

建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交 易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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 2020 年 3 月 6 日起至 6 月 30 日止。

1.2 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54

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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	建信大湾区发展主题 ETF
场内简称	湾区 ETF
基金主代码	159978
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 6 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	158,919,115.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 4 月 14 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足、港股通额度受限等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可通过投资非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证沪港深粤港澳大湾区发展主题指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	张燕
	联系电话	010-66228888	0755—83199084
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95555
传真		010-66228001	0755—83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码	100033	518040
法定代表人	孙志晨	李建红

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2020 年 3 月 6 日(基金合同生效日) - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	34,562,819.60
本期利润	51,179,669.14
加权平均基金份额本期利润	0.0863
本期加权平均净值利润率	8.50%
本期基金份额净值增长率	12.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	17,520,493.93
期末可供分配基金份额利润	0.1102
期末基金资产净值	179,379,997.77
期末基金份额净值	1.1288
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	12.88%

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 2020 年 3 月 6 日生效，截止报告期末仍处于建仓期。

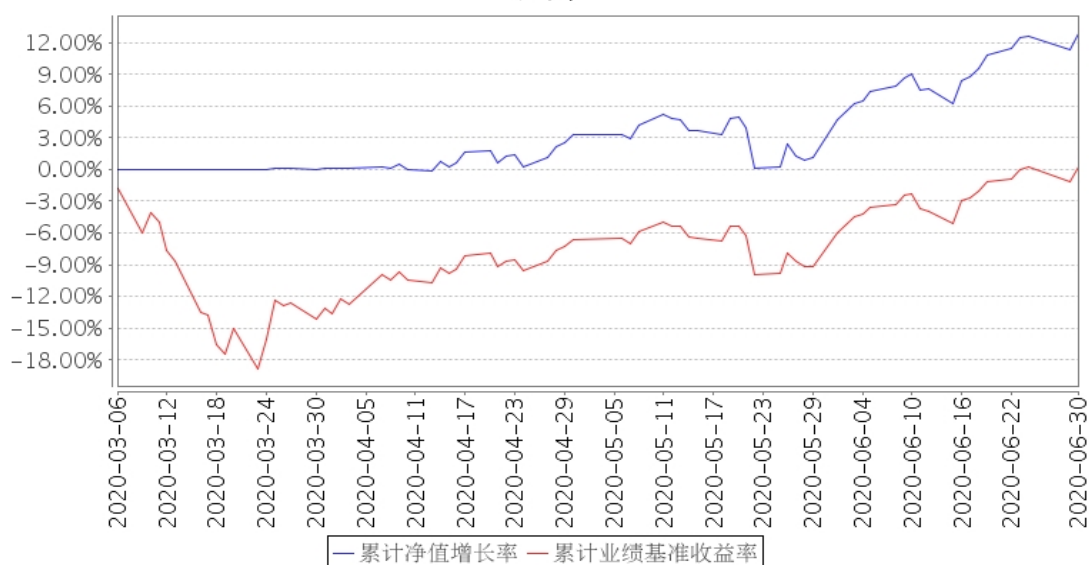
3.2 基金净值表现

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	11.66%	1.11%	10.34%	1.15%	1.32%	-0.04%
过去三个月	12.76%	1.03%	15.31%	1.19%	-2.55%	-0.16%
自基金合同生效起至今	12.88%	0.90%	0.22%	1.73%	12.66%	-0.83%

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

建信大湾区发展主题ETF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 2020 年 3 月 6 日生效，截至报告期末仍处于建仓期。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，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、基础设施投资部、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、内控合规部和审计部，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、石家庄六个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司以及在香港设立建信资产管理（香港）有限公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家资产管理行业的领跑者”。

截至 2020 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、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、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、建信富时 100 指数型证券投资基金、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、建信灵活配置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、建信短债债券型证券投资基金、建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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 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）、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金，建信高股息主题股票型证券投资基金、建信科技创新混合型证券投资基金、建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金共计 126 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 4939.77 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		
龚佳佳	本基金的基金经理	2020 年 3 月 6 日	-	7 年	龚佳佳先生，硕士。2012 年 7 月至 2014 年 10 月在诺安基金管理有限公司数量投资部担任研究员、基金经理助理；2014 年 10 月至 2015 年 3 月在工银瑞信基金管理有限公司指数投资部担任量化研究员；2015 年 3 月至 2018 年 5 月在华夏基金管理有限公司数量投资部担任研究员、投资经理；2018 年 5 月至今在建信基金管理公司金融工程及指数投资部历任基金经理助理、基金经理。2019 年 2 月 22 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；2019 年 3 月 7 日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2019 年 8 月 23 日起任建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 3 月 6 日起任建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指

					数证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 17 日起任建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 6 月 29 日起任建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 2 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

