

建信兴润一年持有期混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 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 2023 年 1 月 1 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	5
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	6
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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49

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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信兴润一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	建信兴润一年持有混合
基金主代码	013021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 24 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,290,238,109.21 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚持以合理的价格买入优质公司并长期持有持续获得超额回报的有效方法，重点布局竞争优势明显、管理层优秀、估值相对合理的优质公司，力求赢得长期稳定的回报。
投资策略	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，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金可投资港股通标的的股票，一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	010-60836588
传真	010-66228001	010-60834004
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	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
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	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中 信证券大厦 5 层
邮政编码	100033	100125
法定代表人	刘军	张佑君

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	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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-239,389,054.41
本期利润	-89,318,997.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0250
本期加权平均净值利润率	-3.13%
本期基金份额净值增长率	-2.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-819,083,096.84
期末可供分配基金份额利润	-0.2489
期末基金资产净值	2,577,120,547.56
期末基金份额净值	0.7833
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-21.67%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.38%	1.33%	1.44%	0.72%	1.94%	0.61%
过去三个月	-0.70%	1.03%	-3.63%	0.67%	2.93%	0.36%

过去六个月	-2.94%	0.92%	-0.30%	0.68%	-2.64%	0.24%
过去一年	-18.25%	1.10%	-10.33%	0.82%	-7.92%	0.28%
自基金合同生效起至今	-21.67%	1.06%	-15.44%	0.90%	-6.23%	0.16%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×20%

中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，为中国全市场债券指数，其以 2001 年 12 月 31 日为基期，基点为 100 点，并于 2002 年 12 月 31 日起发布。

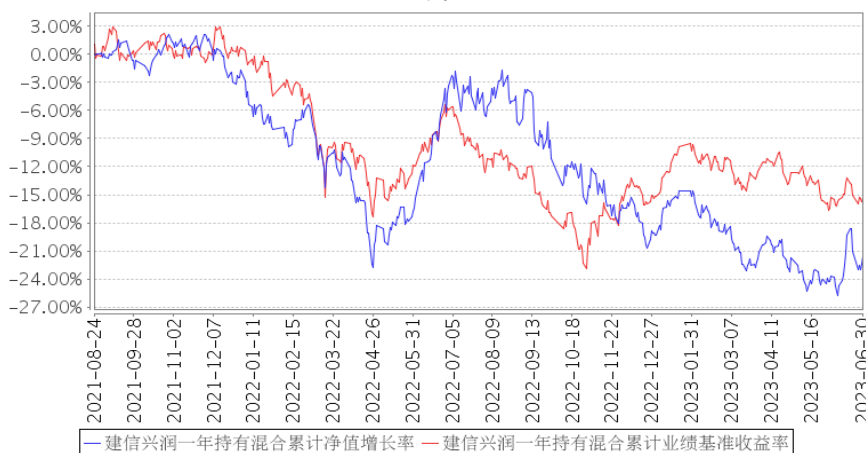
中债综合指数的样本具有广泛的市场代表性，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成份债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类，能较好地反映债券市场的整体收益；

沪深 300 指数是由中证指数公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的市场代表性。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数，能够反映港股市场的表现，市场代表性良好。

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

建信兴润一年持有混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

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，由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合资设立，注册资本 2 亿元。

公司拥有公开募集证券投资基金、私募资产管理计划、QDII、保险资金受托等业务资格，总部设在北京，下设北京、上海、广州、成都、深圳五家分公司，并分别在上海和香港设立了子公司——建信资本管理有限责任公司、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”。

公司以持续优秀的管理能力、完善周到的服务，为超过 7000 万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至 2023 年 6 月 30 日，公司管理运作 161 只公开募集证券投资基金以及多个私募资产管理计划，资产管理规模 1.11 余万亿元。

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		
陶灿	权益投资部执行总经理，本基金的基金经理	2021 年 8 月 24 日	-	15	陶灿先生，权益投资部执行总经理，硕士。2007 年 7 月加入本公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、权益投资部总经理助理兼研究部首席策略官等职务。2011 年 7 月 11 日至 2016 年 4 月 22 日任建信优化配置混合型证券投资基金的基金经理；2014 年 5 月 14 日起任建信改革红利股票型证券投资基金的基金经理；2016 年 2 月 23 日至 2021 年 9 月 29 日任建信现代服务业股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 2 月 9 日至 2019 年 1 月 21 日任建信回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 3 月 22 日起任建信恒久价值混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 10 月 27 日起任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于 2017 年 11 月 4 日起转型为建信鑫利灵

