

建信灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 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。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 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	5
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	6
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66

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	66
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	66
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	66
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§ 8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
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	68
§ 9 开放式基金份额变动	68
§ 10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
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	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	建信灵活配置混合
基金主代码	000270
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 11 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	205,562,820.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金自上而下积极、动态地配置大类资产，同时通过合理的证券选择，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整大类资产配置比例，同时将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，运用自上而下和自下而上相结合的个股、个券投资策略，在大类资产配置和证券选择两个层面上实现投资组合的双重优化。
业绩比较基准	55%×沪深 300 指数+45%×中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533 010-66228000	95568
传真	010-66228001	010-57093382
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	北京市西城区复兴门内大街 2 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	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	100033	100031
法定代表人	孙志晨	高迎欣

注：1、2022 年 5 月 13 日，建信基金管理有限责任公司发布公告，孙志晨先生于 2022 年 5 月 11 日离任，暂由总裁张军红先生代为履行董事长职务。

2、建信基金管理有限责任公司法定代表人已于 2022 年 7 月 27 日变更为刘军先生。

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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-29,923,191.05
本期利润	-21,241,380.92
加权平均基金份额本期利润	-0.0990
本期加权平均净值利润率	-9.90%
本期基金份额净值增长率	-6.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	78,384,018.09
期末可供分配基金份额利润	0.3813
期末基金资产净值	214,906,917.74
期末基金份额净值	1.0455
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-1.27%

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

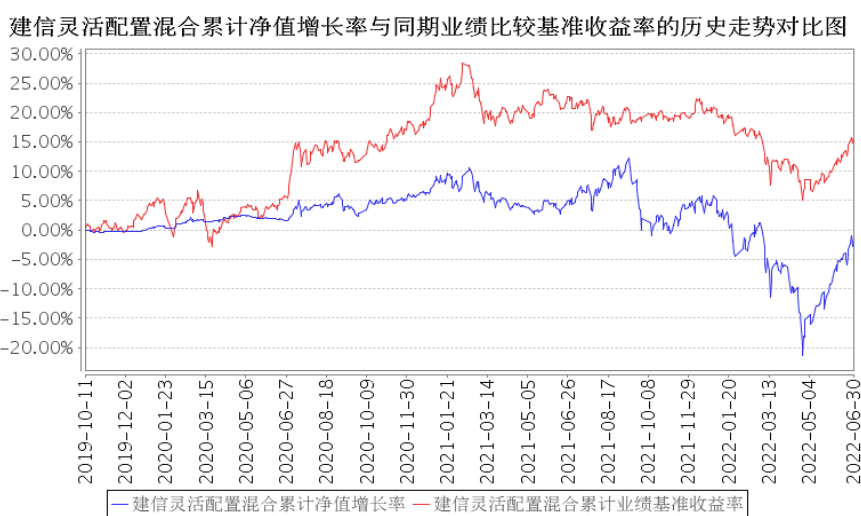
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去一个月	8.85%	1.06%	5.19%	0.59%	3.66%	0.47%
过去三个月	5.36%	1.64%	3.96%	0.78%	1.40%	0.86%
过去六个月	-6.75%	1.54%	-4.23%	0.80%	-2.52%	0.74%
过去一年	-5.82%	1.26%	-5.51%	0.69%	-0.31%	0.57%
自基金合同生效起至今	-1.27%	0.82%	15.72%	0.71%	-16.99%	0.11%

注：本基金业绩比较基准： $55\% \times$ 沪深 300 指数 $+45\% \times$ 中国债券总指数。 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。中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于 2001 年 12 月 31 日推出的债券指数。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。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。

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



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，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、国际投资与业务发展部、资产配置及量化投资部、基础设施投资部、交易部、研究部、创新发展部、银行业务部、品牌推广部（二级部）、机构业务部、网络金融业务部、证券公司业务部、投资顾问与客户服务部、办公室、人力资源部、计划财务部、基金会计部、注册登记部、金融科技部、投资风险管理部、风险与合规管理部和审计部，以及北京、上海、广州、成都、深圳五家分公司，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 2022 年 6 月 30 日，公司旗下有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、建信利率债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、建信货币市场基金、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、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信龙祥稳进 6 个月持有期混合型基金中基金(FOF)、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、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒瑞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、建信彭博政策性银行债券 1-5 年指数证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数证券投资基金(LOF)、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、建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人(MOM)证券投资基金、建信智能生活混合型证券投资基金、建信中关村产业园封闭式基础设施证券投资基金、建信沃信一年持有期混合型证券投资基金、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、建信荣瑞一年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、建信智能汽车股票型证券投资基金、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、建信中债 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、建信臻选混合型

证券投资基金、建信汇益一年持有期混合型证券投资基金、建信卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、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、建信裕丰利率债三个月定期开放债券型证券投资基金、建信普泽养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、建信鑫怡 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、建信优享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、建信创新驱动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、建信兴润一年持有期混合型证券投资基金、建信中证创新药产业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发起式联接基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信国证新能源车电池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、建信中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金、建信中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、建信中证饮料主题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、建信利率债策略纯债债券型证券投资基金、建信泓利一年持有期债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信鑫悦 90 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、建信食品饮料行业股票型证券投资基金、建信港股通精选混合型证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金、建信中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、建信中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、建信高端装备股票型证券投资基金、建信纳斯达克 100 指数型证券投资基金 (QDII)、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(QDII)、建信医疗健康行业股票型证券投资基金、建信鑫享短债债券型证券投资基金、建信普泽养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、建信鑫恒 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、建信兴衡优选一年持有期混合型证券投资基金共计 154 只证券投资基金, 管理的基金净资产规模共计为 7150.00 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		
牛兴华	本基金的基金经理	2019年10月11日	-	11年	牛兴华先生，硕士，2008年毕业于英国卡迪夫大学国际经济、银行与金融学专业，同年进入神州数码中国有限公司，任投资专员；2010年9月，加入中诚信国际信用评级有限责任公司，担任高级分析师；2013年4月加入本公司，历任债券研究员、基金经理。2014年12月2日至2017年6月30日任建信稳定得利债券型证券投资基金的基金经理；2015年4月17日至2020年8月6日任建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015年5月13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；2015年5月14日起任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015年6月16日至2018年1月23日任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015年7月2日至2015年11月25日任建信鑫裕回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015年10月29日至2017年7月12日任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理；2016年2月22日至2018年1月23日任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理；2016年10月25日至2017年12月6日任建信瑞盛添利混合型证券投资基金的基金经理；2016年12月2日至2018年4月2日任建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016年12月23日至2017年12月29日任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017年3月1日起任建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年4月20日起任建信安心保本混合型证券投资基金的基金经理，该基

					金在 2019 年 10 月 11 日转型为建信灵活配置混合型证券投资基金，牛兴华继续担任该基金的基金经理；2019 年 3 月 26 日起任建信润利增强债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 8 月 6 日至 2020 年 12 月 15 日任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 8 月 6 日至 2021 年 3 月 9 日任建信稳定添利债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 10 日起任建信兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2021 年 1 月 25 日起任建信转债增强债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 30 日起任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理。
叶乐天	金融工程及指数投资部副总经理，本基金的基金经理	2021 年 9 月 15 日	-	14 年	叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理，博士。2008 年 5 月至 2011 年 9 月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。2011 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理。2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理，该基金自 2021 年 1 月 1 日起转型为建信央视财经 50 指数证券投资基金（LOF），叶乐天继续担任该基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 4 月 18 日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 22 日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 1 月 10 日起任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 8 月 24 日起任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日起任建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日起任建信 MSCI 中国 A 股

					指数增强型证券投资基金的基金经理, 2021 年 9 月 15 日起任建信灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
吕鑫	本基金的基金经理	2021 年 9 月 15 日	-	5 年	吕鑫先生, 硕士。2016 年 7 月毕业于北京大学信息科学技术学院通信与信息系统专业, 同年 7 月加入建信基金金融工程及指数投资部, 历任研究员、基金经理助理、基金经理等职务。2021 年 8 月 11 日起任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、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理; 2021 年 9 月 15 日起任建信灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2021 年 10 月 29 日起任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《建信灵活配置混合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

