

# 建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
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	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51

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 .....	51
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 .....	51
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 .....	51
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 .....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金	
基金简称	建信潜力新蓝筹股票	
基金主代码	000756	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 9 月 10 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	592,776,315.35 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信潜力新蓝筹股票 A	建信潜力新蓝筹股票 C
下属分级基金的交易代码	000756	014967
报告期末下属分级基金的份额总额	398,691,945.50 份	194,084,369.85 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于股票市场，通过股票精选和组合投资，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值，力争创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势等因素对各个行业及上市公司的影响以及核心股票资产的估值水平，综合分析证券市场的走势，主动判断市场时机，通过稳健的资产配置，合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	85%×沪深 300 指数收益率+15%×中债总财富（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxiipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	95559
传真	010-66228001	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝	中国（上海）长宁区仙霞路 18

	国际金融中心 16 层	号
邮政编码	100033	200336
法定代表人	刘军	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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)	
	建信潜力新蓝筹股票 A	建信潜力新蓝筹股票 C
本期已实现收益	-85,107,405.82	-51,700,121.13
本期利润	-52,494,363.65	-31,206,188.90
加权平均基金份额本期利润	-0.1210	-0.1161
本期加权平均净值利润率	-3.45%	-3.31%
本期基金份额净值增长率	-2.53%	-2.75%
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	791,237,460.56	381,317,239.21
期末可供分配基金份额利润	1.9846	1.9647
期末基金资产净值	1,333,565,524.84	645,347,899.34
期末基金份额净值	3.345	3.325
3.1.3 累计期末	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

指标		
基金份额累计净值增长率	234.50%	2.56%

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

建信潜力新蓝筹股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.89%	0.97%	1.07%	0.74%	0.82%	0.23%
过去三个月	-5.54%	0.88%	-4.10%	0.70%	-1.44%	0.18%
过去六个月	-2.53%	0.89%	-0.21%	0.71%	-2.32%	0.18%
过去一年	-15.68%	1.24%	-11.61%	0.84%	-4.07%	0.40%
过去三年	87.29%	1.60%	-4.29%	1.02%	91.58%	0.58%
自基金合同生效起至今	234.50%	1.70%	60.59%	1.22%	173.91%	0.48%

建信潜力新蓝筹股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.84%	0.97%	1.07%	0.74%	0.77%	0.23%
过去三个月	-5.62%	0.88%	-4.10%	0.70%	-1.52%	0.18%
过去六个月	-2.75%	0.89%	-0.21%	0.71%	-2.54%	0.18%
过去一年	-16.04%	1.24%	-11.61%	0.84%	-4.43%	0.40%
自基金合同生效起	2.56%	1.41%	-14.52%	0.99%	17.08%	0.42%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

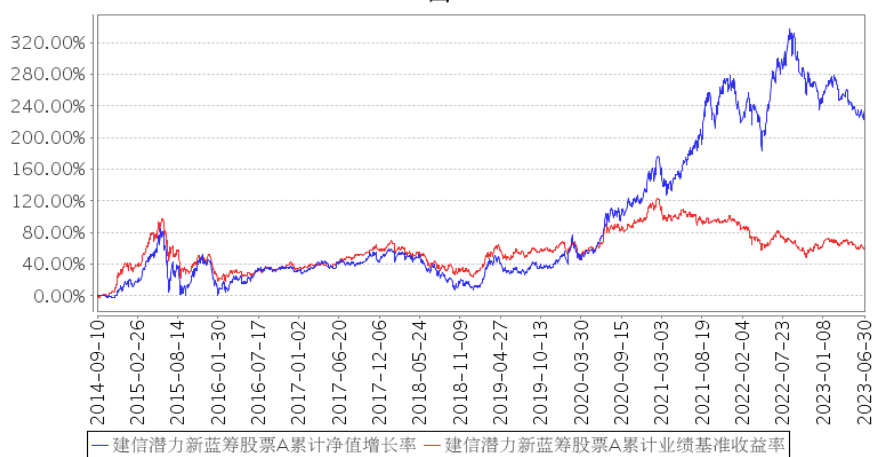
注：本基金业绩比较基准为： $85\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+15\% \times$ 中债总财富（总值）指数收益率。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制的，从上海和深圳股票市场中选取的 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。该指数为具有良好的市场代表性、能够反映 A 股市场整体走势的指数。

