

建信中证 1000 指数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：上海浦东发展银行股份有限公司

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 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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
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	45
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	54
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	56
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
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	58
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
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	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金		
基金简称	建信中证 1000 指数增强		
基金主代码	006165		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018 年 11 月 22 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		
报告期末基金份额总额	1,042,060,781.52 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 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E
下属分级基金的交易代码	006165	006166	013442
报告期末下属分级基金的份额总额	618,809,004.72 份	405,671,634.08 份	17,580,142.72 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	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 1000 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。</p> <p>在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。</p> <p>本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p>
业绩比较基准	中证 1000 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。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	朱萍
	联系电话	010-66228888	021-31888888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400-81-95533; 010-66228000	95528
传真		010-66228001	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		100033	200126
法定代表人		生柳荣	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英 蓝国际金融中心 16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期 间数据和 指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)		
	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发 起 E
本期已实现 收益	-93,000,254.71	-62,619,110.89	-9,486,950.97
本期利润	-123,666,344.48	-77,656,172.71	-13,056,562.44
加权平均基 金份额本期	-0.2069	-0.1927	-0.2459

利润			
本期加权平均净值利润率	-15.04%	-14.33%	-18.28%
本期基金份额净值增长率	-13.73%	-13.90%	-13.90%
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	75,657,870.89	38,106,563.16	1,659,950.90
期末可供分配基金份额利润	0.1223	0.0939	0.0944
期末基金资产净值	799,825,564.71	512,176,584.55	22,203,684.19
期末基金份额净值	1.2925	1.2625	1.2630
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	74.73%	70.89%	-25.96%

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 1000 指数增强 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	-8.27%	1.42%	-8.15%	1.36%	-0.12%	0.06%
过去三个月	-7.74%	1.47%	-9.51%	1.42%	1.77%	0.05%
过去六个月	-13.73%	1.95%	-15.97%	1.87%	2.24%	0.08%
过去一年	-22.86%	1.53%	-24.61%	1.47%	1.75%	0.06%
过去三年	-16.62%	1.41%	-29.31%	1.36%	12.69%	0.05%
自基金合同生效起至今	74.73%	1.42%	1.80%	1.42%	72.93%	0.00%

建信中证 1000 指数增强 C

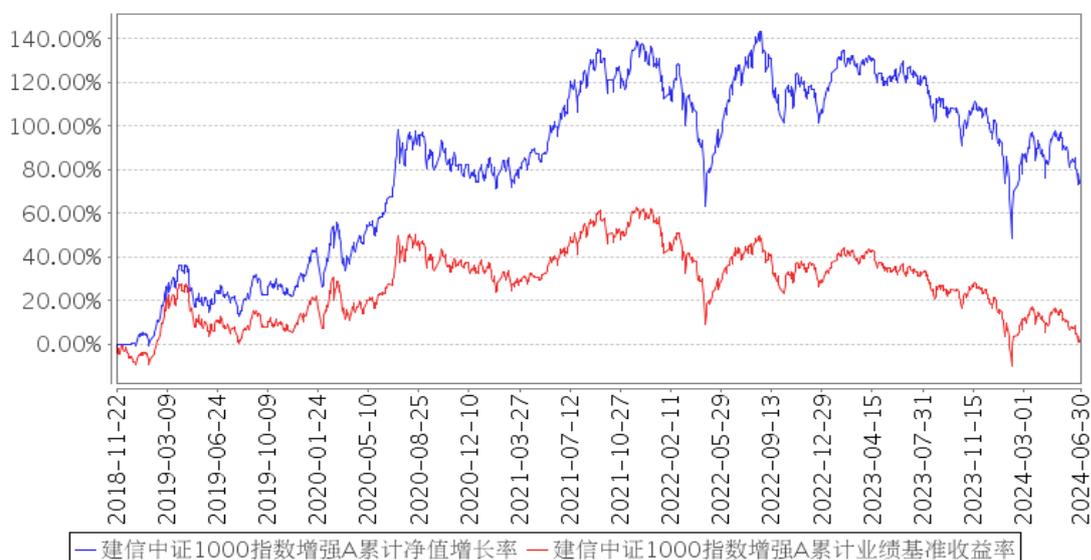
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.31%	1.42%	-8.15%	1.36%	-0.16%	0.06%
过去三个月	-7.83%	1.47%	-9.51%	1.42%	1.68%	0.05%
过去六个月	-13.90%	1.95%	-15.97%	1.87%	2.07%	0.08%
过去一年	-23.17%	1.53%	-24.61%	1.47%	1.44%	0.06%
过去三年	-17.61%	1.41%	-29.31%	1.36%	11.70%	0.05%
自基金合同生效起至今	70.89%	1.42%	1.80%	1.42%	69.09%	0.00%

建信中证 1000 指数增强发起 E

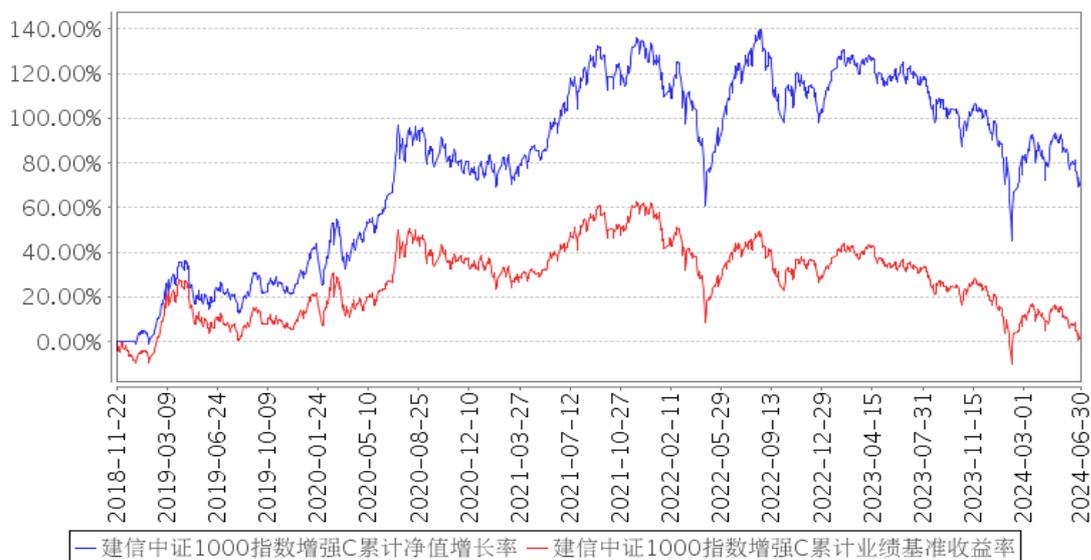
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.31%	1.42%	-8.15%	1.36%	-0.16%	0.06%
过去三个月	-7.83%	1.47%	-9.51%	1.42%	1.68%	0.05%
过去六个月	-13.90%	1.95%	-15.97%	1.87%	2.07%	0.08%
过去一年	-23.16%	1.53%	-24.61%	1.47%	1.45%	0.06%
自基金合同生效起至今	-25.96%	1.41%	-36.11%	1.36%	10.15%	0.05%

