

建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 26 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	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
3.4 过去三年基金的利润分配情况	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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23

§ 8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 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	57
8.7 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	57
8.8 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	57
8.9 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	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12 投资组合报告附注	58
§ 9 基金份额持有人信息	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§ 10 开放式基金份额变动	59
§ 11 重大事件揭示	59
11.1 基金份额持有人大会决议	59
11.2 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	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 其他重大事件	62
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	63
12.1 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	63
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 13 备查文件目录	63
13.1 备查文件目录	63
13.2 存放地点	63
13.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金
基金简称	建信潜力新蓝筹股票
基金主代码	000756
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 10 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	30,188,143.66 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	陆志俊
	联系电话	010-66228888	95559
	电子邮箱	xinxiipilu@ccbfund.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95559
传真		010-66228001	021-62701216
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		100033	200336
法定代表人		孙志晨	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn

基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	28,385,598.60	14,278,351.86	-14,894,427.78
本期利润	33,710,903.94	20,064,351.52	-22,483,073.18
加权平均基金份额本期利润	0.9253	0.3721	-0.3940
本期加权平均净值利润率	51.06%	27.91%	-29.14%
本期基金份额净值增长率	65.21%	32.28%	-26.80%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	42,772,297.15	22,191,735.85	6,014,561.26
期末可供分配基金份额利润	1.4169	0.4625	0.1058
期末基金资产净值	72,960,440.81	70,173,684.61	62,848,179.22
期末基金份额净值	2.417	1.463	1.106
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值	141.70%	46.30%	10.60%

增长率			
-----	--	--	--

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

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
过去三个月	18.02%	1.43%	11.76%	0.84%	6.26%	0.59%
过去六个月	35.33%	1.65%	21.27%	1.14%	14.06%	0.51%
过去一年	65.21%	1.77%	23.69%	1.21%	41.52%	0.56%
过去三年	59.96%	1.54%	28.67%	1.14%	31.29%	0.40%
过去五年	70.93%	1.48%	37.95%	1.06%	32.98%	0.42%
自基金合同生效起至今	141.70%	1.75%	103.47%	1.30%	38.23%	0.45%

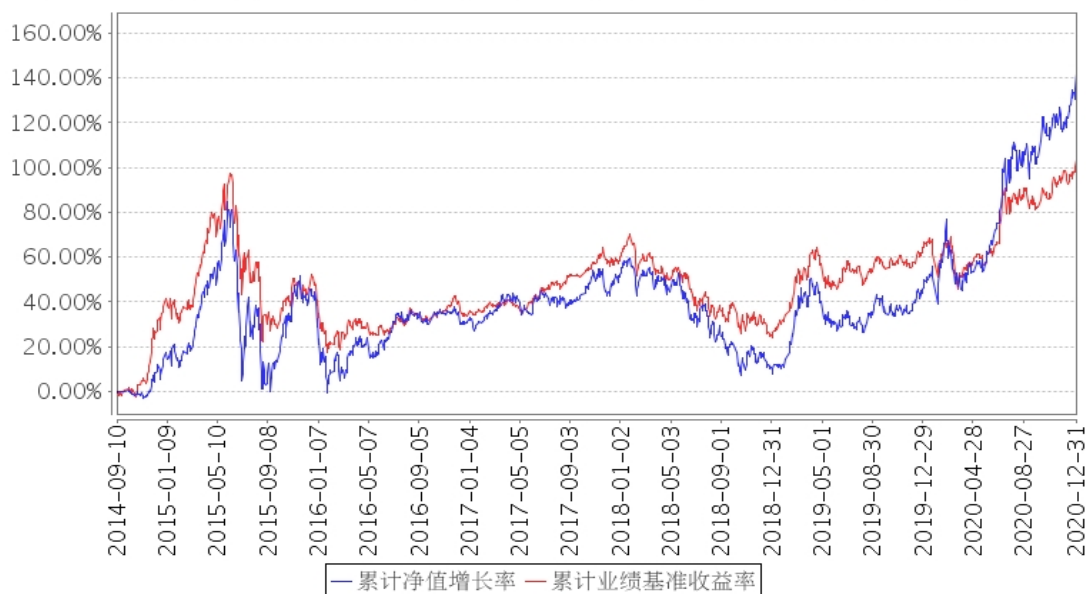
注：本基金业绩比较基准为： $85\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+15\% \times$ 中债总财富（总值）指数收益率。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制的，从上海和深圳股票市场中选取的 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。该指数为具有良好的市场代表性、能够反映 A 股市场整体走势的指数。中债总财富（总值）指数是由中央国债登记结算有限责任公司推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中债总财富（总值）指数为