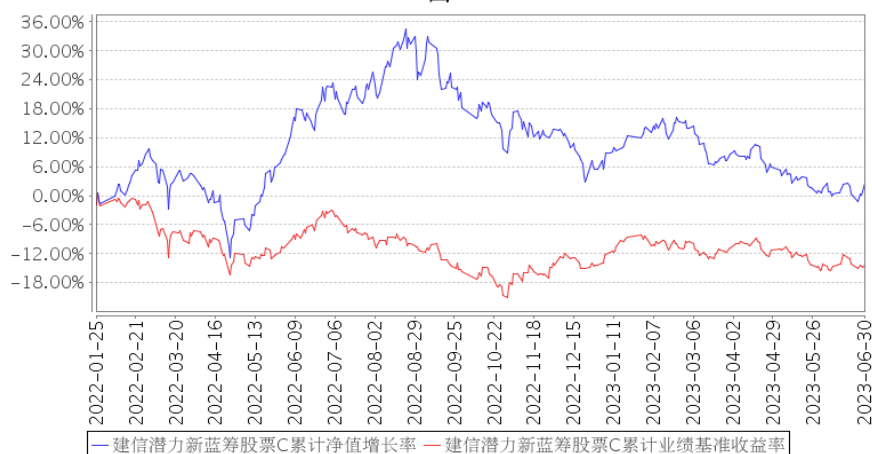
中债总财富（总值）指数是由中央国债登记结算有限责任公司推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中债总财富（总值）指数为掌握我国债券市场价格波动幅度和变动趋势、测算债券投资回报率水平提供了很好的依据。

### 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

建信潜力新蓝筹股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信潜力新蓝筹股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，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		
周智硕	本基金的基金经理	2020 年 9 月 18 日	-	13	周智硕先生，权益投资部高级基金经理，硕士。曾任南方基金管理有限公司研究部研究员、中国国际金融有限公司研究部高级经理、北京鸿道投资管理有限责任公司研究部权益资深研究员、权益基金经理、七曜投资管理合伙企业投资部权益投资经理、工银瑞信基金管理有限公司养老金投资中心投资经理。2020 年 6 月加入建信基金权益投资部任基金经理。2020 年 9 月 18 日起任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的基金经理；2021 年 9 月 29 日起任建信优化配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 10 月 14 日起任建信智远先锋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《建信潜力新蓝筹股票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 年上半年宏观环境先后经历疫后经济复苏、房地产接力不畅导致复苏动力不足等阶段，并在二季度集中表现出衰退、通缩、贬值等悲观情绪堆积的特征。具体来看，国内经济经历了疫后经济快速脉冲修复、并逐渐转向复苏换挡阶段。国内防控政策调整叠加今年春节较早，年初消费需求率先复苏，春节假期出游和消费旺盛，PMI 环比大幅改善，需求强于供给。春节过后，预期的“二次疫情”并未爆发，工业生产加速复苏，2 月是复苏斜率最大的阶段，制造业 PMI 录得

十年新高。但是，从 3 月开始，内生性动能逐渐减弱，经济放缓进入换挡期。随着需求复苏逐渐趋于温和，工业生产的复苏也随之放缓，制造业 PMI 逐月回落，表明复苏的斜率边际放缓，且从高频数据看二季度经济修复力度显著低于预期，内生性动能逐渐减弱，并重点集中在房地产投资增速逐级下探。受此影响，市场在二季度呈现出对于经济重回衰退的担忧情绪，叠加价格因素持续回落导致通缩预期发酵，以及人民币持续贬值，衰退、通缩、贬值等多重悲观因素叠加。

宏观上的波动，导致今年上半年市场出现了极为分化的行情。从指数上来看，上证指数上涨 3.65%，深成指微涨 0.10%，创业板指下跌 5.61%，上证 50 下跌 5.43%，中证 500 上涨 2.29%，沪深 300 下跌 0.75%。分行业来看，按照中信行业分类，涨幅靠前的三个行业分别是通信、传媒和计算机，涨幅分别是 45.41%，43.43%和 32.27%。跌幅靠前的三个行业分别是消费者服务、地产和综合，跌幅分别为 27.92%，14.07%和 11.77%。

