

建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基  
金  
2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 建信 MSCI 中国 A 股指数增强   |
| 基金主代码      | 007806   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2019 年 11 月 13 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 245,626,179.11 份   |
| 投资目标       | 本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。   |
| 投资策略       | 本基金采用指数增强型投资策略，以 MSCI 中国 A 股指数（人民币）作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 |
| 业绩比较基准     | MSCI 中国 A 股指数（人民币）收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%  |
| 风险收益特征     | 本基金为股票指数增强型基金，跟踪 MSCI 中国 A 股指数（人民币），其预期风险与预期收益高于债券型基金、混合型基金、货币市场基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。  |

|                 |                      |                      |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 基金管理人           | 建信基金管理有限责任公司         |                      |
| 基金托管人           | 上海浦东发展银行股份有限公司       |                      |
| 下属分级基金的基金简称     | 建信 MSCI 中国 A 股指数增强 A | 建信 MSCI 中国 A 股指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 007806               | 007807               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 77,991,360.51 份      | 167,634,818.60 份     |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日） |                      |
|-----------------|---------------------------------------|----------------------|
|                 | 建信 MSCI 中国 A 股指数增强 A                  | 建信 MSCI 中国 A 股指数增强 C |
| 1. 本期已实现收益      | -3,254,746.21                         | -3,846,876.30        |
| 2. 本期利润         | -5,548,648.10                         | -7,024,282.58        |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0738                               | -0.0749              |
| 4. 期末基金资产净值     | 80,859,946.89                         | 172,664,818.83       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0368                                | 1.0300               |

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、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 MSCI 中国 A 股指数增强 A

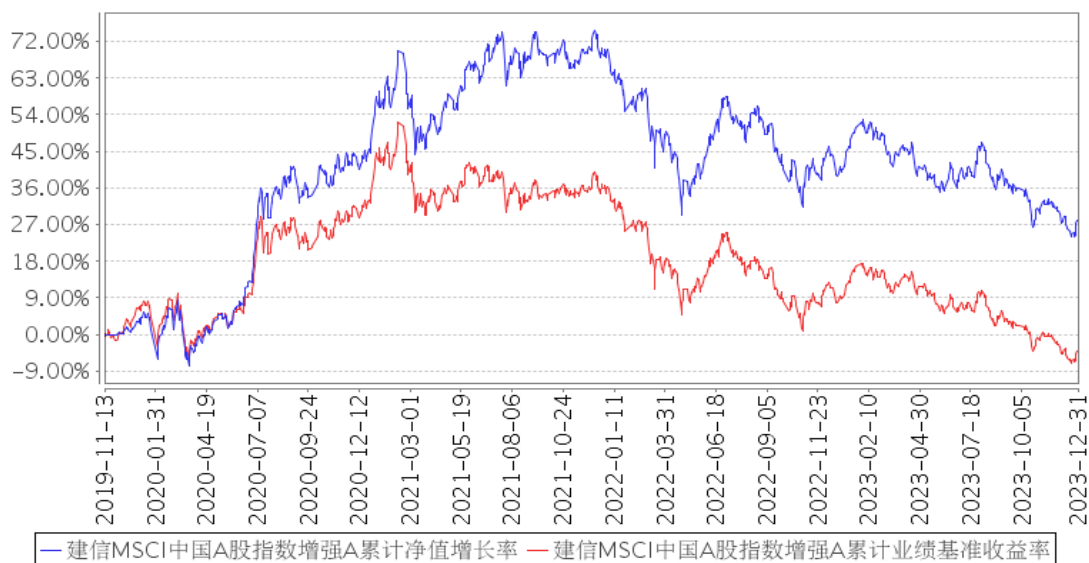
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -5.90%  | 0.79%     | -6.10%     | 0.74%         | 0.20%  | 0.05% |
| 过去六个月      | -7.93%  | 0.85%     | -9.88%     | 0.79%         | 1.95%  | 0.06% |
| 过去一年       | -9.00%  | 0.82%     | -12.18%    | 0.77%         | 3.18%  | 0.05% |
| 过去三年       | -14.87% | 1.10%     | -29.86%    | 1.04%         | 14.99% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 27.85%  | 1.17%     | -4.13%     | 1.12%         | 31.98% | 0.05% |