掌握我国债券市场价格波动幅度和变动趋势、测算债券投资回报率水平提供了很好的依据。

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

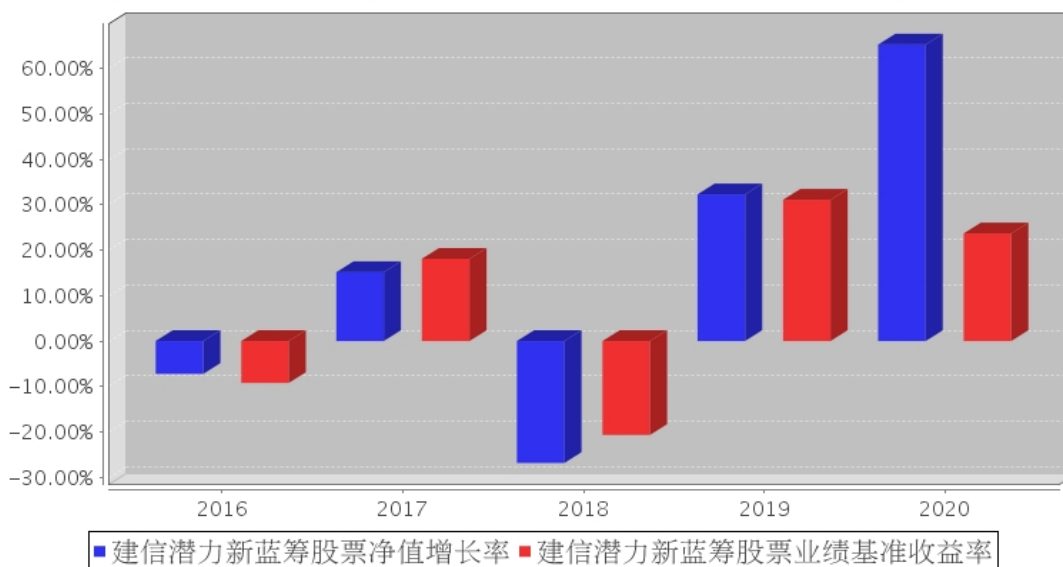
建信潜力新蓝筹股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信潜力新蓝筹股票基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：过去三年本基金未实施利润分配。

§ 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，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、基础设施投资部、网络金融部、人力资源管理部、基金会计部、注册登记部、财务管理部、金融科技部、投资风险管理部、内控合规部和审计部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京、石家庄六个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司以及在香港设立建信资产管理（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”。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司旗下有建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)、上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金、建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信恒久价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金 (FOF)、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金 (FOF)、建信睿信三个月定期开放债券型发

起式证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金、建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信短债债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金 (LOF)、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金 (LOF)、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债债券型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信高股息主题股票型证券投资基金、建信科技创新混合型证券投资基金、建信上海金交易型开放式证券投资基金、建信上海金交易型开放式证券投资基金联接基金、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金、建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投

资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信食品饮料行业股票型证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信富时 100 指数型证券投资基金、建信利率债策略纯债债券型证券投资基金共计 131 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 4655.29 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		
许杰	本基金的基金经理	2014年9月10日	2020年7月20日	18年	许杰先生，权益投资部资深基金经理，硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员，2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职，2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理；2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理；2008年9月26日

					至 2011 年 9 月 30 日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011 年 10 月加入我公司，历任权益投资部副总经理、基金经理、资深基金经理 2012 年 3 月 21 日至 2017 年 1 月 24 日任建信恒稳价值混合型证券投资基金的基金经理；2012 年 8 月 14 日至 2019 年 11 月 28 日任建信社会责任混合型证券投资基金的基金经理；2014 年 9 月 10 日至 2020 年 7 月 20 日任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的基金经理；2015 年 2 月 3 日至 2020 年 7 月 20 日任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 5 月 26 日至 2020 年 7 月 20 日任建信新经济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 2020 年 7 月 20 日任建信中小盘先锋股票型证券投资基金的基金经理。
邵卓	权益投资部副总经理，本基金的基金经理	2020 年 7 月 17 日	-	10 年	邵卓先生，权益投资部副总经理，硕士。2006 年 4 月至 2010 年 7 月先后就职于明基（西门子）移动通信研发中心、IBM 中国软件实验室；2010 年 7 月加入广发证券发展研究中心。邵卓于 2011 年 9 月加入我公司，历任研究部研究员、研究主管，权益投资部基金经理、权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官、权益投资部副总经理。2015 年 3 月 24 日起任建信信息产业股票型证券投资基金的基金经理；2015 年 5 月 22 日起任建信创新中国混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 19 日起任建信安心保本三号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于 2018 年 1 月 11 日起转型为建信裕利灵活配置混合型证券投资基金，邵卓继续担任该基金的基金经理；2020 年 4 月 14 日起任建信科技创新混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 7 月 17 日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金的基金经理。
周智硕	本基金的基金经理	2020 年 9 月 18 日	-	10 年	周智硕先生，硕士。2009 年 7 月至 2012 年 8 月在南方基金管理有限公司担任研究员；2012 年 8 月至 2013 年 7 月在中国国际金融有限公司担任研究员；2013 年 8 月至 2016 年 2 月在北京鸿道投资管理有限责任公司担任研究员、投资经理；2016 年 2 月至 2016 年 11 月在注册登记私募担任研

					究员和投资经理 2016 年 11 月至 2017 年 11 月在上海七曜投资管理合伙企业担任投资经理；2017 年 11 月至 2020 年 6 月在工银瑞信基金管理有限公司担任投资经理。2020 年 6 月加入建信基金权益投资部拟任基金经理。2020 年 9 月 18 日起任建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 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 5 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

