

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资 基金 2019 年半年度报告

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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

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。

基金托管人上海浦东发展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。

目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	10
2.1 基金基本情况.....	10
2.2 基金产品说明.....	10
2.3 基金管理人和基金托管人.....	11
2.4 信息披露方式.....	11
2.5 其他相关资料.....	11
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	11
3.1 主要会计数据和财务指标.....	11
3.2 基金净值表现.....	12
§ 4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	22
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	57
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.....	57
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.....	57

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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	58
§ 8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	59
§ 9 开放式基金份额变动.....	60
§ 10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
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.....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§ 12 备查文件目录.....	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	建信中证 1000 指数增强	
基金主代码	006165	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 22 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	36,119,649.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 A	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 C
下属分级基金的交易代码	006165	006166
报告期末下属分级基金的份额总额	26,757,791.44 份	9,361,858.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 1000 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。</p> <p>本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

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		上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	胡波
	联系电话	010-66228888	021-61618888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话	400-81-95533 010-66228000		95528
传真	010-66228001		021-63602540
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		上海市中山东一路 12 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		上海市北京东路 689 号
邮政编码	100033		200001
法定代表人	孙志晨		高国富

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

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(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 A	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 C
本期已实现收益	4,126,907.20	1,476,777.25
本期利润	4,056,725.48	1,162,720.26
加权平均基金份额本期利润	0.1834	0.1452
本期加权平均净值利润率	15.37%	12.12%
本期基金份额净值增长率	22.66%	22.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	期末可供分配利	2,080,624.40
	6,034,073.57	

润		
期末可供分配基金份额利润	0.2255	0.2222
期末基金资产净值	32,925,504.74	11,489,010.57
期末基金份额净值	1.2305	1.2272
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	23.05%	22.72%

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。

4、本基金基金合同于 2018 年 11 月 22 日生效,截至报告期末未满一年。

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

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 A

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	1.71%	1.42%	-0.22%	1.45%	1.93%	-0.03%
过去三个月	-4.55%	1.75%	-9.45%	1.84%	4.90%	-0.09%
过去六个月	22.66%	1.68%	19.16%	1.80%	3.50%	-0.12%
自基金合同生	23.05%	1.52%	9.42%	1.73%	13.63%	-0.21%

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 C

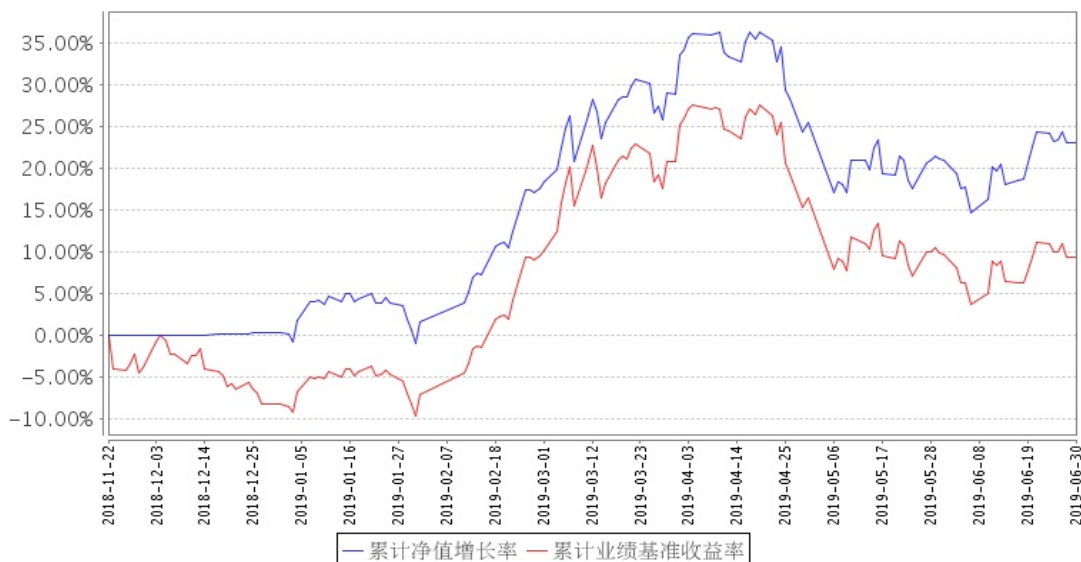
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.69%	1.42%	-0.22%	1.45%	1.91%	-0.03%
过去三个月	-4.52%	1.75%	-9.45%	1.84%	4.93%	-0.09%

过去六个月	22.63%	1.68%	19.16%	1.80%	3.47%	-0.12%
自基金合同生	22.72%	1.52%	9.42%	1.73%	13.30%	-0.21%

注:本基金业绩比较基准为: 中证 1000 指数收益率 \times 95%+银行活期存款税后利率 \times 5%

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

建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金A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