本基金跟踪的标的指数为中证沪港深粤港澳大湾区发展主题指数（930999.CSI），该指数由中证指数公司编制和维护。从指数的编制方案看，所选的成分股为沪港深上市、总部位于粤港澳大湾区的市值最大的 300 家公司，成分股采用自由流通市值加权。基金成立于 2020 年 3 月 6 日，并于 2020 年 4 月 14 日在深交所上市，是境内首批同时投资上交所、深交所、港交所的 ETF 产品。由于基金同时投资 A 股和港股，而两地交易所在清算交收、交易时间、交易日期等方面存在诸多差异，给基金的安全运作带来了很大挑战。出于持有人利益优先的考虑，管理人采用股指期货进行了部分现货替代，以便留出更多的现金参与打新。待基金建仓期结束后，管理人将在控制好风险的基础上，力争将偏离度和跟踪误差控制在合同约定的范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 12.88%，波动率 0.90%，业绩比较基准收益率 0.22%，波动率 1.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金采用完全复制法，即根据标的指数的权重结构构建组合。从指数的选样方案看，成分股均为总部位于粤港澳大湾区的公司；从权重分布看，成分股中 A 股和港股的权重大约各占一半。上半年，受新冠疫情在国内外扩散的影响，国内外的经济都受到了较大的影响，对 A 股和港股均产生了一定影响。截至 2020 年 6 月 30 日，标的指数上半年上涨了 3.88%，基金上半年上涨了 12.88%（基金成立于 2020 年 3 月 6 日）。

展望后市，随着疫情获得逐步控制，国内外经济的稳步恢复，美国大选落地后中美关系或将阶段性的缓和，估值优势明显的港股获将出现一定的机会，从而带动大湾区指数的上涨。后续管理人将坚持持有人利益优先的原则，在做好风险控制的基础上，在打新的同时尽量将跟踪误差和跟踪偏离度控制在合同约定的范围内。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	16,724,324.62
结算备付金		1,394,375.42
存出保证金		895,986.44
交易性金融资产	6.4.7.2	170,022,100.48
其中：股票投资		170,022,100.48
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	—
应收证券清算款		—
应收利息	6.4.7.5	3,375.27
应收股利		434,679.63
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		189,474,841.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 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		9,032,903.19
应付赎回款		—
应付管理人报酬		54,072.61
应付托管费		18,024.21

应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	911,278.38
应交税费		10,240.50
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	68,325.20
负债合计		10,094,844.09
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	158,919,115.00
未分配利润	6.4.7.10	20,460,882.77
所有者权益合计		179,379,997.77
负债和所有者权益总计		189,474,841.86

注：1、报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1288 元，基金份额总额 158,919,115.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 3 月 6 日（基金合同生 效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		54,114,650.81
1. 利息收入		1,233,924.56
其中：存款利息收入	6.4.7.11	872,052.89
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		361,871.67
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		36,047,224.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	32,168,884.87
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	304,776.70
股利收益	6.4.7.16	3,573,563.35
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	16,616,849.54

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	216,651.79
减：二、费用		2,934,981.67
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	569,386.81
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	189,795.61
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	2,079,719.80
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		1,097.20
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	94,982.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		51,179,669.14
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		51,179,669.14

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 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）	866,919,115.00	-	866,919,115.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	51,179,669.14	51,179,669.14
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）	-708,000,000.00	-30,718,786.37	-738,718,786.37
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-708,000,000.00	-30,718,786.37	-738,718,786.37
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)	158,919,115.00	20,460,882.77	179,379,997.77
---------------------	----------------	---------------	----------------

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

吴灵玲

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

建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金（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”）《关于准予建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]1461号）注册，由建信基金管理有限责任公司作为管理人向社会公开发行人募集设立。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 866,818,061.00 元（含募集股票市值），业经安永华明会计师事务所安永华明（2020）验字第 61490173_A12 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 866,919,115.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 101,054.00 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2020]264 号核准，本基金于 2020 年 4 月 14 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪中证沪港深粤港澳大湾区发展主题指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。主要投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板、其他港股通标的股票及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（股指期货、股票期权）、债券资产（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为中证沪港深粤港澳大湾区发展主

题指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 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

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。

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日止期间。

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、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具等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、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具等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。基金投资在持有期间应取得的红利于除息日确认为投资收益。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、托管费和销售服务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

本基金同一类别的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，但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。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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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) 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	16,724,324.62
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	16,724,324.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	153,725,650.94	170,022,100.48	16,296,449.54
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	153,725,650.94	170,022,100.48	16,296,449.54

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	
货币衍生工具	—	—	—	
权益衍生工具	7,092,000.00	—	—	
其中：股指期货投资	7,092,000.00	—	—	
其他衍生工具	—	—	—	
合计	7,092,000.00	—	—	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)(单位:手)	合约市值	公允价值变动
IF2007	沪深 300 指数期货 IF2007 合约	6	7,412,400.00	320,400.00
总额合计	—	6	7,412,400.00	320,400.00
减：可抵销期货暂收款	—	—	—	320,400.00
股指期货投资净额	—	—	—	—

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,556.77
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	1,660.21
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	—
应收出借证券利息	—
其他	158.29
合计	3,375.27

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	911,278.38
银行间市场应付交易费用	—
合计	911,278.38

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付指数使用费	39,172.31
预提费用	29,152.89
合计	68,325.20

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	866,919,115.00	866,919,115.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-708,000,000.00	-708,000,000.00
- 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	158,919,115.00	158,919,115.00

注：1、如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

2、本基金自 2020 年 1 月 20 日至 2020 年 2 月 28 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 866,818,061.00 元，折合基金份额 866,818,061.00 份；根据《建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数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 101,054.00 元在本基金成立后，折算为 101,054.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据《建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》的相关规定，本基金于 2020 年 4 月 14 日在深圳证券交易所上市交易。申购业务、赎回业务自 2020 年 4 月 14 日起开始办理。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	34,562,819.60	16,616,849.54	51,179,669.14
本期基金份额交易产生的变动数	-17,042,325.67	-13,676,460.70	-30,718,786.37
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-17,042,325.67	-13,676,460.70	-30,718,786.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,520,493.93	2,940,388.84	20,460,882.77