报告期内，本基金认为，由于市场对于经济的过于担忧，和对一些子行业供给的过于担忧，市场不但忽略了有竞争力的企业有的已经经历了出清，只是在等待需求好转，有的正在经历出清，即将迎来业绩改善，还因为没有看到好转信号或者出清信号，相关股票还在继续下跌，他们的中长期风险收益比正在逐步提升。而这类公司，在财报端，有望在今年 3、4 季度就有所表现。因此，本基金继续自下而上，寻找竞争力突出、风险收益比较高、有望穿越周期的公司这条主线进行投资，重点投资了电子、医药、机械、电力设备及新能源、国防军工、汽车、煤炭、化工等行业的企业。希冀通过此类投资，提高投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率-2.53%，波动率 0.89%，业绩比较基准收益率-0.21%，波动率 0.71%。本报告期本基金 C 净值增长率-2.75%，波动率 0.89%，业绩比较基准收益率-0.21%，波动率 0.71%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

向后看，经济复苏的进展并非一马平川，但我们可以通过寻找库存拐点的公司来提升我们的胜率。本轮周期中，美国经济各项数据较好，库存未达低位，大多数处于主动去库阶段，国内库存则已处于低位，处于主动去库和被动去库之间。同时，我们认为主要悲观因素均已经完成逆转。一是制造业 PMI 连续两个月回升，各行业生产高频数据出现不同程度的好转，经济基本面正完成环比复苏的转换；二是从工业品价格的前瞻指标和翘尾因素来看，预计此轮 PPI 同比增速的底部已经在 6 月数据中得以确立，对经济重现中长期通缩的担忧也明显缓解；三是美联储加息周期临近收尾，海外流动性带来贬值压力收敛，国内基本面环比拐点出现，以及央行持续引导汇率预期，人民币汇率压力最大阶段已经过去。本基金将继续发掘优质的有望成为新的蓝筹股的公司，希冀

通过研究发掘能够穿越周期的企业，跟随企业成长，将成为我们获取投资回报的重要手段。

#### 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，基金托管人在建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，建信基金管理有限责任公司在建信潜力新蓝筹股票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、基金收益分配等问题上，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

本报告期内，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潜力新蓝筹股票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：建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	120,723,874.45	220,821,181.97
结算备付金		42,467,996.70	22,496,010.07
存出保证金		732,284.23	1,056,152.35
交易性金融资产	6.4.7.2	1,852,171,138.96	2,368,149,601.29
其中：股票投资		1,852,171,138.96	2,353,377,929.71
基金投资		-	-
债券投资		-	14,771,671.58
资产支持证券投资		-	-
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	-	78,174,000.00
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,465,444.72	7,695,273.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,017,560,739.06	2,698,392,219.06
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			

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		4,021,906.65	83,372,630.90
应付赎回款		25,385,965.05	5,492,885.54
应付管理人报酬		2,517,763.73	3,449,138.36
应付托管费		419,627.27	2,652,488.74
应付销售服务费		216,426.84	389,614.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	60.77
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	6,085,625.34	4,951,653.05
负债合计		38,647,314.88	100,308,471.86
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	592,776,315.35	758,198,794.64
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,386,137,108.83	1,839,884,952.56
净资产合计		1,978,913,424.18	2,598,083,747.20
负债和净资产总计		2,017,560,739.06	2,698,392,219.06

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 592,776,315.35 份，其中建信潜力新蓝筹股票 A 基金份额总额 398,691,945.50 份，基金份额净值人民币 3.345 元；建信潜力新蓝筹股票 C 基金份额总额 194,084,369.85 份，基金份额净值人民币 3.325 元。