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

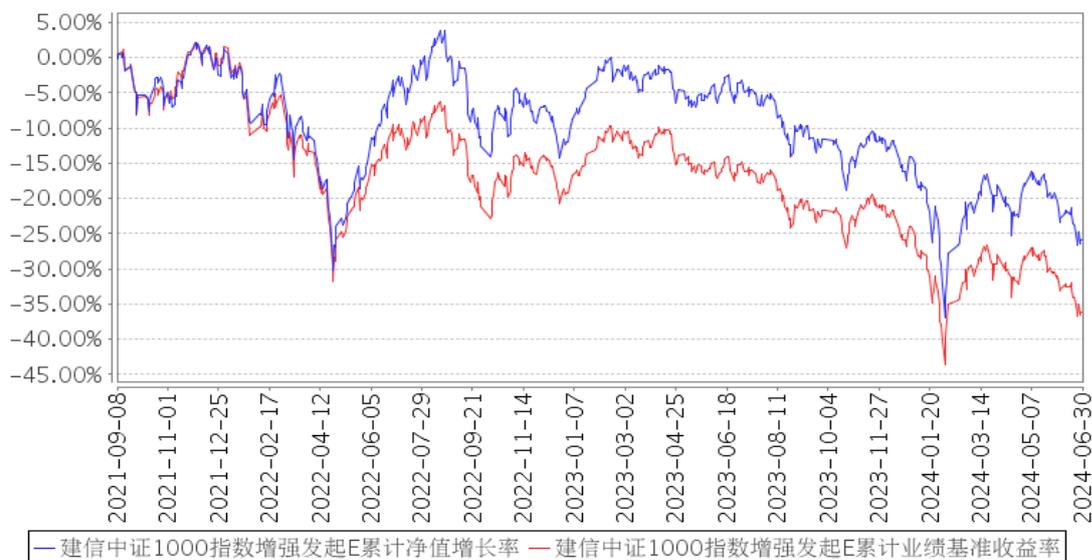
建信中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信中证1000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



建信中证1000指数增强发起E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		
叶乐天	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2018 年 11 月 22 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 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。
赵云煜	数量投资部总经理助理，本基金的基	2018 年 11 月 22 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

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。
-----	--	--	--	---

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

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	1,637,687,843.27	2018 年 11 月 16 日
	私募资产管理计划	4	237,751,108.75	2016 年 6 月 22 日
	其他组合	-	-	-
	合计	7	1,875,438,952.02	-

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 1000 指数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

报告期间，产品基准指数中证 1000 在一季度先明显下行后快速反弹震荡，五月后下行为主，最终在前半年收跌。本基金稳健开展投资运作，并成功跑赢了基准指数。

本基金为指数增强基金，主要采用量化多因子模型进行选股和组合管理，以期达成在跟踪基准指数的基础上超越指数收益的目标。具体来说，个股选择方面，产品主要通过多因子 Alpha 模型进行多维度的股票筛选；跟踪误差方面，产品亦采用量化风险模型对市场的风险特征进行建模，从而通过保持组合整体的风格、行业配置与基准指数接近，以管理产品的风险暴露。此外，本基金也积极参与新股申购力争进一步增厚产品收益。

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-13.73%，波动率 1.95%，业绩比较基准收益率-15.97%，波动率 1.87%。本报告期本基金 C 净值增长率-13.90%，波动率 1.95%，业绩比较基准收益率-15.97%，波动率 1.87%。本报告期本基金 E 净值增长率-13.90%，波动率 1.95%，业绩比较基准收益率-15.97%，波动率 1.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年上半年，国内仍处于经济修复的过程中，呈现“低位弱复苏”的特征。在这样的市场环境中，从风格层面观察，大盘指数明显跑赢小盘微盘，且价值类股票明显好于成长类，因此本产品的基准指数中证 1000 相对跌幅较为明显；行业层面，贴近红利类价值类的行业有较好的表现，例如银行，公用事业，煤炭等，其它方面，出口链、稀缺资源品等亦有不错的表现；TMT 相关的传媒、计算机等行业收益率较为落后，跑输市场。

展望后市，我们认为市场可能在当前位置维持震荡，待基本面情况改善信号出现后有所上行。盈利方面，预估全年 A 股非金融的净利润增速将回到正增长，但后续弹性可能有限；流动性方面，在实际利率相对较高，且海外宽松预期较为不确定的环境下，可能需要关注财政政策的支持力度。

本基金将密切跟踪市场动态，持续提升模型的效果，精选个券，谨慎管理组合风险，力争为投资者提供稳健超越业绩基准的回报。

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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金

合同、托管协议的规定，对建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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本托管人复核的本报告中的财务指标、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 1000 指数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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	173,731,746.07	198,255,158.06
结算备付金		11,781,637.09	13,010,496.91
存出保证金		13,373,428.80	13,930,564.37
交易性金融资产	6.4.7.2	1,133,486,480.98	1,370,405,776.29
其中：股票投资		1,133,486,480.98	1,370,405,776.29
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		-	30,716,870.20
应收股利		-	-
应收申购款		5,792,317.79	1,478,281.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,338,165,610.73	1,627,797,146.95

负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	13,124,978.79
应付赎回款		1,576,055.10	22,932,531.84
应付管理人报酬		1,134,700.06	1,400,844.04
应付托管费		226,940.02	280,168.81
应付销售服务费		181,540.35	272,481.57
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	840,541.75	5,939,890.74
负债合计		3,959,777.28	43,950,895.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,042,060,781.52	1,067,682,305.87
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	292,145,051.93	516,163,945.29
净资产合计		1,334,205,833.45	1,583,846,251.16
负债和净资产总计		1,338,165,610.73	1,627,797,146.95