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	407,980.54
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	460,249.22
其他	3,823.13
合计	872,052.89

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	32,168,884.87
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	32,168,884.87

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出股票成交总额	585,863,405.09
减：卖出股票成本总额	553,694,520.22
买卖股票差价收入	32,168,884.87

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	304,776.70

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,573,563.35
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,573,563.35

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	16,296,449.54
股票投资	16,296,449.54
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	320,400.00
权证投资	-
期货	320,400.00
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	16,616,849.54

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	216,651.79
合计	216,651.79

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,079,719.80
银行间市场交易费用	—
合计	2,079,719.80

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,152.89
信息披露费	—
证券出借违约金	—
银行划款手续费	8,890.68
指数使用费	56,938.68
合计	94,982.25

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”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
建信资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	569,386.81
其中：支付销售机构的客户维护费	23,614.34

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%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×0.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	189,795.61	

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入

招商银行-活期存款	16,724,324.62	407,980.54
-----------	---------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2020 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
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新发未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新发未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新发未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、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同责任，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 2020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	16,724,324.62	-	-	-	16,724,324.62
结算备付金	1,394,375.42	-	-	-	1,394,375.42
存出保证金	895,986.44	-	-	-	895,986.44
交易性金融资产	-	-	-	170,022,100.48	170,022,100.48
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	-	-	-	3,375.27	3,375.27
应收股利	-	-	-	434,679.63	434,679.63

应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	19,014,686.48	-	-	170,460,155.38	189,474,841.86
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	-	-	-	9,032,903.19	9,032,903.19
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	54,072.61	54,072.61
应付托管费	-	-	-	18,024.21	18,024.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	911,278.38	911,278.38
应交税费	-	-	-	10,240.50	10,240.50
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	68,325.20	68,325.20
负债总计	-	-	-	10,094,844.09	10,094,844.09
利率敏感度缺口	19,014,686.48	-	-	-160,365,311.29	179,379,997.77

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	79,968,751.25	-	79,968,751.25
资产合计	-	79,968,751.25	-	79,968,751.25
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	79,968,751.25	-	79,968,751.25

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

	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（2020 年 6 月 30 日）
分析	所有外币相对人民币贬值 5%	-3,998,437.56
	所有外币相对人民币升值 5%	3,998,437.56

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的股票，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。

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足、港股通额度受限等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可通过投资非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。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 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	170,022,100.48	94.78
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	170,022,100.48	94.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 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，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 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人民币 169,999,257.97 元，属于第二层次的余额为人民币 22,842.51 元，无属于第三层次的余额。

6.4.14.1.2.2 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可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.2 承诺事项

无。

6.4.14.3 其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	170,022,100.48	89.73
	其中：股票	170,022,100.48	89.73
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	18,118,700.04	9.56
8	其他各项资产	1,334,041.34	0.70
9	合计	189,474,841.86	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 79,968,751.25 元，占期末基金资产净值比例为 44.58%。

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	-	-
B	采矿业	387,390.00	0.22
C	制造业	53,758,318.46	29.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	513,583.60	0.29
E	建筑业	306,031.00	0.17
F	批发和零售业	787,523.60	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	1,834,093.50	1.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,455,665.00	2.48
J	金融业	18,818,727.00	10.49
K	房地产业	5,816,903.00	3.24
L	租赁和商务服务业	967,918.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	1,230,400.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	402,991.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	268,500.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	32,544.00	0.02
S	综合	289,340.00	0.16
	合计	89,869,928.16	50.10

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	-	-
C	制造业	162,368.65	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,286.10	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	183,421.07	0.10

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
Materials 材料	-	-
Consumer Discretionary 非日常生活消费品	5,315,544.85	2.96
Consumer Staples 日常消费品	1,019,321.39	0.57
Energy 能源	-	-
Financials 金融	25,656,529.17	14.30
Health Care 医疗保健	330,838.83	0.18
Industrials 工业	3,363,528.15	1.88
Information Technology 信息技术	3,825,336.01	2.13
Telecommunication	19,643,294.27	10.95

Services 通讯服务		
Utilities 公用事业	6,204,701.05	3.46
Real Estate 房地产	14,609,657.53	8.14
合计	79,968,751.25	44.58