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期间，本基金保持高权益仓位运作，在股票组合的配置上以基本面量化分析为基础，利用量化模型精选股票。在宏观环境充满不确定性的情况下，本基金积极改进投资框架以适应市场的最新情况，尽量减小收益的回撤。此基础上，本基金也积极参与新股申购，尽可能地增厚收益。

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-6.75%，波动率 1.54%，业绩比较基准收益率-4.23%，波动率 0.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，市场大幅波动，呈明显的 V 型走势，截至报告期末，尚未完全收复失地。一季度受疫情、俄乌战争、通胀等多因素影响，资金拥挤度较高的成长股大幅下跌，周期板块表现出相对优势。进入二季度，前期影响市场的风险因素有所缓解，在稳增长政策的刺激下，成长板块迎来大幅反弹，在挂钩中证 1000 指数的衍生品上市的助推下，小盘成长成为市场上涨的主线。展望下半年，高景气度赛道的景气度有望持续，伴随着相对宽松货币政策的支持，小盘成长板块依旧会成为关注的热点。伴随着国内疫情的缓解，消费板块也有望迎来支撑。但受多变的国际形势以及海外货币政策的变化影响，权益市场波动可能会加剧，做好收益与风险的平衡在下半年更加重要。管理人会尽可能的复合多策略选股组合，降低组合波动，力争实现更优的收益风险比。

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、基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理

部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,162,184.59	8,943,823.85
结算备付金		561,095.36	903,499.75
存出保证金		52,364.95	117,121.18
交易性金融资产	6.4.7.2	204,074,712.29	249,812,320.56
其中：股票投资		202,026,132.56	243,551,323.80
基金投资		-	-
债券投资		2,048,579.73	6,260,996.76
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		1,801,246.16	69,803.73
应收股利		-	-
应收申购款		95,802.15	140.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	63,778.76
资产总计		217,747,405.50	259,910,488.55
负债和净资产			
	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		1,641,111.68	-
应付赎回款		47,646.09	10.29
应付管理人报酬		166,077.66	217,677.37
应付托管费		41,519.41	54,419.34
应付销售服务费		-	-
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	944,132.92	582,545.15
负债合计		2,840,487.76	854,652.15
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	134,481,813.33	151,161,579.53
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	80,425,104.41	107,894,256.87
净资产合计		214,906,917.74	259,055,836.40
负债和净资产总计		217,747,405.50	259,910,488.55

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0455 元，基金份额总额 205,562,820.12 份。

（2）以下比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：建信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-19,807,358.23	-291,540.01
1. 利息收入		44,018.56	606,608.39
其中：存款利息收入	6.4.7.13	44,018.56	19,066.44
债券利息收入		-	586,498.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,043.01
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-28,796,884.75	622,216.83
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-30,842,306.98	454,749.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	24,990.73	1,993.46
资产支持证券投资收	6.4.7.16	-	-

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	2,020,431.50	165,473.89
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	8,681,810.13	-1,525,287.92
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	263,697.83	4,922.69
减：二、营业总支出		1,434,022.69	703,528.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,064,121.13	392,036.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	266,030.29	65,339.42
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	12,162.83
其中：卖出回购金融资产支出		-	12,162.83
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.95	1,699.76
8. 其他费用	6.4.7.23	103,870.32	232,290.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-21,241,380.92	-995,068.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-21,241,380.92	-995,068.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-21,241,380.92	-995,068.63

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：建信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	151,161,579.53	-	107,894,256.87	259,055,836.40
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	151,161,579.53	-	107,894,256.87	259,055,836.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-16,679,766.20	-	-27,469,152.46	-44,148,918.66
(一)、综合收益总额	-	-	-21,241,380.92	-21,241,380.92
(二)、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)	-16,679,766.20	-	-6,227,771.54	-22,907,537.74
其中:1. 基金申购款	32,176,218.23	-	16,407,140.57	48,583,358.80
2. 基金赎回款	-48,855,984.43	-	-22,634,912.11	-71,490,896.54
(三)、本期向基金份额	-	-	-	-

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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	134,481,813.33	-	80,425,104.41	214,906,917.74
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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(基金净值)	34,048,060.66	-	24,913,467.01	58,961,527.67
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	34,048,060.66	-	24,913,467.01	58,961,527.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,166,564.63	-	-4,788,750.47	-9,955,315.10
(一)、综合收益总额	-	-	-995,068.63	-995,068.63

(二)、 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)	-5,166,564.63	-	-3,793,681.84	-8,960,246.47
其中:1. 基金申购款	449,013.09	-	326,332.35	775,345.44
2. 基金赎回款	-5,615,577.72	-	-4,120,014.19	-9,735,591.91
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	28,881,496.03	-	20,124,716.54	49,006,212.57

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

基金管理人负责人

吴曙明

主管会计工作负责人

丁颖

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）是由原建信安心保本混合型证券投资基金转型而来。根据原建信安心保本混合型证券投资基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司发布的《建信安心保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为建信灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》，基金合同生效日为 2019 年 10 月 11 日。原建信安心保本混合型证券投资基金转型为非避险策略基金，基金名称相应变更为“建信灵活配置混合型证券投资基金”，建信安心保本混合型证券投资基金份额转换为建信灵活配置混合型证券投资基金份额。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2019 年 10 月 11 日起《建信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《建信灵活配置混合型证券投资基金托管协议》生效，原《建信安心保本混合型证券投资基金基金合同》、《建信安心保本混合型证券投资基金托管协议》自同一起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为建信基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信灵活配置混合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、创业板、存托凭证，以及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、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。基金的投资组合比例为：本基金股票等权益类资产的投资占基金资产的比例为 0%-95%，其中，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准：55%×沪深 300 指数+45%×中国债券总指数。

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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准

备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，

适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 8,943,823.85 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,078.11 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 8,945,901.96 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 903,499.75 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 447.15 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 903,946.90 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 117,121.18 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 57.97 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 117,179.15 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 63,778.76 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 2,078.11 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 447.15 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 57.97 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 61,195.53 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 249,812,320.56 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 61,195.53 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 249,873,516.09 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简

称“资管产品运营业务”), 暂适用简易计税方法, 按照 3%的征收率缴纳增值税, 资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定, 自 2018 年 1 月 1 日起, 资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务, 按照以下规定确定销售额: 提供贷款服务, 以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额; 转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货, 可以选择按照实际买入价计算销售额, 或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票, 为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额;

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加, 以实际缴纳的增值税税额为计税依据, 分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定, 自 2008 年 10 月 9 日起, 对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定, 自 2013 年 1 月 1 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50%计入应纳税所得额;

持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	11,162,184.59
等于：本金	11,159,872.86
加：应计利息	2,311.73
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	11,162,184.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	190,730,720.50	-	202,026,132.56	11,295,412.06	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,005,600.00	46,579.73	2,048,579.73	-3,600.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,005,600.00	46,579.73	2,048,579.73	-3,600.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	192,736,320.50	46,579.73	204,074,712.29	11,291,812.06

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 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	63.23
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	793,973.25
其中：交易所市场	793,973.25
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	150,096.44
合计	944,132.92

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	231,058,003.34	151,161,579.53
本期申购	49,183,332.20	32,176,218.23
本期赎回（以“-”号填列）	-74,678,515.42	-48,855,984.43
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	205,562,820.12	134,481,813.33

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	120,902,709.83	-13,008,452.96	107,894,256.87
本期利润	-29,923,191.05	8,681,810.13	-21,241,380.92
本期基金份额交易产生的变动数	-12,595,500.69	6,367,729.15	-6,227,771.54
其中：基金申购款	21,135,397.34	-4,728,256.77	16,407,140.57
基金赎回款	-33,730,898.03	11,095,985.92	-22,634,912.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,384,018.09	2,041,086.32	80,425,104.41

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	37,962.26
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	4,743.86
其他	1,312.44
合计	44,018.56

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-30,842,306.98
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	-30,842,306.98

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	414,211,337.39

减：卖出股票成本总额	443,857,907.43
减：交易费用	1,195,736.94
买卖股票差价收入	-30,842,306.98

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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	55,355.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-30,364.76
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	24,990.73