2020 年股票市场表现较好，全年上证综指上涨 13.86%，沪深 300 上涨 27.21%，创业板指上涨 64.94%。2020 年，受新冠疫情冲击，国内经济波动加剧，对应财政、货币等政策也经历了极度宽松到逐渐边际收紧的过程，因此疫情的发展和逆周期政策的节奏是主导 2020 年 A 股市场的重要变量。分季度来看，一季度受疫情影响，A 股春节后开盘第一天市场大跌，但随着国内流动性持续宽松，逆周期调控政策持续加码，市场开始大幅反弹；但 2 月底开始，疫情开始在海外扩散，全球金融市场波动加剧，持续下跌并多次熔断，VIX 指数一度飙升至 2008 年的最高点，虽然美联储两次紧急降息至 0，但市场流动性危机严重，直至 3 月中下旬，美国再度开启 QE，各国出台大规模财政刺激政策，海外市场的急跌趋势开始放缓并出现反弹；二季度在国内外流动性大幅宽松下，市场走出流动性驱动的拔估值行情，整体风格偏成长，疫情受益的医药和科技成长板块跑赢；三季度市场出现分化，7 月市场在资金的驱动下市场大涨，但随后进入震荡调整，这一阶段国内流动性边际收紧，经济复苏预期加强，市场风格开始发生变化，顺周期板块表现更强势；四季度初期市场仍处于弱势震荡期，11 月开始，随着疫苗出现进展，美国大选落地，全球风险偏好快速提升，12 月政治局会议又确认了货币政策不会系统性收紧的基调，年末市场迎来一波跨年行情，风格较为均衡，休闲服务、电气设备、食品饮料、国防军工及有色等表现较好。

本基金继续认为我国经济正在由高速增长阶段转向高质量发展阶段，经济的增长动能正从要素驱动转向创新驱动，从中国制造转向中国创造，从人口红利转向工程师红利。因此，本基金继续围绕行业中可以成长为中国经济增长新动能的公司这条主线进行投资，重点投资了军工、电力设备及新能源、食品饮料、传媒、机械、电子、化工等行业，投资了一些有独特盈利模式，且未来有持续增长能力的公司。从全年的业绩情况来看，一季度随市场震荡，二季度开始，成长股表现较好，基金业绩出现上涨，全年取得 65.21% 的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 65.21%，波动率 1.77%，业绩比较基准收益率 23.69%，波动率 1.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，预计市场整体盈利水平继续提升，考虑到信贷周期拐点出现，流动性边际偏紧，有可能影响市场的估值。围绕“高质量发展”，选取符合新经济发展方向的龙头公司，将继续是本基金 2021 年最重要的工作。

疫情打乱了本应从 2020 年开启的“库存周期”的节奏，但并没有实质性破坏经济运行的周期

性特点，预计 2021 年经济增长的主要动力将来自消费和制造业投资，而这两者的逐渐恢复也预示着 3 年左右的短周期可能逐步进入中后期。

随着疫苗推出，疫情对中国以及全球经济的影响逐步消退，经济与政策将会回归常态，考虑到国内外复苏节奏差异，流动性将会呈现外松内稳。美国大选后首年，美国政策将聚焦国内经济复苏，中美博弈缓和，海外不确定性有望降低。在这种情况下，金融市场改革、注册制加速推进，中长期增量资金持续入市，我们认为市场投资逻辑从总量转向结构性亮点，结构性牛市有望继续演绎，经营优秀的企业能在中长期仍能获得较好的回报。本基金将继续发掘新经济下主导产业中的龙头企业，跟随优秀企业成长将成为我们获取投资回报的重要手段。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司内控合规部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总裁和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施：

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备定期监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由内控合规部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司年度监察稽核工作计划，

实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发违法违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的原则，秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2017]13号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

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、内控合规部、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。

本公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》，并依据其提供

的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）；对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣，对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，建信基金管理有限责任公司在建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由建信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 61490173_A07 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的财务报告过程。

注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊 贺耀
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2021 年 3 月 22 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	3,922,898.91	3,702,165.97
结算备付金		2,072,529.28	3,977,131.15
存出保证金		48,769.36	80,493.86
交易性金融资产	7.4.7.2	67,849,884.45	63,016,688.34
其中: 股票投资		67,849,884.45	63,016,688.34
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,422,676.33
应收利息	7.4.7.5	1,800.33	2,415.10
应收股利		-	-
应收申购款		24,682.59	33,215.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		73,920,564.92	72,234,786.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		109,770.27	470,937.14
应付赎回款		160,084.58	545,076.02
应付管理人报酬		87,583.74	88,568.64
应付托管费		54,791.43	14,761.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	408,705.10	625,442.91
应交税费		5.96	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	139,183.03	316,315.44
负债合计		960,124.11	2,061,101.56
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	30,188,143.66	47,981,948.76
未分配利润	7.4.7.10	42,772,297.15	22,191,735.85

所有者权益合计		72,960,440.81	70,173,684.61
负债和所有者权益总计		73,920,564.92	72,234,786.17

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.417 元，基金份额总额 30,188,143.66 份。

7.2 利润表

会计主体：建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		36,608,284.71	23,556,913.80
1. 利息收入		90,325.08	142,321.42
其中：存款利息收入	7.4.7.11	89,191.39	142,314.06
债券利息收入		1,133.69	7.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,132,495.89	17,591,563.21
其中：股票投资收益	7.4.7.12	29,615,250.38	16,799,143.07
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	982,826.09	2,104.64
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	534,419.42	790,315.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,325,305.34	5,785,999.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	60,158.40	37,029.51
减：二、费用		2,897,380.77	3,492,562.28
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	987,332.08	1,076,356.90
2. 托管费	7.4.10.2.2	164,555.28	179,392.84
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,575,145.80	1,920,801.76
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		4.12	-
7. 其他费用	7.4.7.20	170,343.49	316,010.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,710,903.94	20,064,351.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,710,903.94	20,064,351.52

