2.0%,涨幅比去年同期扩大0.6个百分点。食品价格涨幅相对较低为居民消费价格总体平稳奠定了良好的基础,非食品项中油价和服务项向上拉动较为明显。工业品价格指数上半年同比增长3.9%,涨幅比去年同期回落2.7个百分点,受国内供给侧改革和国际原油等大宗商品价格回升影响, 重要生产资料价格如石油和钢铁等多数呈现上涨态势。

上半年货币政策维持了稳健中性的主基调,同时更加强调灵活适度。从货币操作上看,上半年人民银行又进行了两次定向降准操作,4月份央行进行置换MLF的定向降准操作并多投放流动性4000亿元,6月下旬央行再次针对债转股和小微贷款进行定向降准操作,整体来看上半年资金面情况较为平稳,资金利率多数时间维持在较低水平。政策利率上看, 美联储在3月进行2018年来首次联邦基金利率加息,人民银行紧跟着对逆回购利率加息5BP,而联储在6月中旬进行的第二次加息后,央行则根据国内情况并没有进行跟随式加息。此外上半年人民银行和银保监会陆续颁布了《资管新规》正式稿和《理财新规(征求意见稿)》等重要监管文件,并结合实体经济情况做出补充意见,以保证政策过渡期内市场和经济的平稳运行。上半年人民币兑美元贬值程度较大, 中间价从年初的6.5342贬值到二季度末的6.6166,且贬值预期有所加强。

今年以来股票市场表现低迷, 各市场指数均录得负涨幅, 其中上证综指下跌13.90%,沪深300指数下跌12.90%,创业板指数下跌8.33%。从板块和风格轮动看,今年以来的市场呈现出典型的后周期特征。年初以地产、金融为代表的价值板块表现最佳;2-3月,医药、信息技术等成长性较高的行业反弹,带动创业板取得阶段性收益;4-6月,消费、医药等后周期行业持续取得超额收益。整体来看,行业绝对收益的持续性不强,后周期、防御板块相对占优,仅医药、食品饮料、旅游板块取得正收益。

上半年市场下跌的影响因素较多,全球经济复苏力度减弱,各国进入加息周期是大的外部环境;就我们国内而言,去杠杆过程带来的信用紧缩导致流动性压力,对贸易摩擦的担忧也越发显著,股票市场的风险偏好有所下行,这些都直接或者间接影响了二级市场表现。

在市场下跌过程中, 主流赛道上的优质公司取得较好的超额收益, 行业空间大、增长趋势明确、业绩可预测性强的个股被给予估值溢价,立足于产业β基础上的优质α成为核心选股思路,这与2017年大市值个股普涨的主线有所不同。

本基金长期聚焦在具有持续内生增长的行业与公司, 主要聚焦在了消费品行业,包括食品饮料、医药、轻工等板块,少数板块上综合考虑了潜在收益空间和未来景气度的变化,同时该公司的估值水平与增长速度基本匹配。回顾上半年,本基金保持了中高仓位,核心配置在食品饮料、轻工制造、商业服装等消费类行业,看好消费升级的背景下,品牌消费品通过渠道下沉和产品创新带来的收入利润持续增长;同时基于对产业升级和进口替代的判断,本基金也配置了半导体、创新药、电子化学品、光伏等方向。回顾上半年的失误,我们配置的部分股票因短期经营的低于预期或者产业政策的剧烈变化出现一定程度调整,给净值带来较大损失;同时上半年组合对医药行业的配置偏低,也影响了净值表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-9.11%, 波动率1.31%, 业绩比较基准收益率-8.6%,波动率0.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济短周期处于下行中继,企业盈利承压。宏观经济趋于疲软在2018年上半年的部分数据中已经有所表现,基建投资下行较多,房地产投资增速乏力,消费数据在6月份超预期下滑,短周期经济运行压力增大成为市场的一致预期。从宏观经济向微观企业利润的传导普遍有1-2个季度的时滞, 这意味着当前企业利润增速处于顶部区间。

我们预计在经济进入可能的衰退时,往往会出现宏观政策的对冲。面对贸易摩擦及去杠杆过程的冲击, 保持就业的稳定越来越重要, 宏观政策已经做出部分调整,政策组合向“紧信用、松货币、宽财政”转变,有助于防范局部危机的发生,实现平稳去杠杆。我们预计在政策的微调下,下半年经济将不会出现重大风险,且有助于改善目前悲观的增长预期。

估值层面,目前A股估值已经跌至几次历史低点附近,而且与债券比较股票市场的收益率已经具备足够吸引力。

综上,我们对下半年的市场保持谨慎乐观,看好经济预期改善带来的低估值蓝筹估值修复,保持对未来空间较大的消费品板块的关注。组合将继续持有估值与成长基本匹配的稳健类投资品种,并主动参与结构性机会,尽力为基金持有人创造回报。

