

建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF） 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	7
3.3 其他指标	7
§ 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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产 (基金净值) 变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59

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	59
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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末上市基金前十名持有人	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.4 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	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	建信沪深 300 指数 (LOF)
场内简称	沪深 300LOF 建信
基金主代码	165309
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 11 月 5 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	272,046,395.11 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2009 年 11 月 30 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资方式, 通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段, 力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数, 并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为: $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+5\% \times$ 商业银行税后活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金, 其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金, 为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
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	95588
传真	010-66228001	(010) 66105798
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 55 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 55 号
邮政编码	100033	100140
法定代表人	孙志晨	陈四清

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	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	1,406,544.46
本期利润	-34,935,769.20
加权平均基金份额本期利润	-0.1314
本期加权平均净值利润率	-8.11%
本期基金份额净值增长率	-7.69%
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	188,939,645.55
期末可供分配基金份额利润	0.6945
期末基金资产净值	460,986,040.66
期末基金份额净值	1.6945
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	69.45%

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。

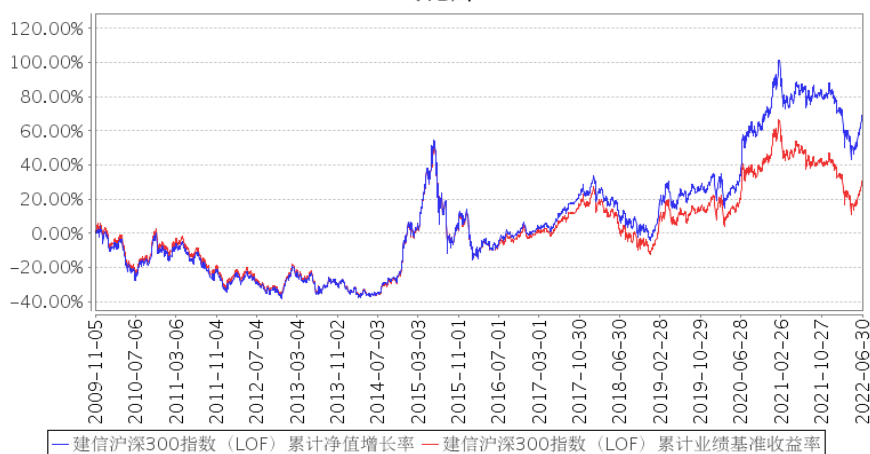
3.2 基金净值表现

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	10.03%	1.00%	9.12%	1.02%	0.91%	-0.02%
过去三个月	6.95%	1.34%	5.93%	1.36%	1.02%	-0.02%
过去六个月	-7.69%	1.36%	-8.72%	1.38%	1.03%	-0.02%
过去一年	-9.27%	1.17%	-13.40%	1.18%	4.13%	-0.01%
过去三年	37.83%	1.19%	16.70%	1.20%	21.13%	-0.01%
自基金合同生效起至今	69.45%	1.36%	30.44%	1.36%	39.01%	0.00%

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

建信沪深300指数 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准, 建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日, 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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理, 本基金的基金经理	2009年11月5日	-	19年	梁洪昀先生, 金融工程及指数投资部总经理, 博士。特许金融分析师 (CFA)。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司, 历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司, 历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理; 2010年5月28日至2012年5月28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; 2011年9月8日至2016年7月20日任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金 (ETF) 及其联接基金的基金经理; 2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金的基金经理; 2015年3月25日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理, 该基金自2020年5月7日转型为建信沪深300指数增强型证券投资基金 (LOF), 梁洪昀继续担任该基金的基金经理; 2015年7月31日至2018年7月31日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理; 2015年8月6日至2016年10月25日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理; 2018年2月6日至2019年11月25日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 2018年6月13日至2019年11月25日任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; 2018年2月7日起任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理; 2018年4月19日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 2018年5月16日起任建信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《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 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

在报告期内，本基金根据基金合同规定，采取了对指数的复制策略，将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。在报告期内，标的指数中部分股票限于规定无法

投资, 必须用其他股票进行替代, 这是基金跟踪误差的重要来源之一。基金管理人通过量化分析研究, 制定及执行了相应的策略, 并根据市场情况, 对替代方案进行动态优化和调整, 以尽可能地降低这种不利影响。在报告期内, 沪深 300 指数的成分股进行了例行调整, 管理人通过适当的调仓策略, 尽量降低了成分股调整过程中投资组合的跟踪误差与偏离度。基金在遵守基金合同、确保平稳运作的基础上, 参与了新股申购, 并适时兑现, 以进一步增厚收益。

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-7.69%, 波动率 1.36%, 业绩比较基准收益率-8.72%, 波动率 1.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年下半年, 全球经济面临着中短期内通货膨胀持续, 并逐渐转向衰退的预期。地缘政治风险与上半年相比, 预计难有缓解, 从而继续加剧上述压力。国内宏观经济方面, 疫情防控仍是重要工作, 在上半年所取得的经验教训基础上, 政策将更为注重防疫和保证经济活动正常运行之间的平衡。部分高负债行业可能造成的风险外溢如何有效化解, 对于政策制定是个考验, 也将是市场关注的焦点。投资者预期会随着这些因素的变化不断发生调整。在预期发生重大变化时, 市场波动会随之放大。本管理人将根据基金合同, 继续以量化分析研究为基础, 克服个别成份股无法投资、基金日常申赎、成份股停牌等各种因素造成的不利影响, 将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平, 同时以研究为基础, 在基金合同规定的范围内适当捕捉其他投资机会, 力求增厚基金收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本公司设立资产估值委员会, 主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜, 确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、风险与合规管理部、投资风险管理部 and 基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