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,807,665.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,768,242.12
减：应计利息总额	69,782.56
减：交易费用	5.28
买卖债券差价收入	-30,364.76

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,020,431.50
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	2,020,431.50

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	8,681,810.13
股票投资	8,683,610.13
债券投资	-1,800.00
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	8,681,810.13

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	263,662.99
基金转换费收入	34.84
合计	263,697.83

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,117.76
银行间账户维护费	17,850.00
其他	600.00
合计	103,870.32

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
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,064,121.13	392,036.53
其中：支付销售机构的客户维护费	87,193.90	158,691.05

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	266,030.29	65,339.42

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行-活期	11,162,184.59	37,962.26	3,564,933.69	17,277.39

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2022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
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新发未上市	55.57	30.03	149	8,279.93	4,474.47	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	新发未上市	52.37	47.83	199	10,421.63	9,518.17	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新发未上市	32.68	32.02	251	8,202.50	8,037.02	-
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新发未上市	23.18	16.14	506	11,730.97	8,166.84	-
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新发未上市	27.53	45.04	279	7,680.87	12,566.16	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新发未上市	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新发未上市	13.73	15.49	922	12,659.06	14,281.78	-
301125	腾亚精工	2022年5月27日	6个月	新发未上市	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新发未上市	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新发未上市	31.98	26.26	266	8,506.68	6,985.16	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新发未上市	15.37	15.99	575	8,837.75	9,194.25	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	38.46	38.46	2,542	97,765.32	97,765.32	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新发未上市	38.46	38.46	283	10,884.18	10,884.18	-
301148	嘉戎	2022年	6个月	新发未	38.39	23.90	284	10,902.76	6,787.60	-

	技术	4月14日		上市							
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新发未上市	108.47	82.76	95	10,304.28	7,862.20		-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新发未上市	30.82	21.46	281	8,660.42	6,030.26		-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新发未上市	33.68	43.98	199	6,702.32	8,752.02		-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新发未上市	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41		-
301175	中科环保	2022年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	3.82	3.82	21,066	80,472.12	80,472.12		-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新发未上市	3.82	3.82	2,341	8,942.62	8,942.62		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新发未上市	40.25	30.59	202	8,130.50	6,179.18		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新发未上市	64.08	37.52	92	5,895.36	3,451.84		-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新发未上市	76.56	51.92	155	11,866.80	8,047.60		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新发未上市	56.88	56.42	155	8,816.40	8,745.10		-
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新发未上市	29.67	33.28	296	8,782.32	9,850.88		-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新发未上市	3.80	6.39	2,877	10,932.60	18,384.03		-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新发未上市	35.68	29.84	257	9,169.76	7,668.88		-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新发未上市	96.36	87.82	65	6,263.28	5,708.30		-

301220	亚香股份	2022年 6月15日	6个月	新发未上市	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022年 3月2日	6个月	新发未上市	33.98	28.96	254	8,630.92	7,355.84	-
301228	实朴检测	2022年 1月21日	6个月	新发未上市	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301233	盛帮股份	2022年 6月24日	1个月内(含)	新发未上市	41.52	41.52	1,382	57,380.64	57,380.64	-
301233	盛帮股份	2022年 6月24日	6个月	新发未上市	41.52	41.52	154	6,394.08	6,394.08	-
301236	软通动力	2022年 3月8日	6个月	新发未上市	48.59	31.38	291	14,138.72	9,131.58	-
301237	和顺科技	2022年 3月16日	6个月	新发未上市	56.69	41.86	153	8,673.57	6,404.58	-
301238	瑞泰新材	2022年 6月10日	6个月	新发未上市	19.18	32.07	565	10,836.70	18,119.55	-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	1个月内(含)	新发未上市	33.65	33.65	2,025	68,141.25	68,141.25	-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	6个月	新发未上市	33.65	33.65	226	7,604.90	7,604.90	-
301248	杰创智能	2022年 4月13日	6个月	新发未上市	39.07	29.87	266	10,392.62	7,945.42	-
301256	华融化学	2022年 3月14日	6个月	新发未上市	8.05	10.08	1,119	9,007.95	11,279.52	-
301258	富士莱	2022年 3月21日	6个月	新发未上市	48.30	41.68	155	7,486.50	6,460.40	-
301259	艾布鲁	2022年 4月18日	6个月	新发未上市	18.39	24.94	478	8,790.42	11,921.32	-
301263	泰恩康	2022年 3月22日	6个月	新发未上市	19.93	31.38	405	8,071.65	12,708.90	-

		日								
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新发未上市	26.86	47.07	339	9,105.54	15,956.73	-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新发未上市	28.50	34.87	270	7,695.00	9,414.90	-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新发未上市	31.20	22.81	241	7,519.20	5,497.21	-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新发未上市	16.91	19.79	525	8,877.75	10,389.75	-
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新发未上市	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	新发未上市	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新发未上市	52.03	56.42	175	9,105.25	9,873.50	-
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	新发未上市	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688173	希荻微	2022年1月13日	6个月	新发未上市	33.57	31.62	1,919	64,420.83	60,678.78	-
688237	超卓航科	2022年6月24日	1个月内(含)	新发未上市	41.27	41.27	2,001	82,581.27	82,581.27	-
688337	普源精电	2022年3月30日	6个月	新发未上市	60.88	51.03	1,969	119,872.72	100,478.07	-
688348	昱能科技	2022年5月31日	6个月	新发未上市	163.00	416.57	940	153,220.00	391,575.80	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新发未上市	21.93	21.93	3,616	79,298.88	79,298.88	-

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	245,996.76
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	245,996.76

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,162,184.59	-	-	-	11,162,184.59

结算备付金	561,095.36	-	-	-	561,095.36
存出保证金	52,364.95	-	-	-	52,364.95
交易性金融资产	2,048,579.73	-	-	-202,026,132.56	204,074,712.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	95,802.15	95,802.15
其他资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,801,246.16	1,801,246.16
资产总计	13,824,224.63	-	-	-203,923,180.87	217,747,405.50
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	-	-	-	1,641,111.68	1,641,111.68
应付赎回款	-	-	-	47,646.09	47,646.09
应付管理人报酬	-	-	-	166,077.66	166,077.66
应付托管费	-	-	-	41,519.41	41,519.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	944,132.92	944,132.92
负债总计	-	-	-	2,840,487.76	2,840,487.76
利率敏感度缺口	13,824,224.63	-	-	-201,082,693.11	214,906,917.74
上年度末 2021 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	8,943,823.85	-	-	-	8,943,823.85
结算备付金	903,499.75	-	-	-	903,499.75
存出保证金	117,121.18	-	-	-	117,121.18
交易性金融资产	6,015,000.00	-	245,996.76	243,551,323.80	249,812,320.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	69,803.73	69,803.73
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	140.72	140.72
其他资产	-	-	-	63,778.76	63,778.76
资产总计	15,979,444.78	-	245,996.76	243,685,047.01	259,910,488.55
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	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	10.29	10.29
应付管理人报酬	-	-	217,677.37	217,677.37
应付托管费	-	-	54,419.34	54,419.34
应付销售服务费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	582,545.15	582,545.15
负债总计	-	-	854,652.15	854,652.15
利率敏感度缺口	15,979,444.78	-	245,996.76	242,830,394.86
				259,055,836.40

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

	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-629.43	-9,209.70
	市场利率下降 25 个基点	629.83	9,237.99

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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。本基金股票等权益类资产的投资占基金资产的比例为 0%-95%，其中，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	202,026,132.56	94.01	243,551,323.80	94.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,048,579.73	0.95	6,260,996.76	2.42
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	204,074,712.29	94.96	249,812,320.56	96.43

6.4.13.4.3.2 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	15,683,080.34	10,155,674.75
	业绩比较基准下降5%	-15,683,080.34	-10,155,674.75

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	199,248,836.45	242,858,769.83
第二层次	2,548,044.99	6,637,249.13
第三层次	2,277,830.85	316,301.60
合计	204,074,712.29	249,812,320.56