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	00700	腾讯控股	41,800.00	19,037,441.49	10.61
2	01299	友邦保险	158,800.00	10,487,423.87	5.85
3	601318	中国平安	142,300.00	10,160,220.00	5.66
4	002475	立讯精密	110,167.00	5,657,075.45	3.15
5	02318	中国平安	78,500.00	5,557,140.60	3.10
6	00388	香港交易所	16,700.00	5,033,967.84	2.81
7	600036	招商银行	135,500.00	4,569,060.00	2.55
8	000333	美的集团	64,400.00	3,850,476.00	2.15
9	000651	格力电器	63,200.00	3,575,224.00	1.99
10	300760	迈瑞医疗	9,600.00	2,934,720.00	1.64
11	000063	中兴通讯	70,900.00	2,845,217.00	1.59
12	000002	万科A	89,500.00	2,339,530.00	1.30
13	03968	招商银行	60,500.00	1,970,130.23	1.10
14	002594	比亚迪	23,800.00	1,708,840.00	0.95
15	000001	平安银行	127,500.00	1,632,000.00	0.91
16	00001	长和	35,500.00	1,614,870.58	0.90
17	00002	中电控股	23,000.00	1,596,693.12	0.89
18	603288	海天味业	12,780.00	1,589,832.00	0.89
19	00003	香港中华煤气	140,500.00	1,540,059.84	0.86
20	01113	长实集团	34,000.00	1,434,831.55	0.80
21	300601	康泰生物	8,800.00	1,427,008.00	0.80
22	600048	保利地产	94,100.00	1,390,798.00	0.78
23	00016	新鸿基地产	15,000.00	1,355,773.32	0.76
24	00027	银河娱乐	28,000.00	1,349,150.88	0.75
25	02388	中银香港	55,500.00	1,249,654.43	0.70
26	00688	中国海外发展	58,000.00	1,242,369.74	0.69
27	01109	华润置地	46,000.00	1,233,235.34	0.69
28	00011	恒生银行	10,000.00	1,188,385.44	0.66
29	01928	金沙中国有限公司	42,400.00	1,177,387.62	0.66
30	300014	亿纬锂能	24,171.00	1,156,582.35	0.64

31	00268	金蝶国际	70,000.00	1,152,213.22	0.64
32	000100	TCL 科技	177,700.00	1,101,740.00	0.61
33	300136	信维通信	20,400.00	1,081,608.00	0.60
34	603160	汇顶科技	4,800.00	1,069,920.00	0.60
35	300124	汇川技术	27,300.00	1,037,127.00	0.58
36	02007	碧桂园	115,000.00	1,000,034.11	0.56
37	002352	顺丰控股	17,400.00	951,780.00	0.53
38	03333	中国恒大	51,000.00	931,708.80	0.52
39	01211	比亚迪股份	17,000.00	929,379.53	0.52
40	00066	港铁公司	24,500.00	898,528.09	0.50
41	300454	深信服	4,300.00	885,628.00	0.49
42	600183	生益科技	29,900.00	875,173.00	0.49
43	02018	瑞声科技	19,000.00	825,247.37	0.46
44	600999	招商证券	37,500.00	823,125.00	0.46
45	002008	大族激光	22,400.00	805,280.00	0.45
46	002027	分众传媒	135,100.00	752,507.00	0.42
47	00006	电能实业	19,500.00	750,779.17	0.42
48	300529	健帆生物	10,440.00	725,580.00	0.40
49	06098	碧桂园服务	22,000.00	723,444.48	0.40
50	002841	视源股份	6,900.00	686,688.00	0.38
51	001979	招商蛇口	41,500.00	682,260.00	0.38
52	02909	新世界发展	20,000.00	672,291.84	0.37
53	300676	华大基因	4,200.00	654,822.00	0.37
54	00522	ASM PACIFIC	8,600.00	639,051.76	0.36
55	002916	深南电路	3,760.00	629,875.20	0.35
56	002465	海格通信	48,500.00	627,590.00	0.35
57	000066	中国长城	46,100.00	608,520.00	0.34
58	00288	万洲国际	96,000.00	582,263.19	0.32
59	00384	中国燃气	26,600.00	580,710.35	0.32
60	300482	万孚生物	5,400.00	561,600.00	0.31
61	02202	万科企业	24,900.00	557,244.07	0.31
62	002180	纳思达	16,700.00	549,597.00	0.31
63	000776	广发证券	38,900.00	549,268.00	0.31
64	300207	欣旺达	28,900.00	546,210.00	0.30
65	01997	九龙仓置业	16,000.00	540,756.48	0.30
66	00012	恒基地产	19,000.00	510,247.58	0.28
67	00270	粤海投资	42,000.00	510,247.58	0.28
68	00101	恒隆地产	30,000.00	503,122.75	0.28
69	002340	格林美	100,600.00	499,982.00	0.28
70	000513	丽珠集团	9,700.00	465,697.00	0.26
71	300724	捷佳伟创	5,100.00	451,503.00	0.25