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	30,737,250.29	32,852,341.41
结算备付金		-	-
存出保证金		20,280.77	12,249.78

交易性金融资产	6.4.7.2	432,216,360.90	426,695,986.78
其中：股票投资		432,216,360.90	426,695,986.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		18,615.99	72,143.48
应收股利		-	-
应收申购款		122,870.78	136,739.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	3,477.25
资产总计		463,115,378.73	459,772,938.59
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		-	-
应付赎回款		927,190.71	245,838.42
应付管理人报酬		269,427.74	293,374.43
应付托管费		53,885.55	58,674.88
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	878,834.07	1,175,536.19
负债合计		2,129,338.07	1,773,423.92
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.10	272,046,395.11	249,496,612.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	188,939,645.55	208,502,902.67
净资产合计		460,986,040.66	457,999,514.67

负债和净资产总计		463,115,378.73	459,772,938.59
----------	--	----------------	----------------

注：(1) 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6945 元，基金份额总额 272,046,395.11 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：建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

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		-32,918,857.35	22,940,041.28
1. 利息收入		60,765.16	56,543.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	60,765.16	56,543.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,348,260.06	42,278,006.96
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-765,707.82	39,240,747.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	34,124.10	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
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	4,079,843.78	3,037,259.63
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	6.4.7.20	-36,342,313.66	-19,462,342.76

以“-”号填列)			
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	14,431.09	67,833.11
减: 二、营业总支出		2,016,911.85	2,896,022.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,602,255.23	1,704,664.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	320,451.00	340,932.76
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.06	-
8. 其他费用	6.4.7.23	94,205.56	850,425.34
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-34,935,769.20	20,044,019.02
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-34,935,769.20	20,044,019.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-34,935,769.20	20,044,019.02

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: 建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

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)	249,496,612.00	-	208,502,902.67	457,999,514.67
加: 会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	249,496,612.00	-	208,502,902.67	457,999,514.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	22,549,783.11	-	-19,563,257.12	2,986,525.99
(一)、综合收益总额	-	-	-34,935,769.20	-34,935,769.20
(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)	22,549,783.11	-	15,372,512.08	37,922,295.19
其中:1. 基金申购款	37,503,381.48	-	25,073,300.02	62,576,681.50
2. 基金赎回款	-14,953,598.37	-	-9,700,787.94	-24,654,386.31
(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、本期末净资产(基金净值)	272,046,395.11	-	188,939,645.55	460,986,040.66
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)	264,356,814.87	-	208,967,192.09	473,324,006.96
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)	264,356,814.87	-	208,967,192.09	473,324,006.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-23,866,339.01	-	-285,459.30	-24,151,798.31
(一)、综合收益总额	-	-	20,044,019.02	20,044,019.02
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-23,866,339.01	-	-20,329,478.32	-44,195,817.33

(净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	34,750,536.82	-	29,710,637.85	64,461,174.67
2. 基金赎回款	-58,616,875.83	-	-50,040,116.17	-108,656,992.00
(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、本期末净资产(基金净值)	240,490,475.86	-	208,681,732.79	449,172,208.65

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

吴曙明

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (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[2009]882 号《关于核准建信沪深 300 指数证券投资基金

(LOF) 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《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2009 年 9 月 21 日至 2009 年 10 月 30 日止。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 5,324,471,976.73 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字 (2009) 第 233 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2009 年 11 月 5 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 5,326,413,369.61 份基金份额, 其中认购资金利息折合 1,941,392.88 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 深证上 [2009]157 号审核同意, 本基金 59,552,590.00 份基金份额于 2009 年 11 月 30 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%, 投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金对标的指数的跟踪目标: 力争使得日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年化跟踪误差不得超过 4%。本基金业绩比较基准为 95%×沪深 300 指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。本基金的标的指数使用费由基金管理人建信基金管理有限责任公司承担, 不计入本基金费用。

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 32,852,341.41 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,471.20 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 32,855,812.61 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 12,249.78 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 6.05 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 12,255.83 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 3,477.25 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 3,471.20 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 6.05 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。

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	30,737,250.29
等于：本金	30,734,321.93
加：应计利息	2,928.36
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	30,737,250.29

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	405,334,981.04	-	432,216,360.90	26,881,379.86
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	405,334,981.04	-	432,216,360.90	26,881,379.86

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	2,367.90

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	737,663.61
其中：交易所市场	737,663.61
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	138,802.56
合计	878,834.07

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	249,496,612.00	249,496,612.00
本期申购	37,503,381.48	37,503,381.48
本期赎回 (以“-”号填列)	-14,953,598.37	-14,953,598.37
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	272,046,395.11	272,046,395.11

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	339,415,771.18	-130,912,868.51	208,502,902.67
本期利润	1,406,544.46	-36,342,313.66	-34,935,769.20
本期基金份额交易产生的变动数	30,695,681.30	-15,323,169.22	15,372,512.08
其中：基金申购款	51,075,179.65	-26,001,879.63	25,073,300.02
基金赎回款	-20,379,498.35	10,678,710.41	-9,700,787.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	371,517,996.94	-182,578,351.39	188,939,645.55