					活配置混合型证券投资基金，陶灿于 2017 年 11 月 4 日起至 2023 年 6 月 28 日担任该基金的基金经理；2020 年 1 月 21 日起任建信高股息股票型证券投资基金的基金经理；2020 年 6 月 17 日起任建信新能源行业股票型证券投资基金的基金经理；2021 年 3 月 26 日起任建信智能生活混合型证券投资基金的基金经理；2021 年 8 月 24 日起任建信兴润一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 1 月 19 日起任建信沃信一年持有期混合型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证券从业的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信兴润一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的规定。

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

本报告期内未出现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。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

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

2023 年一季度，国内 A 股市场整体走势偏强。沪深 300 指数上涨 4.6%，创业板指数上涨 2.2%，表现最突出的科创 50 上涨 12.7%。从行业来看，一季度以计算机、传媒、通信、电子为代表的 TMT 板块表现突出，而顺周期的房地产、银行则表现较弱。值得注意的是成长板块中的新能源亦表现较弱，在产能扩张迅猛的背景下，需求增速的回落持续压缩行业估值水平。整体上，一季度是疫情后时代的复苏阶段，预期与现实之间或许存在差异，但趋势向上，特别是二季度随着库存见底，经济内生动力向上，市场依然值得期待。

兴润基金在一季度继续调整了行业配置，降低了制造业、大金融地产行业的配置，增加了消费、TMT 板块的配置。在行业配置上，从供给角度观察上中下游的低库存、紧供给细分行业，在个股上强调独特竞争力带来的阿尔法收益。

2023 年二季度市场主要指数出现普遍下跌，上证指数下跌 2.16%，科创 50 和创业板指领跌，跌幅超过 7%。行业层面，分化仍然显著，消费者服务、食品饮料、农业等领跌，通信、家电、传媒等领涨。

进入二季度后，市场的主线仍然围绕 AI，但出现了明显的波动和泛化。计算机行业指数 4 月初见顶，其后最大回撤达到 20% 左右，在 5 月底重新反弹至前期高点、然后再次回撤 15%。传媒行业指数在 5 月初见顶，也经历了类似的回撤-反弹-再回撤的过程。相比之下，通信指数表现最强，在 4 月底回撤之后大幅反弹并明显超越前高。

兴润基金在二季度根据行业景气、公司竞争优势、估值等因素进行了优化调整，中观的行业景气因素依然决定了行业配置方向，在国内需求偏弱的现实下，寻找需求较为稳定的产业链进行结构性布局。

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-2.94%，波动率 0.92%，业绩比较基准收益率-0.30%，波动率 0.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

行至年中，宏观经济层面，总结国内大循环、海外循环的双循环体系，我们发现除了经济本身周期因素诸如去库存等影响之外，国内大循环在生产和消费的匹配上尚需磨合，居民可支配收

入增速偏缓，收入预期下降是当前政策亟需针的问题。海外循环中，欧美制造业“本土化”、“供应链重整”都给予中国企业家新的课题：如何摆布产能、构建核心竞争力，有效积极参与全球贸易供应链当中去。

在政策层面，高质量发展需要总量政策托底稳住预期，结构政策牵引提升动力。

落实到股票市场，上市公司企业 ROE 的企稳、盈利的可持续性依然使我们关注的重点，虽然估值的剧烈波动是短期价格的主导因素，但估值目前的位置相对较低，有利于基本面驱动行情的展开。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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、风险与合规管理部、投资风险管理部、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。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

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

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对建信兴润一年持有期混合

型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，建信基金管理有限责任公司在建信兴润一年持有期混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期，由建信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关建信兴润一年持有期混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信兴润一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	137,942,042.12	200,400,022.79
结算备付金		69,144,166.32	125,506,493.28
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,375,539,035.62	2,822,160,823.51
其中：股票投资		2,334,755,907.95	2,742,564,414.75
基金投资		-	-
债券投资		40,783,127.67	59,397,597.80
资产支持证券投资		-	20,198,810.96
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-