建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金C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:本基金基金合同于 2018 年 11 月 22 日生效,截至报告期末未满一年。本基金建仓期为 6 个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§ 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 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、投资风险管理部门和内控合规部，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		
赵云煜	本基金的基金经理	2018 年 11 月 22 日	-	6	赵云煜先生，硕士。2012 年 11 月加入太平资产管理有限公司，任风险管理分析师；2014 年 7 月加入建信基金，历任助理研究员、研究员、基金经理助理，2016 年 6 月 22 日至 2018 年 11 月 7 日任专户投资经理。2018 年 11 月 16 日起任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日起任建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
叶乐天	金融工程及指数投资部副总经理，本基金的基金经理	2018 年 11 月 22 日	-	11	叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理，硕士。2008 年 5 月至 2011 年 9 月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。2011 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理，2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 4 月 18 日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 22 日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 1 月 10 日起任建信鑫利回报灵活配置混

					合型证券投资基金的基金经理；2018 年 8 月 24 日起任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日起任建信中证 1000 指数增强型发起式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

报告期间，本基金逐步完成了建仓并平稳开展投资运作。本基金的目标是指数增强，主要采用以建信多因子模型为主的量化选股模型进行个股选择，同时使用风险模型严格管理股票组合和基准之间的相对风险。报告期间，权益市场波动较为显著，一季度有明显上行，而后下跌盘整。总体来说，基金组合与基准指数基本保持了行业和风格配置的中性，较好地控制了基金的跟踪误差。同时，本基金超越了基准，获取了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 22.66%，波动率 1.68%，本报告期本基金 C 净值增长率 22.63%，波动率 1.68%；业绩比较基准收益率 19.16%，波动率 1.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年，权益市场整体上行，估值有所修复，但经历了较为明显的波动。细分来看，一季度市场快速反弹，二季度震荡调整；风格层面，大市值股票表现优于小市值，部分消费行业表现强劲。下半年，不论是内部增长还是外部环境都仍面临持续的磨合。于内，经济暂未走出弱势；于外，全球经济增长压力增大，贸易争端仍需进展。展望下半年，基本面仍是最为主要的因素，流动性和政策面的变化值得持续关注。股票市场预期将继续保持较大的区间震荡。本基金将密切跟踪市场动态，持续提升模型的效果，精选个券，谨慎管理组合风险，力争为投资者提供稳健超越业绩基准的回报。

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、投资风险管理部门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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由建信基金管理有限公司编制本托管人复核的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：建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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	6.4.7.1	2,919,760.61	20,599,686.18
结算备付金		303,605.51	358,181.82
存出保证金		31,360.74	-

交易性金融资产	6.4.7.2	41,667,652.88	-
其中：股票投资		41,667,652.88	-
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	10,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,512.83	26,132.71
应收股利		-	-
应收申购款		105,424.92	35,169.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		45,029,317.49	31,019,170.11
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,440.20	-
应付赎回款		147,935.47	1,427,906.32
应付管理人报酬		35,752.47	73,282.65
应付托管费		7,150.50	14,656.53
应付销售服务费		3,810.58	14,029.44
应付交易费用	6.4.7.7	150,887.38	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	266,825.58	48,567.87
负债合计		614,802.18	1,578,442.81
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	36,119,649.76	29,370,128.89
未分配利润	6.4.7.10	8,294,865.55	70,598.41
所有者权益合计		44,414,515.31	29,440,727.30
负债和所有者权益总计		45,029,317.49	31,019,170.11

注：1、报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 36,119,649.76 份，其中建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 A 基金份额总额为 26,757,791.44 份，基金份额净值 1.2305 元；

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 C 基金份额总额为 9,361,858.32 份，基金份额净

值 1.2272 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 11 月 22 日(基金合同生效日)至 2019 年 06 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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
一、收入		6,113,498.39
1. 利息收入		30,464.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	26,688.76
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		3,775.35
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,406,360.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,077,876.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	328,484.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-384,238.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	60,912.06
减：二、费用		894,052.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	177,402.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	35,480.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	18,888.04
4. 交易费用	6.4.7.19	417,565.62
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	6.4.7.20	244,716.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,219,445.74
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,219,445.74

--	--	--

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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）	29,370,128.89	70,598.41	29,440,727.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,219,445.74	5,219,445.74
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）	6,749,520.87	3,004,821.40	9,754,342.27
其中：1. 基金申购款	38,255,965.01	8,369,691.13	46,625,656.14
2. 基金赎回款	-31,506,444.14	-5,364,869.73	-36,871,313.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	36,119,649.76	8,294,865.55	44,414,515.31

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

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金(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”)证监基金字[2018]1029 号《关于同意建信中证 1000 指数增强型发起式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《建信中证 1000 指数增强型发起式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 99,635,875.53 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(2018)第 0686 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金》于 2018 年 11 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 99,645,967.84 份基金份额,其中认购资金利息折合 10,092.31 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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 1000 指数增强型发起式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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、货币市场工具(含同业存单)、银行存款、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券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)。本基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%,投资于中证 1000 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例不低于 80%;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,现金或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。本基金业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 \times 95%+银行活期存款税后利率 \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信中证 1000 指数增

强型发起式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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