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	58,612.13
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	1,382.74
其他	770.29
合计	60,765.16

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	-765,707.82
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	-765,707.82

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	36,610,443.50
减：卖出股票成本总额	37,203,722.23
减：交易费用	172,429.09
买卖股票差价收入	-765,707.82

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	14.61
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	34,109.49
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	34,124.10

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	162,124.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	127,999.44
减：应计利息总额	15.71
减：交易费用	0.16
买卖债券差价收入	34,109.49

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	4,079,843.78
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	4,079,843.78

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	-36,342,313.66
股票投资	-36,342,313.66
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	-36,342,313.66

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	14,174.60
基金转换费收入	256.49
合计	14,431.09

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	903.00
银行间账户维护费	9,000.00
合计	94,205.56

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”)	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	1,602,255.23	1,704,664.16
其中：支付销售机构的客户维护费	397,531.62	488,354.39

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75%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×0.75%/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	320,451.00	340,932.76

注：支付基金托管人的托管费为按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 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固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 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

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期	30,737,250.29	58,612.13	33,941,668.54	53,737.23

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	267	14,837.19	8,018.01	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	新发未上市	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新发未上市	32.71	32.02	456	14,917.50	14,601.12	-
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新发未上市	23.20	16.14	1,040	24,123.33	16,785.60	-
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新发未上市	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
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	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301125	腾亚	2022年	6个月	新发未	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-

	精工	5月27日		上市							
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	338	10,809.24	8,875.88		-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新发未上市	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56		-
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	5,085	195,569.10	195,569.10		-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新发未上市	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36		-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新发未上市	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40		-
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新发未上市	109.04	82.76	189	20,608.56	15,641.64		-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新发未上市	30.82	21.46	530	16,334.60	11,373.80		-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新发未上市	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04		-
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	44,760	170,983.20	170,983.20		-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新发未上市	3.82	3.82	4,974	19,000.68	19,000.68		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新发未上市	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新发未上市	64.08	37.52	165	10,573.20	6,190.80		-

301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新发未 上市	76.56	51.92	286	21,896.16	14,849.12	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新发未 上市	56.88	56.42	285	16,210.80	16,079.70	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新发未 上市	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新发未 上市	35.68	29.84	476	16,983.68	14,203.84	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新发未 上市	96.97	87.82	122	11,830.64	10,714.04	-
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	332	11,281.36	9,614.72	-
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	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新发未 上市	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新发未 上市	48.59	31.38	561	27,257.12	17,604.18	-
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新发未 上市	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新发未 上市	19.18	32.07	1,251	23,994.18	40,119.57	-
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	4,526	152,299.90	152,299.90	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22	6 个月	新发未 上市	33.65	33.65	503	16,925.95	16,925.95	-

		日									
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	新发未上市	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64		-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新发未上市	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48		-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新发未上市	48.30	41.68	287	13,862.10	11,962.16		-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月	新发未上市	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02		-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新发未上市	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16		-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新发未上市	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19		-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新发未上市	28.50	34.87	513	14,620.50	17,888.31		-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新发未上市	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76		-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新发未上市	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36		-
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	392	20,395.76	22,116.64		-
688153	唯捷创芯	2022年4月1日	6个月	新发未上市	66.60	44.24	3,423	227,971.80	151,433.52		-
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	2,891	119,311.57	119,311.57		-
688270	臻镭	2022年	6个月	新发未	61.88	59.87	3,027	187,310.76	181,226.49		-

	科技	1 月 20 日		上市							
688283	坤恒顺维	2022 年 2 月 8 日	6 个月	新发未上市	33.80	45.41	1,595	53,911.00	72,428.95		-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内 (含)	新发未上市	21.93	21.93	7,550	165,571.50	165,571.50		-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程 度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督 和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制 上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理与内控合规委员会、 督察长、风险与合规管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和 其他业务部门的督察长和风险与合规管理部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检 查、监督及报告。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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	30,737,250.29	-	-	-	30,737,250.29
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	20,280.77	-	-	-	20,280.77
交易性金融资产	-	-	-	-432,216,360.90	432,216,360.90
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	250.00	-	-	122,620.78	122,870.78
其他资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	18,615.99	18,615.99
资产总计	30,757,781.06	-	-	-432,357,597.67	463,115,378.73
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	927,190.71	927,190.71
应付管理人报酬	-	-	-	269,427.74	269,427.74
应付托管费	-	-	-	53,885.55	53,885.55
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	-	-	-	878,834.07	878,834.07
负债总计	-	-	-	2,129,338.07	2,129,338.07
利率敏感度缺口	30,757,781.06	-	-	-430,228,259.60	460,986,040.66
上年度末 2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	32,852,341.41	-	-	-	32,852,341.41
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	12,249.78	-	-	-	12,249.78
交易性金融资产	-	-	-	-426,695,986.78	426,695,986.78
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	72,143.48	72,143.48
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	805.00	-	-	135,934.89	136,739.89
其他资产	-	-	-	3,477.25	3,477.25
资产总计	32,865,396.19	-	-	426,907,542.40	459,772,938.59
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	-	-	-	245,838.42	245,838.42
应付管理人报酬	-	-	-	293,374.43	293,374.43
应付托管费	-	-	-	58,674.88	58,674.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,175,536.19	1,175,536.19
负债总计	-	-	-	1,773,423.92	1,773,423.92
利率敏感度缺口	32,865,396.19	-	-	-425,134,118.48	457,999,514.67

