

建信新能源行业股票型证券投资基金 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：中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投证券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	9
§ 4 管理人报告	9
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	11
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	13
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	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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信新能源行业股票型证券投资基金	
基金简称	建信新能源行业股票	
基金主代码	009147	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 月 17 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,288,953,254.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信新能源行业股票 A	建信新能源行业股票 C
下属分级基金的交易代码	009147	015048
报告期末下属分级基金的份额总额	2,224,079,169.50 份	64,874,085.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于新能源主题相关的上市公司，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>新能源又称非常规能源，是指煤炭、石油、天然气等已广泛使用的传统能源之外的各种能源形式。新能源行业主要包括太阳能、核电、地热能、风电、新能源汽车及新能源服务等相关行业。本基金投资的新能源行业界定如下：</p> <p>(1) 直接从事新能源产业相关的行业，包括：太阳能、光伏、风能、核能、水能、电力、页岩气、绿色照明、生物资源、天然气发电、地热、建筑节能、玻璃类/太阳能光电幕墙、乙醇汽油、氢能、锂电池、垃圾发电、节能 LED 照明、节能环保、新能源汽车、新能源汽车电子等。投资标的涵盖新能源产业链的上下游企业，包括上游大能源、大资源类、设备厂商类及下游运营商上市公司。</p> <p>(2) 受益于新能源主题的行业，包括：有潜力成为以上述新能源产业作为公司重要收入或利润来源或增长点的公司股票；与新能源主题相关的服务行业；投资于新能源产业相关的上市公司；因与新能源主题相关的产业结构升级、消费生活模式转变而受益的其他上市公司等。未来随着科技进步、政策或市场环境发生变化导致本基金</p>

	对相关行业的界定范围发生变动，本基金可调整上述界定标准，并在更新的招募说明书中进行公告。
业绩比较基准	中证新能源指数收益率×75%+恒生能源行业指数×10%+中证全债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金的基金资产如投资于港股，会面临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	中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	朱志明
	联系电话	010-66228888	4008-888-108
	电子邮箱	xinxiipilu@ccbfund.cn	service@csc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533；010-66228000	95587
传真		010-66228001	010-56162085
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	北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层	北京市朝阳区景辉街16号院1号楼泰康集团大厦8层/18层，北京市朝阳区光华路10号中信大厦82层
邮政编码		100033	100010
法定代表人		生柳荣	王常青

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	建信新能源行业股票 A	建信新能源行业股票 C
本期已实现收益	-494,738,406.95	-16,012,588.01

本期利润	-350,828,659.76	-12,162,093.12
加权平均基金份额本期利润	-0.1558	-0.1714
本期加权平均净值利润率	-11.67%	-12.97%
本期基金份额净值增长率	-10.41%	-10.59%
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	-726,895,281.99	-21,947,648.30
期末可供分配基金份额利润	-0.3268	-0.3383
期末基金资产净值	2,935,912,331.05	84,788,136.00
期末基金份额净值	1.3201	1.3070
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	32.01%	-46.65%

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

建信新能源行业股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

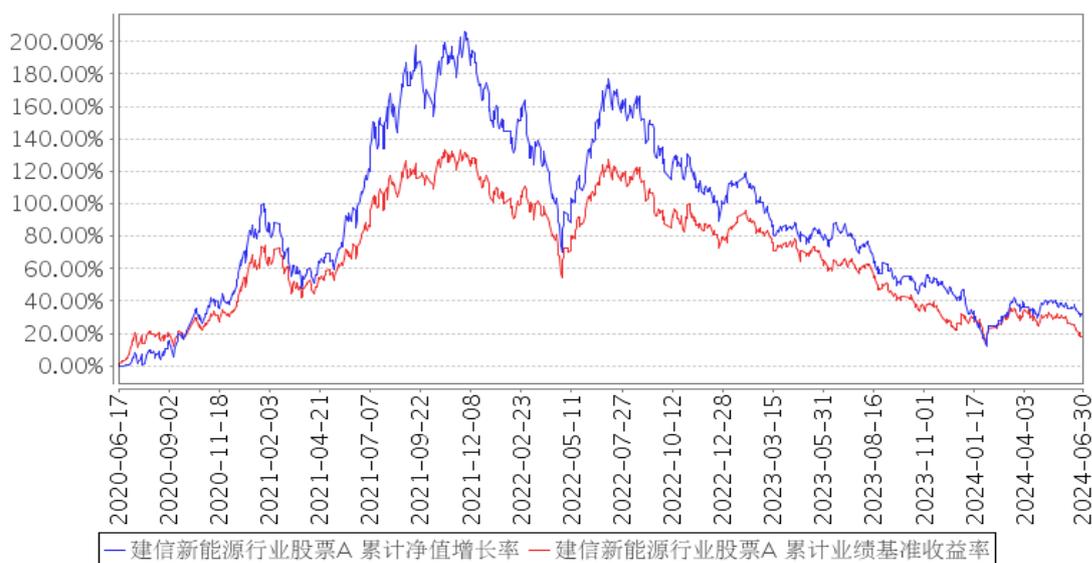
过去一个月	-3.69%	0.96%	-9.19%	0.80%	5.50%	0.16%
过去三个月	-3.22%	1.19%	-9.61%	1.19%	6.39%	0.00%
过去六个月	-10.41%	1.59%	-10.63%	1.39%	0.22%	0.20%
过去一年	-28.75%	1.40%	-28.82%	1.25%	0.07%	0.15%
过去三年	-39.35%	1.88%	-37.58%	1.51%	-1.77%	0.37%
自基金合同生效起 至今	32.01%	1.94%	17.63%	1.58%	14.38%	0.36%