其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	6,514,589.34
应收股利		1,195,200.00	-
应收申购款		20,990.17	387,960.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,583,841,434.23	3,154,969,889.73
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,825,935.55	3,785,353.29
应付管理人报酬		3,163,163.15	4,124,910.25
应付托管费		527,193.87	687,485.04
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,372.90	4,131.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	203,221.20	219,762.50
负债合计		6,720,886.67	8,821,642.25
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	3,290,238,109.21	3,898,813,610.11
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-713,117,561.65	-752,665,362.63
净资产合计		2,577,120,547.56	3,146,148,247.48
负债和净资产总计		2,583,841,434.23	3,154,969,889.73

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 0.7833 元，基金份额总额 3,290,238,109.21 份。

6.2 利润表

会计主体：建信兴润一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
一、营业总收入		-64,337,342.25	-73,108,145.89

1. 利息收入		1, 105, 037. 47	10, 973, 876. 86
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	1, 105, 037. 47	6, 769, 662. 37
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		-	4, 204, 214. 49
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-215, 512, 437. 01	-398, 208, 556. 74
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	-227, 693, 517. 63	-420, 988, 504. 78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	890, 876. 05	2, 065, 757. 50
资产支持证券投资	6. 4. 7. 16	438, 533. 22	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	48, 321. 41	-
股利收益	6. 4. 7. 19	10, 803, 349. 94	20, 714, 190. 54
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	150, 070, 057. 29	314, 126, 533. 99
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. 21	-	-
减：二、营业总支出		24, 981, 654. 87	33, 830, 862. 22
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	21, 299, 683. 97	28, 894, 205. 14
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	3, 549, 947. 32	4, 815, 700. 89
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		2, 913. 40	430. 96
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	129, 110. 18	120, 525. 23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-89, 318, 997. 12	-106, 939, 008. 11
减：所得税费用		-	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-89,318,997.12	-106,939,008.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-89,318,997.12	-106,939,008.11

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：建信兴润一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	3,898,813,610. 11	-	-752,665,362.6 3	3,146,148,247.4 8
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	3,898,813,610. 11	-	-752,665,362.6 3	3,146,148,247.4 8
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-608,575,500.9 0	-	39,547,800.98	-569,027,699.92
(一)、综合收益总额	-	-	-89,318,997.12	-89,318,997.12
(二)、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)	-608,575,500.9 0	-	128,866,798.10	-479,708,702.80
其中：1. 基金申购款	10,397,905.92	-	-1,977,999.15	8,419,906.77
2. 基金赎回款	-618,973,406.8 2	-	130,844,797.25	-488,128,609.57
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	3,290,238,109.21	-	-713,117,561.65	2,577,120,547.56
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	4,363,765,230.40	-	-72,957,568.42	4,290,807,661.98
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	4,363,765,230.40	-	-72,957,568.42	4,290,807,661.98
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	35,499,828.24	-	-110,818,114.96	-75,318,286.72
(一)、综合收益总额	-	-	-106,939,008.11	-106,939,008.11
(二)、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)	35,499,828.24	-	-3,879,106.85	31,620,721.39
其中: 1. 基金申购款	35,499,828.24	-	-3,879,106.85	31,620,721.39
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、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)	-	-	-	-

（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	4,399,265,058.64	-	-183,775,683.38	4,215,489,375.26

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：

<u>张军红</u>	<u>张力铮</u>	<u>丁颖</u>
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

建信兴润一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]2267号《关于准予建信兴润一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》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《建信兴润一年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,350,494,621.62元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第61490173_A68号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信兴润一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年8月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,351,536,973.03份基金份额，其中认购资金利息折合1,042,351.41份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信兴润一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为国内依法发行上市的股票（含主板、创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票），内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、股指期货、股票期权、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金，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：股票资产占基金资产的比例为60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%）；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货

和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×20%。

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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 3 号《半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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非

货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《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[2016]127号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	7,753,953.33
等于：本金	7,748,301.75
加：应计利息	5,651.58
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	130,188,088.79
等于：本金	130,169,815.68
加：应计利息	18,273.11
减：坏账准备	-
合计	137,942,042.12

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	2,199,390,401.94	-	2,334,755,907.95	135,365,506.01	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	40,000,000.00	807,127.67	40,783,127.67	-24,000.00
	合计	40,000,000.00	807,127.67	40,783,127.67	-24,000.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,239,390,401.94	807,127.67	2,375,539,035.62	135,341,506.01	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	203,138.35
其他应付款	82.85
合计	203,221.20