72	002030	达安基因	16,170.00	441,117.60	0.25
73	00763	中兴通讯	19,800.00	428,640.85	0.24
74	600872	中炬高新	7,300.00	427,269.00	0.24
75	002138	顺络电子	17,000.00	424,150.00	0.24
76	600380	健康元	25,600.00	415,744.00	0.23
77	01193	华润燃气	12,000.00	413,788.32	0.23
78	000050	深天马 A	26,925.00	413,568.00	0.23
79	00083	信和置业	46,000.00	409,677.84	0.23
80	002152	广电运通	31,600.00	408,904.00	0.23
81	600383	金地集团	29,600.00	405,520.00	0.23
82	002436	兴森科技	31,300.00	401,579.00	0.22
83	601138	工业富联	26,100.00	395,415.00	0.22
84	002402	和而泰	24,000.00	389,040.00	0.22
85	00817	中国金茂	78,000.00	388,303.34	0.22
86	002683	宏大爆破	11,100.00	387,390.00	0.22
87	01038	长江基建集团	10,500.00	382,685.69	0.21
88	002736	国信证券	32,400.00	366,120.00	0.20
89	300037	新宙邦	6,500.00	357,890.00	0.20
90	300012	华测检测	17,500.00	345,800.00	0.19
91	002123	梦网集团	17,100.00	338,580.00	0.19
92	002938	鹏鼎控股	6,700.00	335,402.00	0.19
93	600728	佳都科技	36,800.00	335,248.00	0.19
94	300115	长盈精密	14,400.00	329,040.00	0.18
95	300457	赢合科技	10,300.00	328,364.00	0.18
96	000069	华侨城 A	53,900.00	326,634.00	0.18
97	002294	信立泰	11,000.00	326,260.00	0.18
98	00345	VITASOY INT'L	12,000.00	325,001.95	0.18
99	00868	信义玻璃	36,000.00	312,396.48	0.17
100	600446	金证股份	15,900.00	308,460.00	0.17
101	300476	胜宏科技	12,300.00	295,815.00	0.16
102	600029	南方航空	56,600.00	292,622.00	0.16
103	000009	中国宝安	34,000.00	289,340.00	0.16
104	00285	比亚迪电子	17,500.00	283,577.45	0.16
105	01972	太古地产	15,400.00	276,838.09	0.15
106	03380	龙光地产	22,000.00	275,712.73	0.15
107	603882	金域医学	3,000.00	268,500.00	0.15
108	002920	德赛西威	4,300.00	263,719.00	0.15
109	002425	凯撒文化	15,000.00	263,400.00	0.15
110	00019	太古股份公 司 A	7,000.00	262,796.69	0.15

111	300348	长亮科技	13,300.00	252,700.00	0.14
112	01128	永利澳门	20,400.00	248,579.91	0.14
113	00008	电讯盈科	61,000.00	246,281.69	0.14
114	002399	海普瑞	9,800.00	245,392.00	0.14
115	002709	天赐材料	7,200.00	243,288.00	0.14
116	600332	白云山	7,400.00	239,242.00	0.13
117	603228	景旺电子	6,740.00	237,180.60	0.13
118	00880	澳博控股	30,000.00	235,667.52	0.13
119	003816	中国广核	77,400.00	229,104.00	0.13
120	002912	中新赛克	1,400.00	229,026.00	0.13
121	300098	高新兴	37,100.00	224,826.00	0.13
122	002063	远光软件	17,800.00	224,814.00	0.13
123	300458	全志科技	6,100.00	224,480.00	0.13
124	002797	第一创业	32,100.00	222,132.00	0.12
125	601238	广汽集团	24,400.00	219,600.00	0.12
126	00836	华润电力	26,000.00	216,357.40	0.12
127	01816	中广核电力	146,000.00	213,379.58	0.12
128	000021	深科技	9,700.00	211,751.00	0.12
129	01310	香港宽频	17,000.00	210,566.19	0.12
130	603233	大参林	2,580.00	209,547.60	0.12
131	600004	白云机场	13,600.00	207,264.00	0.12
132	002745	木林森	13,400.00	206,494.00	0.12
133	03319	雅生活服务	5,750.00	205,101.53	0.11
134	300146	汤臣倍健	10,400.00	204,776.00	0.11
135	02238	广汽集团	40,000.00	204,245.18	0.11
136	002572	索菲亚	8,400.00	203,028.00	0.11
137	00010	恒隆集团	12,000.00	197,522.27	0.11
138	603833	欧派家居	1,700.00	197,030.00	0.11
139	300572	安车检测	3,100.00	197,005.00	0.11
140	000555	神州信息	12,800.00	196,864.00	0.11
141	01813	合景泰富集团	16,500.00	196,234.32	0.11
142	002106	莱宝高科	14,900.00	195,786.00	0.11
143	00303	VTECH HOLDINGS	4,600.00	195,594.91	0.11
144	002851	麦格米特	7,400.00	191,808.00	0.11
145	002511	中顺洁柔	8,600.00	191,780.00	0.11
146	00152	深圳国际	17,000.00	191,621.44	0.11
147	002815	崇达技术	9,300.00	188,139.00	0.10
148	00148	建滔集团	10,000.00	183,601.44	0.10
149	002583	海能达	24,100.00	182,919.00	0.10
150	00014	希慎兴业	8,000.00	181,591.87	0.10