建信新能源行业股票 C

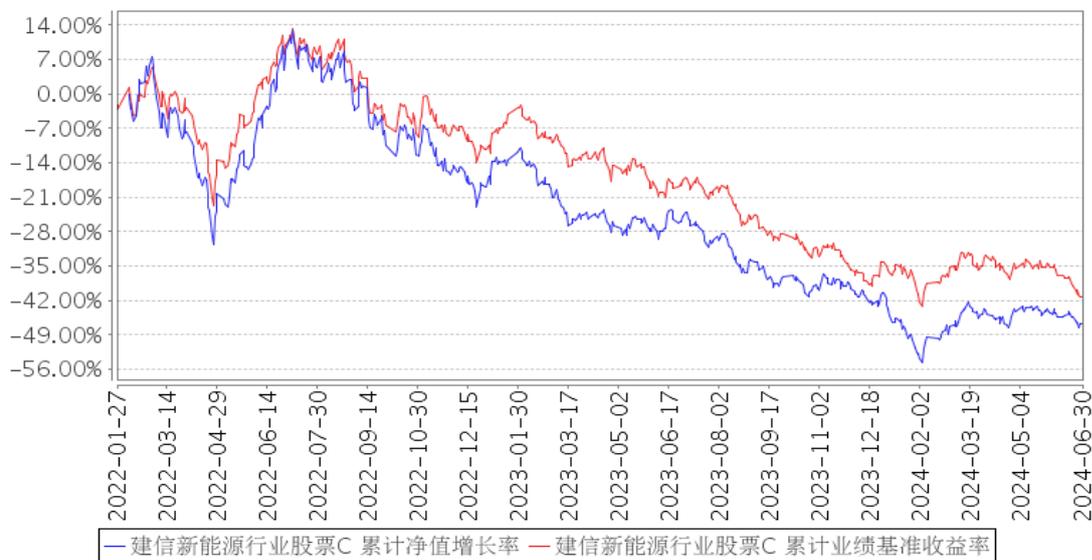
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.72%	0.96%	-9.19%	0.80%	5.47%	0.16%
过去三个月	-3.31%	1.19%	-9.61%	1.19%	6.30%	0.00%
过去六个月	-10.59%	1.59%	-10.63%	1.39%	0.04%	0.20%
过去一年	-29.03%	1.40%	-28.82%	1.25%	-0.21%	0.15%
自基金合同生效起 至今	-46.65%	1.72%	-41.27%	1.42%	-5.38%	0.30%