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,898,813,610.11	3,898,813,610.11
本期申购	10,397,905.92	10,397,905.92
本期赎回（以“-”号填列）	-618,973,406.82	-618,973,406.82
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	3,290,238,109.21	3,290,238,109.21

注：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。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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
上年度末	-710,668,954.88	-41,996,407.75	-752,665,362.63
本期利润	-239,389,054.41	150,070,057.29	-89,318,997.12
本期基金份额交易产生的变动数	130,974,912.45	-2,108,114.35	128,866,798.10
其中：基金申购款	-2,149,618.47	171,619.32	-1,977,999.15
基金赎回款	133,124,530.92	-2,279,733.67	130,844,797.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-819,083,096.84	105,965,535.19	-713,117,561.65

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	193,177.76
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	274,185.71
结算备付金利息收入	637,673.04
其他	0.96
合计	1,105,037.47

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-227,693,517.63
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	-227,693,517.63

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	2,776,190,937.06
减：卖出股票成本总额	2,995,616,964.48
减：交易费用	8,267,490.21
买卖股票差价收入	-227,693,517.63

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	702,273.31
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	188,602.74
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	890,876.05

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,275,363.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,000,000.00
减：应计利息总额	86,410.96
减：交易费用	350.00
买卖债券差价收入	188,602.74

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	438,533.22
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券 差价收入	0.00
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	438,533.22

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	49,953.86
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	177.48
减：买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	1,454.97
买卖权证差价收入	48,321.41

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	10,803,349.94
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	10,803,349.94

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	150,070,057.29
股票投资	149,164,057.29
债券投资	760,000.00
资产支持证券投资	146,000.00
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	150,070,057.29

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	17,850.00
其他	600.00
证券组合费	6,521.83
合计	129,110.18

6.4.7.24 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、注册登记机构、基金销售机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人、基金销售机构

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	21,299,683.97	28,894,205.14
其中：支付销售机构的客户维护费	8,488,235.57	11,504,384.10

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 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,549,947.32	4,815,700.89

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，

按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
基金合同生效日（2021年8月24日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,999,450.00	9,999,450.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,999,450.00	9,999,450.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.30%	0.23%

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

无。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间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（2023 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	受限期	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
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新发未上市	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新发未上市	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新发未上市	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新发未上市	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新发未上市	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301260	格	2023	6个月	新发	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-

	力博	年 1 月 20 日		未上市						
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新发未上市	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新发未上市	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新发未上市	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新发未上市	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新发未上市	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新发未上市	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新发未上市	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月内(含)	新发未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301397	溯	2023	6 个月	新发	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-

	联股份	年6月15日		未上市						
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新发未上市	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新发未上市	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新发未上市	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新发未上市	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新发未上市	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新发未上市	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新发未上市	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新发未上市	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新发未上市	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新发未上市	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688507	索	2023	6个月	新发	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-

	辰科技	年 4 月 10 日		未上市						
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新发未上市	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新发未上市	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新发未上市	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-

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、由风险管理与内控合规委员会、督察长、风险与合规管理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风险与合规管理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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
AAA	20,217,780.82	29,695,238.35
AAA 以下	20,565,346.85	19,683,296.44
未评级	-	10,019,063.01
合计	40,783,127.67	59,397,597.80

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	20,198,810.96
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	20,198,810.96

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。基金管理人对于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 2023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	137,942,042.12	-	-	-	137,942,042.12
结算备付金	69,144,166.32	-	-	-	69,144,166.32
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	40,783,127.67	-	-2,334,755,907.95	2,375,539,035.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	1,195,200.00	1,195,200.00
应收申购款	-	-	-	20,990.17	20,990.17
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	207,086,208.44	40,783,127.67	-	-2,335,972,098.12	2,583,841,434.23
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,825,935.55	2,825,935.55
应付管理人报酬	-	-	-	3,163,163.15	3,163,163.15
应付托管费	-	-	-	527,193.87	527,193.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,372.90	1,372.90
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	203,221.20	203,221.20
负债总计	-	-	-	6,720,886.67	6,720,886.67
利率敏感度缺口	207,086,208.44	40,783,127.67	-	-2,329,251,211.45	2,577,120,547.56
上年度末 2022 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	200,400,022.79	-	-	-	200,400,022.79
结算备付金	125,506,493.28	-	-	-	125,506,493.28
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	20,198,810.96	59,397,597.80	-	-2,742,564,414.75	2,822,160,823.51
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	6,514,589.34	6,514,589.34
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	387,960.81	387,960.81
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	346,105,327.03	59,397,597.80	-	-2,749,466,964.90	3,154,969,889.73
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,785,353.29	3,785,353.29
应付管理人报酬	-	-	-	4,124,910.25	4,124,910.25
应付托管费	-	-	-	687,485.04	687,485.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4,131.17	4,131.17
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	219,762.50	219,762.50
负债总计	-	-	-	8,821,642.25	8,821,642.25
利率敏感度缺口	346,105,327.03	59,397,597.80	-	-2,740,645,322.65	3,146,148,247.48