## 6.2 利润表

会计主体：建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		-60,319,202.02	270,255,194.28
1. 利息收入		1,404,170.85	640,109.11
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,393,922.56	634,961.84
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		10,248.29	5,147.27
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-116,710,980.45	-19,181,200.71
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-133,687,242.33	-36,410,123.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,001,455.37	198,905.32
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	13,974,806.51	17,030,017.58
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	53,106,974.40	287,286,814.68
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	1,880,633.18	1,509,471.20
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>23,381,350.53</b>	<b>8,928,824.01</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,323,039.84	6,917,867.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,053,839.94	1,152,977.95
3. 销售服务费		1,874,343.10	752,282.23
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		6.44	0.66
8. 其他费用	6.4.7.23	130,121.21	105,695.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-83,700,552.55</b>	<b>261,326,370.27</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-83,700,552.55</b>	<b>261,326,370.27</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-83,700,552.55</b>	<b>261,326,370.27</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金

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)	758,198,794.64	-	1,839,884,952.56	2,598,083,747.20
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)	758,198,794.64	-	1,839,884,952.56	2,598,083,747.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-165,422,479.29	-	-453,747,843.73	-619,170,323.02
(一)、综合收益总额	-	-	-83,700,552.55	-83,700,552.55
(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)	-165,422,479.29	-	-370,047,291.18	-535,469,770.47
其中：1. 基金申购款	347,424,464.57	-	909,376,821.06	1,256,801,285.63
2. 基金赎回款	-512,846,943.86	-	-1,279,424,112.24	-1,792,271,056.10
(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)	592,776,315.35	-	1,386,137,108.83	1,978,913,424.18
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)	57,719,164.94	-	158,570,161.58	216,289,326.52
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)	57,719,164.94	-	158,570,161.58	216,289,326.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	710,974,741.46	-	2,119,564,046.07	2,830,538,787.53
(一)、综合收益总额	-	-	261,326,370.27	261,326,370.27
(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)	710,974,741.46	-	1,858,237,675.80	2,569,212,417.26
其中：1. 基金申购款	862,224,215.46	-	2,215,418,437.34	3,077,642,652.80
2. 基金赎回款	-151,249,474.00	-	-357,180,761.54	-508,430,235.54
(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)	768,693,906.40	-	2,278,134,207.65	3,046,828,114.05

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

张力铮

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

建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]702号《关于核准建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,466,728,443.99 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2014）第 498 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,467,496,662.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 768,218.55 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》并报证监会备案，本基金于 2022 年 1 月 25 日起根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式等不同，将本基金基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别。2022 年 1 月 25 日前原有的基金份额全部转换为建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金 A 类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板股票、创业板股票、存托凭证，以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规和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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%，投资于潜力新蓝筹股票的资产不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资

的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-20%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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。本基金的业绩比较基准为  $85\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+15\% \times$  中债总财富（总值）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《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。

### 6.4.7 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	120,723,874.45
等于：本金	120,676,156.22
加：应计利息	47,718.23
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	120,723,874.45

#### 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	1,930,609,922.47	-	1,852,171,138.96	-78,438,783.51
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	1,930,609,922.47	-	1,852,171,138.96	-78,438,783.51

#### 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	49,725.96
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,837,529.61
其中：交易所市场	5,837,529.61
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	198,369.77
合计	6,085,625.34

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 建信潜力新蓝筹股票 A

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	445,860,797.99	445,860,797.99
本期申购	201,958,922.04	201,958,922.04
本期赎回（以“-”号填列）	-249,127,774.53	-249,127,774.53
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	398,691,945.50	398,691,945.50

## 建信潜力新蓝筹股票 C

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	312,337,996.65	312,337,996.65
本期申购	145,465,542.53	145,465,542.53
本期赎回（以“-”号填列）	-263,719,169.33	-263,719,169.33
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	194,084,369.85	194,084,369.85

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

建信潜力新蓝筹股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	972,130,351.73	112,265,530.79	1,084,395,882.52
本期利润	-85,107,405.82	32,613,042.17	-52,494,363.65
本期基金份额交易产生的变动数	-95,785,485.35	-1,242,454.18	-97,027,939.53
其中：基金申购款	430,206,350.03	95,219,637.06	525,425,987.09
基金赎回款	-525,991,835.38	-96,462,091.24	-622,453,926.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	791,237,460.56	143,636,118.78	934,873,579.34

