

# 建信中证 500 指数增强型证券投资基金 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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
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	16
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	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>52</b>
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69

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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
7.12 投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>71</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
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 .....	72
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>72</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>73</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	73
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 .....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
10.4 基金投资策略的改变 .....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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 .....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	74
10.8 其他重大事件 .....	77
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>77</b>
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 .....	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	77
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>78</b>
12.1 备查文件目录 .....	78
12.2 存放地点 .....	78
12.3 查阅方式 .....	78

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	建信中证 500 指数增强	
基金主代码	000478	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 1 月 27 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,950,716,429.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	000478	005633
报告期末下属分级基金的份额总额	1,820,972,382.83 份	129,744,046.48 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p>
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

## 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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	姜敏
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		400-81-95533      010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100033	100020
法定代表人		孙志晨	朱鹤新

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	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
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 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	-490,988,475.76	-33,313,906.95
本期利润	-411,891,038.41	-19,005,073.32
加权平均基金份额本期利润	-0.2347	-0.1623
本期加权平均净	-8.32%	-5.90%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	-7.94%	-8.17%
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	3,494,920,844.98	240,696,906.83
期末可供分配基金份额利润	1.9193	1.8552
期末基金资产净值	5,353,048,050.97	373,105,771.61
期末基金份额净值	2.9397	2.8757
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	193.97%	21.18%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.73%	1.05%	6.74%	1.05%	1.99%	0.00%
过去三个月	3.85%	1.66%	1.99%	1.66%	1.86%	0.00%

过去六个月	-7.94%	1.54%	-11.65%	1.55%	3.71%	-0.01%
过去一年	0.88%	1.32%	-4.83%	1.26%	5.71%	0.06%
过去三年	51.19%	1.33%	29.13%	1.28%	22.06%	0.05%
自基金合同生效起 至今	193.97%	1.61%	64.54%	1.57%	129.43 %	0.04%

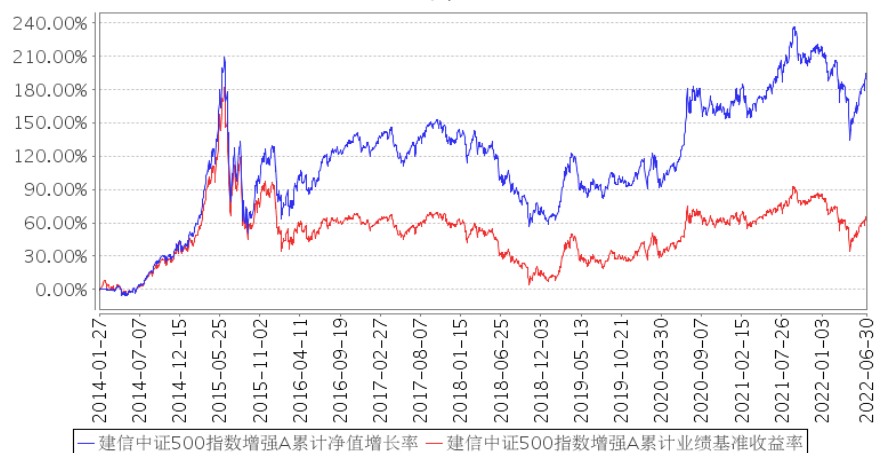
建信中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①—③	②—④
过去一个月	8.69%	1.04%	6.74%	1.05%	1.95%	-0.01%
过去三个月	3.72%	1.66%	1.99%	1.66%	1.73%	0.00%
过去六个月	-8.17%	1.54%	-11.65%	1.55%	3.48%	-0.01%
过去一年	0.38%	1.32%	-4.83%	1.26%	5.21%	0.06%
过去三年	48.92%	1.33%	29.13%	1.28%	19.79%	0.05%
自基金合同生效起 至今	21.18%	1.40%	5.38%	1.37%	15.80%	0.03%