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-300,081.41	-446,248.03
市场利率下降25个基点	303,394.18	450,952.71	

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 2023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	-	78,361,875.64	-	78,361,875.64
资产合计	-	78,361,875.64	-	78,361,875.64
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	-	78,361,875.64	-	78,361,875.64
项目	上年度末 2022年12月31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	-	296,420,421.10	-	296,420,421.10
资产合计	-	296,420,421.10	-	296,420,421.10
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	-	296,420,421.10	-	296,420,421.10

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	所有外币相对人民币贬值5%	-3,918,093.78	-14,821,021.05
	所有外币相对人民币升值5%	3,918,093.78	14,821,021.05

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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%）；每个交易日日

终在扣除国债期货，股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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 2023年6月30日		上年度末 2022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	2,334,755,907.95	90.60	2,742,564,414.75	87.17
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	40,783,127.67	1.58	79,596,408.76	2.53
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	2,375,539,035.62	92.18	2,822,160,823.51	89.70

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	117,534,134.68	136,319,884.54
	业绩比较基准下降5%	-117,534,134.68	-136,319,884.54

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,333,980,119.08	2,741,386,460.65
第二层次	40,921,756.95	79,596,408.76
第三层次	637,159.59	1,177,954.10
合计	2,375,539,035.62	2,822,160,823.51

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	2,334,755,907.95	90.36
	其中：股票	2,334,755,907.95	90.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,783,127.67	1.58
	其中：债券	40,783,127.67	1.58
	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	207,086,208.44	8.01
8	其他各项资产	1,216,190.17	0.05
9	合计	2,583,841,434.23	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 78,361,875.64 元，占期末基金资产净值比例为 3.04%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	11,049,830.00	0.43
C	制造业	2,065,215,306.57	80.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	118,026,614.14	4.58
F	批发和零售业	42,350.04	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	2,963.80	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,048,259.94	0.39
J	金融业	20,771,007.50	0.81
K	房地产业	448.64	0.00
L	租赁和商务服务业	10,853,792.30	0.42
M	科学研究和技术服务业	94,320.23	0.00

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	20,286,616.15	0.79
R	文化、体育和娱乐业	2,523.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,256,394,032.31	87.55

7.2.2 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 Staples 日常生活消费品	54,485,330.08	2.11
Consumer Discretionary 非日常消费品	14,460,105.67	0.56
Energy 能源	-	-
Financials 金融	-	-
Health Care 医疗保健	-	-
Industrials 工业	-	-
Real Estate 房地产	-	-
Information Technology 信息技术	-	-
Telecommunication Services 通讯服务	9,416,439.89	0.37
Utilities 公用事业	-	-
合计	78,361,875.64	3.04

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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

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	300316	晶盛机电	2,907,686	206,154,937.40	8.00
2	600600	青岛啤酒	862,500	89,380,875.00	3.47
2	00168	青岛啤酒股份	830,000	54,485,330.08	2.11
3	300308	中际旭创	965,400	142,348,230.00	5.52
4	300750	宁德时代	461,030	105,479,053.70	4.09
5	600129	太极集团	1,636,400	97,349,436.00	3.78
6	000568	泸州老窖	443,282	92,898,608.74	3.60
7	003031	中瓷电子	588,680	78,365,081.60	3.04
8	600519	贵州茅台	40,700	68,823,700.00	2.67
9	300394	天孚通信	614,900	65,689,767.00	2.55
10	002487	大金重工	2,125,600	65,553,504.00	2.54
11	300502	新易盛	921,213	62,614,847.61	2.43

