

建信中证 500 指数量化增强型发起式证券  
投资基金  
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 29 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 2024 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
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	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
7.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	59
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	59
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4 基金投资策略的改变 .....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金	
基金简称	建信中证 500 指数量化增强	
基金主代码	016267	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 月 23 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	173, 158, 290. 75 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
下属分级基金的交易代码	016267	016268
报告期末下属分级基金的份额总额	113, 224, 616. 59 份	59, 933, 674. 16 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以标的指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0. 5%，年跟踪误差不超过 7. 75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。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	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	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	xinxipilu@ccbfund.cn
		方圆
		95559
		fangy_20@bankcomm.com

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 国际金融中心 16 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	100033	200336
法定代表人	生柳荣	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	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
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(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
本期已实现收益	-3,588,016.02	-2,901,665.35
本期利润	-4,590,941.38	-3,130,114.34
加权平均基金份 额本期利润	-0.0382	-0.0441
本期加权平均净 值利润率	-4.13%	-4.79%
本期基金份额净 值增长率	-4.06%	-4.20%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	-10,912,541.83	-6,023,018.89
期末可供分配基	-0.0964	-0.1005

金份额利润		
期末基金资产净值	102,895,153.50	54,225,443.94
期末基金份额净值	0.9088	0.9048
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-9.12%	-9.52%

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

建信中证 500 指数量化增强发起 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	-5.12%	0.86%	-6.55%	0.91%	1.43%	-0.05%
过去三个月	-1.94%	0.98%	-6.16%	1.09%	4.22%	-0.11%
过去六个月	-4.06%	1.44%	-8.46%	1.53%	4.40%	-0.09%
过去一年	-12.72%	1.15%	-16.71%	1.21%	3.99%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-9.12%	1.02%	-13.68%	1.07%	4.56%	-0.05%

建信中证 500 指数量化增强发起 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	-5.14%	0.86%	-6.55%	0.91%	1.41%	-0.05%
过去三个月	-2.01%	0.98%	-6.16%	1.09%	4.15%	-0.11%

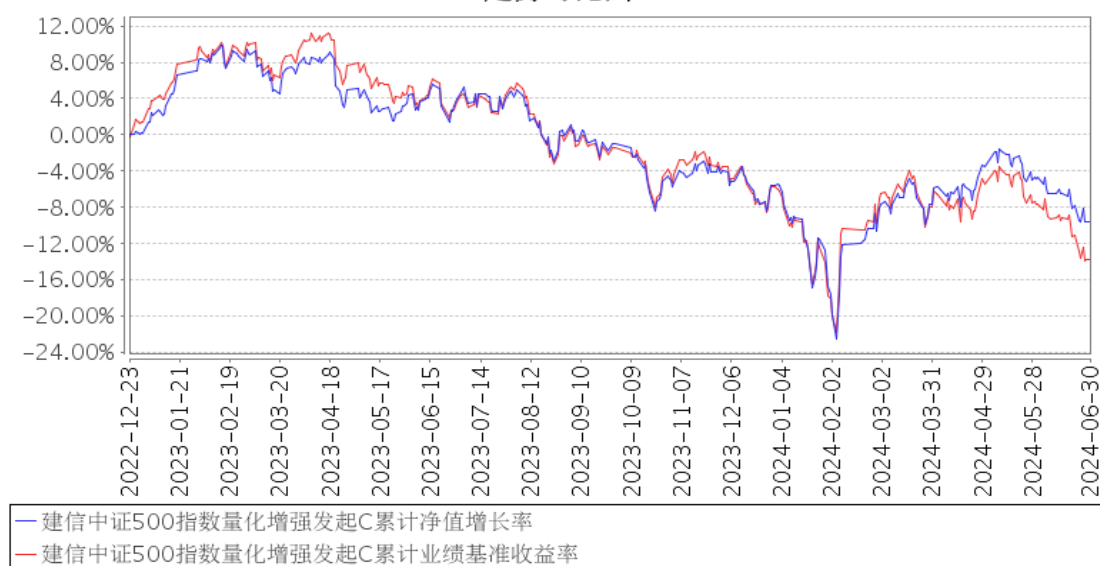
过去六个月	-4.20%	1.44%	-8.46%	1.53%	4.26%	-0.09%
过去一年	-12.98%	1.15%	-16.71%	1.21%	3.73%	-0.06%
自基金合同生效起 至今	-9.52%	1.02%	-13.68%	1.07%	4.16%	-0.05%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信中证500指数量化增强发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信中证500指数量化增强发起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、中国华电集团产融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、南京、武汉七家分公司，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 8000 万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至 2024 年 6 月 30 日，公司管理运作 166 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 1.12 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		
刘明辉	本基金的基金经理	2022 年 12 月 23 日	-	8	刘明辉先生，硕士。2015 年 7 月毕业于北京大学应用统计专业，同年 7 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部助理研究员、研究员兼投资经理助理、投资经理、基金经理职务。2021 年 10 月 27 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；2022 年 10 月 17 日起任建信恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理；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。
叶乐天	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2022 年 12 月 23 日	-	16	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

					<p>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 日至 2024 年 2 月 5 日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。</p>
--	--	--	--	--	---

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《建信中证 500 指数量化增强型发起式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，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数增强型基金，基准指数为中证 500 指数。在报告期内，管理人通过量化模型构建投资组合并进行风险管理。主要模型为多因子模型，并结合了卫星策略。管理人充分利用现有数据，并引入新的数据源，构建信号稳定有效、与原因子相关度低的因子，进行加权组合，作为选股的主要依据。同时关注近期风格变化对投资组合的影响。

报告期内，微盘股出现数次急跌，对量化组合影响较为明显。管理人坚持风格中性的投资策略，并进一步减少了微盘股在股票池中的比例，避免在微盘端暴露过多，降低投资风险。

在运作期内，管理人利用股指期货对基金仓位调整并利用基差策略进行增强。

报告期内，本基金取得了一定的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率-4.06%，波动率 1.44%，业绩比较基准收益率-8.46%，波动率 1.53%。本报告期本基金 C 净值增长率-4.20%，波动率 1.44%，业绩比较基准收益率-8.46%，波动

率 1.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年 A 股市场整体呈现震荡，没有明显的主营行情，也缺少增量资金，整体情绪并不乐观。长期信心仍有待进一步观察政策效果和经济修复程度。未来我们认为市场是一个温和修复的震荡市。

中证 500 指数在 1 月和 2 月初下跌明显，修复后呈现震荡行情。2 月初的急跌由微盘股引起，并深刻影响了量化投资的环境。在二季度，微盘股又出现数次急跌情形，表明其潜在风险的扩大。