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

建信新能源行业股票A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信新能源行业股票C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，由中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团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		
陶灿	权益投资部执行总经理，本基金的基金经理	2020年6月17日	-	16	陶灿先生，权益投资部执行总经理，硕士。2007年7月加入本公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、权益投资部总经理助理兼研究部首席策略官等职务。2011年7月11日至2016年4月22日任建信优化配置混合型证券投资基金的基金经理；2014年5月14日起任建信改革红利股票型证券投资基金的基金经理；2016年2月23日至2021年9月29日任建信现代服务业股票型证券投资基金的基金经理；2017年2月9日至2019年1月21日任建信回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017年3月22日至2024年2月22日任建信恒久价值混合型证券投资基金的基金经理；2017年10月27日起任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于2017年11月4日起转型为建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金，陶灿于2017年11月4日起至2023年6月28日担任该基金的基金经理；2020年1月21日起任建信高股息股票型证券投资基金的基金经理；2020年6月17日起任建信新能源行业股票型证券投资基金的基金经理；2021年3月26日至2023年11月10日任建信智能生活混合型证券投资基金的基金经理；2021年8月24日起任建信兴润一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；2022年1月19日起任建信沃信一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。
田元泉	研究部副总经理，本基金的基金经理	2020年6月17日	-	11	田元泉先生，研究部副总经理，硕士。曾任安邦资产管理有限责任公司研究员、投资经理助理。2015年6月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究员、研究主管、资深研究员、研究部总经理助理、副总经理。2020年6月17日起任建信新能源行业股票型证券投资基金的基金经理；2021年9月10日起任建信智能汽车股票型证券投资基金的基金经理；2024年6月12日起任建信研究精选混合型证券投资基金的基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信新能源行业股票型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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

2024 年上半年宏观经济总体呈现“总量前高后低、结构内冷外热”的特征，一季度 GDP 增速 5.3%并超市场预期，但二季度以来，由于内需不足，地产、消费相对偏弱，经济动能边际回落，制造业 PMI5 月、6 月连续两个月运行在荣枯线之下。整体来看，上半年大盘指数整体微跌但波动

较大，大盘股和价值股表现好于成长股。

新能源行业 2024 年上半年下跌 19.32%，大幅跑输上证指数和沪深 300 指数，也跑输创业板指。从基本面来看，2024 年上半年产业链仍面临产能过剩压力，单位盈利大幅下行，组件出现全行业亏损情况，只有少数环节盈利尚可；新国内汽车行业需求乏力，但新能源汽车渗透率仍维持上升势头，锂电材料环节面临产能过剩压力，龙头和非龙头公司之间盈利能力开始显著分化；风电行业装机进度受多方面因素影响整体慢于预期，海上风电部分重点项目已经取得政策性突破，部分风电零部件公司出海已经屡有斩获。总结来看，新能源行业面临的突出问题主要是产能过剩问题，行业需求短期也有放缓趋势，我们判断 2025 年部分细分行业的产能过剩将开始缓解，更长周期的视角来看，能源结构绿色转型仍是全球大势所趋，新能源行业估值已经跌至历史底部，左侧布局的时间或已不远。

本基金维持较高仓位，规避有产能过剩风险的锂电池材料、光伏主材等环节，减持短期需求一般的汽车零部件，超配风电、电网设备等方向，逢低加仓了业绩较好、估值较低的新能源汽车龙头公司。

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-10.41%，波动率 1.59%，业绩比较基准收益率-10.63%，波动率 1.39%。本报告期本基金 C 净值增长率-10.59%，波动率 1.59%，业绩比较基准收益率-10.63%，波动率 1.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于宏观经济，我们认为下半年经济修复仍维持的低位弱复苏的特征。支撑经济修复的动力来自于两个方面：一是出口，海外补库存和制造业周期驱动下出口实现较高增长，预计能至少维持至三季度，但四季度需要关注拐点的出现；二是财政支出，化债以及地方政府对专项债项目的质量要求的提升，是今年以来专项债发行进度整体偏慢，财政支出偏弱的主要原因，后续需要关注专项债发行提速、财政支出再度发力对基建形成支撑。当前阶段，价格信号对经济和股票市场的意义更加重要。下半年重点关注两大价格信号：一是 PPI 是否转正并摆脱通缩，作为观察企业盈利改善的重要信号，我们预计年底 PPI 仍有一定概率转正，对应 2024 年全 A 非金融企业盈利增速从去年的-3%修复至 3%，盈利对于市场整体的负面压制有望缓解；二是核心城市房价边际企稳的信号，作为观察本轮地产政策效果，以及中长期地产及经济预期企稳的重要标志。

对于市场，我们认为当前中国股票市场具备中长期配置价值：一是国内经济将延续温和修复趋势，总量政策维持偏宽松基调，低利率环境有助于企业加强资本开支及制造业高质量转型发展；二是美国经济或在今年下半年转弱，美联储开启降息周期，中美经济比价反转将提升人民币计价

资产的全球配置吸引力；三是资本市场改革力度加强有助于上市公司的优胜劣汰，基础市场环境的不断优化，监管强调以投资者为中心；四是当前市场估值处于历史较低分位，权益资产估值性价比凸显，中长期配置价值显现。