建信潜力新蓝筹股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	676,695,490.79	78,793,579.25	755,489,070.04
本期利润	-51,700,121.13	20,493,932.23	-31,206,188.90
本期基金份额交易产生的变动数	-243,678,130.45	-29,341,221.20	-273,019,351.65
其中：基金申购款	309,171,855.57	74,778,978.40	383,950,833.97
基金赎回款	-552,849,986.02	-104,120,199.60	-656,970,185.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	381,317,239.21	69,946,290.28	451,263,529.49

## 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	1,024,044.73
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	356,228.25
其他	13,649.58
合计	1,393,922.56

## 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	-133,687,242.33

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	-133,687,242.33

#### 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	2,752,205,404.87
减：卖出股票成本总额	2,878,449,690.57
减：交易费用	7,442,956.63
买卖股票差价收入	-133,687,242.33

#### 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	1,791.11
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,999,664.26
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	3,001,455.37

##### 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	15,306,520.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,298,939.76
减：应计利息总额	7,304.69
减：交易费用	611.87
买卖债券差价收入	2,999,664.26

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

无。

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

无。

## 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	13,974,806.51
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	13,974,806.51

## 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	53,106,974.40
股票投资	55,574,246.34
债券投资	-2,467,271.94
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	53,106,974.40

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	1,863,498.08
基金转换费收入	17,135.10
合计	1,880,633.18

#### 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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	12,342.26
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	130,121.21

#### 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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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	18,323,039.84	6,917,867.79
其中：支付销售机构的客户维护费	4,072,998.57	1,488,948.65

注：支付基金管理人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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$
**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	3,053,839.94	1,152,977.95

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$
**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信潜力新蓝筹股票 A	建信潜力新蓝筹股票 C	合计

建信基金	-	682,851.63	682,851.63
合计	-	682,851.63	682,851.63
获得销售服务费的各关联方 名称	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销售服务费		
	建信潜力新蓝筹股票 A	建信潜力新蓝筹股票 C	合计
建信基金	-	117,733.56	117,733.56
合计	-	117,733.56	117,733.56

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费的计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期	120,723,874.45	1,024,044.73	372,689,437.59	600,999.56

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/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
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新发未上市	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
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	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新发未上市	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-



001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新发未上市	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新发未上市	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新发未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新发未上市	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新发未上市	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
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	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新发未上市	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
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	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新发未上市	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新发未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新发未上市	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-

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	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新发未上市	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
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	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新发未上市	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新发未上市	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新发未上市	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
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	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新发未上市	87.30	53.24	392	34,219.71	20,870.08	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新发未上市	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新发未上市	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-

301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新发未上市	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新发未上市	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
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	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新发未上市	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新发未上市	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
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	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新发未上市	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
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	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新发未上市	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-

301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新发未上市	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新发未上市	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新发未上市	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
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	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新发未上市	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
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	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新发未上市	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
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	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新发未上市	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
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	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新发未上市	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新发未上市	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新发未上市	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新发未上市	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
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	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新发未上市	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新发未上市	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-

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	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新发未上市	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
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	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新发未上市	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新发未上市	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新发未上市	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

#### 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	9,845,581.41
AAA 以下	-	4,926,090.17
未评级	-	-
合计	-	14,771,671.58

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**

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 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	120,723,874.45	-	-	-	120,723,874.45
结算备付金	42,467,996.70	-	-	-	42,467,996.70
存出保证金	732,284.23	-	-	-	732,284.23
交易性金融资产	-	-	-	1,852,171,138.96	1,852,171,138.96
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	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,465,444.72	1,465,444.72
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	163,924,155.38	-	-	1,853,636,583.68	2,017,560,739.06