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	47,981,948.76	22,191,735.85	70,173,684.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,710,903.94	33,710,903.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-17,793,805.10	-13,130,342.64	-30,924,147.74
其中：1. 基金申购款	12,584,531.14	12,139,127.35	24,723,658.49
2. 基金赎回款	-30,378,336.24	-25,269,469.99	-55,647,806.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	30,188,143.66	42,772,297.15	72,960,440.81
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	56,833,617.96	6,014,561.26	62,848,179.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,064,351.52	20,064,351.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-8,851,669.20	-3,887,176.93	-12,738,846.13
其中：1. 基金申购款	9,852,638.94	3,366,127.91	13,218,766.85
2. 基金赎回款	-18,704,308.14	-7,253,304.84	-25,957,612.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	47,981,948.76	22,191,735.85	70,173,684.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

吴灵玲

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,467,496,662.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 768,218.55 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板股票、创业板股票，以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%，投资于潜力新蓝筹股票的资产不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-20%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为 85%×沪深 300 指数收益率+15%×中债总财富（总值）指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2021 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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 2 号《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累

计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若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,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组

成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩。（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定相关投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
活期存款	3,922,898.91	3,702,165.97
定期存款	-	-
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	-	-
合计	3,922,898.91	3,702,165.97

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	58,436,203.90	67,849,884.45	9,413,680.55
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	58,436,203.90	67,849,884.45	9,413,680.55
项目	上年度末		
	2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	58,928,313.13	63,016,688.34	4,088,375.21

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	58,928,313.13	63,016,688.34	4,088,375.21

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	1,103.00	1,033.68
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	673.13	1,341.60
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	24.20	39.82
合计	1,800.33	2,415.10

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	408,705.10	625,442.91
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	408,705.10	625,442.91

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	183.03	851.58
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	139,000.00	315,463.86
合计	139,183.03	316,315.44

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,981,948.76	47,981,948.76
本期申购	12,584,531.14	12,584,531.14
本期赎回（以“-”号填列）	-30,378,336.24	-30,378,336.24
- 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	30,188,143.66	30,188,143.66

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,671,321.90	-8,479,586.05	22,191,735.85
本期利润	28,385,598.60	5,325,305.34	33,710,903.94
本期基金份额交易产生的变动数	-14,850,076.72	1,719,734.08	-13,130,342.64
其中：基金申购款	13,315,888.09	-1,176,760.74	12,139,127.35
基金赎回款	-28,165,964.81	2,896,494.82	-25,269,469.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,206,843.78	-1,434,546.63	42,772,297.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	35,798.60	29,688.78
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	52,338.08	111,085.43
其他	1,054.71	1,539.85
合计	89,191.39	142,314.06

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	29,615,250.38	16,799,143.07
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	29,615,250.38	16,799,143.07

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	531,370,160.72	640,709,419.83
减：卖出股票成本总额	501,754,910.34	623,910,276.76
买卖股票差价收入	29,615,250.38	16,799,143.07

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	982,826.09	2,104.64
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	982,826.09	2,104.64

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,220,432.91	50,112.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,228,045.43	47,999.79
减：应收利息总额	9,561.39	7.57
买卖债券差价收入	982,826.09	2,104.64

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	534,419.42	790,315.50
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	534,419.42	790,315.50

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	5,325,305.34	5,785,999.66
股票投资	5,325,305.34	5,785,999.66
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	5,325,305.34	5,785,999.66

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	57,610.20	36,339.08
基金转换费收入	2,548.20	690.43
合计	60,158.40	37,029.51

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	1,575,145.80	1,920,801.76
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,575,145.80	1,920,801.76

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00

信息披露费	80,000.00	226,463.86
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	3,143.49	2,346.92
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	170,343.49	316,010.78

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
建信资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	987,332.08	1,076,356.90
其中：支付销售机构的客户维护费	396,287.28	433,306.90

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 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	164,555.28	179,392.84

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	交通银行-活期	3,922,898.91	35,798.60	3,702,165.97

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新发未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新发未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新发未上市	16.95	16.95	494	8,373.30	8,373.30	-

注：上述可流通日取自截至审计报告日的上市公司相关公告。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、由风险管理委员会、督察长、
内控合规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
督察长和内控合规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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等,其余大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,922,898.91	-	-	-	3,922,898.91
结算备付金	2,072,529.28	-	-	-	2,072,529.28
存出保证金	48,769.36	-	-	-	48,769.36
交易性金融资产	-	-	-	67,849,884.45	67,849,884.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,800.33	1,800.33
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	24,682.59	24,682.59
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,044,197.55	-	-	67,876,367.37	73,920,564.92
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	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	109,770.27	109,770.27
应付赎回款	-	-	-	160,084.58	160,084.58
应付管理人报酬	-	-	-	87,583.74	87,583.74
应付托管费	-	-	-	54,791.43	54,791.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	408,705.10	408,705.10
应交税费	-	-	-	5.96	5.96
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	139,183.03	139,183.03
负债总计	-	-	-	960,124.11	960,124.11
利率敏感度缺口	6,044,197.55	-	-	66,916,243.26	72,960,440.81
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,702,165.97	-	-	-	3,702,165.97
结算备付金	3,977,131.15	-	-	-	3,977,131.15
存出保证金	80,493.86	-	-	-	80,493.86
交易性金融资产	-	-	-	63,016,688.34	63,016,688.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,422,676.33	1,422,676.33
应收利息	-	-	-	2,415.10	2,415.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	33,215.42	33,215.42
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,759,790.98	-	-	64,474,995.19	72,234,786.17
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	470,937.14	470,937.14
应付赎回款	-	-	-	545,076.02	545,076.02
应付管理人报酬	-	-	-	88,568.64	88,568.64
应付托管费	-	-	-	14,761.41	14,761.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	625,442.91	625,442.91
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	316,315.44	316,315.44
负债总计	-	-	-	2,061,101.56	2,061,101.56
利率敏感度缺口	7,759,790.98	-	-	62,413,893.63	70,173,684.61