对于新能源行业，我们认为行业下行压力最大的时间已经过去，未来主要看产能出清进度。我们认为新能源行业的长期逻辑没有发生任何变化，即长期空间大、渗透率较低、中国新能源产业竞争力强、行业中期需求仍维持相对较快增长。经过前期的大幅调整后，新能源行业的估值水平已经处于历史底部。产能过剩压力下部分高壁垒环节的龙头公司仍能维持较高的市场份额和合理的利润水平，在估值低位下，这类公司具备长期配置价值；新能源行业新的技术变化层出不穷，新的细分板块的投资机会将持续涌现，这些机会的把握需要研究上的前瞻性和投资上的敏锐性。当然，在当前宏观和金融环境下，A 股整体和新能源产业内部还是会继续延续结构化特征，我们也会积极参与不同细分板块之间轮动的机会。

我们将兢兢业业、勤勉尽责，挖掘新能源产业的投资机会，尽最大努力为投资者创造好的回报。

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

在本报告期内，本基金托管人在托管建信新能源行业股票型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 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：建信新能源行业股票型证券投资基金

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	165,157,230.47	195,036,992.02
结算备付金		33,612,463.00	3,256,657.07
存出保证金		1,123,815.19	1,650,425.57
交易性金融资产	6.4.7.2	2,824,055,828.00	3,297,802,818.68
其中：股票投资		2,824,055,828.00	3,297,802,818.68
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		13,179,021.73	-
应收股利		-	-
应收申购款		594,848.83	1,817,760.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,037,723,207.22	3,499,564,653.97
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		6,207,631.47	45.38
应付赎回款		2,436,160.92	6,291,593.51
应付管理人报酬		3,053,602.14	3,505,819.81
应付托管费		508,933.70	584,303.30
应付销售服务费		28,589.18	45,243.82
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	4,787,822.76	5,186,080.78
负债合计		17,022,740.17	15,613,086.60
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,288,953,254.81	2,365,064,484.56
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	731,747,212.24	1,118,887,082.81
净资产合计		3,020,700,467.05	3,483,951,567.37
负债和净资产总计		3,037,723,207.22	3,499,564,653.97

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,288,953,254.81 份，其中建信新能源行业股票 A 基金份额总额 2,224,079,169.50 份，基金份额净值人民币 1.3201 元；建信新能源行业股票 C 基金份额总额 64,874,085.31 份，基金份额净值人民币 1.3070 元。

6.2 利润表

会计主体：建信新能源行业股票型证券投资基金

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		-341,140,131.82	-320,114,669.83
1. 利息收入		786,181.26	1,208,193.91
其中：存款利息收入	6.4.7.13	786,181.26	1,208,193.91
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）		-489,901,441.98	-591,912,546.77
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-519,806,361.50	-611,464,119.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	45,142.39	1,068,677.11
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	29,859,777.13	18,482,896.04
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	147,760,242.08	269,855,244.97
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	214,886.82	734,438.06
减：二、营业总支出		21,850,621.06	40,989,575.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,462,630.15	34,785,146.08
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,077,105.04	5,797,524.42
3. 销售服务费		186,563.73	281,284.06
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		5. 33	852. 99
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	124, 316. 81	124, 767. 47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-362, 990, 752. 88	-361, 104, 244. 85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-362, 990, 752. 88	-361, 104, 244. 85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-362, 990, 752. 88	-361, 104, 244. 85

6.3 净资产变动表

会计主体：建信新能源行业股票型证券投资基金

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	2, 365, 064, 484. 56	-	1, 118, 887, 082. 81	3, 483, 951, 567. 37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2, 365, 064, 484. 56	-	1, 118, 887, 082. 81	3, 483, 951, 567. 37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-76, 111, 229. 75	-	-387, 139, 870. 57	-463, 251, 100. 32
（一）、综合收益总额	-	-	-362, 990, 752. 88	-362, 990, 752. 88
（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）	-76, 111, 229. 75	-	-24, 149, 117. 69	-100, 260, 347. 44
其中：1. 基金申购款	135, 095, 007. 66	-	42, 594, 335. 41	177, 689, 343. 07