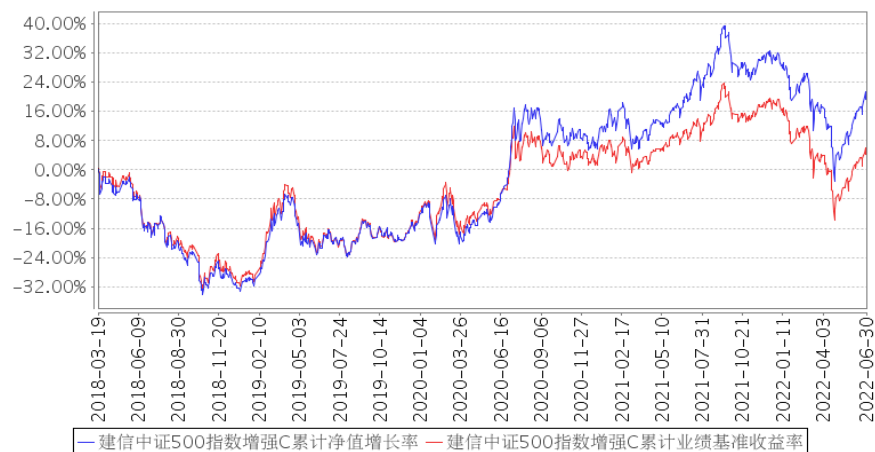


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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		
叶乐天	金融工程及指数投资部副总	2014 年 1 月 27 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、

<p>经理， 本基金的 基金经理</p>				<p>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。</p>
------------------------------	--	--	--	--

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《建信中证 500 指数增强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

本基金为指数增强型基金，管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型进行指数增强和风险管理。本基金自成立以来一直严格控制与标的指数的行业偏离和风格偏离，在个股选择上进行了一定的主动暴露。由于基金规模相对较大，基金管理人采用分散持仓、适当降低换手率、采用算法交易等方式尽量降低交易成本，同时对风险事件进行实时监控，以尽量避免踩雷风险。报告期内指数波动较大，超额收益的波动也相对放大，但整体保持了较为稳定且显著的超额收益，把最大回撤控制在很小的幅度内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率-7.94%，波动率 1.54%，业绩比较基准收益率-11.65%，波动率 1.55%。本报告期本基金 C 净值增长率-8.17%，波动率 1.54%，业绩比较基准收益率-11.65%，波动率 1.55%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在报告期间，市场整体波动较大。一季度受国内疫情以及俄乌战争等因素影响，市场有较大

跌幅，尤其以成长股以及前期赛道股跌幅较大，受通胀因素影响，周期股表现相对较好。五一后，在疫情缓解以及稳增长政策的刺激下，市场收复大部分失地，市场情绪恢复明显，到六月份，在中证 1000 股指期货及期权推出的消息带动下，以中证 1000 为代表的中小市值股票涨幅相对靠前。展望 2022 年下半年，市场的结构性行情预计会更加明显，随着衍生品工具的推出，以中证 1000 为代表的中小市值板块预计会带来更多增量资金，同时会带动市场风格继续从大盘股向中小盘股转变，中小市值指数的 beta 预计相对会更好一些。但另一方面，市场对相关个股的关注度会更高，研究会更深入，带来的是市场有效性的进一步提升，使得 alpha 获取的难度也会有所增加。

#### 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关

法律法规、基金合同和托管协议的规定，对建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年上半年的基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为

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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司在建信中证 500 指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	298,070,355.41	316,238,304.65
结算备付金		587,519,453.64	469,074,041.22
存出保证金		79,505,838.05	32,307,704.38
交易性金融资产	6.4.7.2	4,801,854,227.77	4,498,304,051.59
其中：股票投资		4,801,854,227.77	4,493,375,116.41
基金投资		-	-
债券投资		-	4,928,935.18
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,313,453.36	5,619,180.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	323,961.72
资产总计		5,771,263,328.23	5,321,867,243.96
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
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		36,965.94	102,470,779.34
应付赎回款		12,272,813.82	9,164,898.21
应付管理人报酬		4,518,756.36	4,233,052.28
应付托管费		903,751.27	846,610.46
应付销售服务费		147,053.36	84,703.83
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	51,165.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	27,230,164.90	23,659,139.70
负债合计		45,109,505.65	140,510,349.22
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,950,716,429.31	1,624,363,553.68
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,775,437,393.27	3,556,993,341.06
净资产合计		5,726,153,822.58	5,181,356,894.74
负债和净资产总计		5,771,263,328.23	5,321,867,243.96

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,950,716,429.31 份，其中建信中证 500 指数增强 A 基金份额总额 1,820,972,382.83 份，基金份额净值 2.9397 元；建信中证 500 指数增强 C 基金份额总额 129,744,046.48 份，基金份额净值 2.8757 元。

（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：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