微盘股在过去相当长的时间内为大量量化产品提供了超额收益，而量化模型是利用过往数据学习而来，所以或多或少受微盘风格影响。未来微盘股的市场环境发生了较大变化，在投资端、监管端都收到更多的关注。我们认为未来微盘难以如过往一般提供较稳定的超额收益，所以在投资方面尽可能去避免微盘股对我们组合的影响。

500 指数市值中偏大，行业分布均匀，是市场中相对平衡的指数，也是被最多指增和量化多头产品作为基准的指数之一。在缺少主流行情的市场中，指数增强产品既能 BETA 收益，又通过量化模型去获得超额收益，表现相对稳健。

未来我们会针对 500 指数设计定制性的策略，保持模型更新速度。持仓方面保持较低的各类风险敞口，保持和指数类似的风格和行业占比，降低在微盘股方面的风险暴露。在紧跟指数的同时聚焦选股，以期在更加复杂的市场状况中争取获得更高超额收益。

#### 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 and 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，基金托管人在建信中证 500 指数量化增强型发起式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中证 500 指数量化增强型发起式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中证 500 指数量化增强型发起式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：建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	12,291,098.38	14,906,927.33
结算备付金		3,567,758.22	1,966,353.46
存出保证金		708,134.40	282,624.00
交易性金融资产	6.4.7.2	141,780,605.49	186,787,042.46

其中：股票投资		141,780,605.49	186,787,042.46
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
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		127.57	-
应收申购款		134,050.37	381,463.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		158,481,774.43	204,324,410.87
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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		-	-
应付赎回款		1,050,772.28	970,008.36
应付管理人报酬		133,797.38	176,052.21
应付托管费		13,379.74	17,605.21
应付销售服务费		13,852.55	21,285.97
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,234.42	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	142,140.62	76,541.44
负债合计		1,361,176.99	1,261,493.19
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	173,158,290.75	214,623,580.44
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-16,037,693.31	-11,560,662.76
净资产合计		157,120,597.44	203,062,917.68
负债和净资产总计		158,481,774.43	204,324,410.87

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 173,158,290.75 份，其中建信中证 500 指数量化增强发起 A 基金份额总额 113,224,616.59 份，基金份额净值人民币 0.9088 元；建信中证 500 指数量化增强发起 C 基金份额总额 59,933,674.16 份，基金份额净值人民币 0.9048 元。

## 6.2 利润表

会计主体：建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-6,570,957.62	-4,672,481.92
1. 利息收入		45,428.95	40,056.72
其中：存款利息收入	6.4.7.13	45,428.95	37,782.47
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		-	2,274.25
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,398,187.22	-1,593,133.03
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-8,914,137.90	-3,458,420.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	1,141,139.04	48,550.04
股利收益	6.4.7.19	2,374,811.64	1,816,737.07
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	-1,231,374.35	-3,243,406.61
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	13,175.00	124,001.00
<b>减：二、营业总支出</b>		1,150,098.10	886,588.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	878,666.46	736,027.02

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	87,866.68	73,602.65
3. 销售服务费		97,695.45	48,057.35
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		4,117.24	507.91
8. 其他费用	6.4.7.23	81,752.27	28,393.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-7,721,055.72</b>	<b>-5,559,070.00</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-7,721,055.72</b>	<b>-5,559,070.00</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>-7,721,055.72</b>	<b>-5,559,070.00</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	214,623,580.44	-	-11,560,662.76	203,062,917.68
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	214,623,580.44	-	-11,560,662.76	203,062,917.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-41,465,289.69	-	-4,477,030.55	-45,942,320.24
（一）、综合收益总额	-	-	-7,721,055.72	-7,721,055.72
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-41,465,289.69	-	3,244,025.17	-38,221,264.52



(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	23,156,051.58	-	-1,854,350.06	21,301,701.52
2. 基金赎回款	-64,621,341.27	-	5,098,375.23	-59,522,966.04
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	173,158,290.75	-	-16,037,693.31	157,120,597.44
项目	上年度可比期间 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	13,337,950.88	-	28,424.58	13,366,375.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	13,337,950.88	-	28,424.58	13,366,375.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	175,545,761.50	-	7,697,479.10	183,243,240.60
(一)、综合收益总额	-	-	-5,559,070.00	-5,559,070.00
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	175,545,761.50	-	13,256,549.10	188,802,310.60
其中：1. 基金申购款	341,212,273.56	-	25,367,551.64	366,579,825.20
2. 基金赎回款	-165,666,512.06	-	-12,111,002.54	-177,777,514.60

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	188,883,712.38	-	7,725,903.68	196,609,616.06

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

建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]1423 号《关于准予建信中证 500 指数量化增强型发起式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《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 13,334,913.62 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 61490173\_A104 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 12 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 13,337,950.88 份基金份额，其中认购资金利息折合 3,037.26 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。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/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认购/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。A 类基金份额、C 类基金份额分设不同的基金代码，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

将分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,001,889.08 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

#### 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 2024 年 6 月 30 日的财

务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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%，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；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	3,819,865.12
等于：本金	3,819,645.97
加：应计利息	219.15
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	8,471,233.26
等于：本金	8,470,774.79
加：应计利息	458.47
减：坏账准备	-
合计	12,291,098.38

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 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	148,523,316.92	-	141,780,605.49	-6,742,711.43
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	148,523,316.92	-	141,780,605.49	-6,742,711.43

## 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,098,360.00	-	-	-
其中：股指期货投资	6,098,360.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,098,360.00	-	-	-

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

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
----	----	----------	------	--------

IC2407	IC2407	6.00	5,901,120.00	-197,240.00
合计				-197,240.00
减：可抵销期货 暂收款				-197,240.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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 2024 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	119,563.12
其他应付款	22,577.50
合计	142,140.62

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 500 指数量化增强发起 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	126,436,026.38	126,436,026.38
本期申购	2,716,286.22	2,716,286.22
本期赎回（以“-”号填列）	-15,927,696.01	-15,927,696.01
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	113,224,616.59	113,224,616.59

建信中证 500 指数量化增强发起 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	88,187,554.06	88,187,554.06
本期申购	20,439,765.36	20,439,765.36
本期赎回（以“-”号填列）	-48,693,645.26	-48,693,645.26
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	59,933,674.16	59,933,674.16