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				4,021,906.65	4,021,906.65
应付赎回款				25,385,965.05	25,385,965.05
应付管理人报酬				2,517,763.73	2,517,763.73
应付托管费				419,627.27	419,627.27
应付销售服务费				216,426.84	216,426.84
应付投资顾问费					
应交税费					
应付利润					
其他负债				6,085,625.34	6,085,625.34
负债总计				38,647,314.88	38,647,314.88
利率敏感度缺口	163,924,155.38			-1,814,989,268.80	1,978,913,424.18
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	220,821,181.97				220,821,181.97
结算备付金	22,496,010.07				22,496,010.07
存出保证金	1,056,152.35				1,056,152.35
交易性金融资产			14,771,671.58	2,353,377,929.71	2,368,149,601.29
衍生金融资产					
买入返售金融资产	78,174,000.00				78,174,000.00
应收清算款					
债权投资					
应收股利					
应收申购款				7,695,273.38	7,695,273.38
其他资产					
资产总计	322,547,344.39		14,771,671.58	2,361,073,203.09	2,698,392,219.06
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				83,372,630.90	83,372,630.90
应付赎回款				5,492,885.54	5,492,885.54
应付管理人报酬				3,449,138.36	3,449,138.36
应付托管费				2,652,488.74	2,652,488.74
应付销售服务费				389,614.50	389,614.50
应付投资顾问费					

应交税费	-	-	-	60.77	60.77
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,951,653.05	4,951,653.05
负债总计	-	-	-	100,308,471.86	100,308,471.86
利率敏感度缺口	322,547,344.39	-	14,771,671.58	2,260,764,731.23	2,598,083,747.20

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%，投资于潜力新蓝筹股票的资产不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-20%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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。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	1,852,171,138.96	93.60	2,353,377,929.71	90.58
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	14,771,671.58	0.57
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	1,852,171,138.96	93.60	2,368,149,601.29	91.15

#### 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%	85,070,114.72	133,709,715.58
	业绩比较基准下降5%	-85,070,114.72	-133,709,715.58

#### 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	1,850,685,108.97	2,339,008,971.49
第二层次	366,947.18	-
第三层次	1,119,082.81	29,140,629.80
合计	1,852,171,138.96	2,368,149,601.29

## 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	1,852,171,138.96	91.80
	其中：股票	1,852,171,138.96	91.80
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	163,191,871.15	8.09
8	其他各项资产	2,197,728.95	0.11
9	合计	2,017,560,739.06	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末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	165,046,179.88	8.34
C	制造业	1,395,076,357.65	70.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	22,835,566.15	1.15
F	批发和零售业	32,256,716.20	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	10,547,570.00	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,202,126.16	5.47
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	100,569,836.50	5.08
N	水利、环境和公共设施管理业	12,342,696.09	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,234,860.00	0.26
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,852,171,138.96	93.60

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	003031	中瓷电子	1,008,412	134,239,805.44	6.78
2	600188	兖矿能源	3,714,095	111,125,722.40	5.62
3	601965	中国汽研	4,870,210	100,569,836.50	5.08
4	688349	三一重能	2,554,093	82,292,876.46	4.16
5	300068	南都电源	3,860,850	74,746,056.00	3.78
6	600703	三安光电	4,236,678	73,040,328.72	3.69
7	000423	东阿阿胶	1,269,500	67,854,775.00	3.43
8	300896	爱美客	128,293	57,083,970.35	2.88
9	600570	恒生电子	1,228,400	54,405,836.00	2.75
10	300833	浩洋股份	467,800	51,191,354.00	2.59
11	600150	中国船舶	1,396,488	45,958,420.08	2.32
12	300586	美联新材	3,542,849	45,738,180.59	2.31
13	688522	纳睿雷达	825,528	44,182,258.56	2.23
14	601989	中国重工	8,644,600	41,666,972.00	2.11
15	000528	柳工	5,200,730	41,085,767.00	2.08
16	300751	迈为股份	240,811	40,788,567.18	2.06
17	601600	中国铝业	7,366,100	40,439,889.00	2.04
18	002705	新宝股份	2,190,157	39,488,530.71	2.00
19	600845	宝信软件	761,860	38,710,106.60	1.96
20	300285	国瓷材料	1,410,500	38,647,700.00	1.95
21	002371	北方华创	115,698	36,751,469.70	1.86
22	600256	广汇能源	5,098,728	34,977,274.08	1.77
23	601231	环旭电子	2,211,100	33,078,056.00	1.67
24	300034	钢研高纳	801,200	31,559,268.00	1.59
25	000568	泸州老窖	133,400	27,956,638.00	1.41
26	600771	广誉远	770,000	27,157,900.00	1.37
27	002532	天山铝业	4,524,040	27,098,999.60	1.37
28	300633	开立医疗	473,500	25,805,750.00	1.30
29	600970	中材国际	1,790,200	22,825,050.00	1.15
30	301017	漱玉平民	1,196,200	22,775,648.00	1.15
31	002057	中钢天源	2,110,804	22,163,442.00	1.12
32	688012	中微公司	137,190	21,463,375.50	1.08
33	002897	意华股份	431,800	19,983,704.00	1.01
34	688352	颀中科技	1,434,035	19,270,195.83	0.97
35	600482	中国动力	819,800	19,216,112.00	0.97
36	601020	华钰矿业	2,205,260	18,943,183.40	0.96
37	600933	爱柯迪	645,400	15,031,366.00	0.76
38	600986	浙文互联	2,338,500	14,966,400.00	0.76
39	603773	沃格光电	455,800	14,385,048.00	0.73
40	000922	佳电股份	1,053,700	13,866,692.00	0.70