无。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 11 月 13 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 11 月 13 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于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、可交换债券、资产支持证

券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府

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

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

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

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

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

6.4.7 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,919,760.61
定期存款	-
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	-
合计	2,919,760.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	42,051,891.59	41,667,652.88	-384,238.71

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	42,051,891.59	41,667,652.88	-384,238.71

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,362.13
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	136.60
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	14.10
合计	1,512.83

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	150,887.38
银行间市场应付交易费用	-
合计	150,887.38

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	493.02
预提费用	256,332.56
应付指数使用费	10,000.00
合计	266,825.58

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 A

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	19,936,918.37	19,936,918.37
本期申购	23,324,783.46	23,324,783.46
本期赎回(以“-”号填列)	-16,503,910.39	-16,503,910.39
-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	26,757,791.44	26,757,791.44

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 C

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	9,433,210.52	9,433,210.52
本期申购	14,931,181.55	14,931,181.55
本期赎回(以“-”号填列)	-15,002,533.75	-15,002,533.75
-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	9,361,858.32	9,361,858.32

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

- 2、本基金自 2018 年 11 月 12 日至 2018 年 11 月 16 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 99,635,875.53 元，折合基金份额 99,635,875.53 份（其中 A 类基金份额 50,939,095.31 份，C 类基金份额 48,696,780.22 份）；《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 10,092.31 元在本基金成立后，折算为 10,092.31 份基金份额（其中 A 类基金份额 6,519.82 份，C 类基金份额 3,572.49 份），划入基金份额持有人账户。。
- 3、根据《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》和《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务的公告》的规定，本基金申购业务、赎回业务、转换业务、定期定额投资业务自 2018 年 12 月 24 日起开始办理。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	64,162.90	-	64,162.90
本期利润	4,126,907.20	-70,181.72	4,056,725.48
本期基金份额交易产生的变动数	1,843,003.47	203,821.45	2,046,824.92
其中：基金申购款	3,852,830.73	1,210,874.69	5,063,705.42
基金赎回款	-2,009,827.26	-1,007,053.24	-3,016,880.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,034,073.57	133,639.73	6,167,713.30
建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,435.51	-	6,435.51
本期利润	1,476,777.25	-314,056.99	1,162,720.26
本期基金份额交易产生的变动数	597,411.64	360,584.84	957,996.48

其中：基金申购款	2,464,302.36	841,683.35	3,305,985.71
基金赎回款	-1,866,890.72	-481,098.51	-2,347,989.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,080,624.40	46,527.85	2,127,152.25

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	23,067.46
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	3,453.76
其他	167.54
合计	26,688.76

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	147,312,658.04
减：卖出股票成本总额	141,234,781.18
买卖股票差价收入	6,077,876.86

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	328,484.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	328,484.07

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-384,238.71
股票投资	-384,238.71
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	-384,238.71

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	58,168.49
基金转换费收入	2,743.57
合计	60,912.06

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	417,565.62
银行间市场交易费用	-
合计	417,565.62

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	25,101.58
信息披露费	198,354.28
指数使用费	20,000.00
银行划款手续费	860.16
其他费用	400.00
合计	244,716.02

6.4.7.21 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
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金销售机构、基金托管人
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金销售机构、基金管理人的股东

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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	177,402.46
其中：支付销售机构的客户维护费	61,430.98

注：1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 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 X 1.00% / 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。

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	35,480.51

注：支付基金托管人上海浦东发展银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 X 0.2% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基	合计

	金 A	金 C	
建设银行	-	7,070.12	7,070.12
建信基金管理有限责任公司	-	229.19	229.19
浦发银行	-	517.03	517.03
合计	-	7,816.34	7,816.34

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给建信基金管理有限责任公司,再由建信基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.40%。销售服务费的计算公式为:日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.40%/当年天数;

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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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	本期 2019年1月1日至2019年 6月30日
	建信中证1000指数增强型发起式 证券投资基金A	建信中证1000指数增强型发 起式证券投资基金C
基金合同生效日(2018年 11月22日)持有的基金份 额	-	-
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	37.37%	-

注:分级持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行	2,919,760.61	23,067.46

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 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(2019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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新发未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.2 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。

6.4.13 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，将风险控制在此可承受的范围内。

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、由风险管理委员会、督察长、
内控合规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
督察长和内控合规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 2019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	2,919,760.61	-	-	-	2,919,760.61
结算备付金	303,605.51	-	-	-	303,605.51
存出保证金	31,360.74	-	-	-	31,360.74
交易性金融资产	-	-	-	41,667,652.88	41,667,652.88
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	-	-	-	1,512.83	1,512.83
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	105,424.92	105,424.92
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,254,726.86	-	-	41,774,590.63	45,029,317.49