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	202,026,132.56	92.78
	其中：股票	202,026,132.56	92.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,048,579.73	0.94
	其中：债券	2,048,579.73	0.94
	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	11,723,279.95	5.38
8	其他各项资产	1,949,413.26	0.90
9	合计	217,747,405.50	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	3,487,588.00	1.62
B	采矿业	11,885,897.44	5.53
C	制造业	127,784,649.12	59.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,638,546.66	2.62
E	建筑业	2,417,695.00	1.12
F	批发和零售业	4,170,708.80	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	6,838,643.00	3.18
H	住宿和餐饮业	314,510.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,947,949.56	4.16
J	金融业	11,703,465.05	5.45
K	房地产业	5,123,264.00	2.38
L	租赁和商务服务业	2,353,611.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	4,053,438.26	1.89

N	水利、环境和公共设施管理业	1,337,914.50	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,737.00	0.00
Q	卫生和社会工作	1,056,050.17	0.49
R	文化、体育和娱乐业	3,981,798.00	1.85
S	综合	928,667.00	0.43
	合计	202,026,132.56	94.01

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002756	永兴材料	17,600	2,678,896.00	1.25
2	600390	五矿资本	454,300	2,221,527.00	1.03
3	300390	天华超净	25,200	2,202,480.00	1.02
4	603317	天味食品	73,100	2,081,157.00	0.97
5	000987	越秀金控	291,735	2,050,897.05	0.95
6	000983	山西焦煤	152,000	2,035,280.00	0.95
7	000519	中兵红箭	67,100	1,955,965.00	0.91
8	600299	安迪苏	201,200	1,927,496.00	0.90
9	600256	广汇能源	175,500	1,849,770.00	0.86
10	601615	明阳智能	52,900	1,788,020.00	0.83
11	600392	盛和资源	77,300	1,746,980.00	0.81
12	603198	迎驾贡酒	26,300	1,713,182.00	0.80
13	300630	普利制药	48,000	1,687,200.00	0.79
14	600522	中天科技	72,300	1,670,130.00	0.78
15	600167	联美控股	217,866	1,631,816.34	0.76
16	000402	金融街	261,900	1,558,305.00	0.73
17	601828	美凯龙	254,400	1,541,664.00	0.72
18	600566	济川药业	56,100	1,523,676.00	0.71
19	600233	圆通速递	72,300	1,474,197.00	0.69
20	300363	博腾股份	18,900	1,474,011.00	0.69
21	002557	洽洽食品	25,200	1,434,636.00	0.67
22	000733	振华科技	10,500	1,427,685.00	0.66
23	600639	浦东金桥	104,200	1,416,078.00	0.66
24	002399	海普瑞	80,300	1,411,674.00	0.66
25	600765	中航重机	43,540	1,401,117.20	0.65
26	002352	顺丰控股	25,100	1,400,831.00	0.65
27	002595	豪迈科技	62,200	1,389,548.00	0.65

28	000034	神州数码	91,000	1,385,020.00	0.64
29	603585	苏利股份	71,000	1,379,530.00	0.64
30	002497	雅化集团	42,200	1,377,830.00	0.64
31	000617	中油资本	285,700	1,374,217.00	0.64
32	600188	兖矿能源	34,800	1,373,904.00	0.64
33	603898	好莱客	132,200	1,364,304.00	0.63
34	688588	凌志软件	118,507	1,364,015.57	0.63
35	603556	海兴电力	88,900	1,353,058.00	0.63
36	000960	锡业股份	80,000	1,341,600.00	0.62
37	603277	银都股份	63,200	1,334,152.00	0.62
38	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.62
39	600497	驰宏锌锗	256,100	1,329,159.00	0.62
40	600598	北大荒	90,000	1,328,400.00	0.62
41	300009	安科生物	128,300	1,297,113.00	0.60
42	300482	万孚生物	31,740	1,292,135.40	0.60
43	601877	正泰电器	35,800	1,280,924.00	0.60
44	600236	桂冠电力	209,900	1,278,291.00	0.59
45	601801	皖新传媒	258,700	1,249,521.00	0.58
46	600873	梅花生物	109,800	1,238,544.00	0.58
47	000629	攀钢钒钛	321,300	1,220,940.00	0.57
48	300689	澄天伟业	68,700	1,189,197.00	0.55
49	600141	兴发集团	27,000	1,187,730.00	0.55
50	600036	招商银行	28,000	1,181,600.00	0.55
51	000553	安道麦 A	97,300	1,178,303.00	0.55
52	603127	昭衍新药	10,000	1,138,000.00	0.53
53	601689	拓普集团	16,400	1,122,252.00	0.52
54	002543	万和电气	156,200	1,096,524.00	0.51
55	600563	法拉电子	5,300	1,087,348.00	0.51
56	002475	立讯精密	32,100	1,084,659.00	0.50
57	603290	斯达半导	2,800	1,080,520.00	0.50
58	300769	德方纳米	2,640	1,078,915.20	0.50
59	600739	辽宁成大	73,500	1,071,630.00	0.50
60	600348	华阳股份	68,100	1,052,826.00	0.49
61	600737	中粮糖业	136,900	1,029,488.00	0.48
62	600867	通化东宝	99,400	1,027,796.00	0.48
63	300253	卫宁健康	116,700	1,024,626.00	0.48
64	600885	宏发股份	24,360	1,019,466.00	0.47
65	688510	航亚科技	53,114	1,017,664.24	0.47
66	601992	金隅集团	366,600	1,015,482.00	0.47
67	300073	当升科技	11,200	1,011,808.00	0.47
68	600863	内蒙华电	274,100	1,000,465.00	0.47
69	600126	杭钢股份	193,000	988,160.00	0.46

70	603096	新经典	52,100	961,245.00	0.45
71	601872	招商轮船	166,300	957,888.00	0.45
72	600350	山东高速	180,500	947,625.00	0.44
73	600673	东阳光	103,300	928,667.00	0.43
74	600486	扬农化工	6,900	919,632.00	0.43
75	601128	常熟银行	119,900	916,036.00	0.43
76	300751	迈为股份	1,820	893,438.00	0.42
77	600623	华谊集团	107,000	888,100.00	0.41
78	002299	圣农发展	46,200	886,116.00	0.41
79	688222	成都先导	55,100	879,396.00	0.41
80	002180	纳思达	17,300	875,726.00	0.41
81	601811	新华文轩	95,800	875,612.00	0.41
82	603156	养元饮品	38,000	863,360.00	0.40
83	603589	口子窖	14,700	861,567.00	0.40
84	000001	平安银行	57,100	855,358.00	0.40
85	002572	索菲亚	30,900	849,750.00	0.40
86	002678	珠江钢琴	144,800	841,288.00	0.39
87	300244	迪安诊断	26,800	833,480.00	0.39
88	002938	鹏鼎控股	27,500	830,775.00	0.39
89	603886	元祖股份	45,400	799,948.00	0.37
90	603676	卫信康	77,800	784,224.00	0.36
91	000895	双汇发展	26,400	773,520.00	0.36
92	002019	亿帆医药	54,800	766,104.00	0.36
93	000630	铜陵有色	234,300	763,818.00	0.36
94	002841	视源股份	10,100	760,732.00	0.35
95	688099	晶晨股份	7,381	745,481.00	0.35
96	002460	赣锋锂业	5,000	743,500.00	0.35
97	600030	中信证券	34,300	742,938.00	0.35
98	002653	海思科	46,100	742,671.00	0.35
99	603868	飞科电器	9,800	742,350.00	0.35
100	002582	好想你	96,900	725,781.00	0.34
101	300522	世名科技	59,100	711,564.00	0.33
102	605358	立昂微	10,388	699,943.44	0.33
103	600389	江山股份	11,500	698,395.00	0.32
104	002746	仙坛股份	75,200	688,080.00	0.32
105	002223	鱼跃医疗	26,800	687,688.00	0.32
106	600809	山西汾酒	2,100	682,080.00	0.32
107	603456	九洲药业	12,700	656,590.00	0.31
108	601869	长飞光纤	21,000	649,320.00	0.30
109	688339	亿华通	6,580	647,340.40	0.30
110	603826	坤彩科技	10,700	629,802.00	0.29
111	300498	温氏股份	29,100	619,539.00	0.29