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：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）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%，投资于潜力新蓝筹股票的资产不低于非现金基金资产的 80%；债券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-20%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%

的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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	67,849,884.45	93.00	63,016,688.34	89.80
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	67,849,884.45	93.00	63,016,688.34	89.80

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	4,305,207.23	3,924,600.11
	业绩比较基准下降5%	-4,305,207.23	-3,924,600.11

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 67,828,315.26 元，属于第二层次的余额为人民币 21,569.19 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元（于 2019 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 63,016,688.34 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为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。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

无。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	67,849,884.45	91.79

	其中：股票	67,849,884.45	91.79
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	5,995,428.19	8.11
8	其他各项资产	75,252.28	0.10
9	合计	73,920,564.92	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	1,395,510.00	1.91
B	采矿业	-	-
C	制造业	47,285,992.70	64.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,858.12	0.02
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	4,552,855.67	6.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,095,525.00	5.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,579.46	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,501,563.50	14.39
S	综合	-	-
	合计	67,849,884.45	93.00

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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	300413	芒果超媒	70,719	5,127,127.50	7.03
2	688099	晶晨股份	57,591	4,534,139.43	6.21
3	600519	贵州茅台	2,100	4,195,800.00	5.75
4	601888	中国中免	14,500	4,095,525.00	5.61
5	002304	洋河股份	13,900	3,280,261.00	4.50
6	300751	迈为股份	4,600	3,114,246.00	4.27
7	300860	锋尚文化	23,800	3,110,660.00	4.26
8	688017	绿的谐波	20,320	2,976,880.00	4.08
9	600176	中国巨石	141,000	2,814,360.00	3.86
10	000547	航天发展	87,700	2,411,750.00	3.31
11	600893	航发动力	40,500	2,403,675.00	3.29
12	300750	宁德时代	6,700	2,352,437.00	3.22
13	600760	中航沈飞	29,100	2,275,038.00	3.12
14	601966	玲珑轮胎	62,200	2,187,574.00	3.00
15	601636	旗滨集团	164,600	2,106,880.00	2.89
16	300395	菲利华	34,300	2,052,169.00	2.81
17	002206	海利得	447,878	1,751,202.98	2.40
18	300251	光线传媒	123,000	1,484,610.00	2.03
19	300482	万孚生物	16,500	1,471,965.00	2.02
20	300677	英科医疗	8,600	1,446,090.00	1.98
21	603198	迎驾贡酒	41,200	1,437,880.00	1.97
22	600438	通威股份	37,300	1,433,812.00	1.97
23	300406	九强生物	56,100	1,403,622.00	1.92
24	601058	赛轮轮胎	231,100	1,395,844.00	1.91
25	002714	牧原股份	18,100	1,395,510.00	1.91
26	002026	山东威达	115,100	1,312,140.00	1.80
27	603877	太平鸟	38,385	1,151,550.00	1.58
28	002025	航天电器	12,800	834,304.00	1.14
29	300592	华凯创意	42,300	779,166.00	1.07
30	002984	森麒麟	29,100	738,849.00	1.01
31	300822	贝仕达克	14,500	645,395.00	0.88
32	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.03
33	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.02
34	605186	健麾信息	626	17,609.38	0.02

35	605500	森林包装	762	14,980.92	0.02
36	003020	立方制药	374	12,858.12	0.02
37	003025	思进智能	305	10,763.45	0.01
38	605299	舒华体育	738	9,335.70	0.01
39	605277	新亚电子	494	8,373.30	0.01
40	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01
41	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.01
42	003027	同兴环保	139	5,579.46	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300413	芒果超媒	8,578,058.31	12.22
2	600519	贵州茅台	8,567,557.00	12.21
3	300122	智飞生物	8,297,553.00	11.82
4	000858	五粮液	7,583,991.75	10.81
5	600176	中国巨石	6,579,381.80	9.38
6	300760	迈瑞医疗	6,412,970.84	9.14
7	601636	旗滨集团	6,313,508.00	9.00
8	601628	中国人寿	5,820,074.00	8.29
9	002332	仙琚制药	5,724,736.00	8.16
10	300450	先导智能	5,684,940.00	8.10
11	000967	盈峰环境	5,193,019.00	7.40
12	601966	玲珑轮胎	4,486,309.09	6.39
13	688099	晶晨股份	4,424,695.78	6.31
14	300136	信维通信	4,394,078.00	6.26
15	000100	TCL 科技	4,376,475.00	6.24
16	002938	鹏鼎控股	4,364,204.98	6.22
17	601888	中国中免	4,254,873.00	6.06
18	002405	四维图新	4,232,679.00	6.03
19	002984	森麒麟	4,196,415.00	5.98
20	300395	菲利华	4,165,754.00	5.94
21	002174	游族网络	4,159,194.00	5.93
22	002555	三七互娱	4,129,736.00	5.89
23	600183	生益科技	4,096,842.00	5.84
24	300860	锋尚文化	4,061,334.00	5.79
25	688015	交控科技	4,060,948.62	5.79
26	300274	阳光电源	4,011,944.00	5.72
27	688012	中微公司	4,003,696.87	5.71
28	603916	苏博特	3,957,825.00	5.64
29	000568	泸州老窖	3,895,788.00	5.55