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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,440.20	2,440.20
应付赎回款	-	-	-	147,935.47	147,935.47
应付管理人报酬	-	-	-	35,752.47	35,752.47
应付托管费	-	-	-	7,150.50	7,150.50
应付销售服务费	-	-	-	3,810.58	3,810.58
应付交易费用	-	-	-	150,887.38	150,887.38
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	266,825.58	266,825.58
负债总计	-	-	-	614,802.18	614,802.18
利率敏感度缺口	3,254,726.86	-	-	41,159,788.45	44,414,515.31
上年度末 2018 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	20,599,686.18	0.00			20,599,686.18
结算备付金	358,181.82				358,181.82
存出保证金	0.00				0.00
交易性金融资产				0.00	0.00
衍生金融资产					0.00
买入返售金融资产	10,000,000.00	0.00			10,000,000.00
应收证券清算款				0.00	0.00
应收利息				26,132.71	26,132.71
应收股利				0.00	0.00
应收申购款				35,169.40	35,169.40
其他资产				0.00	0.00
资产总计	30,957,868.00	0.00	0.00	61,302.11	31,019,170.11
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	0.00			0.00
短期借款					0.00
交易性金融负债					0.00
衍生金融负债					0.00
应付证券清算款				0.00	0.00
应付赎回款				1,427,906.32	1,427,906.32
应付管理人报酬				73,282.65	73,282.65
应付托管费				14,656.53	14,656.53
应付销售服务费				14,029.44	14,029.44
应付交易费用				0.00	0.00
应交税费				0.00	0.00

应付利息				0.00	0.00
应付利润				0.00	0.00
其他负债				48,567.87	48,567.87
负债总计	0.00	0.00	0.00	1,578,442.81	1,578,442.81
利率敏感度缺口	30,957,868.00	0.00	0.00	-1,517,140.70	29,440,727.30

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

注：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。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于中证 1000 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 80%；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，现金或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。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 2019年6月30日		上年度末 2018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	41,667,652.88	93.82	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	41,667,652.88	93.82	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	-	-
	业绩比较基准下降5%	-	-

注：于本期末，本基金成立不满一年，尚无足够经验数据。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 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 41,633,782.94 元，属于第二层次的余额为 33,869.94 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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。

(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。

§ 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	41,667,652.88	92.53
	其中：股票	41,667,652.88	92.53
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	3,223,366.12	7.16
8	其他各项资产	138,298.49	0.31
9	合计	45,029,317.49	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	249,326.00	0.56
B	采矿业	1,182,528.00	2.66
C	制造业	21,235,925.72	47.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,190,637.00	2.68
E	建筑业	797,569.00	1.80
F	批发和零售业	1,275,556.00	2.87
G	交通运输、仓储和邮政业	1,035,368.00	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,694,447.00	6.07
J	金融业	515,565.00	1.16
K	房地产业	2,009,574.92	4.52
L	租赁和商务服务业	190,508.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	132,430.00	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	878,859.15	1.98
Q	卫生和社会工作	662,690.00	1.49
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	113,408.00	0.26
	合计	34,164,391.79	76.92

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	27,956.25	0.06
C	制造业	4,591,654.22	10.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	333,467.00	0.75
E	建筑业	124,953.00	0.28
F	批发和零售业	362,847.00	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	205,443.00	0.46
H	住宿和餐饮业	544,887.00	1.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	373,287.68	0.84
J	金融业	55,357.94	0.12
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	94,922.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	9,534.00	0.02
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	778,952.00	1.75
S	综合	-	-
	合计	7,503,261.09	16.89

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	601666	平煤股份	181,800	759,924.00	1.71
2	000517	荣安地产	220,900	678,163.00	1.53
3	600661	昂立教育	25,005	585,867.15	1.32
4	603680	今创集团	36,800	578,496.00	1.30
5	300487	蓝晓科技	18,200	573,664.00	1.29
6	002651	利君股份	108,900	531,432.00	1.20
7	300219	鸿利智汇	70,200	518,076.00	1.17

8	603882	金域医学	14,600	500,780.00	1.13
9	002518	科士达	54,800	491,008.00	1.11
10	300020	银江股份	56,200	452,972.00	1.02
11	002267	陕天然气	53,600	438,984.00	0.99
12	601566	九牧王	34,500	425,040.00	0.96
13	000555	神州信息	36,900	419,922.00	0.95
14	300158	振东制药	75,900	411,378.00	0.93
15	603898	好莱客	24,800	410,192.00	0.92
16	300061	康旗股份	59,200	406,704.00	0.92
17	603989	艾华集团	21,000	396,480.00	0.89
18	603997	继峰股份	50,600	390,632.00	0.88
19	000631	顺发恒业	130,200	390,600.00	0.88
20	603555	贵人鸟	74,500	386,655.00	0.87
21	600720	祁连山	41,400	363,906.00	0.82
22	600278	东方创业	29,800	358,792.00	0.81
23	002911	佛燃股份	23,000	345,690.00	0.78
24	000810	创维数字	38,900	343,876.00	0.77
25	002658	雪迪龙	39,200	340,256.00	0.77
26	300100	双林股份	44,100	335,160.00	0.75
27	000936	华西股份	36,500	325,945.00	0.73
28	002351	漫步者	56,800	325,464.00	0.73
29	002534	杭锅股份	46,400	314,128.00	0.71
30	600728	佳都科技	31,400	309,290.00	0.70
31	603063	禾望电气	27,800	308,024.00	0.69
32	600180	瑞茂通	39,100	307,717.00	0.69
33	300367	东方网力	31,100	306,957.00	0.69
34	601375	中原证券	58,000	306,820.00	0.69
35	600261	阳光照明	82,200	301,674.00	0.68
36	002621	美吉姆	22,400	292,992.00	0.66
37	002543	万和电气	21,800	292,556.00	0.66
38	603979	金诚信	34,400	289,648.00	0.65
39	002577	雷柏科技	26,248	282,166.00	0.64
40	002204	大连重工	75,700	277,062.00	0.62
41	000828	东莞控股	30,100	276,017.00	0.62
42	600618	氯碱化工	34,900	274,314.00	0.62
43	300634	彩讯股份	12,600	273,042.00	0.61
44	000514	渝开发	56,586	272,744.52	0.61
45	002346	柘中股份	21,000	272,580.00	0.61
46	600764	中国海防	9,749	271,802.12	0.61
47	600012	皖通高速	41,500	262,695.00	0.59
48	002451	摩恩电气	25,900	259,777.00	0.58
49	600675	中华企业	49,440	256,593.60	0.58