112	002268	卫 士 通	14,400	617,904.00	0.29
113	603968	醋化股份	29,900	615,940.00	0.29
114	601611	中国核建	73,300	614,987.00	0.29
115	603177	德创环保	39,700	601,455.00	0.28
116	601231	环旭电子	41,200	591,632.00	0.28
117	603787	新日股份	39,700	589,148.00	0.27
118	603696	安记食品	56,900	582,656.00	0.27
119	688180	君实生物	7,594	572,131.96	0.27
120	603698	航天工程	44,100	569,772.00	0.27
121	002100	天康生物	58,300	566,676.00	0.26
122	300308	中际旭创	18,200	565,110.00	0.26
123	002081	金 螳 螂	110,800	562,864.00	0.26
124	002608	江苏国信	86,300	560,950.00	0.26
125	000021	深科技	47,000	547,080.00	0.25
126	603515	欧普照明	31,300	546,185.00	0.25
127	600604	市北高新	92,900	542,536.00	0.25
128	688158	优刻得	37,300	541,969.00	0.25
129	002880	卫光生物	20,500	539,560.00	0.25
130	300149	睿智医药	47,500	535,800.00	0.25
131	000999	华润三九	11,900	535,500.00	0.25
132	000738	航发控制	19,000	533,900.00	0.25
133	601566	九牧王	63,000	532,980.00	0.25
134	300618	寒锐钴业	9,200	532,864.00	0.25
135	600096	云天化	16,900	532,012.00	0.25
136	601952	苏垦农发	37,600	526,024.00	0.24
137	600177	雅戈尔	78,800	522,444.00	0.24
138	002567	唐人神	61,300	521,663.00	0.24
139	601696	中银证券	39,200	521,360.00	0.24
140	601677	明泰铝业	21,900	521,220.00	0.24
141	002947	恒铭达	28,155	518,052.00	0.24
142	300566	激智科技	28,500	515,850.00	0.24
143	600648	外高桥	37,800	514,080.00	0.24
144	300017	网宿科技	95,400	511,344.00	0.24
145	600985	淮北矿业	34,900	508,144.00	0.24
146	600259	广晟有色	9,900	501,435.00	0.23
147	002738	中矿资源	5,340	494,537.40	0.23
148	000988	华工科技	21,100	488,887.00	0.23
149	600380	健康元	39,400	486,590.00	0.23
150	603016	新宏泰	22,300	481,680.00	0.22
151	000848	承德露露	49,500	479,160.00	0.22
152	002545	东方铁塔	41,700	474,546.00	0.22
153	600499	科达制造	22,900	472,656.00	0.22

154	600887	伊利股份	11,700	455,715.00	0.21
155	600118	中国卫星	22,400	449,792.00	0.21
156	603613	国联股份	5,025	445,215.00	0.21
157	600415	小商品城	79,300	441,701.00	0.21
158	688536	思瑞浦	781	438,601.79	0.20
159	601636	旗滨集团	34,300	437,325.00	0.20
160	002234	民和股份	27,100	431,974.00	0.20
161	000887	中鼎股份	23,100	421,344.00	0.20
162	300724	捷佳伟创	4,700	419,945.00	0.20
163	600197	伊力特	13,700	412,370.00	0.19
164	300341	麦克奥迪	44,100	400,869.00	0.19
165	688348	昱能科技	940	391,575.80	0.18
166	603267	鸿远电子	2,900	389,557.00	0.18
167	002867	周大生	24,950	387,473.50	0.18
168	000807	云铝股份	38,200	377,416.00	0.18
169	000985	大庆华科	23,000	376,740.00	0.18
170	300474	景嘉微	5,500	376,145.00	0.18
171	002010	传化智联	57,000	366,510.00	0.17
172	002304	洋河股份	2,000	366,300.00	0.17
173	300681	英搏尔	6,270	362,217.90	0.17
174	002212	天融信	35,400	359,310.00	0.17
175	601928	凤凰传媒	49,900	356,785.00	0.17
176	300575	中旗股份	17,450	352,490.00	0.16
177	603489	八方股份	1,800	350,082.00	0.16
178	603501	韦尔股份	2,000	346,060.00	0.16
179	000778	新兴铸管	70,300	338,846.00	0.16
180	002385	大北农	43,300	338,173.00	0.16
181	002066	瑞泰科技	29,600	336,552.00	0.16
182	688005	容百科技	2,600	336,544.00	0.16
183	000537	广宇发展	25,900	336,441.00	0.16
184	600760	中航沈飞	5,500	332,475.00	0.15
185	601318	中国平安	7,100	331,499.00	0.15
186	002128	电投能源	22,900	327,928.00	0.15
187	000027	深圳能源	51,100	327,551.00	0.15
188	000898	鞍钢股份	101,600	327,152.00	0.15
189	603707	健友股份	11,553	325,794.60	0.15
190	002008	大族激光	9,700	321,361.00	0.15
191	688123	聚辰股份	3,000	319,560.00	0.15
192	600835	上海机电	23,200	318,536.00	0.15
193	600416	湘电股份	16,800	318,528.00	0.15
194	002422	科伦药业	16,900	316,030.00	0.15
195	601098	中南传媒	33,300	314,352.00	0.15

196	301073	君亭酒店	4,500	312,030.00	0.15
197	002549	凯美特气	17,100	309,510.00	0.14
198	603568	伟明环保	9,100	303,667.00	0.14
199	603866	桃李面包	18,200	301,210.00	0.14
200	601666	平煤股份	22,100	300,339.00	0.14
201	600481	双良节能	17,800	299,930.00	0.14
202	002906	华阳集团	6,600	299,046.00	0.14
203	601799	星宇股份	1,700	290,700.00	0.14
204	600487	亨通光电	19,800	287,892.00	0.13
205	603078	江化微	9,940	283,985.80	0.13
206	002153	石基信息	17,780	282,168.60	0.13
207	002920	德赛西威	1,900	281,200.00	0.13
208	603929	亚翔集成	26,200	279,030.00	0.13
209	000517	荣安地产	87,500	278,250.00	0.13
210	601211	国泰君安	18,100	275,120.00	0.13
211	603128	华贸物流	27,400	274,822.00	0.13
212	688561	奇安信	4,900	273,420.00	0.13
213	600153	建发股份	20,900	273,163.00	0.13
214	002405	四维图新	18,100	272,767.00	0.13
215	000656	金科股份	93,900	268,554.00	0.12
216	300803	指南针	4,500	264,510.00	0.12
217	002216	三全食品	13,500	264,465.00	0.12
218	000559	万向钱潮	44,300	263,142.00	0.12
219	000090	天健集团	36,800	253,552.00	0.12
220	600325	华发股份	33,400	252,838.00	0.12
221	603558	健盛集团	20,500	250,510.00	0.12
222	600009	上海机场	4,400	249,480.00	0.12
223	300396	迪瑞医疗	17,400	247,776.00	0.12
224	603708	家家悦	17,400	247,776.00	0.12
225	603026	石大胜华	1,700	247,095.00	0.11
226	601898	中煤能源	23,800	247,044.00	0.11
227	002468	申通快递	20,700	246,744.00	0.11
228	603609	禾丰股份	25,300	243,639.00	0.11
229	600029	南方航空	33,300	243,423.00	0.11
230	003035	南网能源	38,200	242,570.00	0.11
231	600862	中航高科	8,600	241,660.00	0.11
232	000408	藏格矿业	7,300	240,462.00	0.11
233	600970	中材国际	24,300	235,467.00	0.11
234	600015	华夏银行	44,700	232,887.00	0.11
235	002847	盐津铺子	2,600	228,644.00	0.11
236	600428	中远海特	47,400	225,624.00	0.10
237	603858	步长制药	11,400	224,694.00	0.10