151	601615	明阳智能	14,500.00	180,525.00	0.10
152	00123	越秀地产	142,000.00	178,997.70	0.10
153	00683	嘉里建设	9,500.00	173,553.60	0.10
154	300149	量子生物	9,200.00	172,868.00	0.10
155	00004	九龙仓集团	12,000.00	172,749.77	0.10
156	001914	招商积余	5,600.00	172,088.00	0.10
157	300633	开立医疗	4,300.00	170,495.00	0.10
158	01776	广发证券	22,400.00	169,826.76	0.09
159	03383	雅居乐集团	20,000.00	166,611.46	0.09
160	002625	光启技术	22,800.00	165,300.00	0.09
161	300053	欧比特	14,800.00	160,728.00	0.09
162	002791	坚朗五金	1,700.00	159,953.00	0.09
163	00867	康哲药业	19,000.00	158,454.44	0.09
164	002421	达实智能	40,600.00	157,528.00	0.09
165	600325	华发股份	22,300.00	157,438.00	0.09
166	300638	广和通	2,600.00	156,260.00	0.09
167	03883	中国奥园	18,000.00	154,060.79	0.09
168	002705	新宝股份	4,200.00	153,216.00	0.09
169	300568	星源材质	8,227.00	153,186.74	0.09
170	002850	科达利	2,205.00	152,586.00	0.09
171	002449	国星光电	13,100.00	151,960.00	0.08
172	000999	华润三九	5,200.00	151,788.00	0.08
173	300735	光弘科技	8,220.00	151,659.00	0.08
174	00144	招商局港口	18,000.00	150,607.99	0.08
175	002939	长城证券	12,200.00	150,304.00	0.08
176	00777	网龙	7,500.00	149,004.90	0.08
177	300085	银之杰	9,300.00	148,986.00	0.08
178	002317	众生药业	8,600.00	147,576.00	0.08
179	600110	诺德股份	30,200.00	147,376.00	0.08
180	02128	中国联塑	16,000.00	147,319.60	0.08
181	00069	香格里拉(亚洲)	24,000.00	146,004.25	0.08
182	600685	中船防务	8,600.00	145,426.00	0.08
183	603118	共进股份	12,200.00	145,058.00	0.08
184	000070	特发信息	14,900.00	144,828.00	0.08
185	06049	保利物业	2,000.00	142,496.64	0.08
186	300134	大富科技	10,000.00	139,800.00	0.08
187	002670	国盛金控	15,200.00	139,080.00	0.08
188	02282	美高梅中国	15,200.00	138,842.88	0.08
189	002168	惠程科技	16,900.00	138,749.00	0.08
190	02777	富力地产	16,800.00	138,419.04	0.08
191	00200	新濠国际发	10,000.00	137,016.00	0.08

		展			
192	00570	中国中药	40,000.00	136,650.62	0.08
193	002446	盛路通信	19,000.00	135,850.00	0.08
194	01999	敏华控股	20,000.00	135,371.81	0.08
195	002249	大洋电机	37,300.00	134,653.00	0.08
196	002055	得润电子	8,800.00	132,528.00	0.07
197	600323	瀚蓝环境	6,000.00	131,280.00	0.07
198	01233	时代中国控股	10,000.00	130,804.61	0.07
199	300602	飞荣达	3,960.00	129,967.20	0.07
200	00659	新创建集团	21,000.00	128,329.19	0.07
201	300377	赢时胜	13,600.00	127,024.00	0.07
202	000034	神州数码	5,200.00	126,568.00	0.07
203	300376	易事特	24,300.00	126,360.00	0.07
204	300232	洲明科技	15,500.00	125,395.00	0.07
205	002139	拓邦股份	21,700.00	122,171.00	0.07
206	300177	中海达	12,500.00	121,625.00	0.07
207	002544	杰赛科技	9,100.00	119,665.00	0.07
208	000090	天健集团	17,200.00	118,852.00	0.07
209	300679	电连技术	3,700.00	118,326.00	0.07
210	002429	兆驰股份	23,900.00	118,305.00	0.07
211	01888	建滔积层板	16,500.00	117,409.01	0.07
212	300438	鹏辉能源	6,600.00	115,170.00	0.06
213	00551	裕元集团	10,500.00	112,983.39	0.06
214	02669	中海物业	15,000.00	112,353.12	0.06
215	01112	H & H 国际控股	3,500.00	112,056.25	0.06
216	300770	新媒股份	500	111,830.00	0.06
217	300526	中潜股份	900	111,780.00	0.06
218	002611	东方精工	24,200.00	111,562.00	0.06
219	603328	依顿电子	10,524.00	109,765.32	0.06
220	002609	捷顺科技	8,500.00	108,375.00	0.06
221	002313	日海智能	5,800.00	107,880.00	0.06
222	000690	宝新能源	22,800.00	107,616.00	0.06
223	03311	中国建筑国际	26,000.00	107,347.47	0.06
224	300130	新国都	7,700.00	105,875.00	0.06
225	002130	沃尔核材	23,100.00	105,567.00	0.06
226	002183	怡亚通	19,600.00	105,056.00	0.06
227	000967	盈峰环境	12,500.00	103,125.00	0.06
228	000089	深圳机场	13,400.00	102,644.00	0.06

229	002191	劲嘉股份	11,500.00	102,465.00	0.06
230	000039	中集集团	13,900.00	100,497.00	0.06
231	601333	广深铁路	44,600.00	100,350.00	0.06
232	000016	深康佳 A	14,700.00	99,372.00	0.06
233	01929	周大福	14,400.00	97,467.70	0.05
234	002618	丹邦科技	10,100.00	97,465.00	0.05
235	300044	赛为智能	14,500.00	97,295.00	0.05
236	300047	天源迪科	13,400.00	97,284.00	0.05
237	002970	锐明技术	1,400.00	95,662.00	0.05
238	002035	华帝股份	9,100.00	92,183.00	0.05
239	000078	海王生物	21,900.00	91,761.00	0.05
240	00839	中教控股	8,000.00	91,051.70	0.05
241	002292	奥飞娱乐	10,800.00	90,936.00	0.05
242	002792	通宇通讯	3,600.00	88,488.00	0.05
243	000027	深圳能源	18,840.00	87,417.60	0.05
244	000031	大悦城	17,000.00	86,530.00	0.05
245	000028	国药一致	1,900.00	85,519.00	0.05
246	01638	佳兆业集团	32,000.00	85,351.83	0.05
247	000006	深振业 A	12,500.00	85,125.00	0.05
248	000810	创维数字	7,000.00	84,560.00	0.05
249	000987	越秀金控	7,200.00	83,952.00	0.05
250	002301	齐心集团	4,800.00	78,816.00	0.04
251	300297	蓝盾股份	19,600.00	78,596.00	0.04
252	000049	德赛电池	1,600.00	78,416.00	0.04
253	300043	星辉娱乐	19,600.00	78,400.00	0.04
254	002518	科士达	6,100.00	75,640.00	0.04
255	002042	华孚时尚	12,000.00	74,760.00	0.04
256	002528	英飞拓	15,800.00	74,576.00	0.04
257	002959	小熊电器	600	73,800.00	0.04
258	000712	锦龙股份	5,900.00	73,750.00	0.04
259	300252	金信诺	7,600.00	72,732.00	0.04
260	000921	海信家电	5,900.00	71,744.00	0.04
261	002913	奥士康	1,200.00	71,136.00	0.04
262	300634	彩讯股份	3,200.00	71,136.00	0.04
263	000976	华铁股份	12,600.00	70,308.00	0.04
264	00293	国泰航空	10,000.00	68,508.00	0.04
265	603043	广州酒家	2,100.00	68,292.00	0.04
266	002503	搜于特	24,300.00	68,283.00	0.04
267	002291	星期六	2,900.00	66,990.00	0.04
268	000061	农产品	8,900.00	65,949.00	0.04
269	002867	周大生	2,900.00	64,293.00	0.04