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,042,060,781.52 份，其中建信中证 1000 指数增强 A 基金份额总额 618,809,004.72 份，基金份额净值人民币 1.2925 元；建信中证 1000 指数增强 C 基金份额总额 405,671,634.08 份，基金份额净值人民币 1.2625 元；建信中证 1000 指数增强发起 E 基金份额总额 17,580,142.72 份，基金份额净值人民币 1.2630 元。

6.2 利润表

会计主体：建信中证 1000 指数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
一、营业总收入		-204,392,002.28	87,213,108.07
1. 利息收入		469,390.22	492,656.93
其中：存款利息收入	6.4.7.13	469,390.22	492,656.93
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-156,278,224.19	61,561,510.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-157,901,916.46	53,530,228.33
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	-9,151,069.73	-3,524,648.19
股利收益	6.4.7.19	10,774,762.00	11,555,929.97
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	-49,272,763.06	24,590,315.46
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	689,594.75	568,625.57
减：二、营业总支出		9,987,077.35	11,068,585.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,131,209.49	7,930,151.66
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,426,241.92	1,586,030.32
3. 销售服务费		1,220,363.22	1,329,463.93
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		-	7,686.39
8. 其他费用	6.4.7.23	209,262.72	215,253.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-214,379,079.63	76,144,522.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-214,379,079.63	76,144,522.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-214,379,079.63	76,144,522.68

6.3 净资产变动表

会计主体：建信中证 1000 指数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	1,067,682,305.87	-	516,163,945.29	1,583,846,251.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,067,682,305.87	-	516,163,945.29	1,583,846,251.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-25,621,524.35	-	-224,018,893.36	-249,640,417.71
(一)、综合收益总额	-	-	-214,379,079.63	-214,379,079.63
(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)	-25,621,524.35	-	-9,639,813.73	-35,261,338.08
其中：1. 基金申购款	379,602,361.97	-	128,918,161.72	508,520,523.69
2. 基金赎回款	-405,223,886.32	-	-138,557,975.45	-543,781,861.77
(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	1,042,060,781.52	-	292,145,051.93	1,334,205,833.45
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	611,543,514.51	-	340,744,645.19	952,288,159.70
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	611,543,514.51	-	340,744,645.19	952,288,159.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	407,455,480.85	-	371,646,003.87	779,101,484.72
(一)、综合收益总额	-	-	76,144,522.68	76,144,522.68
(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)	407,455,480.85	-	295,501,481.19	702,956,962.04
其中：1. 基金申购款	1,067,838,021.18	-	745,430,701.42	1,813,268,722.60
2. 基金赎回款	-660,382,540.33	-	-449,929,220.23	-1,110,311,760.56
(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	1,018,998,995.36	-	712,390,649.06	1,731,389,644.42

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 1000 指数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[2018]1029 号《关于准予建信中证 1000 指数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 1000 指数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 99,635,875.53 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（2018）第 0686 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 99,645,967.84 份基金份额，其中认购资金利息折合 10,092.31 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，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；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。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。

根据《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2021 年 9 月 6 日起本基金新增 E 类基金份额，从本类别基金资产中计提销售服务费，且在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用。根据更新的《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金份额包括建信中证 1000 指数增强基金之 A 类份额、建信中证 1000 指数增强基金之 C 类份额和建信中证 1000 指数增强发起基金之 E 类份额。本基金各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 1000 指数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（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、货币市场工具（含同业存单）、银行存款、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。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。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。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%，投资于中证 1000 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%；本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 80%；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，现金或到期日在一年以内的政府债券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。本基金业绩比较基准为：中证 1000 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。

6.4.7 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	72,142,980.82
等于：本金	72,135,975.51
加：应计利息	7,005.31
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	101,588,765.25
等于：本金	101,579,357.10
加：应计利息	9,408.15
减：坏账准备	-
合计	173,731,746.07

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	1,236,207,357.42	-	1,133,486,480.98	-102,720,876.44
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	1,236,207,357.42	-	1,133,486,480.98	-102,720,876.44

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	120,393,880.00	-	-	-
其中：股指期货投资	120,393,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	120,393,880.00	-	-	-

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
IM2407	IM2407	35.00	34,006,000.00	-2,245,000.00
IM2409	IM2409	81.00	77,439,240.00	-6,703,640.00
合计				-8,948,640.00
减：可抵销期货暂收款				-8,948,640.00
净额				-

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	1,108.15
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	192,353.72
其中：交易所市场	192,353.72
银行间市场	-

应付利息	-
应付指数使用费	57,310.28
预提费用	149,507.60
其他应付款	440,262.00
合计	840,541.75

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 1000 指数增强 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	572,284,641.61	572,284,641.61
本期申购	209,705,483.63	209,705,483.63
本期赎回（以“-”号填列）	-163,181,120.52	-163,181,120.52
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	618,809,004.72	618,809,004.72

建信中证 1000 指数增强 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	410,222,204.30	410,222,204.30
本期申购	159,216,352.69	159,216,352.69
本期赎回（以“-”号填列）	-163,766,922.91	-163,766,922.91
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	405,671,634.08	405,671,634.08

建信中证 1000 指数增强发起 E

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	85,175,459.96	85,175,459.96
本期申购	10,680,525.65	10,680,525.65
本期赎回（以“-”号填列）	-78,275,842.89	-78,275,842.89
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	17,580,142.72	17,580,142.72

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 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	159,002,473.20	126,092,767.34	285,095,240.54
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	159,002,473.20	126,092,767.34	285,095,240.54
本期利润	-93,000,254.71	-30,666,089.77	-123,666,344.48
本期基金份额交易产生的变动数	9,655,652.40	9,932,011.53	19,587,663.93
其中：基金申购款	38,864,985.35	37,817,580.50	76,682,565.85
基金赎回款	-29,209,332.95	-27,885,568.97	-57,094,901.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,657,870.89	105,358,689.10	181,016,559.99

建信中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	102,048,488.35	89,252,633.38	191,301,121.73
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	102,048,488.35	89,252,633.38	191,301,121.73
本期利润	-62,619,110.89	-15,037,061.82	-77,656,172.71
本期基金份额交易产生的变动数	-1,322,814.30	-5,817,184.25	-7,139,998.55
其中：基金申购款	26,117,789.71	23,033,252.51	49,151,042.22
基金赎回款	-27,440,604.01	-28,850,436.76	-56,291,040.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,106,563.16	68,398,387.31	106,504,950.47