50	000576	广东甘化	28,000	256,200.00	0.58
51	000059	华锦股份	39,200	250,880.00	0.56
52	600020	中原高速	46,100	242,025.00	0.54
53	600226	瀚叶股份	76,100	241,998.00	0.54
54	603718	海利生物	17,400	241,338.00	0.54
55	600283	钱江水利	21,300	236,430.00	0.53
56	002609	捷顺科技	29,000	233,160.00	0.52
57	002581	未名医药	34,500	232,530.00	0.52
58	002307	北新路桥	34,500	231,840.00	0.52
59	300502	新易盛	9,400	230,488.00	0.52
60	002467	二六三	37,400	229,636.00	0.52
61	000626	远大控股	27,300	229,320.00	0.52
62	603896	寿仙谷	6,100	226,920.00	0.51
63	300531	优博讯	12,600	221,256.00	0.50
64	002219	恒康医疗	71,900	217,857.00	0.49
65	603508	思维列控	3,300	214,764.00	0.48
66	603118	共进股份	22,100	204,646.00	0.46
67	300439	美康生物	13,800	202,998.00	0.46
68	600626	申达股份	29,200	199,728.00	0.45
69	300497	富祥股份	13,200	198,132.00	0.45
70	300447	全信股份	17,900	197,616.00	0.44
71	002568	百润股份	10,800	193,104.00	0.43
72	002226	江南化工	35,600	191,528.00	0.43
73	002135	东南网架	33,400	185,036.00	0.42
74	002261	拓维信息	29,400	179,634.00	0.40
75	603699	纽威股份	14,900	178,800.00	0.40
76	601789	宁波建工	43,100	178,434.00	0.40
77	600273	嘉化能源	15,400	178,024.00	0.40
78	002617	露笑科技	40,000	173,600.00	0.39
79	002429	兆驰股份	61,700	169,058.00	0.38
80	300347	泰格医药	2,100	161,910.00	0.36
81	603861	白云电器	16,100	161,000.00	0.36
82	000951	中国重汽	10,000	160,500.00	0.36
83	300114	中航电测	17,000	158,270.00	0.36
84	002197	证通电子	20,700	156,906.00	0.35
85	300034	钢研高纳	10,500	155,820.00	0.35
86	300353	东土科技	11,900	155,176.00	0.35
87	300068	南都电源	13,600	153,680.00	0.35
88	600517	置信电气	20,800	152,256.00	0.34
89	603707	健友股份	4,300	152,005.00	0.34
90	002099	海翔药业	21,100	149,810.00	0.34
91	600662	强生控股	28,400	148,816.00	0.34