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（上年末：同）

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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。

本基金为以完全复制为目标的被动型指数基金，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于沪深 300 指数成份股、备选成份

股的资产不低于基金资产净值的 90%，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。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	432,216,360.90	93.76	426,695,986.78	93.17
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	432,216,360.90	93.76	426,695,986.78	93.17

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%	22,557,777.98	22,666,334.22
	业绩比较基准下降 5%	-22,557,777.98	-22,666,334.22

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	430,300,423.43	423,315,769.97
第二层次	926,865.78	611,077.81
第三层次	989,071.69	2,769,139.00
合计	432,216,360.90	426,695,986.78

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	432,216,360.90	93.33
	其中：股票	432,216,360.90	93.33
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	30,737,250.29	6.64
8	其他各项资产	161,767.54	0.03
9	合计	463,115,378.73	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,271,512.90	1.14
B	采矿业	12,210,454.30	2.65
C	制造业	258,232,068.84	56.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,894,176.00	2.36
E	建筑业	8,450,301.42	1.83
F	批发和零售业	1,117,710.40	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	11,494,693.28	2.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,330,141.92	2.89
J	金融业	83,073,902.28	18.02
K	房地产业	8,126,825.60	1.76
L	租赁和商务服务业	6,090,448.30	1.32
M	科学研究和技术服务业	6,613,859.94	1.43
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	221,160.63	0.05
Q	卫生和社会工作	3,786,632.74	0.82
R	文化、体育和娱乐	514,411.20	0.11

	业		
S	综合	-	-
	合计	429,428,299.75	93.15

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,025,129.57	0.44
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	21,401.16	0.00
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	288,660.96	0.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	37,894.59	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	231,147.90	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	183,826.97	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,788,061.15	0.60

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	12,945	26,472,525.00	5.74
2	300750	宁德时代	28,900	15,432,600.00	3.35

3	600036	招商银行	255,580	10,785,476.00	2.34
4	601318	中国平安	223,632	10,441,378.08	2.27
5	601012	隆基绿能	125,124	8,337,012.12	1.81
6	000858	五粮液	40,087	8,094,767.91	1.76
7	002594	比亚迪	18,700	6,236,263.00	1.35
8	000333	美的集团	101,140	6,107,844.60	1.32
9	601166	兴业银行	300,201	5,973,999.90	1.30
10	300059	东方财富	218,268	5,544,007.20	1.20
11	600900	长江电力	234,800	5,428,576.00	1.18
12	601888	中国中免	20,118	4,686,085.74	1.02
13	603259	药明康德	42,366	4,405,640.34	0.96
14	600030	中信证券	201,498	4,364,446.68	0.95
15	600887	伊利股份	105,672	4,115,924.40	0.89
16	000568	泸州老窖	15,200	3,747,408.00	0.81
17	002415	海康威视	97,408	3,526,169.60	0.76
18	002475	立讯精密	102,400	3,460,096.00	0.75
19	600276	恒瑞医药	92,181	3,418,993.29	0.74
20	600438	通威股份	55,800	3,340,188.00	0.72
21	000651	格力电器	97,712	3,294,848.64	0.71
22	600809	山西汾酒	10,089	3,276,907.20	0.71
23	600309	万华化学	32,418	3,144,221.82	0.68
24	300760	迈瑞医疗	10,000	3,132,000.00	0.68
25	000725	京东方 A	774,419	3,051,210.86	0.66
26	002714	牧原股份	54,970	3,038,191.90	0.66
27	000001	平安银行	200,279	3,000,179.42	0.65
28	002142	宁波银行	81,754	2,927,610.74	0.64
29	000002	万科 A	140,571	2,881,705.50	0.63
30	601328	交通银行	567,220	2,824,755.60	0.61
31	002812	恩捷股份	11,100	2,779,995.00	0.60
32	601899	紫金矿业	297,592	2,776,533.36	0.60
33	002129	TCL 中环	46,700	2,750,163.00	0.60
34	000792	盐湖股份	89,700	2,687,412.00	0.58
35	002466	天齐锂业	21,300	2,658,240.00	0.58
36	603288	海天味业	28,748	2,597,669.28	0.56
37	600048	保利发展	148,300	2,589,318.00	0.56
38	603799	华友钴业	26,267	2,511,650.54	0.54
39	300124	汇川技术	38,097	2,509,449.39	0.54
40	300015	爱尔眼科	55,962	2,505,418.74	0.54
41	002460	赣锋锂业	16,650	2,475,855.00	0.54
42	600031	三一重工	122,700	2,338,662.00	0.51
43	601668	中国建筑	432,950	2,303,294.00	0.50
44	300014	亿纬锂能	23,400	2,281,500.00	0.49