12	601390	中国中铁	8,145,300	61,741,374.00	2.40
13	002050	三花智控	2,033,600	61,536,736.00	2.39
14	603019	中科曙光	1,158,173	58,951,005.70	2.29
15	300274	阳光电源	502,400	58,594,912.00	2.27
16	000032	深桑达 A	1,710,700	56,282,030.00	2.18
17	300567	精测电子	568,594	54,101,719.10	2.10
18	600487	亨通光电	3,585,092	52,557,448.72	2.04
19	002236	大华股份	2,512,300	49,617,925.00	1.93
20	600079	人福医药	1,795,500	48,370,770.00	1.88
21	688012	中微公司	300,235	46,971,765.75	1.82
22	301155	海力风电	608,737	46,921,447.96	1.82
23	300969	恒帅股份	480,103	42,321,079.45	1.64
24	002867	周大生	2,246,250	39,938,325.00	1.55
25	002262	恩华药业	1,263,100	38,941,373.00	1.51
26	300260	新莱应材	873,401	34,516,807.52	1.34
27	688668	鼎通科技	341,451	33,393,907.80	1.30
28	688121	卓然股份	821,659	30,730,046.60	1.19
29	002459	晶澳科技	663,900	27,684,630.00	1.07
30	688569	铁科轨道	617,492	25,977,888.44	1.01
31	300724	捷佳伟创	227,200	25,525,920.00	0.99
32	603606	东方电缆	492,400	24,142,372.00	0.94
33	603345	安井食品	144,800	21,256,640.00	0.82
34	300033	同花顺	118,500	20,770,680.00	0.81
35	601689	拓普集团	257,200	20,756,040.00	0.81
36	300015	爱尔眼科	1,089,765	20,215,140.75	0.78
37	03690	美团-W	128,240	14,460,105.67	0.56
38	002837	英维克	481,310	14,410,421.40	0.56
39	002897	意华股份	277,000	12,819,560.00	0.50
40	600587	新华医疗	357,800	12,641,074.00	0.49
41	603305	旭升集团	446,032	12,430,911.84	0.48
42	300881	盛德鑫泰	346,340	11,411,903.00	0.44
43	300760	迈瑞医疗	37,800	11,332,440.00	0.44
44	002271	东方雨虹	414,502	11,299,324.52	0.44
45	603979	金诚信	355,300	11,049,830.00	0.43
46	605168	三人行	126,295	10,853,792.30	0.42
47	00700	腾讯控股	30,800	9,416,439.89	0.37
48	688041	海光信息	125,911	8,595,943.97	0.33
49	688031	星环科技	62,861	8,375,599.64	0.32
50	300161	华中数控	154,700	8,279,544.00	0.32
51	688362	甬矽电子	245,353	8,167,801.37	0.32
52	600732	爱旭股份	254,100	7,813,575.00	0.30
53	603179	新泉股份	173,400	7,610,526.00	0.30
54	600933	爱柯迪	326,300	7,599,527.00	0.29

55	688297	中无人机	37,246	1,910,347.34	0.07
56	688501	青达环保	80,700	1,795,575.00	0.07
57	000768	中航西飞	41,600	1,112,800.00	0.04
58	688082	盛美上海	9,337	1,030,804.80	0.04
59	688663	新风光	30,047	955,194.13	0.04
60	688469	中芯集成	137,994	778,837.98	0.03
61	600602	云赛智联	49,800	749,988.00	0.03
62	600660	福耀玻璃	19,400	695,490.00	0.03
63	000852	石化机械	89,251	641,714.69	0.02
64	688107	安路科技	7,821	433,205.19	0.02
65	688392	骄成超声	3,843	426,534.57	0.02
66	600887	伊利股份	14,400	407,808.00	0.02
67	688262	国芯科技	10,002	406,981.38	0.02
68	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.02
69	688372	伟测科技	2,383	364,956.45	0.01
70	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
71	688351	微电生理	10,946	213,118.62	0.01
72	688125	安达智能	3,774	205,116.90	0.01
73	688244	永信至诚	2,229	172,524.60	0.01
74	688206	概伦电子	6,000	168,240.00	0.01
75	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.01
76	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
77	688553	汇宇制药	8,928	133,295.04	0.01
78	688227	品高股份	4,164	103,392.12	0.00
79	688236	春立医疗	4,052	99,274.00	0.00
80	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.00
81	301357	北方长龙	1,900	98,250.90	0.00
82	301386	未来电器	3,776	94,554.26	0.00
83	688247	宣泰医药	7,155	91,226.25	0.00
84	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
85	688265	南模生物	2,374	88,835.08	0.00
86	688737	中自科技	2,186	85,232.14	0.00
87	688210	统联精密	4,347	84,853.44	0.00
88	688255	凯尔达	2,309	78,182.74	0.00
89	301260	格力博	3,202	75,739.40	0.00
90	301267	华夏眼科	1,052	64,119.40	0.00
91	001311	多利科技	649	37,272.07	0.00
92	001287	中电港	1,460	31,189.44	0.00
93	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
94	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
95	301303	真兰仪表	1,074	23,980.32	0.00
96	301101	明月镜片	556	22,812.68	0.00
97	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00