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

建信中证 500 指数量化增强发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,846,454.59	2,179,594.96	-6,666,859.63
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-8,846,454.59	2,179,594.96	-6,666,859.63
本期利润	-3,588,016.02	-1,002,925.36	-4,590,941.38
本期基金份额交易产生的变动数	1,521,928.78	-593,590.86	928,337.92
其中：基金申购款	-318,530.71	86,676.38	-231,854.33
基金赎回款	1,840,459.49	-680,267.24	1,160,192.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,912,541.83	583,078.74	-10,329,463.09

建信中证 500 指数量化增强发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,415,287.91	1,521,484.78	-4,893,803.13
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-6,415,287.91	1,521,484.78	-4,893,803.13
本期利润	-2,901,665.35	-228,448.99	-3,130,114.34
本期基金份额交易产生的变动数	3,293,934.37	-978,247.12	2,315,687.25
其中：基金申购款	-2,318,131.57	695,635.84	-1,622,495.73
基金赎回款	5,612,065.94	-1,673,882.96	3,938,182.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,023,018.89	314,788.67	-5,708,230.22

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,727.85
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	11,088.54
结算备付金利息收入	30,612.49
其他	0.07
合计	45,428.95

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,914,137.90
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	-8,914,137.90

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	555,701,062.22
减：卖出股票成本总额	563,462,941.56
减：交易费用	1,152,258.56
买卖股票差价收入	-8,914,137.90

##### 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

无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 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

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	1,141,139.04

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,374,811.64
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	2,374,811.64

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,052,227.68
股票投资	-1,052,227.68
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-179,146.67
权证投资	-
期货投资	-179,146.67
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	-1,231,374.35

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,174.38
基金转换费收入	0.62
合计	13,175.00

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,181.96
证券组合费	6.02
存托服务费	1.17
合计	81,752.27

#### 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	878,666.46	736,027.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	403,869.15	81,318.90
应支付基金管理人的净管理费	474,797.31	654,708.12

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 1.00%的年费率计提，逐日累计每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00 / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	87,866.68	73,602.65

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10 / \text{当年天数}。$$

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信中证 500 指数量 化增强发起 A	建信中证 500 指数量 化增强发起 C	合计
建信基金	-	4.25	4.25
交通银行	-	11.25	11.25
中国建设银行	-	5,777.83	5,777.83
合计	-	5,793.33	5,793.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	建信中证 500 指数量 化增强发起 A	建信中证 500 指数量 化增强发起 C	合计
建信基金	-	0.20	0.20
交通银行	-	0.50	0.50
中国建设银行	-	4,077.69	4,077.69
合计	-	4,078.39	4,078.39

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 0.3%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 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

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
基金合同生效日(2022 年 12 月 23 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,889.08	-
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	10,001,889.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.83%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
基金合同生效日(2022 年 12 月 23 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,889.08	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-



减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,889.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.95%	-

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

#### 6.4.10.5.2 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	3,819,865.12	3,727.85	21,656,763.81	18,112.37

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（2024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
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新发未上市	17.39	20.60	123	2,138.97	2,533.80	-
001387	雪祺电	2024年1月4日	6个月	新发未上市	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-

	气	日								
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新发未上市	17.43	34.56	152	2,649.36	5,253.12	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新发未上市	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新发未上市	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新发未上市	16.16	32.27	327	5,284.32	10,552.29	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新发未上市	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新发未上市	11.88	18.98	362	4,300.56	6,870.76	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新发未上市	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新发未上市	44.95	65.93	100	4,495.00	6,593.00	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新发未上市	21.73	25.26	224	4,867.52	5,658.24	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新发未上市	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301591	肯特股	2024年2月20日	6个月	新发未上市	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-

	份	日								
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	新发未上市	16.20	15.96	274	4,438.80	4,373.04	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新发未上市	21.28	29.49	86	1,830.08	2,536.14	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新发未上市	18.65	18.65	762	14,211.30	14,211.30	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新发未上市	18.65	18.65	85	1,585.25	1,585.25	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新发未上市	29.02	25.36	76	2,205.52	1,927.36	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新发未上市	72.46	68.06	33	2,391.18	2,245.98	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新发未上市	26.00	37.49	102	2,652.00	3,823.98	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新发未上市	19.18	22.66	104	1,994.72	2,356.64	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新发未上市	20.56	20.56	772	15,872.32	15,872.32	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新发未上市	20.56	20.56	86	1,768.16	1,768.16	-
603381	永臻股	2024年6月19日	6个月	新发未上市	23.35	25.13	72	1,681.20	1,809.36	-

	份	日								
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新发未上市	19.86	42.51	206	4,091.16	8,757.06	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新发未上市	86.96	174.93	63	5,478.48	11,020.59	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新发未上市	22.43	31.55	180	4,037.40	5,679.00	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新发未上市	15.69	18.79	338	5,303.22	6,351.02	-
688717	艾罗能源	2023年12月26日	6个月	新发未上市	55.66	47.02	3,596	200,153.36	169,083.92	-

#### 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**

无。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	12,291,098.38	-	-	-	12,291,098.38
结算备付金	3,567,758.22	-	-	-	3,567,758.22
存出保证金	708,134.40	-	-	-	708,134.40
交易性金融资产	-	-	-	-141,780,605.49	141,780,605.49
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	-	-	-	127.57	127.57
应收申购款	-	-	-	134,050.37	134,050.37
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,566,991.00	-	-	-141,914,783.43	158,481,774.43
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	-	-	-	1,050,772.28	1,050,772.28
应付管理人报酬	-	-	-	133,797.38	133,797.38
应付托管费	-	-	-	13,379.74	13,379.74
应付销售服务费	-	-	-	13,852.55	13,852.55
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,234.42	7,234.42
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	142,140.62	142,140.62
负债总计	-	-	-	1,361,176.99	1,361,176.99
利率敏感度缺口	16,566,991.00	-	-	-140,553,606.44	157,120,597.44
上年度末 2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	14,906,927.33	-	-	-	14,906,927.33
结算备付金	1,966,353.46	-	-	-	1,966,353.46
存出保证金	282,624.00	-	-	-	282,624.00
交易性金融资产	-	-	-	-186,787,042.46	186,787,042.46
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	-	-	381,463.62	381,463.62
其他资产	-	-	-	-
资产总计	17,155,904.79	-	187,168,506.08	204,324,410.87
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	-	-	970,008.36	970,008.36
应付管理人报酬	-	-	176,052.21	176,052.21
应付托管费	-	-	17,605.21	17,605.21
应付销售服务费	-	-	21,285.97	21,285.97
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	76,541.44	76,541.44
负债总计	-	-	1,261,493.19	1,261,493.19
利率敏感度缺口	17,155,904.79	-	-185,907,012.89	203,062,917.68