238	601998	中信银行	47,300	224,675.00	0.10
239	002466	天齐锂业	1,800	224,640.00	0.10
240	603208	江山欧派	3,100	223,913.00	0.10
241	000568	泸州老窖	900	221,886.00	0.10
242	688521	芯原股份	4,412	217,952.80	0.10
243	002372	伟星新材	9,000	216,360.00	0.10
244	603327	福蓉科技	15,650	215,187.50	0.10
245	002004	华邦健康	38,500	214,830.00	0.10
246	600339	中油工程	74,100	214,149.00	0.10
247	605138	盛泰集团	17,000	212,160.00	0.10
248	000729	燕京啤酒	21,900	211,554.00	0.10
249	688668	鼎通科技	3,000	211,020.00	0.10
250	600941	中国移动	3,400	205,700.00	0.10
251	600779	水井坊	2,200	203,588.00	0.09
252	600801	华新水泥	10,400	202,904.00	0.09
253	603337	杰克股份	9,400	201,912.00	0.09
254	301058	中粮工科	11,499	199,967.61	0.09
255	601699	潞安环能	13,400	195,908.00	0.09
256	688819	天能股份	5,600	193,648.00	0.09
257	603348	文灿股份	3,600	192,960.00	0.09
258	688228	开普云	6,100	190,137.00	0.09
259	300636	同和药业	7,800	187,200.00	0.09
260	300354	东华测试	5,800	186,470.00	0.09
261	600606	绿地控股	46,700	184,932.00	0.09
262	601000	唐山港	71,500	184,470.00	0.09
263	300037	新宙邦	3,500	183,960.00	0.09
264	002965	祥鑫科技	6,000	181,740.00	0.08
265	002996	顺博合金	11,800	179,360.00	0.08
266	688179	阿拉丁	3,500	179,340.00	0.08
267	002946	新乳业	13,700	177,963.00	0.08
268	600511	国药股份	6,500	174,070.00	0.08
269	600064	南京高科	15,700	172,700.00	0.08
270	600755	厦门国贸	22,946	172,095.00	0.08
271	002555	三七互娱	8,100	171,963.00	0.08
272	002041	登海种业	8,100	170,829.00	0.08
273	601717	郑煤机	11,800	170,038.00	0.08
274	603228	景旺电子	7,200	167,976.00	0.08
275	603650	彤程新材	5,100	166,158.00	0.08
276	002518	科士达	5,400	165,240.00	0.08
277	000066	中国长城	15,100	163,382.00	0.08
278	300926	博俊科技	6,978	162,936.30	0.08
279	603719	良品铺子	5,600	160,328.00	0.07

280	600346	恒力石化	7,200	160,128.00	0.07
281	002832	比音勒芬	6,300	158,760.00	0.07
282	603815	交建股份	17,600	158,752.00	0.07
283	603212	赛伍技术	5,900	156,999.00	0.07
284	002396	星网锐捷	6,900	156,216.00	0.07
285	600376	首开股份	31,800	156,138.00	0.07
286	603229	奥翔药业	4,100	156,046.00	0.07
287	000970	中科三环	8,270	155,310.60	0.07
288	002508	老板电器	4,300	154,929.00	0.07
289	603896	寿仙谷	3,990	154,732.20	0.07
290	002932	明德生物	2,235	153,231.60	0.07
291	600273	嘉化能源	14,100	153,126.00	0.07
292	601838	成都银行	9,200	152,536.00	0.07
293	300019	硅宝科技	6,800	151,164.00	0.07
294	603345	安井食品	900	151,083.00	0.07
295	600871	石化油服	79,700	150,633.00	0.07
296	300196	长海股份	7,900	149,231.00	0.07
297	601019	山东出版	22,900	148,621.00	0.07
298	603328	依顿电子	23,400	148,590.00	0.07
299	601609	金田股份	19,600	147,196.00	0.07
300	002539	云图控股	9,200	147,108.00	0.07
301	603379	三美股份	6,600	146,850.00	0.07
302	300938	信测标准	5,240	145,095.60	0.07
303	605368	蓝天燃气	11,500	144,900.00	0.07
304	601156	东航物流	7,300	144,540.00	0.07
305	600018	上港集团	24,600	143,418.00	0.07
306	300453	三鑫医疗	14,200	141,148.00	0.07
307	002916	深南电路	1,500	140,565.00	0.07
308	000581	威孚高科	7,300	140,525.00	0.07
309	600063	皖维高新	18,500	140,230.00	0.07
310	605169	洪通燃气	12,432	139,984.32	0.07
311	300861	美畅股份	1,500	139,035.00	0.06
312	002233	塔牌集团	15,700	138,945.00	0.06
313	300015	爱尔眼科	3,100	138,787.00	0.06
314	002192	融捷股份	900	138,330.00	0.06
315	300573	兴齐眼药	900	137,988.00	0.06
316	300887	谱尼测试	3,220	137,526.20	0.06
317	300327	中颖电子	2,760	137,475.60	0.06
318	300260	新莱应材	2,700	137,349.00	0.06
319	002624	完美世界	9,300	133,641.00	0.06
320	601225	陕西煤业	6,300	133,434.00	0.06
321	000830	鲁西化工	7,700	133,133.00	0.06

322	000423	东阿阿胶	3,600	133,020.00	0.06
323	603605	珀莱雅	800	132,144.00	0.06
324	600536	中国软件	3,250	131,917.50	0.06
325	688617	惠泰医疗	600	131,448.00	0.06
326	688139	海尔生物	1,800	131,094.00	0.06
327	300920	润阳科技	6,100	130,296.00	0.06
328	603583	捷昌驱动	3,900	130,221.00	0.06
329	000876	新希望	8,500	130,050.00	0.06
330	601003	柳钢股份	32,100	130,005.00	0.06
331	603038	华立股份	15,300	129,591.00	0.06
332	603808	歌力思	13,200	127,776.00	0.06
333	300352	北信源	27,200	125,664.00	0.06
334	600795	国电电力	32,100	125,511.00	0.06
335	300481	濮阳惠成	5,200	122,200.00	0.06
336	603486	科沃斯	1,000	121,890.00	0.06
337	603236	移远通信	910	121,630.60	0.06
338	300682	朗新科技	4,800	120,912.00	0.06
339	600160	巨化股份	9,100	119,665.00	0.06
340	601668	中国建筑	22,400	119,168.00	0.06
341	603528	多伦科技	19,800	118,998.00	0.06
342	003816	中国广核	42,400	118,720.00	0.06
343	601088	中国神华	3,500	116,550.00	0.05
344	002563	森马服饰	19,600	116,032.00	0.05
345	688321	微芯生物	4,600	115,874.00	0.05
346	600875	东方电气	7,000	115,150.00	0.05
347	002110	三钢闽光	18,900	115,101.00	0.05
348	000961	中南建设	37,300	113,765.00	0.05
349	300559	佳发教育	11,400	112,176.00	0.05
350	002797	第一创业	17,500	112,175.00	0.05
351	002815	崇达技术	8,500	108,885.00	0.05
352	301139	元道通信	2,825	108,649.50	0.05
353	002294	信立泰	3,700	103,970.00	0.05
354	002195	二三四五	45,800	103,050.00	0.05
355	601778	晶科科技	18,900	102,060.00	0.05
356	603565	中谷物流	6,400	101,568.00	0.05
357	601016	节能风电	21,000	100,800.00	0.05
358	000563	陕国投 A	32,300	100,776.00	0.05
359	688337	普源精电	1,969	100,478.07	0.05
360	600959	江苏有线	30,500	99,430.00	0.05
361	601866	中远海发	32,500	97,500.00	0.05
362	688008	澜起科技	1,600	96,928.00	0.05
363	600066	宇通客车	10,900	94,285.00	0.04