30	603259	药明康德	3,833,289.40	5.46
31	300750	宁德时代	3,790,925.00	5.40
32	300034	钢研高纳	3,760,352.00	5.36
33	601336	新华保险	3,743,490.00	5.33
34	600720	祁连山	3,703,753.00	5.28
35	000725	京东方 A	3,668,708.00	5.23
36	688008	澜起科技	3,652,885.13	5.21
37	002025	航天电器	3,493,027.00	4.98
38	000547	航天发展	3,491,305.00	4.98
39	300751	迈为股份	3,446,402.00	4.91
40	603596	伯特利	3,338,745.83	4.76
41	603881	数据港	3,250,861.50	4.63
42	300598	诚迈科技	3,178,785.00	4.53
43	002425	凯撒文化	3,172,373.00	4.52
44	688017	绿的谐波	3,170,851.19	4.52
45	600690	海尔智家	3,098,675.03	4.42
46	601668	中国建筑	3,094,683.00	4.41
47	300496	中科创达	3,092,318.10	4.41
48	002007	华兰生物	3,046,453.70	4.34
49	601211	国泰君安	2,935,241.00	4.18
50	300171	东富龙	2,883,844.90	4.11
51	600118	中国卫星	2,850,158.00	4.06
52	600600	青岛啤酒	2,849,598.00	4.06
53	603877	太平鸟	2,838,578.00	4.05
54	300740	御家汇	2,824,736.00	4.03
55	600406	国电南瑞	2,817,537.00	4.02
56	000333	美的集团	2,782,820.00	3.97
57	000401	冀东水泥	2,763,925.00	3.94
58	002129	中环股份	2,758,639.02	3.93
59	601058	赛轮轮胎	2,719,127.00	3.87
60	600760	中航沈飞	2,708,951.00	3.86
61	002304	洋河股份	2,701,565.00	3.85
62	002409	雅克科技	2,625,159.15	3.74
63	300592	华凯创意	2,622,546.00	3.74
64	002373	千方科技	2,622,247.00	3.74
65	000513	丽珠集团	2,585,788.00	3.68
66	002050	三花智控	2,577,312.50	3.67
67	002273	水晶光电	2,571,844.18	3.66
68	002158	汉钟精机	2,556,133.00	3.64
69	688608	恒玄科技	2,554,357.20	3.64
70	300682	朗新科技	2,525,666.00	3.60
71	002044	美年健康	2,481,199.00	3.54

72	600373	中文传媒	2,473,774.48	3.53
73	300316	晶盛机电	2,472,270.45	3.52
74	002993	奥海科技	2,443,106.60	3.48
75	600779	水井坊	2,426,119.00	3.46
76	300729	乐歌股份	2,387,434.00	3.40
77	002414	高德红外	2,361,546.90	3.37
78	300822	贝仕达克	2,360,708.00	3.36
79	601601	中国太保	2,322,405.00	3.31
80	603787	新日股份	2,303,796.00	3.28
81	000625	长安汽车	2,175,462.00	3.10
82	600547	山东黄金	2,167,784.00	3.09
83	000423	东阿阿胶	2,142,982.00	3.05
84	300482	万孚生物	2,105,857.00	3.00
85	600584	长电科技	2,080,330.00	2.96
86	603136	天目湖	2,074,403.70	2.96
87	002206	海利得	2,067,804.80	2.95
88	002389	航天彩虹	2,039,005.00	2.91
89	600893	航发动力	2,036,095.00	2.90
90	300166	东方国信	2,030,996.00	2.89
91	300383	光环新网	2,030,139.00	2.89
92	600438	通威股份	2,022,792.00	2.88
93	300724	捷佳伟创	2,012,226.00	2.87
94	688408	中信博	2,008,239.02	2.86
95	002271	东方雨虹	1,998,102.00	2.85
96	688111	金山办公	1,990,980.63	2.84
97	002371	北方华创	1,951,468.67	2.78
98	002866	传艺科技	1,892,892.00	2.70
99	601318	中国平安	1,885,483.00	2.69
100	600487	亨通光电	1,882,331.00	2.68
101	000672	上峰水泥	1,876,344.00	2.67
102	002727	一心堂	1,873,744.00	2.67
103	600641	万业企业	1,866,746.00	2.66
104	300451	创业慧康	1,824,963.00	2.60
105	300655	晶瑞股份	1,795,444.00	2.56
106	600984	建设机械	1,738,624.00	2.48
107	002127	南极电商	1,715,735.00	2.44
108	300315	掌趣科技	1,694,847.00	2.42
109	600887	伊利股份	1,663,679.00	2.37
110	688019	安集科技	1,661,393.90	2.37
111	000661	长春高新	1,652,447.00	2.35
112	300408	三环集团	1,646,487.00	2.35
113	002460	赣锋锂业	1,644,233.00	2.34