98	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
99	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.00
100	301262	海看股份	717	18,339.75	0.00
101	301419	阿莱德	392	17,324.36	0.00
102	301397	溯联股份	418	16,926.80	0.00
103	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
104	301280	珠城科技	424	15,162.24	0.00
105	301320	豪江智能	716	15,062.88	0.00
106	301232	飞沃科技	243	14,373.12	0.00
107	301315	威士顿	253	13,168.53	0.00
108	603135	中重科技	673	12,152.92	0.00
109	601065	江盐集团	948	11,340.39	0.00
110	301376	致欧科技	492	11,160.60	0.00
111	301265	华新环保	881	10,237.22	0.00
112	600809	山西汾酒	40	7,402.80	0.00
113	301239	普瑞眼科	75	7,356.00	0.00
114	301366	一博科技	122	5,300.90	0.00
115	603125	常青科技	196	4,949.00	0.00
116	002738	中矿资源	84	4,278.96	0.00
117	001360	南矿集团	262	4,108.44	0.00
118	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
119	301095	广立微	40	3,306.00	0.00
120	603137	恒尚节能	182	3,210.14	0.00
121	600754	锦江酒店	70	2,963.80	0.00
122	600566	济川药业	90	2,613.60	0.00
123	301231	荣信文化	75	2,523.00	0.00
124	301227	森鹰窗业	84	2,329.32	0.00
125	603190	亚通精工	70	2,142.00	0.00
126	301306	西测测试	55	2,136.75	0.00
127	301195	北路智控	45	2,095.20	0.00
128	301363	美好医疗	47	2,067.53	0.00
129	301132	满坤科技	68	1,998.52	0.00
130	301313	凡拓数创	47	1,989.51	0.00
131	301115	建科股份	85	1,943.10	0.00
132	301197	工大科雅	80	1,928.00	0.00
133	603985	恒润股份	84	1,761.48	0.00
134	001278	一彬科技	73	1,735.94	0.00
135	600406	国电南瑞	70	1,617.00	0.00
136	301152	天力锂能	33	1,473.78	0.00
137	301379	天山电子	49	1,368.57	0.00
138	301316	慧博云通	59	1,348.15	0.00
139	001368	通达创智	51	1,296.42	0.00
140	603065	宿迁联盛	81	1,206.90	0.00

141	000403	派林生物	59	1,177.64	0.00
142	301282	金禄电子	34	1,022.04	0.00
143	002402	和而泰	60	1,018.80	0.00
144	301285	鸿日达	65	941.85	0.00
145	301330	熵基科技	22	787.16	0.00
146	301176	逸豪新材	44	755.92	0.00
147	603153	上海建科	40	710.00	0.00
148	603127	昭衍新药	17	695.30	0.00
149	002063	远光软件	73	633.64	0.00
150	603073	彩蝶实业	30	625.80	0.00
151	301388	欣灵电气	20	537.00	0.00
152	301277	新天地	25	487.75	0.00
153	000002	万 科 A	32	448.64	0.00
154	605186	健麾信息	7	346.50	0.00
155	002966	苏州银行	50	327.50	0.00
156	301276	嘉曼服饰	3	76.50	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	002487	大金重工	78,996,700.39	2.51
2	688012	中微公司	72,842,573.51	2.32
3	000063	中兴通讯	71,538,598.96	2.27
4	000032	深桑达 A	70,590,498.30	2.24
5	300308	中际旭创	68,472,857.45	2.18
6	600754	锦江酒店	64,781,875.34	2.06
7	300567	精测电子	58,647,438.85	1.86
8	601390	中国中铁	58,503,139.71	1.86
9	002236	大华股份	57,906,783.94	1.84
10	000983	山西焦煤	56,054,532.72	1.78
11	002050	三花智控	54,125,049.00	1.72
12	300502	新易盛	51,745,932.08	1.64
13	301155	海力风电	50,017,277.76	1.59
14	600989	宝丰能源	48,546,805.50	1.54
15	002532	天山铝业	48,251,318.00	1.53
16	300394	天孚通信	47,604,759.35	1.51
17	601669	中国电建	42,785,461.71	1.36
18	300274	阳光电源	41,894,385.22	1.33
19	300059	东方财富	41,205,701.25	1.31
20	600985	淮北矿业	40,290,076.53	1.28