## 建信 MSCI 中国 A 股指数增强 C

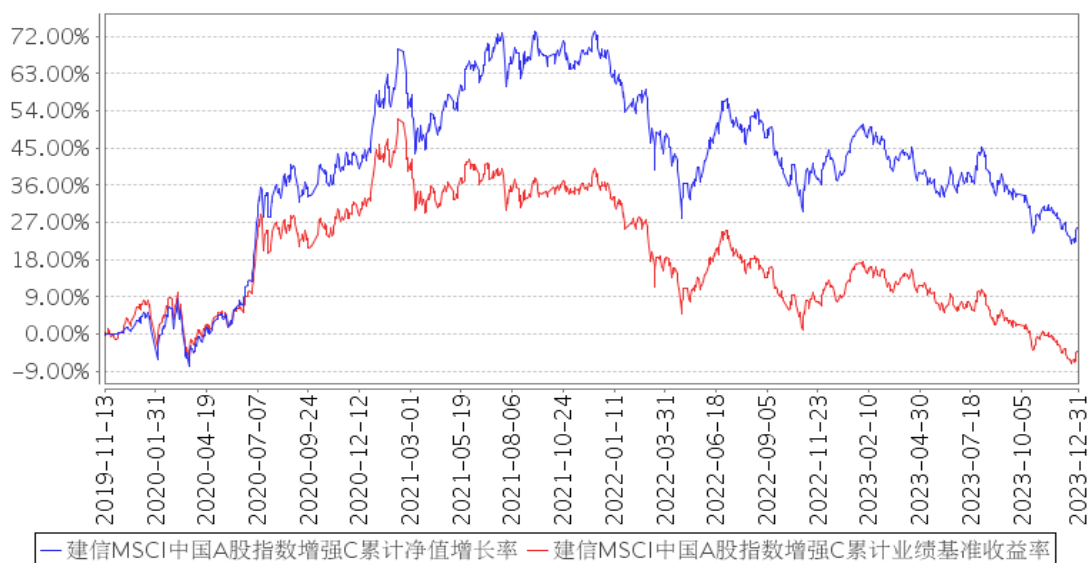
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -5.99%  | 0.79%     | -6.10%     | 0.74%         | 0.11%  | 0.05% |
| 过去六个月      | -8.12%  | 0.86%     | -9.88%     | 0.79%         | 1.76%  | 0.07% |
| 过去一年       | -9.35%  | 0.82%     | -12.18%    | 0.77%         | 2.83%  | 0.05% |
| 过去三年       | -15.89% | 1.10%     | -29.86%    | 1.04%         | 13.97% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 25.77%  | 1.17%     | -4.13%     | 1.12%         | 29.90% | 0.05% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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MSCI中国A股指数增强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MSCI中国A股指数增强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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                 | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|--------------------|-------------|------|--------|---|
|     |                    | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 叶乐天 | 数量投资部副总经理，本基金的基金经理 | 2019年11月13日 | -    | 15     | 叶乐天先生，数量投资部副总经理，博士。曾任中国国际金融有限公司市场风险管理分析员、量化分析经理。2011年9月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理。2012年3月21日至2016年7月20日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013年3月28日起任建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金的基金经理，该基金自2021年1月1日起转型为建信央视财经50指数证券投资基金（LOF），叶乐天继续担任该基金的基金经理；2014年1月27日起任建信中证500指数增强型证券投资基金的基金经理；2015年8月26日 |

|     |                     |                  |   |    |   |
|-----|---------------------|------------------|---|----|---|
|     |                     |                  |   |    | 起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 4 月 18 日至 2023 年 11 月 17 日任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 22 日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 1 月 10 日至 2022 年 8 月 9 日任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 8 月 24 日至 2022 年 11 月 17 日任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日起任建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日起任建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 15 日起任建信灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2022 年 12 月 23 日起任建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理。 |
| 赵云煜 | 数量投资部总经理助理，本基金的基金经理 | 2019 年 11 月 13 日 | - | 11 | 赵云煜先生，数量投资部总经理助理，硕士。曾任太平资产管理有限公司风险管理分析师。2014 年 7 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部研究员、基金经理助理、基金经理、总经理助理等职务。2016 年 6 月 22 日至 2018 年 11 月 7 日任专户投资经理，2018 年 11 月 16 日至 2022 年 11 月 17 日任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日起任建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 9 月 11 日起任建信中证红利潜力指数证券投资基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日起任建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。  |

#### 4.1.1 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

| 姓名  | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值（元）          | 任职时间             |
|-----|----------|---------|------------------|------------------|
| 赵云煜 | 公募基金     | 3       | 1,888,869,606.06 | 2018 年 11 月 16 日 |
|     | 私募资产管理计划 | 5       | 308,979,422.90   | 2016 年 6 月 22 日  |
|     | 其他组合     | -       | -                | -                |

|  |    |   |                  |   |
|--|----|---|------------------|---|
|  | 合计 | 8 | 2,197,849,028.96 | - |
|--|----|---|------------------|---|

## 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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》的规定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 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。

### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期间，本基金基准指数 MSCI 中国 A 股指数震荡下行为主。本基金稳健开展投资运作，并跑赢了基准。

本基金为指数增强基金，主要目标是在跟踪指数的基础上力争跑赢指数。本基金主要通过量化模型进行组合的风险管理和股票选择。具体来说，产品通过风险模型管理股票组合在行业、风格等风险因子上的暴露，适度控制和基准指数之间的差异，以保持产品和基准指数之间相对合理的跟踪误差；同时，产品通过以建信多因子模型为主的量化选股模型进行个股选择，在保持规定的成分股比例下，优选股票力争战胜基准的收益。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率-5.90%，波动率 0.79%，业绩比较基准收益率-6.10%，波动率