2. 基金赎回款	-211,206,237.41	-	-66,743,453.10	-277,949,690.51
(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	2,288,953,254.81	-	731,747,212.24	3,020,700,467.05
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	2,389,799,216.21	-	2,379,653,644.63	4,769,452,860.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,389,799,216.21	-	2,379,653,644.63	4,769,452,860.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	18,498,739.65	-	-326,511,525.85	-308,012,786.20
(一)、综合收益总额	-	-	-361,104,244.85	-361,104,244.85
(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)	18,498,739.65	-	34,592,719.00	53,091,458.65
其中：1. 基金申购款	416,262,611.28	-	394,083,180.82	810,345,792.10
2. 基金赎回款	-397,763,871.63	-	-359,490,461.82	-757,254,333.45
(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	-	-	-	-

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	2,408,297,955.86	-	2,053,142,118.78	4,461,440,074.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

张力铮

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信新能源行业股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]326号《关于准予建信新能源行业股票型证券投资基金注册的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信新能源行业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 330,437,111.18 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2020）验字第 61490173_A20 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信新能源行业股票型证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 330,543,596.71 份基金份额，其中认购资金利息折合 106,485.53 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

根据《建信新能源行业股票型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》并报证监会备案，本基金于 2022 年 1 月 27 日起根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式等不同，将本基金基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别。2022 年 1 月 27 日前原有的基金份额全部转换为建信新能源行业股票型证券投资基金 A 类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信新能源行业股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通投资标的股票”）、股指期货、股票期权、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具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。本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 80-95%，其中投资于本基金界定的“新能源行业股票”的比例不低于非现金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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。本基金的业绩比较基准为中证新能源指数收益率×75%+恒生能源行业指数×10%+中证全债指数收益率×15%。

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	165,157,230.47
等于：本金	165,124,506.20
加：应计利息	32,724.27
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	165,157,230.47

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	2,906,642,764.87	-	2,824,055,828.00	-82,586,936.87

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		2,906,642,764.87	-	2,824,055,828.00	-82,586,936.87

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	244.19
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,584,152.43
其中：交易所市场	4,583,752.43
银行间市场	400.00
应付利息	-
预提费用	203,426.14
合计	4,787,822.76

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信新能源行业股票 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	2,275,705,283.60	2,275,705,283.60
本期申购	120,317,807.94	120,317,807.94
本期赎回(以“-”号填列)	-171,943,922.04	-171,943,922.04
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	2,224,079,169.50	2,224,079,169.50

建信新能源行业股票 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	89,359,200.96	89,359,200.96
本期申购	14,777,199.72	14,777,199.72
本期赎回（以“-”号填列）	-39,262,315.37	-39,262,315.37
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	64,874,085.31	64,874,085.31

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

建信新能源行业股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-244,934,803.76	1,322,552,525.52	1,077,617,721.76
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-244,934,803.76	1,322,552,525.52	1,077,617,721.76
本期利润	-494,738,406.95	143,909,747.19	-350,828,659.76
本期基金份额交易产生的变动数	12,777,928.72	-27,733,829.17	-14,955,900.45
其中：基金申购款	-26,546,532.74	65,969,852.26	39,423,319.52
基金赎回款	39,324,461.46	-93,703,681.43	-54,379,219.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-726,895,281.99	1,438,728,443.54	711,833,161.55

建信新能源行业股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,578,867.00	51,848,228.05	41,269,361.05
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-10,578,867.00	51,848,228.05	41,269,361.05
本期利润	-16,012,588.01	3,850,494.89	-12,162,093.12
本期基金份额交易产生的变动数	4,643,806.71	-13,837,023.95	-9,193,217.24
其中：基金申购款	-3,039,931.36	6,210,947.25	3,171,015.89
基金赎回款	7,683,738.07	-20,047,971.20	-12,364,233.13
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-21,947,648.30	41,861,698.99	19,914,050.69
-----	----------------	---------------	---------------

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	714,635.03	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	59,184.94	
其他	12,361.29	
合计	786,181.26	

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	-519,806,361.50	
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	-519,806,361.50	

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	2,822,275,392.56	
减：卖出股票成本总额	3,336,163,331.53	
减：交易费用	5,918,422.53	
买卖股票差价收入	-519,806,361.50	

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入	6,873.02	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	38,269.37	

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	45,142.39

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	30,048,238.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	30,000,460.30
减：应计利息总额	8,758.66
减：交易费用	750.00
买卖债券差价收入	38,269.37

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	29,859,777.13
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	29,859,777.13

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	147,760,242.08
股票投资	147,760,242.08
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	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	147,760,242.08

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	212,379.32
基金转换费收入	2,507.50
合计	214,886.82

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	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
证券组合费	1,290.67
合计	124,316.81

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司（“中信建投”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
中信建投	2,856,551,661.17	51.59	2,115,269,014.61	27.17