45	002304	洋河股份	12,400	2,271,060.00	0.49
46	601088	中国神华	68,100	2,267,730.00	0.49
47	002352	顺丰控股	40,400	2,254,724.00	0.49
48	300498	温氏股份	104,900	2,233,321.00	0.48
49	600436	片仔癀	6,200	2,211,726.00	0.48
50	600690	海尔智家	78,140	2,145,724.40	0.47
51	600089	特变电工	78,200	2,141,898.00	0.46
52	002271	东方雨虹	41,600	2,141,152.00	0.46
53	300274	阳光电源	21,500	2,112,375.00	0.46
54	601816	京沪高铁	405,500	2,035,610.00	0.44
55	601288	农业银行	659,099	1,990,478.98	0.43
56	603986	兆易创新	13,828	1,966,479.88	0.43
57	600837	海通证券	199,300	1,955,133.00	0.42
58	600000	浦发银行	242,400	1,941,624.00	0.42
59	600016	民生银行	512,500	1,906,500.00	0.41
60	603501	韦尔股份	10,900	1,886,027.00	0.41
61	600406	国电南瑞	69,135	1,866,645.00	0.40
62	300122	智飞生物	16,500	1,831,665.00	0.40
63	601919	中远海控	130,680	1,816,452.00	0.39
64	688981	中芯国际	40,000	1,806,800.00	0.39
65	000625	长安汽车	102,573	1,776,564.36	0.39
66	600585	海螺水泥	49,574	1,748,970.72	0.38
67	600919	江苏银行	243,900	1,736,568.00	0.38
68	601688	华泰证券	121,524	1,725,640.80	0.37
69	002709	天赐材料	27,800	1,725,268.00	0.37
70	600104	上汽集团	96,437	1,717,542.97	0.37
71	601225	陕西煤业	80,083	1,696,157.94	0.37
72	000063	中兴通讯	65,700	1,677,321.00	0.36
73	002049	紫光国微	8,800	1,669,536.00	0.36
74	601601	中国太保	70,700	1,663,571.00	0.36
75	002241	歌尔股份	49,350	1,658,160.00	0.36
76	300142	沃森生物	33,100	1,601,709.00	0.35
77	002230	科大讯飞	38,400	1,582,848.00	0.34
78	600111	北方稀土	44,976	1,581,356.16	0.34
79	000661	长春高新	6,700	1,563,914.00	0.34
80	002459	晶澳科技	19,320	1,524,348.00	0.33
81	002371	北方华创	5,400	1,496,448.00	0.32
82	688599	天合光能	22,400	1,461,600.00	0.32
83	002179	中航光电	22,960	1,453,827.20	0.32
84	300450	先导智能	22,600	1,427,868.00	0.31
85	601988	中国银行	435,171	1,418,657.46	0.31
86	601211	国泰君安	93,084	1,414,876.80	0.31

87	002027	分众传媒	208,672	1,404,362.56	0.30
88	000338	潍柴动力	112,004	1,396,689.88	0.30
89	000100	TCL 科技	289,700	1,387,663.00	0.30
90	601169	北京银行	305,600	1,387,424.00	0.30
91	600660	福耀玻璃	33,100	1,383,911.00	0.30
92	601229	上海银行	205,353	1,345,062.15	0.29
93	601985	中国核电	194,600	1,334,956.00	0.29
94	600050	中国联通	383,900	1,328,294.00	0.29
95	600745	闻泰科技	15,400	1,310,694.00	0.28
96	601766	中国中车	251,126	1,305,855.20	0.28
97	601390	中国中铁	212,018	1,301,790.52	0.28
98	600893	航发动力	27,486	1,250,887.86	0.27
99	601669	中国电建	157,900	1,242,673.00	0.27
100	300347	泰格医药	10,808	1,236,975.60	0.27
101	603659	璞泰来	14,400	1,215,360.00	0.26
102	601658	邮储银行	224,600	1,210,594.00	0.26
103	000776	广发证券	61,100	1,142,570.00	0.25
104	600009	上海机场	19,900	1,128,330.00	0.24
105	600028	中国石化	276,200	1,126,896.00	0.24
106	600905	三峡能源	177,300	1,115,217.00	0.24
107	601009	南京银行	106,404	1,108,729.68	0.24
108	600019	宝钢股份	183,944	1,107,342.88	0.24
109	600010	包钢股份	470,600	1,105,910.00	0.24
110	600999	招商证券	76,600	1,103,806.00	0.24
111	600958	东方证券	107,900	1,101,659.00	0.24
112	600196	复星医药	24,863	1,096,209.67	0.24
113	300896	爱美客	1,800	1,080,018.00	0.23
114	002410	广联达	19,700	1,072,468.00	0.23
115	601628	中国人寿	34,374	1,068,343.92	0.23
116	601857	中国石油	200,600	1,063,180.00	0.23
117	600570	恒生电子	24,160	1,051,926.40	0.23
118	000895	双汇发展	35,729	1,046,859.70	0.23
119	601818	光大银行	341,542	1,028,041.42	0.22
120	002311	海大集团	17,100	1,026,171.00	0.22
121	002050	三花智控	37,100	1,019,508.00	0.22
122	600760	中航沈飞	16,220	980,499.00	0.21
123	300759	康龙化成	10,200	971,244.00	0.21
124	600346	恒力石化	43,580	969,219.20	0.21
125	002493	荣盛石化	62,750	965,722.50	0.21
126	601633	长城汽车	25,400	940,816.00	0.20
127	002074	国轩高科	20,600	939,360.00	0.20
128	300661	圣邦股份	5,100	928,302.00	0.20