建信中证 1000 指数增强发起 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,237,053.19	18,530,529.83	39,767,583.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	21,237,053.19	18,530,529.83	39,767,583.02
本期利润	-9,486,950.97	-3,569,611.47	-13,056,562.44

本期基金份额交易产生的变动数	-10,090,151.32	-11,997,327.79	-22,087,479.11
其中：基金申购款	1,742,004.11	1,342,549.54	3,084,553.65
基金赎回款	-11,832,155.43	-13,339,877.33	-25,172,032.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,659,950.90	2,963,590.57	4,623,541.47

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		162,687.97
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		151,505.23
结算备付金利息收入		154,610.28
其他		586.74
合计		469,390.22

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		-157,901,916.46
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		-157,901,916.46

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		3,773,913,110.94
减：卖出股票成本总额		3,924,079,644.63
减：交易费用		7,735,382.77
买卖股票差价收入		-157,901,916.46

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	-9,151,069.73

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	10,774,762.00
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,774,762.00

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	-42,621,723.06
股票投资	-42,621,723.06
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	-6,651,040.00
权证投资	-
期货投资	-6,651,040.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-49,272,763.06

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	678,635.67
基金转换费收入	10,959.08
合计	689,594.75

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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,855.77
指数使用费	114,099.35
其他	800.00
合计	209,262.72

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	7,131,209.49	7,930,151.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,135,484.01	2,087,192.32
应支付基金管理人的净管理费	4,995,725.48	5,842,959.34

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%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：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	1,426,241.92	1,586,030.32

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E	合计

建信基金	-	7,190.19	5,293.06	12,483.25
上海浦东发展银行	-	5,272.81	-	5,272.81
中国建设银行	-	33,085.05	-	33,085.05
合计	-	45,548.05	5,293.06	50,841.11
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 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E	合计
建信基金	-	150,565.11	2,719.96	153,285.07
上海浦东发展银行	-	5,286.38	-	5,286.38
中国建设银行	-	27,495.53	-	27,495.53
合计	-	183,347.02	2,719.96	186,066.98

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。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额和 E 类基金份额的销售服务费年费率均为 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

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 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E
基金合同生效日	-	-	-

(2018 年 11 月 22 日)持有的基金份额			
报告期初持有的基金份额	329,280.17	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	329,280.17	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.05%	-	-
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 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E
基金合同生效日(2018 年 11 月 22 日)持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	13,173,876.83	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	13,173,876.83	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.55%	-	-

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
上海浦东发展银行-活期	72,142,980.82	162,687.97	226,741,725.29	348,733.81

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	184	3,199.76	3,790.40	-
001387	雪祺电气	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	-
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新发未上市	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
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	2024 年 1 月	6 个月	新发未上市	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

	智能	月 26 日		市						
301536	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新发未上市	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新发未上市	39.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
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	711	8,446.68	13,494.78	-
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	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新发未上市	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
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	肯特股份	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	-
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	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦	2024 年 6 月	6 个月	新发未上市	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-

	股份	月 28 日		市						
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新发未上市	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新发未上市	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新发未上市	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新发未上市	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新发未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新发未上市	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新发未上市	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新发未上市	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新发未上市	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新发未上市	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都	2024 年 1	6 个月	新发未上	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

	华 微	月 31 日		市						
688717	艾 罗 能 源	2023 年 12 月 26 日	6 个月	新发 未上 市	55.66	47.02	11,303	629,124.98	531,467.06	-

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。

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。基金管理人对于基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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	173,731,746.07	-	-	-	173,731,746.07
结算备付金	11,781,637.09	-	-	-	11,781,637.09
存出保证金	13,373,428.80	-	-	-	13,373,428.80
交易性金融资产	-	-	-	1,133,486,480.98	1,133,486,480.98
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	-	-	-	5,792,317.79	5,792,317.79
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	198,886,811.96	-	-	1,139,278,798.77	1,338,165,610.73

负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,576,055.10	1,576,055.10
应付管理人报酬	-	-	-	1,134,700.06	1,134,700.06
应付托管费	-	-	-	226,940.02	226,940.02
应付销售服务费	-	-	-	181,540.35	181,540.35
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	840,541.75	840,541.75
负债总计	-	-	-	3,959,777.28	3,959,777.28
利率敏感度缺口	198,886,811.96	-	-	-1,135,319,021.49	1,334,205,833.45
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	198,255,158.06	-	-	-	198,255,158.06
结算备付金	13,010,496.91	-	-	-	13,010,496.91
存出保证金	13,930,564.37	-	-	-	13,930,564.37
交易性金融资产	-	-	-	-1,370,405,776.29	1,370,405,776.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	30,716,870.20	30,716,870.20
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,478,281.12	1,478,281.12
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	225,196,219.34	-	-	-1,402,600,927.61	1,627,797,146.95
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	-	-	-	13,124,978.79	13,124,978.79
应付赎回款	-	-	-	22,932,531.84	22,932,531.84
应付管理人报酬	-	-	-	1,400,844.04	1,400,844.04
应付托管费	-	-	-	280,168.81	280,168.81
应付销售服务费	-	-	-	272,481.57	272,481.57
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	5,939,890.74	5,939,890.74
负债总计	-	-	-	43,950,895.79	43,950,895.79
利率敏感度缺口	225,196,219.34	-	-	-1,358,650,031.82	1,583,846,251.16

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	1,133,486,480.98	84.96	1,370,405,776.29	86.52
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	1,133,486,480.98	84.96	1,370,405,776.29	86.52

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%	67,889,842.87	79,615,395.09
业绩比较基准下降5%	-67,889,842.87	-79,615,395.09	

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	1,132,692,543.47	1,368,305,062.33
第二层次	45,611.11	898,742.02
第三层次	748,326.40	1,201,971.94
合计	1,133,486,480.98	1,370,405,776.29

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	1,133,486,480.98	84.70
	其中：股票	1,133,486,480.98	84.70
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	185,513,383.16	13.86
8	其他各项资产	19,165,746.59	1.43
9	合计	1,338,165,610.73	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	3,667,680.00	0.27
B	采矿业	22,039,865.00	1.65
C	制造业	606,054,194.60	45.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	11,937,841.00	0.89