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（上年末：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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。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 2024年6月30日		上年度末 2023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	141,780,605.49	90.24	186,787,042.46	91.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	141,780,605.49	90.24	186,787,042.46	91.98

## 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	7,269,426.36	9,573,168.25
	业绩比较基准下降5%	-7,269,426.36	-9,573,168.25

## 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	141,442,271.22	185,834,244.09
第二层次	33,437.03	285,925.42
第三层次	304,897.24	666,872.95
合计	141,780,605.49	186,787,042.46

## 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	141,780,605.49	89.46
	其中：股票	141,780,605.49	89.46
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	15,858,856.60	10.01
8	其他各项资产	842,312.34	0.53
9	合计	158,481,774.43	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,060,109.00	1.31
B	采矿业	6,596,420.00	4.20
C	制造业	69,958,280.91	44.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,717,090.00	4.28
E	建筑业	2,650,652.00	1.69
F	批发和零售业	3,247,798.88	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	3,521,082.85	2.24
H	住宿和餐饮业	55,575.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,821,821.60	2.43
J	金融业	12,708,663.72	8.09
K	房地产业	1,920,029.00	1.22
L	租赁和商务服务业	275,603.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	541,662.00	0.34
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	1,960,148.00	1.25
S	综合	1,191,872.00	0.76
	合计	117,226,807.96	74.61

## 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	779,199.00	0.50
C	制造业	14,422,160.32	9.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,164.00	0.00
E	建筑业	24,138.00	0.02
F	批发和零售业	516,714.43	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	133,757.88	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,317,147.20	3.38
J	金融业	1,892,873.00	1.20
K	房地产业	608,467.00	0.39
L	租赁和商务服务业	57,115.12	0.04
M	科学研究和技术服务业	19,558.42	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	8,510.16	0.01
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	766,993.00	0.49
S	综合	-	-
	合计	24,553,797.53	15.63

## 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

## 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000738	航发控制	117,500	2,358,225.00	1.50
2	600582	天地科技	334,600	2,305,394.00	1.47
3	601216	君正集团	600,760	2,216,804.40	1.41
4	000598	兴蓉环境	293,300	2,205,616.00	1.40

5	002408	齐翔腾达	388,900	2,177,840.00	1.39
6	002064	华峰化学	291,000	2,086,470.00	1.33
7	600598	北大荒	160,900	2,009,641.00	1.28
8	600517	国网英大	463,300	2,006,089.00	1.28
9	000987	越秀资本	398,982	1,978,950.72	1.26
10	601567	三星医疗	55,500	1,942,500.00	1.24
11	601231	环旭电子	114,500	1,837,725.00	1.17
12	002595	豪迈科技	48,000	1,832,160.00	1.17
13	600967	内蒙一机	241,800	1,740,960.00	1.11
14	000883	湖北能源	257,000	1,544,570.00	0.98
15	002372	伟星新材	97,300	1,500,366.00	0.95
16	600704	物产中大	343,400	1,490,356.00	0.95
17	002078	太阳纸业	106,400	1,484,280.00	0.94
18	603185	弘元绿能	86,100	1,471,449.00	0.94
19	600566	济川药业	46,000	1,458,660.00	0.93
20	600873	梅花生物	145,000	1,452,900.00	0.92
21	600820	隧道股份	218,100	1,424,193.00	0.91
22	000933	神火股份	68,600	1,387,778.00	0.88
23	688172	燕东微	85,000	1,375,300.00	0.88
24	002500	山西证券	281,100	1,321,170.00	0.84
25	002128	电投能源	61,900	1,306,090.00	0.83
26	000563	陕国投 A	471,400	1,296,350.00	0.83
27	300502	新易盛	12,200	1,287,710.00	0.82
28	000959	首钢股份	454,800	1,237,056.00	0.79
29	600673	东阳光	169,300	1,191,872.00	0.76
30	600282	南钢股份	238,800	1,189,224.00	0.76
31	601155	新城控股	133,500	1,184,145.00	0.75
32	600970	中材国际	97,400	1,174,644.00	0.75
33	003022	联泓新科	85,600	1,173,576.00	0.75
34	600062	华润双鹤	58,800	1,151,304.00	0.73
35	600521	华海药业	67,300	1,147,465.00	0.73
36	601997	贵阳银行	215,000	1,133,050.00	0.72
37	002625	光启技术	63,800	1,106,930.00	0.70
38	600098	广州发展	170,100	1,088,640.00	0.69
39	600737	中粮糖业	112,000	1,074,080.00	0.68
40	002444	巨星科技	42,700	1,054,690.00	0.67
41	000401	冀东水泥	256,900	1,043,014.00	0.66
42	688819	天能股份	42,400	1,011,664.00	0.64
43	300765	新诺威	40,020	1,009,704.60	0.64
44	002138	顺络电子	36,700	1,007,782.00	0.64
45	600985	淮北矿业	59,200	991,008.00	0.63
46	600398	海澜之家	102,200	944,328.00	0.60
47	001872	招商港口	48,100	925,925.00	0.59

48	002028	思源电气	13,300	889,770.00	0.57
49	300394	天孚通信	9,800	866,516.00	0.55
50	000683	远兴能源	115,100	795,341.00	0.51
51	601958	金钼股份	76,000	791,160.00	0.50
52	601456	国联证券	80,300	774,092.00	0.49
53	601168	西部矿业	42,700	766,465.00	0.49
54	601577	长沙银行	93,200	762,376.00	0.49
55	688169	石头科技	1,900	745,940.00	0.47
56	600529	山东药玻	29,100	737,394.00	0.47
57	600872	中炬高新	32,000	726,080.00	0.46
58	002850	科达利	9,400	717,972.00	0.46
59	601666	平煤股份	63,200	707,840.00	0.45
60	688475	萤石网络	20,700	706,077.00	0.45
61	601019	山东出版	58,700	693,834.00	0.44
62	603883	老百姓	37,700	692,172.00	0.44
63	601098	中南传媒	55,600	690,552.00	0.44
64	601198	东兴证券	85,900	683,764.00	0.44
65	002414	高德红外	114,800	676,172.00	0.43
66	000039	中集集团	72,700	673,202.00	0.43
67	002517	恺英网络	70,300	671,365.00	0.43
68	603939	益丰药房	27,120	665,796.00	0.42
69	600032	浙江新能	83,900	610,792.00	0.39
70	688348	昱能科技	10,200	601,800.00	0.38
71	601555	东吴证券	101,400	598,260.00	0.38
72	600885	宏发股份	21,400	592,352.00	0.38
73	002268	电科网安	41,400	589,122.00	0.37
74	002262	恩华药业	24,500	581,630.00	0.37
75	600901	江苏金租	114,620	578,831.00	0.37
76	002497	雅化集团	61,400	547,688.00	0.35
77	600707	彩虹股份	77,900	530,499.00	0.34
78	000423	东阿阿胶	8,400	525,840.00	0.33
79	603379	三美股份	13,400	524,476.00	0.33
80	001203	大中矿业	54,400	522,784.00	0.33
81	688188	柏楚电子	2,800	516,740.00	0.33
82	002507	涪陵榨菜	42,100	515,725.00	0.33
83	600848	上海临港	56,000	510,160.00	0.32
84	603568	伟明环保	23,500	483,630.00	0.31
85	603786	科博达	7,500	481,125.00	0.31
86	601298	青岛港	49,900	477,044.00	0.30
87	301236	软通动力	12,700	447,167.00	0.28
88	000513	丽珠集团	11,900	442,799.00	0.28
89	601665	齐鲁银行	89,400	438,954.00	0.28
90	002019	亿帆医药	35,500	438,780.00	0.28