129	600926	杭州银行	61,200	916,776.00	0.20
130	300496	中科创达	7,000	913,360.00	0.20
131	600460	士兰微	17,500	910,000.00	0.20
132	300316	晶盛机电	13,300	898,947.00	0.20
133	600426	华鲁恒升	30,700	896,440.00	0.19
134	000538	云南白药	14,820	894,979.80	0.19
135	688012	中微公司	7,600	887,300.00	0.19
136	300782	卓胜微	6,560	885,600.00	0.19
137	001979	招商蛇口	65,470	879,262.10	0.19
138	601989	中国重工	235,400	873,334.00	0.19
139	002001	新和成	38,248	872,436.88	0.19
140	002821	凯莱英	3,000	867,000.00	0.19
141	000768	中航西飞	28,600	866,294.00	0.19
142	600176	中国巨石	49,548	862,630.68	0.19
143	000596	古井贡酒	3,400	848,844.00	0.18
144	002202	金风科技	57,034	844,103.20	0.18
145	002920	德赛西威	5,700	843,600.00	0.18
146	603993	洛阳钼业	145,900	836,007.00	0.18
147	000963	华东医药	18,040	814,686.40	0.18
148	601006	大秦铁路	122,800	809,252.00	0.18
149	601138	工业富联	82,000	806,880.00	0.18
150	600763	通策医疗	4,600	802,424.00	0.17
151	000166	申万宏源	186,109	798,407.61	0.17
152	600584	长电科技	29,400	793,800.00	0.17
153	601877	正泰电器	22,150	792,527.00	0.17
154	300207	欣旺达	24,800	783,680.00	0.17
155	601377	兴业证券	110,600	779,730.00	0.17
156	601066	中信建投	26,800	774,788.00	0.17
157	600588	用友网络	35,500	770,705.00	0.17
158	601600	中国铝业	162,000	769,500.00	0.17
159	688111	金山办公	3,900	768,768.00	0.17
160	600029	南方航空	104,700	765,357.00	0.17
161	600600	青岛啤酒	7,300	758,616.00	0.16
162	600383	金地集团	55,900	751,296.00	0.16
163	600085	同仁堂	14,200	750,896.00	0.16
164	601186	中国铁建	95,003	750,523.70	0.16
165	600741	华域汽车	32,513	747,799.00	0.16
166	600188	兖矿能源	18,900	746,172.00	0.16
167	601838	成都银行	44,700	741,126.00	0.16
168	600132	重庆啤酒	5,000	733,000.00	0.16
169	000786	北新建材	20,972	726,050.64	0.16
170	688005	容百科技	5,600	724,864.00	0.16

171	603806	福斯特	11,000	720,720.00	0.16
172	600795	国电电力	184,100	719,831.00	0.16
173	601111	中国国航	61,700	716,337.00	0.16
174	300408	三环集团	23,700	713,370.00	0.15
175	601117	中国化学	75,700	712,337.00	0.15
176	000876	新希望	46,500	711,450.00	0.15
177	603019	中科曙光	24,180	701,703.60	0.15
178	600150	中国船舶	36,900	700,362.00	0.15
179	601238	广汽集团	45,640	695,553.60	0.15
180	600547	山东黄金	37,275	691,824.00	0.15
181	300751	迈为股份	1,400	687,260.00	0.15
182	003816	中国广核	243,600	682,080.00	0.15
183	601800	中国交建	72,800	675,584.00	0.15
184	601100	恒立液压	10,800	666,576.00	0.14
185	600989	宝丰能源	45,400	665,110.00	0.14
186	300999	金龙鱼	12,300	664,446.00	0.14
187	603369	今世缘	13,000	663,000.00	0.14
188	600015	华夏银行	127,100	662,191.00	0.14
189	300763	锦浪科技	3,100	660,300.00	0.14
190	600886	国投电力	61,600	646,800.00	0.14
191	688396	华润微	10,900	643,863.00	0.14
192	002648	卫星化学	24,800	641,080.00	0.14
193	600011	华能国际	90,800	639,232.00	0.14
194	601788	光大证券	40,300	635,128.00	0.14
195	601868	中国能建	267,800	634,686.00	0.14
196	000157	中联重科	102,485	631,307.60	0.14
197	300601	康泰生物	13,920	628,905.60	0.14
198	603185	上机数控	4,000	623,960.00	0.14
199	000301	东方盛虹	36,800	622,288.00	0.13
200	600115	中国东航	113,100	620,919.00	0.13
201	000425	徐工机械	113,246	610,395.94	0.13
202	002236	大华股份	37,100	609,182.00	0.13
203	300595	欧普康视	10,600	606,214.00	0.13
204	002601	龙佰集团	29,500	591,475.00	0.13
205	002555	三七互娱	27,500	583,825.00	0.13
206	002008	大族激光	17,400	576,462.00	0.13
207	603486	科沃斯	4,700	572,883.00	0.12
208	601916	浙商银行	172,500	572,700.00	0.12
209	603833	欧派家居	3,800	572,584.00	0.12
210	000938	紫光股份	29,500	572,300.00	0.12
211	300628	亿联网络	7,500	571,125.00	0.12
212	601901	方正证券	85,000	570,350.00	0.12