270	002918	蒙娜丽莎	2,100.00	62,811.00	0.04
271	000062	深圳华强	4,200.00	61,068.00	0.03
272	000088	盐田港	10,300.00	60,976.00	0.03
273	002717	岭南股份	14,000.00	60,200.00	0.03
274	002419	天虹股份	6,300.00	60,165.00	0.03
275	300616	尚品宅配	1,000.00	60,080.00	0.03
276	000036	华联控股	13,500.00	59,400.00	0.03
277	300131	英唐智控	11,100.00	59,274.00	0.03
278	002733	雄韬股份	2,700.00	57,375.00	0.03
279	002967	广电计量	2,100.00	56,910.00	0.03
280	01055	中国南方航空股份	18,000.00	56,395.79	0.03
281	300723	一品红	1,300.00	56,017.00	0.03
282	002672	东江环保	6,200.00	55,862.00	0.03
283	03990	美的置业	3,200.00	55,420.23	0.03
284	300197	铁汉生态	21,800.00	55,372.00	0.03
285	002047	宝鹰股份	10,600.00	53,636.00	0.03
286	601139	深圳燃气	7,700.00	50,050.00	0.03
287	002945	华林证券	3,600.00	49,716.00	0.03
288	002285	世联行	16,200.00	45,198.00	0.03
289	000011	深物业 A	2,800.00	44,800.00	0.03
290	000507	珠海港	8,500.00	44,540.00	0.02
291	002782	可立克	3,300.00	43,593.00	0.02
292	002431	棕榈股份	13,800.00	41,400.00	0.02
293	002930	宏川智慧	2,850.00	40,099.50	0.02
294	000040	东旭蓝天	13,400.00	39,396.00	0.02
295	601330	绿色动力	4,100.00	38,950.00	0.02
296	002906	华阳集团	2,500.00	38,725.00	0.02
297	002663	普邦股份	16,400.00	37,392.00	0.02
298	00874	白云山	2,000.00	35,733.77	0.02
299	600548	深高速	3,700.00	33,818.00	0.02
300	002482	广田集团	9,900.00	33,165.00	0.02
301	601900	南方传媒	3,600.00	32,544.00	0.02
302	000058	深赛格	3,900.00	30,654.00	0.02
303	000025	特力 A	1,600.00	29,328.00	0.02
304	002957	科瑞技术	1,100.00	26,290.00	0.01
305	300506	名家汇	4,300.00	21,586.00	0.01
306	002016	世荣兆业	3,300.00	21,582.00	0.01
307	002973	侨银环保	600	14,064.00	0.01
308	300805	电声股份	600	13,752.00	0.01

309	603848	好太太	700	9,555.00	0.01
-----	--------	-----	-----	----------	------

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	603087	甘李药业	904	90,671.20	0.05
2	300824	北鼎股份	1,954.00	26,789.34	0.01
3	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
4	600956	新天绿能	2,533.00	12,766.32	0.01
5	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
6	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
7	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
8	300840	酷特智能	1,185.00	7,038.90	0.00
9	300199	翰宇药业	13	72.28	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	79,677,955.58	44.42
2	01299	友邦保险	48,073,211.60	26.80
3	601318	中国平安	40,403,642.24	22.52
4	02318	中国平安	22,214,069.95	12.38
5	600036	招商银行	20,400,563.27	11.37
6	00388	香港交易所	17,198,077.70	9.59
7	002475	立讯精密	16,175,762.95	9.02
8	000651	格力电器	15,586,144.00	8.69
9	000333	美的集团	14,617,203.00	8.15
10	000063	中兴通讯	11,808,122.75	6.58
11	000002	万科A	9,804,242.00	5.47
12	00002	中电控股	8,953,562.87	4.99
13	03968	招商银行	8,870,194.97	4.94
14	00001	长和	8,536,439.84	4.76
15	00003	香港中华煤气	7,869,877.33	4.39
16	000001	平安银行	7,633,004.84	4.26
17	00016	新鸿基地产	6,865,722.04	3.83
18	00027	银河娱乐	6,806,075.80	3.79
19	600048	保利地产	6,666,438.00	3.72
20	01113	长实集团	6,657,412.26	3.71
21	00688	中国海外发展	6,436,936.78	3.59
22	603288	海天味业	6,269,322.12	3.49
23	002594	比亚迪	6,265,537.79	3.49