91	601717	郑煤机	29,400	435,120.00	0.28
92	688099	晶晨股份	7,200	427,104.00	0.27
93	600435	北方导航	48,400	417,208.00	0.27
94	002294	信立泰	15,300	407,439.00	0.26
95	000729	燕京啤酒	45,800	404,414.00	0.26
96	600642	申能股份	45,100	398,233.00	0.25
97	002056	横店东磁	30,900	385,323.00	0.25
98	688122	西部超导	10,000	383,200.00	0.24
99	603056	德邦股份	28,700	375,970.00	0.24
100	000958	电投产融	102,200	374,052.00	0.24
101	600066	宇通客车	14,400	371,520.00	0.24
102	000887	中鼎股份	30,200	369,648.00	0.24
103	002683	广东宏大	18,300	368,379.00	0.23
104	600909	华安证券	86,500	364,165.00	0.23
105	601598	中国外运	64,500	363,135.00	0.23
106	603868	飞科电器	9,400	360,960.00	0.23
107	601058	赛轮轮胎	24,400	341,600.00	0.22
108	002152	广电运通	32,300	337,858.00	0.22
109	300146	汤臣倍健	24,800	336,040.00	0.21
110	300003	乐普医疗	22,200	329,448.00	0.21
111	002532	天山铝业	40,600	329,266.00	0.21
112	300212	易华录	19,400	326,502.00	0.21
113	000878	云南铜业	26,100	325,206.00	0.21
114	601228	广州港	105,700	322,385.00	0.21
115	603156	养元饮品	14,700	312,669.00	0.20
116	688521	芯原股份	11,600	310,300.00	0.20
117	603338	浙江鼎力	5,100	308,142.00	0.20
118	601156	东航物流	15,100	307,285.00	0.20
119	600126	杭钢股份	71,200	292,632.00	0.19
120	600096	云天化	14,300	277,706.00	0.18
121	002120	韵达股份	35,800	277,092.00	0.18
122	002653	海思科	8,900	273,230.00	0.17
123	600416	湘电股份	27,300	271,362.00	0.17
124	603529	爱玛科技	9,800	267,834.00	0.17
125	002945	华林证券	26,800	267,464.00	0.17
126	601928	凤凰传媒	24,100	264,136.00	0.17
127	300866	安克创新	3,540	252,083.40	0.16
128	300017	网宿科技	31,600	249,640.00	0.16
129	000060	中金岭南	58,700	248,888.00	0.16
130	601615	明阳智能	26,100	246,384.00	0.16
131	603305	旭升集团	23,100	243,936.00	0.16
132	600580	卧龙电驱	20,000	243,000.00	0.15
133	002223	鱼跃医疗	6,400	240,640.00	0.15

134	603688	石英股份	8,100	239,841.00	0.15
135	002670	国盛金控	26,000	220,220.00	0.14
136	600511	国药股份	7,100	218,609.00	0.14
137	301165	锐捷网络	6,900	205,896.00	0.13
138	600483	福能股份	17,500	204,050.00	0.13
139	603979	金诚信	3,900	197,067.00	0.13
140	300529	健帆生物	7,100	193,191.00	0.12
141	601000	唐山港	39,730	186,731.00	0.12
142	688617	惠泰医疗	400	182,440.00	0.12
143	603317	天味食品	14,600	166,586.00	0.11
144	600546	山煤国际	11,200	163,744.00	0.10
145	600755	厦门国贸	21,500	154,155.00	0.10
146	600373	中文传媒	10,300	152,852.00	0.10
147	002240	盛新锂能	10,500	140,910.00	0.09
148	600350	山东高速	15,261	135,059.85	0.09
149	300861	美畅股份	6,900	133,515.00	0.08
150	000830	鲁西化工	11,300	130,967.00	0.08
151	600998	九州通	26,826	130,910.88	0.08
152	002153	石基信息	22,520	129,039.60	0.08
153	603606	东方电缆	2,600	126,906.00	0.08
154	002273	水晶光电	7,400	125,652.00	0.08
155	002608	江苏国信	16,100	124,775.00	0.08
156	000739	普洛药业	9,100	123,487.00	0.08
157	600177	雅戈尔	17,200	122,464.00	0.08
158	601077	渝农商行	24,300	121,986.00	0.08
159	600153	建发股份	13,600	121,448.00	0.08
160	000932	华菱钢铁	23,800	105,434.00	0.07
161	601636	旗滨集团	16,000	103,200.00	0.07
162	300251	光线传媒	12,100	101,761.00	0.06
163	002244	滨江集团	13,500	98,010.00	0.06
164	600377	宁沪高速	7,600	95,760.00	0.06
165	000921	海信家电	2,700	87,048.00	0.06
166	688516	奥特维	1,800	75,258.00	0.05
167	688567	孚能科技	7,400	71,040.00	0.05
168	600663	陆家嘴	7,700	67,914.00	0.04
169	603225	新凤鸣	4,000	62,360.00	0.04
170	601233	桐昆股份	3,900	62,244.00	0.04
171	000400	许继电气	1,800	61,938.00	0.04
172	603160	汇顶科技	900	61,875.00	0.04
173	002155	湖南黄金	3,400	61,540.00	0.04
174	601991	大唐发电	20,200	60,802.00	0.04
175	603728	鸣志电器	1,500	60,345.00	0.04
176	002465	海格通信	5,800	60,088.00	0.04