92	000615	京汉股份	27,200	146,608.00	0.33
93	600310	桂东电力	28,500	144,495.00	0.33
94	002648	卫星石化	9,500	141,360.00	0.32
95	600331	宏达股份	43,400	139,314.00	0.31
96	000925	众合科技	19,600	139,160.00	0.31
97	000928	中钢国际	23,900	138,859.00	0.31
98	300511	雪榕生物	16,600	133,630.00	0.30
99	300355	蒙草生态	32,300	132,430.00	0.30
100	002605	姚记扑克	12,600	132,300.00	0.30
101	300128	锦富技术	32,600	129,096.00	0.29
102	000811	冰轮环境	14,400	127,152.00	0.29
103	300007	汉威科技	9,900	125,631.00	0.28
104	600621	华鑫股份	8,300	123,587.00	0.28
105	300292	吴通控股	19,700	118,200.00	0.27
106	300255	常山药业	19,100	117,656.00	0.26
107	000923	河北宣工	6,800	116,348.00	0.26
108	300118	东方日升	11,400	116,052.00	0.26
109	603711	香飘飘	3,400	115,498.00	0.26
110	600783	鲁信创投	6,400	113,408.00	0.26
111	300109	新开源	6,600	110,550.00	0.25
112	000058	深赛格	18,900	105,840.00	0.24
113	300229	拓尔思	9,900	104,346.00	0.23
114	300107	建新股份	11,200	101,584.00	0.23
115	002393	力生制药	4,200	101,136.00	0.23
116	002631	德尔未来	11,800	97,822.00	0.22
117	002378	章源钨业	13,200	97,416.00	0.22
118	601700	风范股份	16,100	97,244.00	0.22
119	300357	我武生物	2,800	94,976.00	0.21
120	300248	新开普	12,100	94,380.00	0.21
121	300236	上海新阳	2,900	94,076.00	0.21
122	002203	海亮股份	8,500	91,970.00	0.21
123	603299	苏盐井神	13,600	91,800.00	0.21
124	300140	中环装备	7,700	89,551.00	0.20
125	603421	鼎信通讯	4,500	87,750.00	0.20
126	600366	宁波韵升	9,500	87,210.00	0.20
127	600318	新力金融	11,400	85,158.00	0.19
128	002712	思美传媒	12,200	84,668.00	0.19
129	600650	锦江投资	7,000	84,350.00	0.19
130	600677	航天通信	4,700	81,639.00	0.18
131	600295	鄂尔多斯	9,800	81,242.00	0.18
132	002158	汉钟精机	9,100	79,352.00	0.18
133	002043	兔宝宝	13,000	78,520.00	0.18

134	300303	聚飞光电	23,000	76,130.00	0.17
135	000666	经纬纺机	6,100	75,945.00	0.17
136	603081	大丰实业	6,000	75,300.00	0.17
137	000797	中国武夷	16,100	73,255.00	0.16
138	002234	民和股份	2,600	72,774.00	0.16
139	300194	福安药业	12,200	69,662.00	0.16
140	600231	凌钢股份	21,400	68,908.00	0.16
141	002335	科华恒盛	3,900	68,835.00	0.15
142	603730	岱美股份	2,900	67,976.00	0.15
143	002695	煌上煌	4,700	67,445.00	0.15
144	300173	智慧松德	13,900	67,137.00	0.15
145	600456	宝钛股份	2,900	66,149.00	0.15
146	002377	国创高新	14,400	64,944.00	0.15
147	600562	国睿科技	4,200	64,512.00	0.15
148	000733	振华科技	3,900	64,272.00	0.14
149	300130	新国都	4,000	63,600.00	0.14
150	600496	精工钢构	20,000	63,400.00	0.14
151	300131	英唐智控	11,500	60,950.00	0.14
152	600185	格力地产	12,000	58,440.00	0.13
153	000815	美利云	6,300	58,401.00	0.13
154	002698	博实股份	6,450	58,308.00	0.13
155	300624	万兴科技	1,100	53,053.00	0.12
156	000043	中航善达	4,300	50,955.00	0.11
157	300476	胜宏科技	4,500	50,850.00	0.11
158	600590	泰豪科技	7,800	50,466.00	0.11
159	300213	佳讯飞鸿	7,500	49,950.00	0.11
160	300725	药石科技	800	49,864.00	0.11
161	002653	海思科	3,500	49,700.00	0.11
162	002782	可立克	3,950	48,545.50	0.11
163	603218	日月股份	2,460	47,724.00	0.11
164	002840	华统股份	2,800	47,600.00	0.11
165	000561	烽火电子	6,800	46,920.00	0.11
166	601113	华鼎股份	6,400	44,864.00	0.10
167	601519	大智慧	6,300	44,667.00	0.10
168	002458	益生股份	2,200	42,922.00	0.10
169	600129	太极集团	4,000	42,120.00	0.09
170	603456	九洲药业	5,000	41,750.00	0.09
171	600105	永鼎股份	8,400	40,488.00	0.09
172	603636	南威软件	4,000	40,200.00	0.09
173	603612	索通发展	3,600	38,556.00	0.09
174	600172	黄河旋风	11,800	37,996.00	0.09
175	000034	神州数码	2,900	37,410.00	0.08

176	000821	京山轻机	4,400	35,684.00	0.08
177	002511	中顺洁柔	2,900	35,612.00	0.08
178	002733	雄韬股份	1,700	34,374.00	0.08
179	300682	朗新科技	1,900	34,200.00	0.08
180	600577	精达股份	11,100	33,633.00	0.08
181	300221	银禧科技	4,500	29,025.00	0.07
182	000902	新洋丰	2,400	25,752.00	0.06
183	600635	大众公用	3,900	25,038.00	0.06
184	002349	精华制药	4,110	24,290.10	0.05
185	600206	有研新材	2,000	23,900.00	0.05
186	002726	龙大肉食	2,100	22,848.00	0.05
187	600552	凯盛科技	4,500	21,960.00	0.05
188	601107	四川成渝	5,300	21,465.00	0.05
189	600776	东方通信	900	20,682.00	0.05
190	000662	天夏智慧	4,300	19,995.00	0.05
191	600612	老凤祥	400	17,880.00	0.04
192	002020	京新药业	1,500	17,280.00	0.04
193	000036	华联控股	3,380	17,271.80	0.04
194	600758	红阳能源	3,200	16,608.00	0.04
195	300368	汇金股份	1,600	11,568.00	0.03
196	601890	亚星锚链	1,800	11,232.00	0.03