41	688072	拓荆科技	32,001	13,631,465.97	0.69
42	002170	芭田股份	1,870,500	12,850,335.00	0.65
43	600420	国药现代	1,095,241	12,365,270.89	0.62
44	688480	赛恩斯	397,937	12,320,129.52	0.62
45	300065	海兰信	991,663	12,286,704.57	0.62
46	603169	兰石重装	1,516,300	11,281,272.00	0.57
47	600258	首旅酒店	556,600	10,547,570.00	0.53
48	600301	华锡有色	557,900	10,014,305.00	0.51
49	600760	中航沈飞	217,500	9,787,500.00	0.49
50	603368	柳药集团	380,900	9,412,039.00	0.48
51	688456	有研粉材	257,603	8,621,972.41	0.44
52	301319	唯特偶	112,000	6,703,200.00	0.34
53	688273	麦澜德	145,858	5,398,204.58	0.27
54	002607	中公教育	1,113,800	5,234,860.00	0.26
55	605337	李子园	270,920	4,952,417.60	0.25
56	000683	远兴能源	602,600	4,332,694.00	0.22
57	003019	宸展光电	174,350	3,574,175.00	0.18
58	002959	小熊电器	27,600	2,304,600.00	0.12
59	002430	杭氧股份	56,800	1,951,648.00	0.10
60	600438	通威股份	17,800	610,718.00	0.03
61	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
62	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
63	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
64	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
65	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
66	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
67	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
68	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
69	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
70	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
71	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
72	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
73	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
74	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
75	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
76	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
77	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
78	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
79	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
80	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
81	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
82	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
83	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00



84	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
85	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
86	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
87	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
88	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
89	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
90	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
91	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
92	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
93	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
94	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
95	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
96	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
97	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
98	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
99	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
100	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
101	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
102	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
103	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
104	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
105	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
106	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
107	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
108	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
109	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
110	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
111	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
112	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
113	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
114	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
115	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
116	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
117	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
118	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
119	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
120	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
121	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
122	603172	万丰股份	122	1,967.86	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(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	600703	三安光电	147,970,171.50	5.70
2	601398	工商银行	140,383,341.15	5.40
3	002532	天山铝业	88,718,210.54	3.41
4	002371	北方华创	79,299,493.00	3.05
5	600570	恒生电子	72,673,712.91	2.80
6	000423	东阿阿胶	71,138,732.31	2.74
7	600188	兖矿能源	64,597,089.17	2.49
8	300896	爱美客	63,737,164.51	2.45
9	688522	纳睿雷达	58,003,487.45	2.23
10	600011	华能国际	55,593,364.48	2.14
11	600027	华电国际	55,518,130.45	2.14
12	601600	中国铝业	54,037,877.00	2.08
13	300034	钢研高纳	51,529,945.53	1.98
14	600030	中信证券	49,481,748.04	1.90
15	601989	中国重工	46,010,395.97	1.77
16	600150	中国船舶	45,554,151.96	1.75
17	000933	神火股份	43,087,808.53	1.66
18	002705	新宝股份	38,649,277.46	1.49
19	000528	柳 工	37,408,628.00	1.44
20	600845	宝信软件	36,358,522.62	1.40