213	603392	万泰生物	3,670	569,951.00	0.12
214	002736	国信证券	59,500	569,415.00	0.12
215	688008	澜起科技	9,330	565,211.40	0.12
216	600941	中国移动	9,300	562,650.00	0.12
217	000977	浪潮信息	21,000	556,080.00	0.12
218	601336	新华保险	17,200	553,668.00	0.12
219	000069	华侨城 A	84,700	549,703.00	0.12
220	600352	浙江龙盛	53,700	546,666.00	0.12
221	600219	南山铝业	148,000	546,120.00	0.12
222	603290	斯达半导	1,400	540,260.00	0.12
223	601995	中金公司	12,100	538,329.00	0.12
224	300454	深信服	5,100	529,278.00	0.11
225	002841	视源股份	6,900	519,708.00	0.11
226	603260	合盛硅业	4,400	519,024.00	0.11
227	688126	沪硅产业	22,500	517,050.00	0.11
228	601618	中国中冶	147,400	515,900.00	0.11
229	002007	华兰生物	22,603	515,348.40	0.11
230	300413	芒果超媒	15,420	514,411.20	0.11
231	600845	宝信软件	9,380	512,148.00	0.11
232	002120	韵达股份	30,000	511,800.00	0.11
233	300529	健帆生物	10,000	508,900.00	0.11
234	601360	三六零	59,000	502,680.00	0.11
235	601799	星宇股份	2,900	495,900.00	0.11
236	002252	上海莱士	83,480	495,036.40	0.11
237	300003	乐普医疗	26,100	484,677.00	0.11
238	603882	金域医学	5,800	478,790.00	0.10
239	000703	恒逸石化	45,390	477,048.90	0.10
240	601155	新城控股	18,700	475,541.00	0.10
241	300919	中伟股份	3,800	470,820.00	0.10
242	600332	白云山	14,500	458,055.00	0.10
243	601878	浙商证券	40,000	455,200.00	0.10
244	688036	传音控股	5,100	455,073.00	0.10
245	300433	蓝思科技	41,100	454,977.00	0.10
246	002602	世纪华通	92,336	445,059.52	0.10
247	601021	春秋航空	7,600	443,460.00	0.10
248	600489	中金黄金	60,000	443,400.00	0.10
249	600918	中泰证券	57,500	439,875.00	0.10
250	002938	鹏鼎控股	14,400	435,024.00	0.09
251	000066	中国长城	40,000	432,800.00	0.09
252	603899	晨光股份	7,700	431,816.00	0.09
253	300223	北京君正	4,000	425,000.00	0.09
254	300033	同花顺	4,400	423,060.00	0.09

255	000708	中信特钢	20,800	419,120.00	0.09
256	601728	中国电信	112,200	418,506.00	0.09
257	600183	生益科技	23,900	406,061.00	0.09
258	601865	福莱特	10,500	400,050.00	0.09
259	002916	深南电路	4,240	397,330.40	0.09
260	600018	上港集团	67,316	392,452.28	0.09
261	601898	中煤能源	37,800	392,364.00	0.09
262	600362	江西铜业	21,399	381,544.17	0.08
263	688169	石头科技	600	370,020.00	0.08
264	300957	贝泰妮	1,700	369,801.00	0.08
265	002791	坚朗五金	2,700	350,244.00	0.08
266	002414	高德红外	27,180	349,806.60	0.08
267	600161	天坛生物	14,200	344,776.00	0.07
268	601216	君正集团	69,700	340,136.00	0.07
269	600061	国投资本	53,044	337,359.84	0.07
270	601319	中国人保	66,000	333,960.00	0.07
271	002568	百润股份	10,920	328,036.80	0.07
272	000408	藏格矿业	9,800	322,812.00	0.07
273	688561	奇安信	5,700	318,060.00	0.07
274	600606	绿地控股	79,170	313,513.20	0.07
275	601966	玲珑轮胎	12,300	312,051.00	0.07
276	600655	豫园股份	32,100	303,024.00	0.07
277	601998	中信银行	63,300	300,675.00	0.07
278	002600	领益智造	58,400	293,168.00	0.06
279	603160	汇顶科技	4,700	291,071.00	0.06
280	688065	凯赛生物	2,600	290,680.00	0.06
281	688363	华熙生物	2,000	284,360.00	0.06
282	600025	华能水电	37,200	260,028.00	0.06
283	002064	华峰化学	30,700	259,108.00	0.06
284	601881	中国银河	26,600	257,222.00	0.06
285	603195	公牛集团	1,600	244,656.00	0.05
286	300866	安克创新	3,400	225,488.00	0.05
287	002607	中公教育	38,197	221,160.63	0.05
288	603087	甘李药业	4,600	220,662.00	0.05
289	002032	苏泊尔	3,300	185,922.00	0.04
290	000800	一汽解放	19,200	179,328.00	0.04
291	601236	红塔证券	19,500	178,035.00	0.04
292	601808	中海油服	12,200	170,190.00	0.04
293	605499	东鹏饮料	900	153,774.00	0.03
294	000877	天山股份	12,500	153,750.00	0.03
295	300979	华利集团	1,900	138,852.00	0.03
296	601825	沪农商行	19,900	124,773.00	0.03