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
中信建投	2,097,650.71	52.28	1,421,742.68	31.02
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
中信建投	1,514,353.36	26.86	794,042.03	12.98

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,462,630.15	34,785,146.08
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,155,379.60	13,801,252.86
应支付基金管理人的净管理费	11,307,250.55	20,983,893.22

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 1.20% 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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 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	3,077,105.04	5,797,524.42

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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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		
	建信新能源行业股票 A	建信新能源行业股票 C	合计
建信基金	-	110,697.80	110,697.80
中信建投	-	64.93	64.93
合计	-	110,762.73	110,762.73
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		
	建信新能源行业股票 A	建信新能源行业股票 C	合计
建信基金	-	25,093.41	25,093.41
中信建投	-	136.18	136.18
合计	-	25,229.59	25,229.59

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0.4%。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自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	
	建信新能源行业股票 A	建信新能源行业股票 C
基金合同生效日（2020年6月17日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,383,194.68	-
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	8,383,194.68	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.38%	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	建信新能源行业股票 A	建信新能源行业股票 C
基金合同生效日（2020年6月17日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,383,194.68	-
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	8,383,194.68	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.36%	-

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

无。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（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
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	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新发未上市	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
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	-
603350	安	2024	1个月	新发	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-

	乃达	年 6 月 26 日	内(含)	未上市						
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	-
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	-
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	165,157,230.47	-	-	-	165,157,230.47
结算备付金	33,612,463.00	-	-	-	33,612,463.00
存出保证金	1,123,815.19	-	-	-	1,123,815.19
交易性金融资产	-	-	-	-2,824,055,828.00	2,824,055,828.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	13,179,021.73	13,179,021.73
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	594,848.83	594,848.83
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	199,893,508.66	-	-	-2,837,829,698.56	3,037,723,207.22
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	-	-	-	6,207,631.47	6,207,631.47
应付赎回款	-	-	-	2,436,160.92	2,436,160.92
应付管理人报酬	-	-	-	3,053,602.14	3,053,602.14
应付托管费	-	-	-	508,933.70	508,933.70
应付销售服务费	-	-	-	28,589.18	28,589.18
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,787,822.76	4,787,822.76
负债总计	-	-	-	17,022,740.17	17,022,740.17
利率敏感度缺口	199,893,508.66	-	-	-2,820,806,958.39	3,020,700,467.05
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	195,036,992.02	-	-	-	195,036,992.02
结算备付金	3,256,657.07	-	-	-	3,256,657.07
存出保证金	1,650,425.57	-	-	-	1,650,425.57
交易性金融资产	-	-	-	-3,297,802,818.68	3,297,802,818.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,817,760.63	1,817,760.63
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	199,944,074.66	-	-	-3,299,620,579.31	3,499,564,653.97

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	-	-	-	45.38	45.38
应付赎回款	-	-	-	6,291,593.51	6,291,593.51
应付管理人报酬	-	-	-	3,505,819.81	3,505,819.81
应付托管费	-	-	-	584,303.30	584,303.30
应付销售服务费	-	-	-	45,243.82	45,243.82
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,186,080.78	5,186,080.78
负债总计	-	-	-	15,613,086.60	15,613,086.60
利率敏感度缺口	199,944,074.66	-	-	-3,284,007,492.71	3,483,951,567.37

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	40,654,315.70	-	40,654,315.70
资产合计	-	40,654,315.70	-	40,654,315.70
以外币计价的负债				

负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	40,654,315.70	-	40,654,315.70
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	212,394,986.90	-	212,394,986.90
资产合计	-	212,394,986.90	-	212,394,986.90
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	212,394,986.90	-	212,394,986.90

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民 币升值 5%	2,032,715.79	10,619,749.35
	所有外币相对人民 币贬值 5%	-2,032,715.79	-10,619,749.35

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	2,824,055,828.00	93.49	3,297,802,818.68	94.66
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	2,824,055,828.00	93.49	3,297,802,818.68	94.66

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%	135,758,392.43	158,277,301.10
业绩比较基准下降5%	-135,758,392.43	-158,277,301.10	

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	2,823,443,564.32	3,296,636,009.90
第二层次	21,608.56	898,742.02
第三层次	590,655.12	268,066.76
合计	2,824,055,828.00	3,297,802,818.68