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	600188	兖矿能源	153,638,955.58	5.91
2	601398	工商银行	145,384,463.59	5.60
3	300750	宁德时代	97,488,555.86	3.75
4	600546	山煤国际	82,800,157.52	3.19
5	601699	潞安环能	80,651,441.18	3.10
6	300068	南都电源	79,650,499.00	3.07
7	002129	TCL 中环	73,367,255.25	2.82
8	601100	恒立液压	70,577,269.14	2.72
9	603338	浙江鼎力	68,568,039.38	2.64
10	600703	三安光电	64,765,829.50	2.49
11	600549	厦门钨业	64,071,962.32	2.47
12	600233	圆通速递	62,782,388.63	2.42
13	600011	华能国际	58,947,599.00	2.27
14	600795	国电电力	58,643,667.00	2.26
15	600027	华电国际	56,187,274.96	2.16
16	600256	广汇能源	53,634,762.00	2.06
17	000035	中国天楹	50,239,926.00	1.93

18	600030	中信证券	46,849,376.75	1.80
19	601058	赛轮轮胎	46,546,409.50	1.79
20	688261	东微半导	46,465,849.75	1.79

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	2,321,668,653.48
卖出股票收入（成交）总额	2,752,205,404.87

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 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	732,284.23
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,465,444.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,197,728.95

### 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

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
建信潜力 新蓝筹股 票 A	176,087	2,264.18	206,908,758.67	51.90	191,783,186.83	48.10
建信潜力 新蓝筹股 票 C	18,109	10,717.56	166,591,930.22	85.83	27,492,439.63	14.17
合计	194,196	3,052.46	373,500,688.89	63.01	219,275,626.46	36.99

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信潜力新蓝筹股票 A	653,635.43	0.16
	建信潜力新蓝筹股票 C	129,717.26	0.07
	合计	783,352.69	0.13

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

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

项目	建信潜力新蓝筹股票 A	建信潜力新蓝筹股票 C
基金合同生效日 (2014年9月10日) 基金份额总额	1,467,496,662.54	-
本报告期期初基金份 额总额	445,860,797.99	312,337,996.65
本报告期基金总申购 份额	201,958,922.04	145,465,542.53

减：本报告期基金总赎回份额	249,127,774.53	263,719,169.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	398,691,945.50	194,084,369.85

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，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 (%)	
中信证券	3	1,670,763,684.64	33.01	1,449,932.42	33.79	-
华创证券	1	596,293,691.45	11.78	555,327.41	12.94	-
东北证券	1	521,151,374.37	10.30	375,904.32	8.76	-
东吴证券	1	484,369,683.11	9.57	451,095.58	10.51	-
华泰证券	5	459,570,224.34	9.08	394,496.45	9.19	-
中邮证券	1	407,137,276.63	8.04	297,739.54	6.94	-
光大证券	1	288,391,350.49	5.70	265,697.61	6.19	-
开源证券	1	278,443,498.27	5.50	203,627.90	4.74	-
国泰君安	2	154,543,822.42	3.05	111,472.92	2.60	-
招商证券	2	110,529,813.27	2.18	101,830.54	2.37	-
太平洋证券	1	90,567,582.96	1.79	84,345.48	1.97	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-	-

证券						
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	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、本基金本报告期内无剔除交易单元，新增中邮证券、开源证券、东北证券 3 个交易单元。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(%)
中信证券	15,306,520.58	100.00	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-



光大证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
高华证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

### 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	关于新增邮储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06月02日
2	关于调整旗下部分基金申购金额起点（包括转换转入、定投）及赎回份额下限（包括转换转出）的公告	指定报刊和/或公司网站	2023年05月25日
3	建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告	指定报刊和/或公司网站	2023年04月28日
4	建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金暂停大额申购、大额转换转入、	指定报刊和/或公司网站	2023年04月01日

	定期定额投资公告		
5	关于建信潜力新蓝筹股票型基金 A 类份额不参加申购、定投费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 03 月 30 日
6	关于新增中信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 15 日
7	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
8	关于新增兴业银行银银平台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 06 日
9	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
10	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
11	关于新增山西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 02 月 22 日
12	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
13	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潜力新蓝筹股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信潜力新蓝筹股票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