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	000002	万科 A	140,476,893.00	4.47
2	300260	新莱应材	131,276,329.42	4.17
3	600048	保利发展	113,094,319.24	3.59
4	002738	中矿资源	102,595,997.33	3.26
5	600919	江苏银行	80,438,124.60	2.56
6	600519	贵州茅台	79,082,767.00	2.51
7	00700	腾讯控股	74,262,705.13	2.36
8	600754	锦江酒店	71,744,164.00	2.28
9	603799	华友钴业	68,572,272.93	2.18
10	600487	亨通光电	68,420,459.14	2.17
11	00688	中国海外发展	68,313,346.68	2.17
12	000063	中兴通讯	62,665,415.00	1.99
13	300390	天华新能	62,500,869.10	1.99
14	300750	宁德时代	54,879,820.00	1.74
15	000983	山西焦煤	44,009,510.32	1.40
16	600129	太极集团	43,364,392.39	1.38
17	01797	新东方在线	43,356,591.24	1.38
18	600989	宝丰能源	41,275,268.00	1.31
19	600522	中天科技	39,405,967.40	1.25
20	300760	迈瑞医疗	37,952,793.72	1.21

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	2,438,644,400.39
卖出股票收入（成交）总额	2,776,190,937.06

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,565,346.85	0.80
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,217,780.82	0.78

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,783,127.67	1.58

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	242280003	22 江西银行永续债 02	200,000	20,565,346.85	0.80
2	102282094	22 碧桂园 MTN001	200,000	20,217,780.82	0.78

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 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 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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是否超出基金合同规定的备选股票库

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,195,200.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,990.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,216,190.17

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
47,218	69,681.86	36,828,126.25	1.12	3,253,409,982.96	98.88

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	5,341,512.81	0.16

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

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 8 月 24 日） 基金份额总额	4,351,536,973.03
本报告期期初基金份额总额	3,898,813,610.11
本报告期基金总申购份额	10,397,905.92
减：本报告期基金总赎回份额	618,973,406.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,290,238,109.21

注：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。

§ 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

本报告期内，基金管理人于 2023 年 1 月 19 日发布公告，自 2023 年 1 月 17 日起吴灵玲女士不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起刘军先生不再担任建信基金管理有限责任公司董事长，暂由总裁张军红先生代为履行董事长职务；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 3 月 18 日发布公告，自 2023 年 3 月 17 日起聘任张力铮先生担任建信基金管理有限责任公司副总裁，张威威先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁、首席信息官。上述事项均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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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财产、基金管理业务、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

10.6.1 管理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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金托管人及其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 (%)	
东北证券	2	5,207,538,042.08	100.00	4,877,602.16	100.00	-

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、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。

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	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券		回购成交总		证

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
东北证 券	-	-	-	-	49,953.86	100.00

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	关于新增招商银行为公司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	2023 年 03 月 28 日
2	关于新增兴业证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 03 月 09 日
3	关于增加上海陆享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	2023 年 03 月 01 日
4	关于增加博时财富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	2023 年 02 月 24 日
5	关于新增深圳前海微众银行股份有限公司为建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金等代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 24 日
6	关于更新建信基金旗下公募基金产品适当性风险等级评定结果的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 15 日
7	关于增加上海中欧财富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	2023 年 02 月 07 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

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兴润一年持有期混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信兴润一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信兴润一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信兴润一年持有期混合型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

2023 年 8 月 30 日