177	000630	铜陵有色	16,600	59,926.00	0.04
178	600325	华发股份	9,200	59,800.00	0.04
179	000703	恒逸石化	8,400	59,556.00	0.04
180	002557	洽洽食品	2,100	59,199.00	0.04
181	603893	瑞芯微	1,000	59,170.00	0.04
182	300207	欣旺达	3,900	59,163.00	0.04
183	600157	永泰能源	50,000	59,000.00	0.04
184	000960	锡业股份	3,800	58,862.00	0.04
185	600988	赤峰黄金	3,600	58,824.00	0.04
186	601966	玲珑轮胎	3,200	58,784.00	0.04
187	002558	巨人网络	6,200	58,528.00	0.04
188	002266	浙富控股	20,800	58,032.00	0.04
189	002340	格林美	9,100	57,967.00	0.04
190	600535	天士力	4,600	57,868.00	0.04
191	600348	华阳股份	5,800	57,768.00	0.04
192	600801	华新水泥	4,200	57,750.00	0.04
193	300002	神州泰岳	7,100	57,652.00	0.04
194	002563	森马服饰	9,900	57,519.00	0.04
195	601108	财通证券	8,700	57,507.00	0.04
196	600141	兴发集团	3,000	57,240.00	0.04
197	300144	宋城演艺	7,100	57,013.00	0.04
198	600549	厦门钨业	3,300	56,925.00	0.04
199	300474	景嘉微	900	56,907.00	0.04
200	002572	索菲亚	3,700	56,721.00	0.04
201	600380	健康元	5,000	55,850.00	0.04
202	600258	首旅酒店	4,500	55,575.00	0.04
203	002966	苏州银行	7,300	54,750.00	0.03
204	601866	中远海发	21,200	54,696.00	0.03
205	300724	捷佳伟创	1,000	54,010.00	0.03
206	600170	上海建工	24,100	51,815.00	0.03
207	600928	西安银行	15,500	50,685.00	0.03
208	002299	圣农发展	3,700	50,468.00	0.03
209	600655	豫园股份	9,700	49,955.00	0.03
210	000778	新兴铸管	14,100	49,068.00	0.03
211	601568	北元集团	13,100	48,601.00	0.03
212	601158	重庆水务	9,700	46,560.00	0.03
213	600968	海油发展	8,300	34,196.00	0.02
214	002384	东山精密	1,600	33,120.00	0.02
215	002409	雅克科技	500	31,455.00	0.02
216	688153	唯捷创芯	800	29,600.00	0.02
217	688029	南微医学	400	24,624.00	0.02
218	688520	神州细胞	600	23,610.00	0.02
219	601179	中国西电	2,900	23,316.00	0.01

220	688276	百克生物	800	22,696.00	0.01
221	002429	兆驰股份	4,700	22,607.00	0.01
222	600765	中航重机	1,100	22,440.00	0.01
223	688002	睿创微纳	800	22,376.00	0.01
224	300595	欧普康视	1,400	21,952.00	0.01
225	600583	海油工程	3,700	21,867.00	0.01
226	600808	马钢股份	10,700	21,614.00	0.01
227	603517	绝味食品	1,400	21,560.00	0.01
228	002373	千方科技	2,300	20,861.00	0.01
229	603444	吉比特	100	17,801.00	0.01
230	688220	翱捷科技	81	3,034.26	0.00
231	689009	九号公司	25	920.25	0.00

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300386	飞天诚信	244,300	2,543,163.00	1.62
2	002736	国信证券	191,900	1,667,611.00	1.06
3	002749	国光股份	62,600	941,504.00	0.60
4	688519	南亚新材	36,200	925,634.00	0.59
5	300331	苏大维格	54,300	873,144.00	0.56
6	603699	纽威股份	35,500	607,760.00	0.39
7	300515	三德科技	59,500	587,265.00	0.37
8	000975	银泰黄金	31,100	506,619.00	0.32
9	002546	新联电子	155,400	505,050.00	0.32
10	600184	光电股份	58,000	493,580.00	0.31
11	688662	富信科技	20,226	493,514.40	0.31
12	301017	漱玉平民	48,500	477,240.00	0.30
13	300081	恒信东方	105,200	464,984.00	0.30
14	300767	震安科技	53,600	454,528.00	0.29
15	688201	信安世纪	33,000	389,730.00	0.25
16	603556	海兴电力	8,300	388,689.00	0.25
17	688503	聚和材料	13,400	376,540.00	0.24
18	300056	中创环保	47,200	375,240.00	0.24
19	601801	皖新传媒	52,300	362,439.00	0.23
20	688095	福昕软件	7,904	362,082.24	0.23
21	001914	招商积余	36,100	361,722.00	0.23
22	603928	兴业股份	45,340	355,012.20	0.23
23	688383	新益昌	6,800	354,348.00	0.23
24	301321	翰博高新	28,800	331,488.00	0.21
25	600161	天坛生物	12,600	307,440.00	0.20
26	002908	德生科技	38,900	298,363.00	0.19
27	300709	精研科技	11,200	283,136.00	0.18
28	601001	晋控煤业	16,500	272,580.00	0.17

29	003019	宸展光电	10,605	268,624.65	0.17
30	605218	伟时电子	15,500	250,325.00	0.16
31	002378	章源钨业	43,500	249,690.00	0.16
32	600657	信达地产	80,900	246,745.00	0.16
33	603178	圣龙股份	10,800	231,444.00	0.15
34	605118	力鼎光电	14,900	221,861.00	0.14
35	002123	梦网科技	30,200	212,306.00	0.14
36	000550	江铃汽车	9,600	208,416.00	0.13
37	300968	格林精密	22,300	206,498.00	0.13
38	002422	科伦药业	6,400	194,112.00	0.12
39	688066	航天宏图	10,719	190,798.20	0.12
40	688158	优刻得	18,400	188,232.00	0.12
41	603278	大业股份	29,700	184,437.00	0.12
42	301033	迈普医学	4,700	183,817.00	0.12
43	300369	绿盟科技	34,900	178,339.00	0.11
44	300993	玉马遮阳	19,800	177,012.00	0.11
45	300418	昆仑万维	5,400	174,096.00	0.11
46	688292	浩瀚深度	11,000	170,060.00	0.11
47	688717	艾罗能源	3,596	169,083.92	0.11
48	600295	鄂尔多斯	16,700	165,664.00	0.11
49	002139	拓邦股份	15,000	159,300.00	0.10
50	002905	金逸影视	25,300	156,860.00	0.10
51	002981	朝阳科技	8,500	155,635.00	0.10
52	601900	南方传媒	12,200	151,646.00	0.10
53	603416	信捷电气	5,000	142,900.00	0.09
54	002584	西陇科学	25,400	142,748.00	0.09
55	600819	耀皮玻璃	31,500	132,930.00	0.08
56	688146	中船特气	4,431	132,265.35	0.08
57	688371	菲沃泰	13,140	131,925.60	0.08
58	603565	中谷物流	14,800	129,352.00	0.08
59	688208	道通科技	5,200	125,528.00	0.08
60	601838	成都银行	8,000	121,520.00	0.08
61	300155	安居宝	32,100	112,029.00	0.07
62	002664	信质集团	9,000	107,100.00	0.07
63	688687	凯因科技	3,933	100,330.83	0.06
64	603516	淳中科技	3,100	97,867.00	0.06
65	301391	卡莱特	2,200	96,316.00	0.06
66	601999	出版传媒	18,400	96,048.00	0.06
67	301056	森赫股份	12,400	95,108.00	0.06
68	688310	迈得医疗	6,600	86,724.00	0.06
69	002238	天威视讯	9,900	77,715.00	0.05
70	002189	中光学	5,500	76,670.00	0.05
71	688070	纵横股份	2,600	73,476.00	0.05