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、风险管理部和资产核算部门负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的基金管理人于2018年1月18日宣告2018年度第1次分红, 向截至2018年1月19日止在本基金注册登记人建信基金管理有限责任公司登记在册的全体持有人,按每10份基金份额派发红利0.628元,收益分配基准日为2017年12月31日,共发放红利人民币元15,399,927.72(包含现金和红利再投资形式)。

§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, 本基金托管人在对建信内生动力混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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, 建信内生动力混合型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信内生动力混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内, 建信内生动力混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为15,399,927.72元。

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

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信内生动力混合型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:建信内生动力混合型证券投资基金
报告截止日: 2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		109,378,989.43	59,493,695.74
结算备付金		1,776,575.39	1,279,934.05
存出保证金		263,454.87	219,291.39
交易性金融资产		248,955,047.06	354,207,735.90
其中:股票投资		248,955,047.06	354,207,735.90
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		-	25,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		18,663.00	9,896.98
应收股利		-	-
应收申购款		143,527.71	436,117.81
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		360,536,257.46	440,646,671.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	32,269,917.71
应付赎回款		179,478.91	316,495.52
应付管理人报酬		455,262.86	502,144.45
应付托管费		75,877.13	83,690.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		4,030,104.45	3,385,774.38
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		233,058.45	438,130.84
负债合计		4,973,781.80	36,996,153.63
所有者权益:			
实收基金		249,475,961.23	247,913,018.85
未分配利润		106,086,514.43	155,737,499.39
所有者权益合计		355,562,475.66	403,650,518.24
负债和所有者权益总计		360,536,257.46	440,646,671.87

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.425元,基金份额总额249,475,961.23份。

6.2 利润表

会计主体:建信内生动力混合型证券投资基金
本报告期: 2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-28,767,171.47	41,532,639.18
1.利息收入		328,802.91	298,241.96
其中:存款利息收入		244,655.99	238,808.26
债券利息收入		1,335.95	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		82,810.97	59,433.69
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		27,971,982.03	8,907,572.69
其中:股票投资收益		25,654,106.07	7,193,965.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-206,597.02	-
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		2,524,472.98	1,713,607.61
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-57,097,274.29	32,295,966.69
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		29,317.88	30,857.85
减:二、费用		6,327,963.71	5,712,777.22
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	2,833,658.38	2,666,948.51
2. 托管费	6.4.8.2.2	472,276.40	444,491.43
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		2,814,158.16	2,401,560.79
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		4.80	-
7. 其他费用		207,865.97	199,786.49
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-35,095,135.18	35,819,861.96
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-35,095,135.18	35,819,861.96

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信内生动力混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	247,913,018.85	155,737,499.39	403,650,518.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-35,095,135.18	-35,095,135.18
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)	1,562,942.38	844,077.94	2,407,020.32
其中:1.基金申购款	27,825,741.33	15,565,112.00	43,390,853.33
2.基金赎回款	-26,262,798.95	-14,721,034.06	-40,983,833.01
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)	-	-15,399,927.72	-15,399,927.72
五、期末所有者权益(基金净值)	249,475,961.23	106,086,514.43	355,562,475.66
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	319,967,477.03	79,001,602.68	398,969,079.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	35,819,861.96	35,819,861.96
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)	-63,976,061.12	-17,362,008.47	-81,338,069.59
其中:1.基金申购款	4,372,007.85	1,339,303.78	5,711,311.63
2.基金赎回款	-68,348,068.97	-18,701,312.25	-87,049,381.22
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)	255,991,415.91	97,459,456.17	353,450,872.08

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

建信内生动力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[2010]第1206号《关于核准建信内生动力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》和《建信内生动力股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自2010年10月20日至2010年11月12日止,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5,387,627,567.80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(2010)第299号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信内生动力股票型证券投资基金基金合同》于2010年11月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,388,220,664.00份基金份额,其中认购资金利息折合593,096.20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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信内生动力股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市交易的股票、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为:投资于股票的基金资产占基金资产比例为60%-95%,其中投资于内生动力行业(包括消费性内生动力行业、投资性内生动力行业和服务性内生动力行业)的基金资产占投资于股票的基金资产的比例不低于80%;现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-40%,其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,资产支持证券占基金资产净值的比例为0-20%,权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率 X 75% + 中国债券总指数收益率 X 25%。

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》、《建信内生动力混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品期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。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

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

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

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

6.4.7 关联方关系

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

本报告期,存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2