364	600037	歌华有线	9,800	92,022.00	0.04
365	600642	申能股份	16,200	92,016.00	0.04
366	002747	埃斯顿	3,700	90,650.00	0.04
367	603871	嘉友国际	5,320	89,908.00	0.04
368	600062	华润双鹤	3,500	89,810.00	0.04
369	301175	中科环保	23,407	89,414.74	0.04
370	688237	超卓航科	2,001	82,581.27	0.04
371	600808	马钢股份	21,300	80,727.00	0.04
372	603688	石英股份	600	79,566.00	0.04
373	688400	凌云光	3,616	79,298.88	0.04
374	003004	声迅股份	3,800	79,268.00	0.04
375	000567	海德股份	5,300	78,440.00	0.04
376	301239	普瑞眼科	2,251	75,746.15	0.04
377	002690	美亚光电	3,300	71,544.00	0.03
378	603939	益丰药房	1,300	68,679.00	0.03
379	301233	盛帮股份	1,536	63,774.72	0.03
380	300357	我武生物	1,200	62,436.00	0.03
381	600508	上海能源	3,400	61,506.00	0.03
382	688173	希荻微	1,919	60,678.78	0.03
383	603077	和邦生物	13,300	56,658.00	0.03
384	688269	凯立新材	500	53,000.00	0.02
385	601949	中国出版	10,600	51,092.00	0.02
386	603305	旭升股份	1,680	50,769.60	0.02
387	600371	万向德农	3,800	50,730.00	0.02
388	600787	中储股份	8,900	50,641.00	0.02
389	002705	新宝股份	2,300	50,577.00	0.02
390	601933	永辉超市	11,600	49,648.00	0.02
391	002394	联发股份	6,700	48,977.00	0.02
392	002942	新农股份	2,800	46,956.00	0.02
393	600438	通威股份	700	41,902.00	0.02
394	600295	鄂尔多斯	2,040	36,822.00	0.02
395	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
396	000906	浙商中拓	4,000	36,320.00	0.02
397	600195	中牧股份	2,900	35,554.00	0.02
398	000166	申万宏源	8,100	34,749.00	0.02
399	688356	键凯科技	139	33,611.59	0.02
400	002340	格林美	3,600	32,760.00	0.02
401	601882	海天精工	1,500	30,915.00	0.01
402	603880	南卫股份	5,000	29,300.00	0.01
403	600929	雪天盐业	3,100	28,768.00	0.01
404	688033	天宜上佳	1,300	27,612.00	0.01
405	300634	彩讯股份	2,000	25,400.00	0.01

406	688390	固德威	80	25,040.80	0.01
407	300138	晨光生物	1,600	24,912.00	0.01
408	300654	世纪天鸿	3,000	24,570.00	0.01
409	688191	智洋创新	1,400	23,800.00	0.01
410	688696	极米科技	76	23,398.12	0.01
411	605016	百龙创园	500	21,010.00	0.01
412	600746	江苏索普	1,800	20,844.00	0.01
413	603877	太平鸟	1,000	20,240.00	0.01
414	002152	广电运通	2,000	18,540.00	0.01
415	301215	中汽股份	2,877	18,384.03	0.01
416	600316	洪都航空	600	18,144.00	0.01
417	301238	瑞泰新材	565	18,119.55	0.01
418	688036	传音控股	200	17,846.00	0.01
419	600362	江西铜业	900	16,047.00	0.01
420	301266	宇邦新材	339	15,956.73	0.01
421	688357	建龙微纳	134	15,066.96	0.01
422	301120	新特电气	922	14,281.78	0.01
423	600517	国网英大	2,700	14,013.00	0.01
424	301298	东利机械	634	13,206.22	0.01
425	301263	泰恩康	405	12,708.90	0.01
426	301112	信邦智能	279	12,566.16	0.01
427	301259	艾布鲁	478	11,921.32	0.01
428	301116	益客食品	577	11,805.42	0.01
429	600123	兰花科创	700	11,515.00	0.01
430	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
431	301256	华融化学	1,119	11,279.52	0.01
432	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.01
433	688023	安恒信息	75	11,074.50	0.01
434	002050	三花智控	400	10,992.00	0.01
435	603392	万泰生物	70	10,871.00	0.01
436	688595	芯海科技	183	10,581.06	0.00
437	301286	侨源股份	525	10,389.75	0.00
438	603217	元利科技	340	9,999.40	0.00
439	301302	华如科技	175	9,873.50	0.00
440	301212	联盛化学	296	9,850.88	0.00
441	301097	天益医疗	199	9,518.17	0.00
442	301268	铭利达	270	9,414.90	0.00
443	301137	哈焊华通	575	9,194.25	0.00
444	301236	软通动力	291	9,131.58	0.00
445	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
446	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
447	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00

448	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
449	301153	中科江南	199	8,752.02	0.00
450	301207	华兰疫苗	155	8,745.10	0.00
451	301109	军信股份	506	8,166.84	0.00
452	301200	大族数控	155	8,047.60	0.00
453	301103	何氏眼科	251	8,037.02	0.00
454	301248	杰创智能	266	7,945.42	0.00
455	301150	中一科技	95	7,862.20	0.00
456	301216	万凯新材	257	7,668.88	0.00
457	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
458	301222	浙江恒威	254	7,355.84	0.00
459	301135	瑞德智能	266	6,985.16	0.00
460	301148	嘉戎技术	284	6,787.60	0.00
461	301258	富士莱	155	6,460.40	0.00
462	301237	和顺科技	153	6,404.58	0.00
463	300910	瑞丰新材	100	6,322.00	0.00
464	301181	标榜股份	202	6,179.18	0.00
465	600820	隧道股份	1,000	6,120.00	0.00
466	301151	冠龙节能	281	6,030.26	0.00
467	600004	白云机场	400	5,964.00	0.00
468	600928	西安银行	1,600	5,872.00	0.00
469	600372	中航电子	300	5,817.00	0.00
470	603517	绝味食品	100	5,782.00	0.00
471	600338	西藏珠峰	200	5,740.00	0.00
472	301219	腾远钴业	65	5,708.30	0.00
473	688468	科美诊断	455	5,610.15	0.00
474	600803	新奥股份	300	5,577.00	0.00
475	000039	中集集团	400	5,540.00	0.00
476	301279	金道科技	241	5,497.21	0.00
477	002001	新和成	240	5,474.40	0.00
478	300007	汉威科技	300	5,397.00	0.00
479	600085	同仁堂	100	5,288.00	0.00
480	002701	奥瑞金	1,000	5,200.00	0.00
481	600460	士兰微	100	5,200.00	0.00
482	300389	艾比森	500	5,195.00	0.00
483	300001	特锐德	300	5,193.00	0.00
484	600168	武汉控股	800	5,152.00	0.00
485	600869	远东股份	1,000	5,150.00	0.00
486	000877	天山股份	400	4,920.00	0.00
487	002583	海能达	1,000	4,840.00	0.00
488	601818	光大银行	1,600	4,816.00	0.00
489	600038	中直股份	100	4,520.00	0.00

490	300323	华灿光电	600	4,518.00	0.00
491	300834	星辉环材	149	4,474.47	0.00
492	002645	华宏科技	200	4,364.00	0.00
493	002641	公元股份	900	4,338.00	0.00
494	600549	厦门钨业	200	4,324.00	0.00
495	600649	城投控股	1,000	4,280.00	0.00
496	300369	绿盟科技	400	4,208.00	0.00
497	600990	四创电子	100	4,135.00	0.00
498	000002	万 科 A	200	4,100.00	0.00
499	002573	清新环境	700	4,067.00	0.00
500	002958	青农商行	1,200	3,984.00	0.00
501	300738	奥飞数据	340	3,893.00	0.00
502	600699	均胜电子	240	3,770.40	0.00
503	000631	顺发恒业	1,000	3,760.00	0.00
504	000636	风华高科	200	3,758.00	0.00
505	603648	畅联股份	400	3,736.00	0.00
506	002078	太阳纸业	300	3,693.00	0.00
507	002146	荣盛发展	1,200	3,636.00	0.00
508	600399	抚顺特钢	200	3,580.00	0.00
509	002028	思源电气	100	3,566.00	0.00
510	002733	雄韬股份	200	3,482.00	0.00
511	600718	东软集团	300	3,453.00	0.00
512	002507	涪陵榨菜	100	3,452.00	0.00
513	301196	唯科科技	92	3,451.84	0.00
514	600657	信达地产	500	3,445.00	0.00
515	600874	创业环保	500	3,365.00	0.00
516	002895	川恒股份	98	3,313.38	0.00
517	300383	光环新网	300	3,126.00	0.00
518	002984	森麒麟	100	3,111.00	0.00
519	600663	陆家嘴	300	3,108.00	0.00
520	300224	正海磁材	200	3,060.00	0.00
521	300088	长信科技	400	2,968.00	0.00
522	600007	中国国贸	200	2,950.00	0.00
523	603797	联泰环保	500	2,925.00	0.00
524	002391	长青股份	400	2,840.00	0.00
525	601117	中国化学	300	2,823.00	0.00
526	603989	艾华集团	100	2,820.00	0.00
527	600705	中航产融	800	2,768.00	0.00
528	603006	黎明股份	300	2,733.00	0.00
529	002138	顺络电子	100	2,725.00	0.00
530	002262	恩华药业	200	2,720.00	0.00
531	603983	丸美股份	100	2,680.00	0.00