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,824,055,828.00	92.97
	其中：股票	2,824,055,828.00	92.97
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	198,769,693.47	6.54
8	其他各项资产	14,897,685.75	0.49
9	合计	3,037,723,207.22	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 40,654,315.70 元，占期末基金资产净值比例为 1.35%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	363,208,500.48	12.02
C	制造业	2,297,429,839.39	76.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,130,691.00	1.16
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	69,538,133.83	2.30
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	18,094,347.60	0.60
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	2,783,401,512.30	92.14

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
Materials 材料	-	-
Consumer Staples 日常生活消费品	-	-
Consumer Discretionary 非日常消费品	-	-
Energy 能源	-	-
Financials 金融	-	-
Health Care 医疗保健	-	-
Industrials 工业	-	-
Real Estate 房地产	-	-
Information Technology 信息技术	40,654,315.70	1.35
Telecommunication Services 通讯服务	-	-
Utilities 公用事业	-	-
合计	40,654,315.70	1.35

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,440,464	259,326,733.92	8.58
2	603606	东方电缆	4,890,468	238,703,743.08	7.90
3	603993	洛阳钼业	21,836,200	185,607,700.00	6.14
4	600487	亨通光电	8,455,594	133,344,717.38	4.41
5	002594	比亚迪	502,000	125,625,500.00	4.16
6	300274	阳光电源	1,725,551	107,035,928.53	3.54
7	603179	新泉股份	2,644,800	103,781,952.00	3.44
8	600660	福耀玻璃	1,915,500	91,752,450.00	3.04
9	688408	中信博	951,690	87,631,615.20	2.90
10	600312	平高电气	4,205,300	81,793,085.00	2.71
11	002155	湖南黄金	4,245,100	76,836,310.00	2.54

12	002532	天山铝业	9,261,673	75,112,168.03	2.49
13	002487	大金重工	3,207,460	73,386,684.80	2.43
14	002050	三花智控	3,828,900	73,055,412.00	2.42
15	601899	紫金矿业	3,947,399	69,355,800.43	2.30
16	000682	东方电子	6,264,062	69,155,244.48	2.29
17	605196	华通线缆	6,454,308	67,899,320.16	2.25
18	002463	沪电股份	1,826,805	66,678,382.50	2.21
19	601799	星宇股份	592,900	66,428,516.00	2.20
20	000400	许继电气	1,908,800	65,681,808.00	2.17
21	000960	锡业股份	4,147,901	64,250,986.49	2.13
22	605117	德业股份	790,944	58,798,776.96	1.95
23	001301	尚太科技	1,314,418	56,809,145.96	1.88
24	002028	思源电气	754,100	50,449,290.00	1.67
25	301358	湖南裕能	1,311,300	41,253,498.00	1.37
26	600933	爱柯迪	2,736,780	40,476,976.20	1.34
27	002475	立讯精密	931,100	36,601,541.00	1.21
28	002897	意华股份	938,291	35,336,039.06	1.17
29	002837	英维克	1,601,361	34,253,111.79	1.13
30	603979	金诚信	621,585	31,408,690.05	1.04
31	600875	东方电气	1,702,000	31,401,900.00	1.04
32	688772	珠海冠宇	1,552,622	23,134,067.80	0.77
33	300969	恒帅股份	333,999	23,089,350.87	0.76
34	00285	比亚迪电子	582,000	20,716,010.64	0.69
35	01810	小米集团-W	1,325,600	19,938,305.06	0.66
36	603568	伟明环保	879,220	18,094,347.60	0.60
37	002255	海陆重工	3,275,521	16,017,297.69	0.53
38	688100	威胜信息	418,775	15,976,266.25	0.53
39	002920	德赛西威	155,370	13,531,173.30	0.45
40	600795	国电电力	2,246,200	13,454,738.00	0.45
41	003816	中国广核	2,713,100	12,561,653.00	0.42
42	601126	四方股份	487,700	9,373,594.00	0.31
43	600522	中天科技	575,900	9,128,015.00	0.30
44	601985	中国核电	855,000	9,114,300.00	0.30
45	002126	银轮股份	500,000	8,705,000.00	0.29
46	000338	潍柴动力	345,500	5,610,920.00	0.19
47	301548	崇德科技	74,444	3,951,487.52	0.13
48	600066	宇通客车	49,614	1,280,041.20	0.04
49	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.02
50	688692	达梦数据	1,745	382,889.35	0.01
51	603341	龙旗科技	2,978	115,638.42	0.00
52	603381	永臻股份	1,778	49,273.14	0.00
53	603082	北自科技	1,070	32,276.55	0.00
54	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00