	业		
E	建筑业	34,485,399.00	2.58
F	批发和零售业	53,933,673.23	4.04
G	交通运输、仓储和邮政业	23,418,353.00	1.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,003,790.08	6.75
J	金融业	22,011,718.00	1.65
K	房地产业	26,680,750.55	2.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,968,328.00	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	5,944,701.00	0.45
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	28,531,883.00	2.14
S	综合	-	-
	合计	932,678,176.46	69.91

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	2,298,400.00	0.17
C	制造业	143,094,461.79	10.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,535,146.00	0.71
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,219,176.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,960,391.73	2.77
J	金融业	4,772,932.00	0.36
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,892,049.00	0.14

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,035,748.00	0.08
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	200,808,304.52	15.05

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	600248	陕建股份	5,715,400	20,746,902.00	1.56
2	603699	纽威股份	1,151,400	19,711,968.00	1.48
3	601609	金田股份	2,483,400	14,056,044.00	1.05
4	600623	华谊集团	2,210,100	12,774,378.00	0.96
5	688586	江航装备	1,331,800	12,385,740.00	0.93
6	688158	优刻得	1,168,680	11,955,596.40	0.90
7	688128	中国电研	668,232	11,500,272.72	0.86
8	601311	骆驼股份	1,395,730	11,193,754.60	0.84
9	002139	拓邦股份	1,037,600	11,019,312.00	0.83
10	603093	南华期货	1,239,800	10,736,668.00	0.80
11	002036	联创电子	1,577,700	10,649,475.00	0.80
12	000498	山东路桥	2,023,900	10,584,997.00	0.79
13	603328	依顿电子	1,338,000	10,516,680.00	0.79
14	600657	信达地产	3,417,600	10,423,680.00	0.78
15	600562	国睿科技	761,000	10,395,260.00	0.78
16	601801	皖新传媒	1,443,300	10,002,069.00	0.75
17	300369	绿盟科技	1,953,900	9,984,429.00	0.75
18	605333	沪光股份	356,000	9,914,600.00	0.74
19	603556	海兴电力	209,440	9,808,075.20	0.74
20	600428	中远海特	1,594,400	9,757,728.00	0.73
21	002961	瑞达期货	819,000	8,968,050.00	0.67
22	000795	英洛华	1,572,600	8,712,204.00	0.65
23	300049	福瑞股份	170,500	8,582,970.00	0.64

24	600750	江中药业	359,720	8,313,129.20	0.62
25	600285	羚锐制药	340,000	8,231,400.00	0.62
26	600757	长江传媒	1,003,000	8,084,180.00	0.61
27	002456	欧菲光	1,034,600	8,080,226.00	0.61
28	000682	东方电子	729,200	8,050,368.00	0.60
29	000030	富奥股份	1,609,500	7,902,645.00	0.59
30	002978	安宁股份	268,100	7,469,266.00	0.56
31	300596	利安隆	270,600	7,341,378.00	0.55
32	002534	西子洁能	724,880	7,256,048.80	0.54
33	002085	万丰奥威	535,100	7,084,724.00	0.53
34	002318	久立特材	294,800	6,877,684.00	0.52
35	002484	江海股份	516,500	6,843,625.00	0.51
36	300857	协创数据	119,700	6,822,900.00	0.51
37	600710	苏美达	833,100	6,789,765.00	0.51
38	002276	万马股份	922,900	6,617,193.00	0.50
39	000860	顺鑫农业	380,200	6,364,548.00	0.48
40	002727	一心堂	417,500	6,300,075.00	0.47
41	002378	章源钨业	1,079,400	6,195,756.00	0.46
42	002567	唐人神	1,151,700	6,173,112.00	0.46
43	600391	航发科技	403,100	6,147,275.00	0.46
44	600557	康缘药业	385,100	6,046,070.00	0.45
45	603985	恒润股份	502,300	5,977,370.00	0.45
46	603713	密尔克卫	111,400	5,962,128.00	0.45
47	002249	大洋电机	1,198,300	5,667,959.00	0.42
48	300821	东岳硅材	826,400	5,652,576.00	0.42
49	002265	建设工业	653,100	5,636,253.00	0.42
50	600552	凯盛科技	587,900	5,543,897.00	0.42
51	600572	康恩贝	1,240,200	5,543,694.00	0.42
52	000550	江铃汽车	255,300	5,542,563.00	0.42
53	300229	拓尔思	409,900	5,504,957.00	0.41
54	688362	甬矽电子	279,000	5,429,340.00	0.41
55	600602	云赛智联	491,692	5,428,279.68	0.41
56	688503	聚和材料	188,000	5,282,800.00	0.40
57	000761	本钢板材	2,090,800	5,247,908.00	0.39
58	000065	北方国际	503,600	5,222,332.00	0.39
59	000028	国药一致	160,100	5,160,023.00	0.39
60	600993	马应龙	192,900	5,144,643.00	0.39
61	002402	和而泰	479,600	5,136,516.00	0.38
62	002649	博彦科技	635,900	5,061,764.00	0.38
63	688100	威胜信息	131,247	5,007,073.05	0.38
64	601918	新集能源	506,500	4,938,375.00	0.37
65	300735	光弘科技	227,800	4,920,480.00	0.37
66	688278	特宝生物	91,385	4,893,666.75	0.37