297	601698	中国卫通	9,100	102,921.00	0.02
298	001289	龙源电力	3,100	67,456.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688297	中无人机	8,790	467,452.20	0.10
2	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.05
3	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.05
4	301175	中科环保	49,734	189,983.88	0.04
5	688270	臻镭科技	3,027	181,226.49	0.04
6	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.04
7	301239	普瑞眼科	5,029	169,225.85	0.04
8	688400	凌云光	7,550	165,571.50	0.04
9	688153	唯捷创芯	3,423	151,433.52	0.03
10	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.03
11	688283	坤恒顺维	1,595	72,428.95	0.02
12	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
13	301238	瑞泰新材	1,251	40,119.57	0.01
14	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
15	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.01
16	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.01
17	301302	华如科技	392	22,116.64	0.00
18	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
19	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
20	301268	铭利达	513	17,888.31	0.00
21	301236	软通动力	561	17,604.18	0.00
22	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
23	301109	军信股份	1,040	16,785.60	0.00
24	301207	华兰疫苗	285	16,079.70	0.00
25	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
26	301150	中一科技	189	15,641.64	0.00
27	301200	大族数控	286	14,849.12	0.00
28	301103	何氏眼科	456	14,601.12	0.00
29	301216	万凯新材	476	14,203.84	0.00
30	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
31	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
32	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
33	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
34	301258	富士莱	287	11,962.16	0.00
35	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
36	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00

37	301151	冠龙节能	530	11,373.80	0.00
38	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
39	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
40	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
41	301219	腾远钴业	122	10,714.04	0.00
42	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
43	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
44	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
45	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
46	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
47	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
48	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
49	300834	星辉环材	267	8,018.01	0.00
50	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
51	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
52	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
53	301196	唯科科技	165	6,190.80	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	000792	盐湖股份	2,856,647.00	0.62
2	600519	贵州茅台	2,264,040.90	0.49
3	600089	特变电工	1,991,230.00	0.43
4	300750	宁德时代	1,412,342.00	0.31
5	600036	招商银行	1,210,817.08	0.26
6	600958	东方证券	1,133,802.00	0.25
7	601318	中国平安	1,106,329.00	0.24
8	300661	圣邦股份	920,015.00	0.20
9	002074	国轩高科	917,317.00	0.20
10	002142	宁波银行	896,735.00	0.20
11	300496	中科创达	836,672.00	0.18
12	002920	德赛西威	823,620.00	0.18
13	600030	中信证券	816,916.99	0.18
14	600460	士兰微	809,627.00	0.18
15	600887	伊利股份	803,123.00	0.18
16	600188	兖矿能源	796,486.00	0.17
17	000725	京东方 A	783,753.00	0.17
18	601117	中国化学	781,959.00	0.17
19	300207	欣旺达	748,607.00	0.16
20	000858	五粮液	716,582.00	0.16

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	600887	伊利股份	1,291,801.81	0.28
2	002142	宁波银行	1,020,443.30	0.22
3	600958	东方证券	836,546.00	0.18
4	688348	昱能科技	600,010.00	0.13
5	600519	贵州茅台	557,508.00	0.12
6	300408	三环集团	548,776.00	0.12
7	301215	中汽股份	477,993.60	0.10
8	000783	长江证券	473,350.00	0.10
9	688119	中钢洛耐	468,244.35	0.10
10	601108	财通证券	439,296.00	0.10
11	600109	国金证券	436,855.60	0.10
12	601607	上海医药	432,400.27	0.09
13	300144	宋城演艺	410,277.00	0.09
14	301238	瑞泰新材	402,964.80	0.09
15	688223	晶科能源	399,754.14	0.09
16	601696	中银证券	385,378.00	0.08
17	601990	南京证券	373,258.00	0.08
18	603517	绝味食品	365,163.00	0.08
19	603939	益丰药房	349,148.00	0.08
20	600143	金发科技	348,683.00	0.08

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	79,066,410.01
卖出股票收入（成交）总额	36,610,443.50

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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	20,280.77
2	应收清算款	18,615.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	122,870.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	161,767.54

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301139	元道通信	217,337.46	0.05	新发未上市
2	301175	中科环保	189,983.88	0.04	新发未上市
3	688270	臻镭科技	181,226.49	0.04	新发未上市
4	301112	信邦智能	17,970.96	0.00	新发未上市

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 (%)
20,021	13,588.05	39,934,648.25	14.68	232,111,746.86	85.32

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	黄艳	691,814.00	22.78
2	赵新霞	240,180.00	7.91
3	李晓年	197,689.00	6.51
4	邱桂芳	165,796.00	5.46
5	杨灿	143,525.00	4.73
6	郭念发	121,054.00	3.99
7	何剑虹	108,976.00	3.59
8	陈倩	61,049.00	2.01

9	杨利萍	53,800.00	1.77
10	李亚锋	52,839.00	1.74

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	5,234.62	0.00

8.4 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 (2009 年 11 月 5 日) 基金份额总额	5,326,413,369.61
本报告期期初基金份额总额	249,496,612.00
本报告期基金总申购份额	37,503,381.48
减：本报告期基金总赎回份额	14,953,598.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	272,046,395.11

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无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	1	57,039,075.87	55.85	52,234.53	55.44	-
浙商证券	1	45,089,280.23	44.15	41,991.56	44.56	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	4	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

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

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

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

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

（4）佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	290,124.80	100.00	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信华南	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

证券						
----	--	--	--	--	--	--

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增东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
2	建信基金管理有限责任公司关于新增创金启富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 02 月 11 日
3	关于新增天风证券股份有限公司为建信旗下部分公募基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 01 月 25 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 设立的文件；
- 2、《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 4、《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 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