55	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
56	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	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	300274	阳光电源	174,604,431.11	5.01
2	002594	比亚迪	119,525,234.00	3.43
3	600487	亨通光电	118,583,947.64	3.40
4	603993	洛阳钼业	116,063,314.00	3.33
5	600795	国电电力	96,512,615.00	2.77
6	688408	中信博	84,360,156.77	2.42
7	002532	天山铝业	77,314,601.42	2.22
8	600312	平高电气	73,688,832.60	2.12
9	000960	锡业股份	71,693,088.10	2.06
10	605196	华通线缆	71,690,373.08	2.06
11	601899	紫金矿业	69,342,051.20	1.99
12	002463	沪电股份	68,608,362.66	1.97
13	000682	东方电子	64,182,509.72	1.84
14	002533	金杯电工	63,431,137.97	1.82
15	002155	湖南黄金	63,427,400.12	1.82
16	000400	许继电气	61,592,559.04	1.77
17	605117	德业股份	57,553,656.00	1.65
18	002028	思源电气	53,519,372.92	1.54
19	301358	湖南裕能	53,139,335.00	1.53
20	001301	尚太科技	50,581,987.62	1.45

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	300316	晶盛机电	198,098,879.82	5.69
2	000988	华工科技	137,489,620.94	3.95
3	002487	大金重工	119,924,867.12	3.44
4	300129	泰胜风能	114,339,453.24	3.28
5	600522	中天科技	114,038,309.00	3.27
6	002920	德赛西威	108,200,754.18	3.11
7	000625	长安汽车	98,757,656.22	2.83
8	300567	精测电子	97,381,139.33	2.80
9	600795	国电电力	95,102,730.20	2.73
10	002050	三花智控	91,822,408.00	2.64

11	300748	金力永磁	84,678,225.74	2.43
12	09868	小鹏汽车-W	83,617,962.13	2.40
13	02015	理想汽车-W	82,250,229.20	2.36
14	003031	中瓷电子	76,775,568.04	2.20
15	603786	科博达	75,708,351.85	2.17
16	002533	金杯电工	71,691,300.26	2.06
17	002997	瑞鹤模具	69,578,566.19	2.00
18	002444	巨星科技	55,425,658.68	1.59
19	300274	阳光电源	55,071,707.08	1.58
20	600933	爱柯迪	53,218,333.45	1.53

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,714,656,098.77
卖出股票收入（成交）总额	2,822,275,392.56

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,123,815.19
2	应收清算款	13,179,021.73
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	594,848.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,897,685.75

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	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 (%)
建信新能	222,882	9,978.73	353,766,383.98	15.91	1,870,312,785.52	84.09

源行业股票 A						
建信新能源行业股票 C	5,826	11,135.27	37,833,495.69	58.32	27,040,589.62	41.68
合计	228,708	10,008.19	391,599,879.67	17.11	1,897,353,375.14	82.89

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	建信新能源行业股票 A	2,728,469.79	0.12
	建信新能源行业股票 C	893.84	0.00
	合计	2,729,363.63	0.12

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	建信新能源行业股票 A	>100
	建信新能源行业股票 C	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	建信新能源行业股票 A	>100
	建信新能源行业股票 C	-
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信新能源行业股票 A	建信新能源行业股票 C
基金合同生效日 (2020年6月17日) 基金份额总额	330,543,596.71	-

本报告期期初基金份额总额	2,275,705,283.60	89,359,200.96
本报告期基金总申购份额	120,317,807.94	14,777,199.72
减：本报告期基金总赎回份额	171,943,922.04	39,262,315.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,224,079,169.50	64,874,085.31

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，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投	2	2,856,551,661.17	51.59	2,097,650.71	52.28	-
广发证券	2	905,119,489.45	16.35	647,458.08	16.14	-
东吴证券	1	837,496,309.53	15.13	598,478.23	14.92	-
国金证券	1	448,453,998.50	8.10	330,012.52	8.23	-
方正证券	1	388,882,038.59	7.02	264,937.79	6.60	-
东北证券	1	100,112,926.43	1.81	73,663.26	1.84	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。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(%)
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	关于新增东方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6月28日
2	建信基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金申购（包括转换转入、定投）及赎回（包括转换转出）金额起点的公告	指定报刊和/或公司网站	2024年6月7日
3	关于新增国信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5月22日
4	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

§ 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新能源行业股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信新能源行业股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信新能源行业股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信新能源行业股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2024 年 8 月 29 日