7.3.2 期末积极投资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	000524	岭南控股	65,100	544,887.00	1.23
2	603129	春风动力	19,600	408,268.00	0.92
3	601900	南方传媒	41,200	391,400.00	0.88
4	000156	华数传媒	35,200	387,552.00	0.87
5	603988	中电电机	32,800	356,864.00	0.80
6	002401	中远海科	30,300	352,692.00	0.79
7	000999	华润三九	11,700	343,278.00	0.77
8	603818	曲美家居	43,700	332,120.00	0.75
9	000027	深圳能源	43,300	268,460.00	0.60
10	300491	通合科技	18,100	256,477.00	0.58
11	300202	聚龙股份	32,336	251,897.44	0.57
12	300586	美联新材	18,300	249,246.00	0.56
13	601933	永辉超市	22,000	224,620.00	0.51
14	603090	宏盛股份	14,500	216,630.00	0.49
15	002454	松芝股份	36,000	186,840.00	0.42
16	603328	依顿电子	17,900	183,833.00	0.41
17	603585	苏利股份	7,460	178,144.80	0.40

18	001872	招商港口	10,800	176,148.00	0.40
19	300428	四通新材	15,800	171,114.00	0.39
20	300464	星徽精密	17,300	138,227.00	0.31
21	300389	艾比森	10,000	124,000.00	0.28
22	300088	长信科技	22,200	112,332.00	0.25
23	300214	日科化学	16,700	102,204.00	0.23
24	603519	立霸股份	6,300	99,540.00	0.22
25	603637	镇海股份	6,200	94,922.00	0.21
26	002482	广田集团	17,500	85,050.00	0.19
27	002252	上海莱士	11,900	82,705.00	0.19
28	002748	世龙实业	9,600	81,408.00	0.18
29	300690	双一科技	3,600	80,640.00	0.18
30	000700	模塑科技	19,600	74,088.00	0.17
31	600222	太龙药业	15,200	71,592.00	0.16
32	000850	华茂股份	15,100	67,648.00	0.15
33	000895	双汇发展	2,700	67,203.00	0.15
34	000531	穗恒运 A	9,300	65,007.00	0.15
35	600727	鲁北化工	8,400	55,944.00	0.13
36	300540	深冷股份	3,000	52,890.00	0.12
37	300119	瑞普生物	4,500	49,950.00	0.11
38	603007	花王股份	4,700	39,903.00	0.09
39	300702	天宇股份	1,100	39,644.00	0.09
40	603016	新宏泰	2,400	36,672.00	0.08
41	000813	德展健康	4,600	35,052.00	0.08
42	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.08
43	002750	龙津药业	2,900	33,611.00	0.08
44	300782	卓胜微	272	29,626.24	0.07
45	600611	大众交通	6,300	29,295.00	0.07
46	600968	海油发展	7,875	27,956.25	0.06
47	002725	跃岭股份	2,700	27,918.00	0.06
48	600745	闻泰科技	800	26,576.00	0.06
49	603009	北特科技	3,800	25,118.00	0.06
50	603867	新化股份	836	21,577.16	0.05
51	600155	华创阳安	1,600	21,488.00	0.05
52	002437	誉衡药业	5,400	21,330.00	0.05
53	603288	海天味业	200	21,000.00	0.05
54	601698	中国卫通	5,254	20,595.68	0.05
55	300594	朗进科技	378	16,673.58	0.04
56	300266	兴源环境	2,100	9,534.00	0.02

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	603997	继峰股份	1,316,277.65	4.47
2	000620	新华联	1,130,406.00	3.84
3	002378	章源钨业	1,127,116.00	3.83
4	601069	西部黄金	1,121,113.00	3.81
5	000828	东莞控股	1,080,863.00	3.67
6	600661	昂立教育	1,010,911.62	3.43
7	002485	希努尔	964,004.00	3.27
8	300219	鸿利智汇	910,245.74	3.09
9	002651	利君股份	890,454.00	3.02
10	002705	新宝股份	861,643.00	2.93
11	002053	云南能投	855,749.00	2.91
12	002239	奥特佳	826,297.00	2.81
13	601566	九牧王	825,494.00	2.80
14	601038	一拖股份	806,153.62	2.74
15	601666	平煤股份	796,977.20	2.71
16	300363	博腾股份	791,138.00	2.69
17	000555	神州信息	790,547.00	2.69
18	000810	创维数字	779,122.00	2.65
19	300149	量子生物	773,814.00	2.63
20	600180	瑞茂通	773,262.00	2.63
21	002697	红旗连锁	763,562.00	2.59
22	601126	四方股份	760,300.00	2.58
23	002267	陕天然气	759,288.00	2.58
24	300061	康旗股份	754,558.00	2.56
25	600096	云天化	741,673.52	2.52
26	603599	广信股份	733,480.00	2.49
27	002534	杭锅股份	730,352.00	2.48
28	603555	贵人鸟	729,275.00	2.48
29	000631	顺发恒业	728,805.00	2.48
30	000517	荣安地产	725,791.00	2.47
31	002314	南山控股	702,206.00	2.39
32	002653	海思科	700,978.00	2.38
33	300207	欣旺达	698,080.75	2.37
34	000156	华数传媒	689,924.00	2.34
35	603882	金域医学	688,909.09	2.34
36	600295	鄂尔多斯	677,458.00	2.30
37	601500	通用股份	676,317.00	2.30
38	000626	远大控股	670,509.00	2.28
39	600764	中国海防	665,654.05	2.26
40	000967	盈峰环境	665,214.00	2.26
41	603989	艾华集团	664,427.00	2.26
42	600578	京能电力	656,646.00	2.23