72	605228	神通科技	8,200	70,356.00	0.04
73	603768	常青股份	6,200	70,308.00	0.04
74	002779	中坚科技	2,300	65,182.00	0.04
75	688136	科兴制药	3,600	60,336.00	0.04
76	601318	中国平安	1,400	57,904.00	0.04
77	603598	引力传媒	4,300	54,696.00	0.03
78	002035	华帝股份	8,600	53,578.00	0.03
79	601187	厦门银行	8,600	45,838.00	0.03
80	002030	达安基因	7,900	39,500.00	0.03
81	600160	巨化股份	1,500	36,195.00	0.02
82	002463	沪电股份	900	32,850.00	0.02
83	600482	中国动力	1,600	31,168.00	0.02
84	000950	重药控股	5,500	26,785.00	0.02
85	601800	中国交建	2,700	24,138.00	0.02
86	688636	智明达	1,053	24,008.40	0.02
87	688253	英诺特	600	22,866.00	0.01
88	688235	百济神州	182	21,082.88	0.01
89	300769	德方纳米	700	19,740.00	0.01
90	601339	百隆东方	3,600	18,756.00	0.01
91	601127	赛力斯	200	18,224.00	0.01
92	603350	安乃达	858	17,640.48	0.01
93	603285	键邦股份	847	15,796.55	0.01
94	688629	华丰科技	571	15,051.56	0.01
95	000534	万泽股份	1,500	14,895.00	0.01
96	002957	科瑞技术	900	12,204.00	0.01
97	301508	中机认检	327	12,085.92	0.01
98	600186	莲花控股	3,500	12,005.00	0.01
99	301526	国际复材	3,506	11,674.98	0.01
100	301516	中远通	604	11,252.52	0.01
101	688692	达梦数据	63	11,020.59	0.01
102	688443	智翔金泰	364	10,825.36	0.01
103	301536	星辰科技	327	10,552.29	0.01
104	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.01
105	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.01
106	688631	莱斯信息	145	8,992.90	0.01
107	301421	波长光电	205	8,862.15	0.01
108	301413	安培龙	213	8,807.55	0.01
109	688691	灿芯股份	206	8,757.06	0.01
110	301498	乖宝宠物	155	8,339.00	0.01
111	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.01
112	301141	中科磁业	249	8,030.25	0.01
113	301488	豪恩汽电	165	7,936.50	0.01
114	301383	天键股份	301	7,862.12	0.01

115	688592	司南导航	184	7,577.12	0.00
116	688621	阳光诺和	175	7,472.50	0.00
117	688472	阿特斯	731	7,441.58	0.00
118	002015	协鑫能科	900	7,164.00	0.00
119	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
120	301291	明阳电气	238	7,151.90	0.00
121	301459	丰茂股份	176	6,988.96	0.00
122	688653	康希通信	542	6,980.96	0.00
123	601096	宏盛华源	1,698	6,944.82	0.00
124	688652	京仪装备	176	6,879.84	0.00
125	301565	中仑新材	362	6,870.76	0.00
126	688720	艾森股份	165	6,689.10	0.00
127	688543	国科军工	161	6,612.27	0.00
128	301580	爱迪特	100	6,593.00	0.00
129	301568	思泰克	203	6,459.46	0.00
130	688709	成都华微	338	6,351.02	0.00
131	688582	芯动联科	205	5,772.80	0.00
132	688695	中创股份	180	5,679.00	0.00
133	301587	中瑞股份	224	5,658.24	0.00
134	688562	航天软件	369	5,634.63	0.00
135	301262	海看股份	245	5,524.75	0.00
136	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
137	301578	辰奕智能	138	5,460.66	0.00
138	301509	金凯生科	150	5,457.00	0.00
139	688048	长光华芯	173	5,404.52	0.00
140	301362	民爆光电	158	5,381.48	0.00
141	001389	广合科技	152	5,253.12	0.00
142	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
143	301315	威士顿	158	5,149.22	0.00
144	688591	泰凌微	261	5,102.55	0.00
145	301382	蜂助手	281	5,083.29	0.00
146	301310	鑫宏业	206	4,964.60	0.00
147	301376	致欧科技	231	4,890.27	0.00
148	301548	崇德科技	88	4,671.04	0.00
149	688593	新相微	460	4,600.00	0.00
150	601033	永兴股份	274	4,373.04	0.00
151	688523	航天环宇	252	4,347.00	0.00
152	301397	溯联股份	136	4,270.40	0.00
153	688377	迪威尔	318	4,165.80	0.00
154	301418	协昌科技	104	4,160.00	0.00
155	301305	朗坤环境	272	4,137.12	0.00
156	688570	天玛智控	200	4,078.00	0.00
157	688576	西山科技	69	3,957.84	0.00