67	000913	钱江摩托	304,900	4,805,224.00	0.36
68	300475	香农芯创	161,300	4,769,641.00	0.36
69	600874	创业环保	835,500	4,670,445.00	0.35
70	002068	黑猫股份	653,400	4,639,140.00	0.35
71	002020	京新药业	442,000	4,627,740.00	0.35
72	002837	英维克	209,200	4,474,788.00	0.34
73	300476	胜宏科技	138,700	4,474,462.00	0.34
74	600976	健民集团	88,300	4,459,150.00	0.33
75	601038	一拖股份	278,500	4,403,085.00	0.33
76	603297	永新光学	72,700	4,397,623.00	0.33
77	300587	天铁股份	1,070,100	4,323,204.00	0.32
78	001914	招商积余	428,300	4,291,566.00	0.32
79	002204	大连重工	1,000,300	4,271,281.00	0.32
80	688139	海尔生物	113,600	4,225,920.00	0.32
81	300045	华力创通	234,700	4,142,455.00	0.31
82	000597	东北制药	1,061,100	4,106,457.00	0.31
83	601949	中国出版	688,400	4,068,444.00	0.30
84	001696	宗申动力	381,500	4,059,160.00	0.30
85	688023	安恒信息	101,200	4,049,012.00	0.30
86	600458	时代新材	398,210	4,021,921.00	0.30
87	603308	应流股份	320,400	3,979,368.00	0.30
88	002125	湘潭电化	408,800	3,977,624.00	0.30
89	688315	诺禾致源	363,400	3,968,328.00	0.30
90	688322	奥比中光	147,427	3,937,775.17	0.30
91	000603	盛达资源	331,600	3,922,828.00	0.29
92	300134	大富科技	570,900	3,893,538.00	0.29
93	603123	翠微股份	646,100	3,837,834.00	0.29
94	688033	天宜上佳	639,000	3,834,000.00	0.29
95	600007	中国国贸	174,100	3,823,236.00	0.29
96	603595	东尼电子	185,100	3,811,209.00	0.29
97	002911	佛燃能源	411,500	3,761,110.00	0.28
98	002416	爱施德	419,100	3,709,035.00	0.28
99	603025	大豪科技	267,704	3,699,669.28	0.28
100	603026	胜华新材	108,900	3,680,820.00	0.28
101	300761	立华股份	162,000	3,667,680.00	0.27
102	688066	航天宏图	203,400	3,620,520.00	0.27
103	002405	四维图新	577,200	3,590,184.00	0.27
104	300573	兴齐眼药	21,580	3,539,120.00	0.27
105	688575	亚辉龙	146,386	3,413,721.52	0.26
106	601163	三角轮胎	217,000	3,302,740.00	0.25
107	000657	中钨高新	360,600	3,295,884.00	0.25
108	600639	浦东金桥	321,800	3,285,578.00	0.25
109	002895	川恒股份	178,800	3,273,828.00	0.25

110	600335	国机汽车	564,600	3,257,742.00	0.24
111	603766	隆鑫通用	477,300	3,236,094.00	0.24
112	002545	东方铁塔	471,000	3,207,510.00	0.24
113	300755	华致酒行	234,400	3,201,904.00	0.24
114	000555	神州信息	339,600	3,165,072.00	0.24
115	600295	鄂尔多斯	312,800	3,102,976.00	0.23
116	688208	道通科技	128,200	3,094,748.00	0.23
117	000035	中国天楹	680,100	3,080,853.00	0.23
118	688001	华兴源创	136,003	3,070,947.74	0.23
119	300166	东方国信	501,400	3,068,568.00	0.23
120	603358	华达科技	104,300	3,009,055.00	0.23
121	601137	博威合金	195,900	2,985,516.00	0.22
122	002550	千红制药	553,300	2,982,287.00	0.22
123	000688	国城矿业	310,800	2,958,816.00	0.22
124	300953	震裕科技	54,400	2,948,480.00	0.22
125	600675	中华企业	1,190,865	2,941,436.55	0.22
126	600633	浙数文化	333,000	2,933,730.00	0.22
127	301316	慧博云通	199,000	2,921,320.00	0.22
128	000828	东莞控股	320,700	2,889,507.00	0.22
129	600475	华光环能	328,800	2,863,848.00	0.21
130	601595	上海电影	144,200	2,852,276.00	0.21
131	300415	伊之密	136,700	2,840,626.00	0.21
132	688262	国芯科技	155,400	2,829,834.00	0.21
133	002929	润建股份	96,700	2,814,937.00	0.21
134	002906	华阳集团	104,900	2,807,124.00	0.21
135	002038	双鹭药业	378,700	2,791,019.00	0.21
136	300841	康华生物	54,800	2,775,072.00	0.21
137	601001	晋控煤业	166,500	2,750,580.00	0.21
138	605222	起帆电缆	178,700	2,741,258.00	0.21
139	300035	中科电气	321,400	2,735,114.00	0.20
140	688177	百奥泰	128,600	2,716,032.00	0.20
141	301205	联特科技	42,900	2,691,975.00	0.20
142	603129	春风动力	18,900	2,690,226.00	0.20
143	603565	中谷物流	307,800	2,690,172.00	0.20
144	002544	普天科技	142,800	2,668,932.00	0.20
145	300409	道氏技术	310,400	2,657,024.00	0.20
146	600775	南京熊猫	331,300	2,650,400.00	0.20
147	603108	润达医疗	170,300	2,578,342.00	0.19
148	000737	北方铜业	276,600	2,566,848.00	0.19
149	300085	银之杰	317,500	2,565,400.00	0.19
150	300602	飞荣达	168,300	2,543,013.00	0.19
151	600961	株冶集团	268,250	2,532,280.00	0.19
152	603013	亚普股份	183,600	2,473,092.00	0.19

153	002291	遥望科技	564,100	2,425,630.00	0.18
154	688383	新益昌	46,297	2,412,536.67	0.18
155	002706	良信股份	351,500	2,411,290.00	0.18
156	002091	江苏国泰	351,700	2,395,077.00	0.18
157	688266	泽璟制药	42,836	2,322,567.92	0.17
158	000712	锦龙股份	307,600	2,307,000.00	0.17
159	688027	国盾量子	15,121	2,283,271.00	0.17
160	000801	四川九洲	223,900	2,239,000.00	0.17
161	688321	微芯生物	126,800	2,231,680.00	0.17
162	000848	承德露露	283,500	2,228,310.00	0.17
163	000811	冰轮环境	224,900	2,170,285.00	0.16
164	603348	文灿股份	78,200	2,165,358.00	0.16
165	603098	森特股份	273,000	2,145,780.00	0.16
166	300772	运达股份	223,400	2,144,640.00	0.16
167	002698	博实股份	173,300	2,126,391.00	0.16
168	601975	招商南油	590,200	2,118,818.00	0.16
169	002651	利君股份	385,600	2,116,944.00	0.16
170	300133	华策影视	337,700	2,073,478.00	0.16
171	000917	电广传媒	404,200	2,041,210.00	0.15
172	002270	华明装备	91,700	2,039,408.00	0.15
173	002130	沃尔核材	140,800	1,988,096.00	0.15
174	002434	万里扬	397,300	1,946,770.00	0.15
175	300482	万孚生物	79,100	1,930,040.00	0.14
176	600266	城建发展	512,100	1,915,254.00	0.14
177	002901	大博医疗	71,606	1,849,582.98	0.14
178	600776	东方通信	185,600	1,824,448.00	0.14
179	603915	国茂股份	171,500	1,764,735.00	0.13
180	603055	台华新材	168,400	1,705,892.00	0.13
181	002099	海翔药业	317,000	1,619,870.00	0.12
182	603118	共进股份	236,400	1,583,880.00	0.12
183	603567	珍宝岛	147,000	1,547,910.00	0.12
184	603612	索通发展	119,400	1,523,544.00	0.11
185	300910	瑞丰新材	33,200	1,451,504.00	0.11
186	601811	新华文轩	103,600	1,451,436.00	0.11
187	002990	盛视科技	71,000	1,429,230.00	0.11
188	300303	聚飞光电	289,300	1,405,998.00	0.11
189	600531	豫光金铅	217,400	1,400,056.00	0.10
190	688680	海优新材	48,000	1,379,520.00	0.10
191	002123	梦网科技	195,100	1,371,553.00	0.10
192	603071	物产环能	109,091	1,366,910.23	0.10
193	688676	金盘科技	26,000	1,355,900.00	0.10
194	688166	博瑞医药	37,800	1,323,000.00	0.10
195	600869	远东股份	378,800	1,322,012.00	0.10