114	002381	双箭股份	1,630,100.00	2.32
115	601899	紫金矿业	1,588,927.00	2.26
116	600998	九州通	1,588,083.28	2.26
117	600988	赤峰黄金	1,578,134.00	2.25
118	603589	口子窖	1,572,136.00	2.24
119	002317	众生药业	1,565,662.63	2.23
120	600522	中天科技	1,544,781.00	2.20
121	600536	中国软件	1,539,428.00	2.19
122	300009	安科生物	1,529,223.53	2.18
123	000975	银泰黄金	1,514,358.00	2.16
124	688268	华特气体	1,501,292.60	2.14
125	300406	九强生物	1,420,792.00	2.02
126	300082	奥克股份	1,419,368.00	2.02
127	002189	中光学	1,412,692.00	2.01
128	300677	英科医疗	1,411,831.00	2.01

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。

8.4.2 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	300122	智飞生物	10,857,559.48	15.47
2	000858	五粮液	9,965,720.59	14.20
3	600176	中国巨石	7,060,344.96	10.06
4	300760	迈瑞医疗	6,650,821.00	9.48
5	600183	生益科技	6,421,137.00	9.15
6	603916	苏博特	6,087,598.18	8.68
7	000967	盈峰环境	6,064,026.00	8.64
8	000568	泸州老窖	5,949,965.30	8.48
9	601628	中国人寿	5,839,004.20	8.32
10	000725	京东方 A	5,655,520.00	8.06
11	002332	仙琚制药	5,646,510.00	8.05
12	300450	先导智能	5,615,013.01	8.00
13	600519	贵州茅台	5,500,132.04	7.84
14	300316	晶盛机电	5,316,816.80	7.58
15	300136	信维通信	5,099,163.00	7.27
16	601636	旗滨集团	5,092,345.43	7.26
17	000100	TCL 科技	5,004,266.00	7.13
18	300274	阳光电源	4,969,429.00	7.08
19	002938	鹏鼎控股	4,794,589.00	6.83
20	002127	南极电商	4,757,401.37	6.78

21	601601	中国太保	4,683,651.00	6.67
22	002050	三花智控	4,680,218.00	6.67
23	600887	伊利股份	4,450,998.00	6.34
24	688015	交控科技	4,345,975.73	6.19
25	002405	四维图新	4,252,326.00	6.06
26	601899	紫金矿业	4,220,297.00	6.01
27	002555	三七互娱	4,134,654.05	5.89
28	603881	数据港	4,122,927.35	5.88
29	688008	澜起科技	4,111,207.44	5.86
30	300413	芒果超媒	4,038,311.92	5.75
31	601966	玲珑轮胎	4,036,299.86	5.75
32	688012	中微公司	4,036,005.79	5.75
33	002025	航天电器	3,938,248.00	5.61
34	603596	伯特利	3,876,129.50	5.52
35	603259	药明康德	3,855,130.50	5.49
36	600720	祁连山	3,809,247.00	5.43
37	601668	中国建筑	3,783,856.00	5.39
38	688017	绿的谐波	3,782,600.58	5.39
39	600584	长电科技	3,566,578.00	5.08
40	601336	新华保险	3,563,971.00	5.08
41	002624	完美世界	3,552,014.30	5.06
42	002271	东方雨虹	3,508,540.00	5.00
43	300034	钢研高纳	3,492,371.00	4.98
44	601211	国泰君安	3,401,888.00	4.85
45	002984	森麒麟	3,322,227.90	4.73
46	300750	宁德时代	3,313,161.79	4.72
47	002425	凯撒文化	3,292,013.00	4.69
48	300598	诚迈科技	3,290,912.00	4.69
49	300171	东富龙	3,280,427.70	4.67
50	002007	华兰生物	3,213,466.98	4.58
51	002174	游族网络	3,156,196.00	4.50
52	300496	中科创达	3,115,806.00	4.44
53	000002	万科A	3,088,915.00	4.40
54	300395	菲利华	3,080,069.00	4.39
55	002146	荣盛发展	3,068,970.00	4.37
56	603877	太平鸟	3,051,924.00	4.35
57	601688	华泰证券	3,026,700.00	4.31
58	601888	中国中免	2,992,084.00	4.26
59	000513	丽珠集团	2,962,787.00	4.22
60	600600	青岛啤酒	2,913,977.00	4.15
61	600690	海尔智家	2,882,743.54	4.11
62	688111	金山办公	2,746,832.18	3.91