24	300760	迈瑞医疗	6,214,634.59	3.46
25	00011	恒生银行	5,823,855.88	3.25
26	00669	创科实业	5,671,509.72	3.16
27	02388	中银香港	5,632,460.28	3.14
28	01109	华润置地	5,357,511.21	2.99
29	01928	金沙中国有限公司	5,348,373.21	2.98
30	300601	康泰生物	5,029,607.82	2.80
31	02007	碧桂园	4,660,869.29	2.60
32	603160	汇顶科技	4,649,182.64	2.59
33	00066	港铁公司	4,329,954.38	2.41
34	00006	电能实业	4,195,863.65	2.34
35	600183	生益科技	3,995,567.00	2.23
36	00288	万洲国际	3,787,983.71	2.11
37	000100	TCL 科技	3,723,567.00	2.08
38	300124	汇川技术	3,618,219.00	2.02
39	300136	信维通信	3,592,708.69	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	71,768,959.00	40.01
2	01299	友邦保险	37,166,486.95	20.72
3	601318	中国平安	31,844,020.88	17.75
4	02318	中国平安	17,306,731.62	9.65
5	600036	招商银行	17,098,837.00	9.53
6	002475	立讯精密	14,917,770.36	8.32
7	00388	香港交易所	14,795,937.86	8.25
8	000333	美的集团	13,454,356.05	7.50
9	000651	格力电器	13,380,658.00	7.46
10	000063	中兴通讯	8,936,714.00	4.98
11	03968	招商银行	7,461,820.41	4.16
12	00002	中电控股	7,301,176.94	4.07
13	000002	万科 A	7,250,334.00	4.04
14	00669	创科实业	7,052,793.32	3.93
15	00001	长和	6,462,965.40	3.60
16	00027	银河娱乐	6,405,956.17	3.57
17	000001	平安银行	6,296,501.51	3.51
18	00003	香港中华煤气	6,059,083.66	3.38
19	01113	长实集团	5,338,121.41	2.98
20	600048	保利地产	5,254,345.50	2.93

21	603288	海天味业	5,211,863.05	2.91
22	002594	比亚迪	5,174,189.00	2.88
23	00016	新鸿基地产	5,081,846.39	2.83
24	00688	中国海外发展	4,855,710.42	2.71
25	01928	金沙中国有限公司	4,476,018.43	2.50
26	02388	中银香港	4,474,127.52	2.49
27	00011	恒生银行	4,467,338.81	2.49
28	300601	康泰生物	4,250,449.00	2.37
29	01109	华润置地	3,883,498.35	2.16
30	02007	碧桂园	3,832,617.84	2.14
31	002456	欧菲光	3,703,748.00	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	705,157,110.16
卖出股票收入（成交）总额	585,863,405.09

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 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

代 码	名 称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2007	IF2007	6	7,412,400.00	320,400.00	-
公允价值变动总额合计(元)					320,400.00
股指期货投资本期收益(元)					304,776.70
股指期货投资本期公允价值变动(元)					320,400.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。由于沪深 300 指数与标的指数的相关性很高，指数走势多数时候接近。因此，基金留存了部分现金头寸投资沪深 300 股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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	895,986.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	434,679.63
4	应收利息	3,375.27
5	应收申购款	-

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,334,041.34

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

8.1.1 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 (%)
3,665	43,361.29	5,165,841.00	3.25	153,753,274.00	96.75

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	李亨堃	5,924,322.00	3.73
2	方正证券股份有限公司	4,248,589.00	2.67
3	李江忠	3,544,841.00	2.23
4	卫聪明	1,800,000.00	1.13
5	赵平	1,500,291.00	0.94
6	沈立军	1,500,072.00	0.94
7	沈露	1,500,072.00	0.94

8	任志俭	1,056,116.00	0.66
9	闫秀洁	1,000,252.00	0.63
10	左志中	1,000,155.00	0.63

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 3 月 6 日）基金份额总额	866,919,115.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	708,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	158,919,115.00

§ 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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金财富证券	1	1,088,098,523.40	84.40%	728,007.18	79.89%	-
中信证券	1	196,236,552.28	15.22%	178,843.17	19.63%	-
中信建投	1	4,860,096.37	0.38%	4,428.03	0.49%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

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

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

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

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

（4）佣金费率合理。

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

3、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	1,220,000,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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	建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金（“湾区ETF”）关于非港股通交易日暂停相关业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-30
2	建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金关于非港股通交易日暂停相关业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-23
3	建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金（“湾区ETF”）关于非港股通交易日暂停相关业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-28
4	关于建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-24
5	关于新增部分券商为建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代理券商的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-21
6	建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-14
7	建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金开	指定报刊和/或公司网站	2020-04-09

	放日常申购、赎回业务的公告		
8	建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	指定报刊和/或公司网站	2020-04-09
9	建信基金管理有限责任公司关于旗下建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金投资重大关联方证券的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-03-24
10	建信基金管理有限责任公司关于调整建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-03-11
11	建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2020-01-20
12	建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2020-01-20

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；

2、《建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

4、《建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数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

2020 年 8 月 28 日