196	688141	杰华特	80,800	1,305,728.00	0.10
197	002332	仙琚制药	113,800	1,298,458.00	0.10
198	300723	一品红	64,700	1,271,355.00	0.10
199	600331	宏达股份	218,300	1,263,957.00	0.09
200	300446	航天智造	103,500	1,231,650.00	0.09
201	600888	新疆众和	173,000	1,223,110.00	0.09
202	600452	涪陵电力	96,400	1,221,388.00	0.09
203	603693	江苏新能	104,900	1,218,938.00	0.09
204	300113	顺网科技	118,900	1,217,536.00	0.09
205	300777	中简科技	56,400	1,212,600.00	0.09
206	002705	新宝股份	81,800	1,150,926.00	0.09
207	603938	三孚股份	96,400	1,132,700.00	0.08
208	688270	臻镭科技	42,600	1,111,860.00	0.08
209	000600	建投能源	169,200	1,065,960.00	0.08
210	002840	华统股份	64,000	1,061,760.00	0.08
211	300775	三角防务	34,400	1,052,640.00	0.08
212	601886	江河集团	206,500	1,007,720.00	0.08
213	688556	高测股份	82,800	984,492.00	0.07
214	301327	华宝新能	16,360	937,428.00	0.07
215	300298	三诺生物	36,800	932,512.00	0.07
216	000766	通化金马	55,700	901,783.00	0.07
217	000034	神州数码	38,700	885,843.00	0.07
218	688578	艾力斯	13,600	866,864.00	0.06

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	601567	三星医疗	340,400	11,914,000.00	0.89
2	300765	新诺威	331,500	8,363,745.00	0.63
3	002410	广联达	869,440	8,329,235.20	0.62
4	688369	致远互联	488,262	7,680,361.26	0.58
5	600098	广州发展	1,171,900	7,500,160.00	0.56
6	002749	国光股份	398,122	5,987,754.88	0.45
7	600872	中炬高新	262,300	5,951,587.00	0.45
8	688519	南亚新材	230,546	5,895,061.22	0.44
9	003019	宸展光电	227,300	5,757,509.00	0.43
10	688590	新致软件	384,800	4,963,920.00	0.37
11	688662	富信科技	182,685	4,457,514.00	0.33
12	603178	圣龙股份	177,700	3,808,111.00	0.29
13	300331	苏大维格	236,100	3,796,488.00	0.28
14	002736	国信证券	389,200	3,382,148.00	0.25
15	300810	中科海讯	220,800	3,380,448.00	0.25
16	300081	恒信东方	760,900	3,363,178.00	0.25
17	002664	信质集团	280,700	3,340,330.00	0.25

18	603516	淳中科技	101,300	3,198,041.00	0.24
19	688201	信安世纪	267,600	3,160,356.00	0.24
20	688249	晶合集成	214,600	3,148,182.00	0.24
21	688292	浩瀚深度	198,400	3,067,264.00	0.23
22	000933	神火股份	148,500	3,004,155.00	0.23
23	300056	中创环保	375,100	2,982,045.00	0.22
24	301209	联合化学	126,400	2,768,160.00	0.21
25	688609	九联科技	305,600	2,695,392.00	0.20
26	300709	精研科技	96,600	2,442,048.00	0.18
27	603277	银都股份	81,100	2,436,244.00	0.18
28	688079	美迪凯	324,800	2,410,016.00	0.18
29	603657	春光科技	211,000	2,403,290.00	0.18
30	688328	深科达	166,000	2,362,180.00	0.18
31	002942	新农股份	197,500	2,328,525.00	0.17
32	688313	仕佳光子	242,400	2,307,648.00	0.17
33	002532	天山铝业	283,500	2,299,185.00	0.17
34	603993	洛阳钼业	270,400	2,298,400.00	0.17
35	603416	信捷电气	80,200	2,292,116.00	0.17
36	300218	安利股份	150,800	2,274,064.00	0.17
37	300394	天孚通信	24,600	2,175,132.00	0.16
38	688095	福昕软件	46,325	2,122,148.25	0.16
39	600894	广日股份	178,700	2,055,050.00	0.15
40	000883	湖北能源	338,600	2,034,986.00	0.15
41	300871	回盛生物	203,700	1,943,298.00	0.15
42	603380	易德龙	96,200	1,931,696.00	0.14
43	300662	科锐国际	117,300	1,892,049.00	0.14
44	300769	德方纳米	67,000	1,889,400.00	0.14
45	301123	奕东电子	105,000	1,884,750.00	0.14
46	300539	横河精密	225,900	1,818,495.00	0.14
47	300767	震安科技	205,000	1,738,400.00	0.13
48	300968	格林精密	187,600	1,737,176.00	0.13
49	603629	利通电子	91,100	1,681,706.00	0.13
50	601238	广汽集团	216,700	1,677,258.00	0.13
51	600819	耀皮玻璃	376,100	1,587,142.00	0.12
52	603278	大业股份	250,600	1,556,226.00	0.12
53	000987	越秀资本	280,400	1,390,784.00	0.10
54	301260	格力博	96,500	1,314,330.00	0.10
55	603090	宏盛股份	72,900	1,299,078.00	0.10
56	603266	天龙股份	76,300	1,290,996.00	0.10
57	300719	安达维尔	75,400	1,278,030.00	0.10
58	300254	仟源医药	160,700	1,263,102.00	0.09
59	688136	科兴制药	75,000	1,257,000.00	0.09
60	301017	漱玉平民	123,900	1,219,176.00	0.09