0.74%。本报告期本基金 C 净值增长率-5.99%，波动率 0.79%，业绩比较基准收益率-6.10%，波动率 0.74%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 236,886,306.88 | 90.76        |
|    | 其中：股票             | 236,886,306.88 | 90.76        |
| 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      | 20,473,290.31  | 7.84         |
| 8  | 其他资产              | 3,630,718.88   | 1.39         |
| 9  | 合计                | 260,990,316.07 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 1,379,530.00   | 0.54         |
| B  | 采矿业              | 8,791,515.00   | 3.47         |
| C  | 制造业              | 109,763,627.93 | 43.30        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,392,175.00   | 1.34         |
| E  | 建筑业              | 2,205,625.00   | 0.87         |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 5,023,905.20   | 1.98         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 762,450.00     | 0.30         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 7,389,372.60   | 2.91         |
| J  | 金融业              | 42,294,925.22  | 16.68        |
| K  | 房地产业             | 1,966,125.00   | 0.78         |



|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | 4,911,595.00   | 1.94  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 742,152.00     | 0.29  |
| 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       | 2,477,412.00   | 0.98  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 2,187,234.00   | 0.86  |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 193,287,643.95 | 76.24 |

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 3,437,756.00  | 1.36         |
| C  | 制造业              | 26,182,725.68 | 10.33        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,570,552.00  | 1.01         |
| E  | 建筑业              | 2,255,494.00  | 0.89         |
| F  | 批发和零售业           | 222,850.46    | 0.09         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,319,274.57  | 1.31         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,179,928.28  | 1.25         |
| J  | 金融业              | 1,157,078.00  | 0.46         |
| K  | 房地产业             | 1,255,590.00  | 0.50         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,058.00      | 0.00         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 10,273.52     | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 4,082.42      | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | -             | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 43,598,662.93 | 17.20        |

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 600519 | 贵州茅台 | 7,400     | 12,772,400.00 | 5.04         |
| 2  | 000568 | 泸州老窖 | 29,300    | 5,257,006.00  | 2.07         |
| 3  | 002352 | 顺丰控股 | 117,863   | 4,761,665.20  | 1.88         |
| 4  | 002304 | 洋河股份 | 41,900    | 4,604,810.00  | 1.82         |
| 5  | 601138 | 工业富联 | 298,400   | 4,511,808.00  | 1.78         |
| 6  | 002142 | 宁波银行 | 213,300   | 4,289,463.00  | 1.69         |
| 7  | 601658 | 邮储银行 | 982,600   | 4,274,310.00  | 1.69         |
| 8  | 300750 | 宁德时代 | 25,800    | 4,212,108.00  | 1.66         |
| 9  | 600016 | 民生银行 | 1,126,000 | 4,211,240.00  | 1.66         |
| 10 | 601888 | 中国中免 | 50,300    | 4,209,607.00  | 1.66         |

### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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  | 601018 | 宁波港  | 931,600 | 3,316,496.00 | 1.31         |
| 2  | 601001 | 晋控煤业 | 268,400 | 3,309,372.00 | 1.31         |
| 3  | 603786 | 科博达  | 35,900  | 2,561,824.00 | 1.01         |
| 4  | 688055 | 龙腾光电 | 482,000 | 2,352,160.00 | 0.93         |
| 5  | 002608 | 江苏国信 | 352,000 | 2,312,640.00 | 0.91         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

### 5.5 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债券投资明细

无。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

无。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 38,904.28    |
| 2  | 应收证券清算款 | 3,535,925.44 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 55,889.16    |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 其他    | -            |
| 8 | 合计    | 3,630,718.88 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

##### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 建信 MSCI 中国 A 股指数增强 A | 建信 MSCI 中国 A 股指数增强 C |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 68,043,015.64        | 53,496,198.40        |
| 报告期期间基金总申购份额              | 10,621,726.03        | 119,936,842.68       |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 673,381.16           | 5,798,222.48         |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                    | -                    |
| 报告期期末基金份额总额               | 77,991,360.51        | 167,634,818.60       |

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。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                  |              |
|------------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 6,881,624.23 |
|------------------|--------------|

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| 报告期期间买入/申购总份额             | -            |
| 报告期期间卖出/赎回总份额             | -            |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额          | 6,881,624.23 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 2.80         |

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额(份) | 交易金额(元)    | 适用费率(%) |
|----|------|------------|---------|------------|---------|
| 1  | 分红   | 2023-10-19 | -       | 165,158.98 | -       |
| 2  | 分红   | 2023-12-28 | -       | 688,162.42 | -       |
| 合计 |      |            | -       | 853,321.40 |         |

注：该基金分红业务费用为 0。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                     |      |               | 报告期末持有基金情况 |               |          |
|---|----------------|-------------------------------------|------|---------------|------------|---------------|----------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间             | 期初份额 | 申购份额          | 赎回份额       | 持有份额          | 份额占比 (%) |
| 机构  | 1              | 2023 年 12 月 04 日 - 2023 年 12 月 31 日 | -    | 75,804,135.48 | -          | 75,804,135.48 | 30.86    |
| 产品特有风险  |                |                                     |      |               |            |               |          |
| <p>本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。</p> |                |                                     |      |               |            |               |          |

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信 MSCI 中国 A 股指数增强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。

## 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

## 9.3 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

2024 年 1 月 19 日