532	000933	神火股份	200	2,616.00	0.00
533	002187	广百股份	310	2,600.90	0.00
534	300538	同益股份	200	2,590.00	0.00
535	002915	中欣氟材	140	2,525.60	0.00
536	603767	中马传动	300	2,481.00	0.00
537	600258	首旅酒店	100	2,480.00	0.00
538	000723	美锦能源	200	2,440.00	0.00
539	600582	天地科技	500	2,390.00	0.00
540	000029	深深房 A	200	2,380.00	0.00
541	688030	山石网科	112	2,324.00	0.00
542	603256	宏和科技	300	2,226.00	0.00
543	002923	润都股份	130	2,225.60	0.00
544	000789	万年青	200	2,168.00	0.00
545	000401	冀东水泥	200	2,104.00	0.00
546	002434	万里扬	240	2,052.00	0.00
547	002732	燕塘乳业	100	2,004.00	0.00
548	002745	木林森	200	1,954.00	0.00
549	600728	佳都科技	300	1,938.00	0.00
550	600398	海澜之家	400	1,900.00	0.00
551	603100	川仪股份	100	1,764.00	0.00
552	002607	中公教育	300	1,737.00	0.00
553	002125	湘潭电化	100	1,704.00	0.00
554	603286	日盈电子	100	1,649.00	0.00
555	002534	西子洁能	100	1,629.00	0.00
556	688556	高测股份	20	1,614.00	0.00
557	300418	昆仑万维	100	1,600.00	0.00
558	002791	坚朗五金	12	1,556.64	0.00
559	002493	荣盛石化	100	1,539.00	0.00
560	002579	中京电子	200	1,526.00	0.00
561	002752	昇兴股份	300	1,491.00	0.00
562	300113	顺网科技	100	1,447.00	0.00
563	601139	深圳燃气	200	1,388.00	0.00
564	002013	中航机电	100	1,235.00	0.00
565	603529	爱玛科技	20	1,047.60	0.00
566	600312	平高电气	100	798.00	0.00
567	600307	酒钢宏兴	400	776.00	0.00
568	300026	红日药业	100	770.00	0.00
569	600919	江苏银行	100	712.00	0.00
570	300512	中亚股份	50	410.00	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	688536	思瑞浦	4,517,530.51	1.74
2	600348	华阳股份	2,961,311.00	1.14
3	002008	大族激光	2,953,179.00	1.14
4	600233	圆通速递	2,915,156.00	1.13
5	603379	三美股份	2,762,046.88	1.07
6	300498	温氏股份	2,565,111.00	0.99
7	002756	永兴材料	2,496,076.95	0.96
8	600390	五矿资本	2,227,699.00	0.86
9	000987	越秀金控	2,214,190.00	0.85
10	002557	洽洽食品	2,212,834.00	0.85
11	600299	安迪苏	2,123,772.00	0.82
12	601899	紫金矿业	2,122,734.00	0.82
13	603613	国联股份	2,105,117.00	0.81
14	600160	巨化股份	2,103,452.00	0.81
15	000090	天健集团	2,080,249.00	0.80
16	000983	山西焦煤	2,063,048.00	0.80
17	000402	金融街	2,028,121.00	0.78
18	600188	兖矿能源	2,016,303.44	0.78
19	600546	山煤国际	1,967,890.00	0.76
20	688696	极米科技	1,966,938.20	0.76

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	688536	思瑞浦	3,971,478.16	1.53
2	600188	兖矿能源	3,359,101.00	1.30
3	601699	潞安环能	3,213,255.00	1.24
4	002008	大族激光	3,179,735.00	1.23
5	600141	兴发集团	2,721,650.00	1.05
6	603198	迎驾贡酒	2,580,928.00	1.00
7	600546	山煤国际	2,499,090.00	0.96
8	600348	华阳股份	2,473,153.00	0.95
9	603379	三美股份	2,421,814.00	0.93
10	000988	华工科技	2,347,315.00	0.91
11	600765	中航重机	2,319,053.00	0.90
12	600160	巨化股份	2,277,476.00	0.88
13	600256	广汇能源	2,258,246.00	0.87

14	601899	紫金矿业	2,244,729.00	0.87
15	000630	铜陵有色	2,172,478.00	0.84
16	600884	杉杉股份	2,060,749.00	0.80
17	300316	晶盛机电	1,975,759.00	0.76
18	000090	天健集团	1,929,367.00	0.74
19	000987	越秀金控	1,920,647.00	0.74
20	600233	圆通速递	1,893,754.00	0.73

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	393,649,106.06
卖出股票收入（成交）总额	414,211,337.39

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,048,579.73	0.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,048,579.73	0.95

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019641	20 国债 11	20,000	2,048,579.73	0.95

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**

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	52,364.95
2	应收清算款	1,801,246.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	95,802.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,949,413.26

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

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 (%)
80,476	2,554.34	143,856,727.09	69.98	61,706,093.03	30.02

8.2 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	589.93	0.00

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2019 年 10 月 11 日) 基金份额总额	194,476,469.66
本报告期期初基金份额总额	231,058,003.34
本报告期基金总申购份额	49,183,332.20
减：本报告期基金总赎回份额	74,678,515.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	205,562,820.12

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

经本基金管理人建信基金管理有限责任公司 2022 年第一次临时股东会和第六届董事会第

五次会议审议通过，自 2022 年 5 月 11 日起，孙志晨先生不再担任建信基金管理有限责任公司董事长，暂由总裁张军红先生代为履行董事长职务。经本基金管理人建信基金管理有限责任公司第六届董事会第五次会议审议通过，自 2022 年 5 月 11 日起，马勇先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁。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并于 2022 年 5 月 13 日公告。

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基金管理人、基金财产以及基金托管人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

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，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	3	297,236,706.31	37.21	276,821.17	39.75	-
华泰证券	1	202,277,608.77	25.32	144,244.31	20.71	-
东兴证券	1	114,503,043.71	14.33	105,484.07	15.15	-
光大证券	2	63,788,285.20	7.99	58,930.26	8.46	-

招商证券	2	46,984,848.12	5.88	42,805.17	6.15	-
东北证券	1	40,148,904.30	5.03	36,586.35	5.25	-
中泰证券	2	33,897,144.40	4.24	31,568.42	4.53	-
长江证券	1	2,124.00	0.00	1.01	0.00	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
九州证券	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、个股等进行深入、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、本基金本报告期内新增长江证券一个交易单元，无剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,191,738.40	22.70	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	27,665.00	0.53	-	-	-	-
招商证券	4,008,400.00	76.35	-	-	-	-
东北证券	22,000.00	0.42	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-

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	建信基金管理有限责任公司关于新增招商银行为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 04 月 12 日
2	关于新增东方证券股份有限公司为建信灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 03 月 24 日
3	关于新增申万宏源西部证券股份有限公司为建信旗下部分产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 03 月 23 日
4	关于新增东吴证券股份有限公司为建信旗下部分产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 03 月 14 日
5	关于新增和讯信息科技有限公司为建信富时 100 指数型证券投资基金(QDII)等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 02 月 25 日
6	建信基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金申购、转换转入、定投起点金额及赎回起点份额的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 01 月 19 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日	48,212,656.05	-	-	48,212,656.05	23.45
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况,可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险,敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制,持续做好基							

金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信灵活配置混合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

2022 年 8 月 30 日