43	601058	赛轮轮胎	650,359.22	2.21
44	000666	经纬纺机	639,296.00	2.17
45	300531	优博讯	633,678.00	2.15
46	603680	今创集团	625,053.00	2.12
47	300100	双林股份	620,438.00	2.11
48	600763	通策医疗	619,890.00	2.11
49	002416	爱施德	610,947.00	2.08
50	603988	中电电机	606,064.08	2.06

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	000620	新华联	1,086,532.00	3.69
2	601069	西部黄金	1,079,146.00	3.67
3	002378	章源钨业	1,076,046.00	3.65
4	002485	希努尔	976,745.00	3.32
5	603997	继峰股份	936,501.36	3.18
6	002705	新宝股份	930,377.00	3.16
7	601038	一拖股份	910,156.00	3.09
8	002053	云南能投	868,079.00	2.95
9	601126	四方股份	851,855.26	2.89
10	000828	东莞控股	845,300.00	2.87
11	600096	云天化	819,027.68	2.78
12	002697	红旗连锁	815,866.00	2.77
13	603599	广信股份	804,757.22	2.73
14	002239	奥特佳	765,585.00	2.60
15	601500	通用股份	747,423.00	2.54
16	600763	通策医疗	737,081.00	2.50
17	300207	欣旺达	718,882.32	2.44
18	002653	海思科	708,674.00	2.41
19	601058	赛轮轮胎	695,291.00	2.36
20	603258	电魂网络	681,520.00	2.31
21	300363	博腾股份	674,611.00	2.29
22	300149	量子生物	659,777.00	2.24
23	600997	开滦股份	633,284.00	2.15
24	600578	京能电力	632,601.00	2.15
25	600295	鄂尔多斯	629,483.00	2.14
26	000967	盈峰环境	628,992.00	2.14
27	603099	长白山	625,902.00	2.13
28	300276	三丰智能	623,791.04	2.12
29	002314	南山控股	622,456.00	2.11

30	300045	华力创通	618,733.00	2.10
31	002409	雅克科技	614,680.00	2.09
32	600129	太极集团	609,362.00	2.07
33	000546	金圆股份	606,334.00	2.06

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	183,286,672.77
卖出股票收入(成交)总额	147,312,658.04

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),不包含相关交易费用。

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 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	31,360.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,512.83
5	应收申购款	105,424.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,298.49

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 A	1,453	18,415.55	10,000,000.00	37.37	16,757,791.44	62.63
建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 C	1,190	7,867.11	-	-	9,361,858.32	100.00
合计	2,643	13,666.16	10,000,000.00	27.69	26,119,649.76	72.31

注:注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 A	31,147.71	0.12
	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 C	18,653.34	0.20
	合计	49,801.05	0.14

注：基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 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

注：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。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	27.69	10,000,000.00	27.69	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	27.69	10,000,000.00	27.69	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 A	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 C
基金合同生效日（2018 年 11 月 22 日）基金份额总	50,945,615.13	48,700,352.71

额		
本报告期期初基金份额总额	19,936,918.37	9,433,210.52
本报告期基金总申购份额	23,324,783.46	14,931,181.55
减：本报告期基金总赎回份额	16,503,910.39	15,002,533.75
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	26,757,791.44	9,361,858.32

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

本报告期末发生公司和董事、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	
长城证券	1	205,269,954.55	62.19%	191,180.56	79.38%	-
天风证券	1	106,694,629.53	32.32%	33,173.00	13.77%	-
长江证券	1	18,118,469.63	5.49%	16,489.86	6.85%	-

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、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；
- （4）佣金费率合理。

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

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	关于新增第一创业为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2019年6月20日
2	关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司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	2019年6月12日
3	关于增加西藏东方财富证券股份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	2019年6月1日
4	关于增加北京百度百盈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	2019年5月14日
5	关于新增上海基煜基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2019年4月30日
6	关于增加北京新浪仓石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	2019年3月29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

单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	27.69

		01 日- 2019 年 06 月 30 日				
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。						

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中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 1000 指数增强型发起式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

2019 年 8 月 29 日