63	600406	国电南瑞	2,737,158.00	3.90
64	002409	雅克科技	2,732,766.00	3.89
65	002044	美年健康	2,682,839.00	3.82
66	002129	中环股份	2,649,419.96	3.78
67	300596	利安隆	2,644,373.00	3.77
68	002373	千方科技	2,643,683.25	3.77
69	000333	美的集团	2,642,392.00	3.77
70	600118	中国卫星	2,642,219.00	3.77
71	600988	赤峰黄金	2,625,390.00	3.74
72	600779	水井坊	2,596,222.00	3.70
73	002158	汉钟精机	2,586,016.00	3.69
74	688408	中信博	2,582,817.55	3.68
75	000401	冀东水泥	2,566,676.00	3.66
76	002273	水晶光电	2,528,880.00	3.60
77	300729	乐歌股份	2,503,535.40	3.57
78	688608	恒玄科技	2,370,754.22	3.38
79	300383	光环新网	2,344,532.33	3.34
80	000625	长安汽车	2,342,152.00	3.34
81	002993	奥海科技	2,337,910.20	3.33
82	300682	朗新科技	2,327,017.06	3.32
83	002389	航天彩虹	2,325,442.00	3.31
84	300315	掌趣科技	2,283,035.80	3.25
85	603136	天目湖	2,232,357.95	3.18
86	002371	北方华创	2,231,526.00	3.18
87	000423	东阿阿胶	2,224,958.91	3.17
88	300166	东方国信	2,182,893.00	3.11
89	002414	高德红外	2,175,710.00	3.10
90	601166	兴业银行	2,166,228.00	3.09
91	603613	国联股份	2,145,914.91	3.06
92	603787	新日股份	2,143,111.00	3.05
93	300740	御家汇	2,130,425.00	3.04
94	600373	中文传媒	2,109,569.00	3.01
95	600547	山东黄金	2,106,585.00	3.00
96	603063	禾望电气	2,093,474.00	2.98
97	000661	长春高新	2,071,415.00	2.95
98	000961	中南建设	2,054,136.46	2.93
99	000672	上峰水泥	1,936,755.00	2.76
100	300724	捷佳伟创	1,934,959.00	2.76
101	300451	创业慧康	1,910,535.00	2.72
102	300751	迈为股份	1,909,306.00	2.72
103	603806	福斯特	1,892,845.00	2.70
104	002078	太阳纸业	1,876,652.00	2.67

105	601318	中国平安	1,844,914.00	2.63
106	300655	晶瑞股份	1,812,661.00	2.58
107	300408	三环集团	1,806,443.00	2.57
108	600487	亨通光电	1,773,027.08	2.53
109	600641	万业企业	1,744,405.00	2.49
110	002475	立讯精密	1,734,131.13	2.47
111	002727	一心堂	1,733,273.00	2.47
112	002866	传艺科技	1,718,776.00	2.45
113	000338	潍柴动力	1,694,028.00	2.41
114	603589	口子窖	1,675,394.00	2.39
115	600984	建设机械	1,637,658.00	2.33
116	002317	众生药业	1,634,986.06	2.33
117	300082	奥克股份	1,625,501.00	2.32
118	002460	赣锋锂业	1,612,000.00	2.30
119	002381	双箭股份	1,610,311.00	2.29
120	688019	安集科技	1,609,804.04	2.29
121	600029	南方航空	1,594,291.00	2.27
122	600536	中国软件	1,581,225.00	2.25
123	300009	安科生物	1,579,923.00	2.25
124	600998	九州通	1,542,556.00	2.20
125	000975	银泰黄金	1,524,451.00	2.17
126	300433	蓝思科技	1,518,191.00	2.16
127	600522	中天科技	1,499,990.00	2.14
128	002643	万润股份	1,491,826.40	2.13
129	688301	奕瑞科技	1,481,329.46	2.11
130	600031	三一重工	1,472,337.00	2.10
131	601138	工业富联	1,464,532.00	2.09
132	002867	周大生	1,458,299.69	2.08
133	600426	华鲁恒升	1,417,281.00	2.02

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。

8.4.3 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	501,262,801.11
卖出股票收入（成交）总额	531,370,160.72

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

8.12.3 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	48,769.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,800.33
5	应收申购款	24,682.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,252.28

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)

3,357	8,992.60	677,107.20	2.24	29,511,036.46	97.76
-------	----------	------------	------	---------------	-------

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	36,322.61	0.12

9.3 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

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年9月10日） 基金份额总额	1,467,496,662.54
本报告期期初基金份额总额	47,981,948.76
本报告期基金总申购份额	12,584,531.14
减：本报告期基金总赎回份额	30,378,336.24
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	30,188,143.66

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 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），本年度审计费用为人民币 50000 元。该会计师事务所自 2019 年起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
华创证券	1	340,608,024.99	33.02%	317,209.56	33.31%	-
招商证券	2	268,106,517.36	25.99%	247,494.18	25.99%	-
中泰证券	3	181,812,873.65	17.63%	166,195.66	17.45%	-
光大证券	1	85,560,149.82	8.29%	77,971.94	8.19%	-
东吴证券	1	85,062,606.26	8.25%	79,218.84	8.32%	-
安信证券	2	28,223,623.29	2.74%	25,719.90	2.70%	-
中信证券	2	17,651,779.61	1.71%	16,086.33	1.69%	-
长江证券	2	17,285,268.23	1.68%	15,752.33	1.65%	-
华泰证券	5	7,222,298.20	0.70%	6,581.27	0.69%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-

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，剔除中银国际 1 个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

11.7.2 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
华创证券	46,882.71	0.24%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	16,561,823.80	85.12%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	1,389,419.40	7.14%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,419,545.80	7.30%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	39,200.00	0.20%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	建信基金管理有限责任公司关于增加喜鹊财富基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-12-18
2	关于增加玄元保险代理有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-11-04
3	关于建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金经理变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-09-22
4	关于增加民商基金销售（上海）有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-09-18
5	建信基金管理有限责任公司关于新增中国人寿为公司旗下部分开放式基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-08-22
6	建信基金管理有限责任公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-07-29
7	关于建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金经理变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-07-22
8	建信基金管理有限责任公司关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-10
9	建信基金管理有限责任公司关于增加大连网金基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-30
10	建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加渤海银行基金申购、定投费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-26
11	建信基金管理有限责任公司关于增加华瑞保险销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-08

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

13.3 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

2021 年 3 月 30 日