158	001287	中电港	237	3,917.61	0.00
159	301395	仁信新材	364	3,887.52	0.00
160	601061	中信金属	565	3,881.55	0.00
161	688552	航天南湖	239	3,871.80	0.00
162	603341	龙旗科技	102	3,823.98	0.00
163	688646	逸飞激光	122	3,807.62	0.00
164	688716	中研股份	176	3,731.20	0.00
165	301337	亚华电子	134	3,695.72	0.00
166	601083	锦江航运	373	3,565.88	0.00
167	301332	德尔玛	380	3,359.20	0.00
168	301323	新莱福	106	3,347.48	0.00
169	688429	时创能源	195	3,303.30	0.00
170	301371	敷尔佳	106	3,292.36	0.00
171	603273	天元智能	178	3,266.30	0.00
172	301528	多浦乐	76	3,255.84	0.00
173	688657	浩辰软件	85	3,141.60	0.00
174	688581	安杰思	64	3,131.52	0.00
175	001380	华纬科技	159	3,090.96	0.00
176	688433	华曙高科	148	3,087.28	0.00
177	301525	儒竞科技	52	2,926.56	0.00
178	688623	双元科技	52	2,923.96	0.00
179	688458	美芯晟	104	2,787.20	0.00
180	603193	润本股份	150	2,758.50	0.00
181	603107	上海汽配	172	2,733.08	0.00
182	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
183	001239	永达股份	189	2,623.32	0.00
184	688003	天准科技	78	2,555.28	0.00
185	603082	北自科技	86	2,536.14	0.00
186	001359	平安电工	123	2,533.80	0.00
187	001306	夏厦精密	46	2,483.54	0.00
188	603119	浙江荣泰	138	2,445.36	0.00
189	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
190	688512	慧智微	278	2,360.22	0.00
191	603344	星德胜	104	2,356.64	0.00
192	688192	迪哲医药	61	2,247.24	0.00
193	603325	博隆技术	33	2,245.98	0.00
194	688336	三生国健	100	2,035.00	0.00
195	603270	金帝股份	100	1,984.00	0.00
196	603004	鼎龙科技	117	1,983.15	0.00
197	603312	西典新能	76	1,927.36	0.00
198	688690	纳微科技	109	1,893.33	0.00
199	001358	兴欣新材	89	1,826.28	0.00
200	603381	永臻股份	72	1,809.36	0.00

201	688352	颀中科技	149	1,700.09	0.00
202	603231	索宝蛋白	98	1,669.92	0.00
203	603275	众辰科技	55	1,650.00	0.00
204	603075	热威股份	75	1,323.75	0.00
205	002468	申通快递	100	840.00	0.00
206	688549	中巨芯	82	553.50	0.00
207	688308	欧科亿	14	271.88	0.00
208	688496	清越科技	5	46.20	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	002408	齐翔腾达	6,487,624.20	3.19
2	002064	华峰化学	4,727,226.00	2.33
3	601168	西部矿业	3,983,351.00	1.96
4	601567	三星医疗	3,746,507.00	1.84
5	000933	神火股份	3,502,308.00	1.72
6	000563	陕国投 A	3,370,208.00	1.66
7	603355	莱克电气	3,243,385.96	1.60
8	601636	旗滨集团	3,152,718.00	1.55
9	002128	电投能源	3,054,890.00	1.50
10	000598	兴蓉环境	3,034,734.00	1.49
11	600873	梅花生物	2,996,729.00	1.48
12	000039	中集集团	2,952,495.00	1.45
13	600282	南钢股份	2,933,221.00	1.44
14	300682	朗新集团	2,856,129.00	1.41
15	002430	杭氧股份	2,828,440.00	1.39
16	688617	惠泰医疗	2,815,967.88	1.39
17	002595	豪迈科技	2,808,188.00	1.38
18	000547	航天发展	2,782,952.00	1.37
19	600582	天地科技	2,766,845.00	1.36
20	601997	贵阳银行	2,669,343.00	1.31

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	601168	西部矿业	6,270,377.00	3.09
2	002408	齐翔腾达	4,934,263.00	2.43
3	601958	金铂股份	4,534,043.00	2.23
4	600066	宇通客车	4,468,644.00	2.20

5	600737	中粮糖业	3,935,230.00	1.94
6	600350	山东高速	3,635,468.00	1.79
7	603355	莱克电气	3,465,745.00	1.71
8	601636	旗滨集团	3,222,373.00	1.59
9	300682	朗新集团	3,221,711.00	1.59
10	002600	领益智造	3,191,281.66	1.57
11	601611	中国核建	3,092,812.00	1.52
12	002064	华峰化学	3,079,118.00	1.52
13	600299	安迪苏	3,036,275.00	1.50
14	002653	海思科	2,989,354.00	1.47
15	600707	彩虹股份	2,906,760.00	1.43
16	000932	华菱钢铁	2,877,490.00	1.42
17	603026	石大胜华	2,863,248.00	1.41
18	002608	江苏国信	2,844,006.00	1.40
19	688276	百克生物	2,840,455.06	1.40
20	002563	森马服饰	2,826,373.79	1.39

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	519,508,732.27
卖出股票收入（成交）总额	555,701,062.22

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁



调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 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	708,134.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	127.57
4	应收利息	-
5	应收申购款	134,050.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	842,312.34

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
建信中证 500 指数量化增强发起 A	2,388	47,413.99	15,537,468.02	13.72	97,687,148.57	86.28
建信中证 500 指数量化增强发起 C	2,959	20,254.71	596,702.14	1.00	59,336,972.02	99.00
合计	5,347	32,384.20	16,134,170.16	9.32	157,024,120.59	90.68

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信中证 500 指数量化增强发起 A	9,008.83	0.01
	建信中证 500 指数量化增强发起 C	3.37	0.00
	合计	9,012.20	0.01

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。

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,889.08	5.78	10,001,889.08	5.78	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,889.08	5.78	10,001,889.08	5.78	3 年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
基金合同生效日 (2022 年 12 月 23 日) 基金份额总额	12,099,599.84	1,238,351.04
本报告期期初基金份额总额	126,436,026.38	88,187,554.06
本报告期基金总申购份额	2,716,286.22	20,439,765.36
减：本报告期基金总赎回份额	15,927,696.01	48,693,645.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	113,224,616.59	59,933,674.16

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 2024 年 3 月 30 日发布公告，自 2024 年 3 月 28 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司首席信息官。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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	建信基金管理有限责任公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 1 月 18 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	信息披露不及时
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改
其他	无

#### 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 (%)	
国信证券	3	1,074,376,383.62	100.00	803,542.34	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 (%)
国信证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增上海攀赢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	2024年4月30日
2	关于新增上海利得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	2024年4月30日
3	关于新增申万宏源证券有限公司等为建信中证 500 指数量化增强型发起式	指定报刊和/或公司网站	2024年4月29日

	证券投资基金销售机构的公告		
4	关于新增华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	2024 年 4 月 29 日
5	关于新增博时财富基金销售有限公司为建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 1 月 26 日
6	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	2024 年 1 月 11 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中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2024 年 8 月 29 日