61	603739	蔚蓝生物	91,000	1,175,720.00	0.09
62	301037	保立佳	131,400	1,164,204.00	0.09
63	605218	伟时电子	70,900	1,145,035.00	0.09
64	688070	纵横股份	39,200	1,107,792.00	0.08
65	300515	三德科技	110,100	1,086,687.00	0.08
66	300854	中兰环保	104,200	1,035,748.00	0.08
67	301234	五洲医疗	47,300	1,024,045.00	0.08
68	603737	三棵树	26,400	957,528.00	0.07
69	603928	兴业股份	120,640	944,611.20	0.07
70	002988	豪美新材	60,900	934,815.00	0.07
71	688191	智洋创新	50,000	846,500.00	0.06
72	688329	艾隆科技	54,200	805,412.00	0.06
73	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.04
74	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
75	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
76	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
77	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
78	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
79	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
80	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
81	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
82	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
83	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
84	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
85	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
86	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
87	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
88	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
89	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
90	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
91	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
92	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
93	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
94	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
95	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
96	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
97	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
98	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	601567	三星医疗	32,276,628.00	2.04
2	603871	嘉友国际	27,272,532.83	1.72
3	600248	陕建股份	23,371,381.00	1.48
4	600312	平高电气	21,752,836.00	1.37
5	600750	江中药业	21,399,952.02	1.35
6	600657	信达地产	21,286,471.00	1.34
7	002456	欧菲光	20,434,529.00	1.29
8	300475	香农芯创	20,045,530.65	1.27
9	688617	惠泰医疗	16,898,389.83	1.07
10	300767	震安科技	16,875,935.00	1.07
11	300369	绿盟科技	16,520,200.00	1.04
12	688578	艾力斯	16,208,959.80	1.02
13	688158	优刻得	16,171,802.76	1.02
14	603556	海兴电力	15,883,891.30	1.00
15	688033	天宜上佳	15,652,007.80	0.99
16	002085	万丰奥威	15,436,330.00	0.97
17	603979	金诚信	15,073,969.60	0.95
18	688023	安恒信息	14,961,095.64	0.94
19	603025	大豪科技	14,652,076.24	0.93
20	600552	凯盛科技	14,549,162.00	0.92

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	603871	嘉友国际	37,984,208.68	2.40
2	601019	山东出版	30,555,817.00	1.93
3	688100	威胜信息	26,965,236.95	1.70
4	601567	三星医疗	25,006,020.00	1.58
5	600750	江中药业	24,989,424.12	1.58
6	600675	中华企业	23,390,322.94	1.48
7	601702	华峰铝业	23,338,986.00	1.47
8	600312	平高电气	23,278,094.00	1.47
9	688578	艾力斯	23,131,195.62	1.46
10	603530	神马电力	23,122,677.22	1.46
11	688209	英集芯	21,968,996.35	1.39
12	000567	海德股份	20,748,352.02	1.31
13	600225	卓朗科技	20,577,965.20	1.30
14	603730	岱美股份	20,568,277.06	1.30
15	603556	海兴电力	20,039,552.00	1.27
16	002051	中工国际	19,968,008.20	1.26
17	603733	仙鹤股份	19,914,202.00	1.26
18	002461	珠江啤酒	19,106,635.50	1.21

19	601811	新华文轩	19,030,892.00	1.20
20	000688	国城矿业	18,911,240.89	1.19

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	3,729,782,072.38
卖出股票收入（成交）总额	3,773,913,110.94

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

本基金参与股指期货的投资，始终以套期保值为准则。报告期间，本基金主要采用多头套期保值，即通过买入期货的方式，在跟踪对应基准指数的同时，增加仓位调节的灵活度，亦可降低频繁交易股票带来的成本。具体交易时，本基金综合分析不同合约的标的指数、期限、基差和流动性的情况进行配置。本基金投资于股指期货，对基金相对风险的影响较小，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	13,373,428.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,792,317.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,165,746.59

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 (%)
建信中证 1000 指数 增强 A	34,804	17,779.82	356,972,606.35	57.69	261,836,398.37	42.31
建信中证 1000 指数 增强 C	47,750	8,495.74	252,700,180.83	62.29	152,971,453.25	37.71
建信中证 1000 指数 增强发起 E	1,322	13,298.14	10,317,849.14	58.69	7,262,293.58	41.31
合计	83,876	12,423.83	619,990,636.32	59.50	422,070,145.20	40.50

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 1000 指数增强 A	395,486.11	0.06
	建信中证 1000 指数增强 C	389.71	0.00
	建信中证 1000 指数增强发起 E	-	-
	合计	395,875.82	0.04

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研 究部门负责 人持有本开 放式基金	建信中证 1000 指数增强 A	0~10
	建信中证 1000 指数增强 C	0~10
	建信中证 1000 指数增强发 起 E	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有	建信中证 1000 指数增强 A	0~10

本开放式基金	建信中证 1000 指数增强 C	-
	建信中证 1000 指数增强发起 E	-
	合计	0~10

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	329,280.17	0.03	329,280.17	0.03	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	97,814.30	0.01	-	-	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	427,094.47	0.04	329,280.17	0.03	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E
基金合同生效日（2018 年 11 月 22 日）基金份额总额	50,945,615.13	48,700,352.71	-
本报告期期初基金份额总额	572,284,641.61	410,222,204.30	85,175,459.96
本报告期基金总申购份额	209,705,483.63	159,216,352.69	10,680,525.65
减：本报告期基金总赎回份额	163,181,120.52	163,766,922.91	78,275,842.89
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	618,809,004.72	405,671,634.08	17,580,142.72

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，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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	6,735,996,674.51	89.79	4,805,851.16	89.54	-
浙商证券	1	339,920,600.16	4.53	250,155.06	4.66	-
中信建投	1	257,878,312.37	3.44	192,353.72	3.58	-
中金财富证券	3	168,555,659.38	2.25	118,896.32	2.22	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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

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

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

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

（4）佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内增加国信证券 3 个交易单元和中金财富证券 3 个交易单元，无剔除交易单元。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 (%)
国信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	关于新增中国中金财富证券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 2 日
2	关于建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金证券交易模式转换完成的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 1 月 18 日
3	关于建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金证券交易模式转换有关事项的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 1 月 16 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

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	2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日	437,964,287.98	26,633,522.73	-	464,597,810.71	44.58
产品特有风险							
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。							

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 1000 指数增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 1000 指数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