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 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
<b>一、营业总收入</b>		-398,248,525.14	539,248,754.23
1. 利息收入		5,197,864.84	3,544,082.60
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,197,864.84	3,535,757.21
债券利息收入		-	8,325.39
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）		-497,550,490.84	380,345,107.22
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-531,037,974.14	333,752,264.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	777,531.94	65,765.69
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-23,639,608.95	18,813,193.19
股利收益	6.4.7.19	56,349,560.31	27,713,883.42
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	93,406,270.98	153,993,663.96
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	697,829.88	1,365,900.45
<b>减：二、营业总支出</b>		32,647,586.59	52,690,665.18
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,089,231.34	21,822,504.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,217,846.27	4,364,500.87
3. 销售服务费		795,547.84	284,337.87

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		4,705.80	94,857.36
8. 其他费用	6.4.7.23	540,255.34	26,124,465.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-430,896,111.73	486,558,089.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-430,896,111.73	486,558,089.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-430,896,111.73	486,558,089.05

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：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

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)	1,624,363,553.68	-	3,556,993,341.06	5,181,356,894.74
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)	1,624,363,553.68	-	3,556,993,341.06	5,181,356,894.74

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	326,352,875.63	-	218,444,052.21	544,796,927.84
(一)、综合收益总额	-	-	-430,896,111.73	-430,896,111.73
(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)	326,352,875.63	-	649,340,163.94	975,693,039.57
其中:1.基金申购款	617,868,877.53	-	1,169,343,425.72	1,787,212,303.25
2.基金赎回款	-291,516,001.90	-	-520,003,261.78	-811,519,263.68
(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	1,950,716,429.31	-	3,775,437,393.27	5,726,153,822.58

金净值)				
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)	1,829,936,022.65	-	2,965,062,254.53	4,794,998,277.18
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)	1,829,936,022.65	-	2,965,062,254.53	4,794,998,277.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-249,158,884.30	-	58,704,578.65	-190,454,305.65
(一)、综合收益总额	-	-	486,558,089.05	486,558,089.05
(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)	-249,158,884.30	-	-427,853,510.40	-677,012,394.70
其中:1. 基金申购款	335,459,129.54	-	578,055,526.73	913,514,656.27
2. 基金赎回	-584,618,013.84	-	-1,005,909,037.13	-1,590,527,050.97

回款				
(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)	1,580,777,138.35	-	3,023,766,833.18	4,604,543,971.53

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

建信中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]615 号《关于核准建信中证 500 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 308,106,805.84 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2014）第 039 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2014 年 1 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 308,165,342.91 份基金份额，其中认购资金利息折合

58,537.07 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《建信中证 500 指数增强型证券投资基金新增 C 类基金份额及修改基金合同的公告》并报证监会备案，本基金于 2018 年 3 月 16 日起根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同，将本基金基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。2018 年 3 月 16 日前原有的基金份额在开放申购赎回后，全部转换为建信中证 500 指数增强 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数增强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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为不低于 90%，其中投资于中证 500 成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为 95%×中证 500 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税前）。

#### 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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，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 316,238,304.65 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 57,616.16 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 316,295,920.81 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 469,074,041.22 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 265,846.48 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 469,339,887.70 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 32,307,704.38 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 391.05 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 32,308,095.43 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 323,961.72 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 57,616.16 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 265,846.48 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 391.05 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 108.03 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 4,498,304,051.59 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 108.03 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 4,498,304,159.62 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	298,070,355.41
等于：本金	298,012,055.28
加：应计利息	58,300.13
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	298,070,355.41

##### 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	4,572,608,295.71	-	4,801,854,227.77	229,245,932.06
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	4,572,608,295.71	-	4,801,854,227.77	229,245,932.06

## 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	543,490,650.86	-	-	
其中：股指期货投资	543,490,650.86	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	543,490,650.86	-	-	

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2207	IC2207	436.00	561,097,120.00	17,606,469.14
合计				17,606,469.14
减：可抵销期货暂收款				17,606,469.14
净额				-

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------



应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	26,086.97
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	26,376,221.86
其中：交易所市场	26,376,221.86
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	614,260.13
预提费用	213,595.94
合计	27,230,164.90

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 建信中证 500 指数增强 A

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	1,532,162,483.85	1,532,162,483.85
本期申购	558,126,917.52	558,126,917.52
本期赎回（以“-”号填列）	-269,317,018.54	-269,317,018.54
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	1,820,972,382.83	1,820,972,382.83

##### 建信中证 500 指数增强 C

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	92,201,069.83	92,201,069.83
本期申购	59,741,960.01	59,741,960.01
本期赎回（以“-”号填列）	-22,198,983.36	-22,198,983.36
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	129,744,046.48	129,744,046.48

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

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

建信中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,361,982,152.40	-1,521,795.99	3,360,460,356.41
本期利润	-490,988,475.76	79,097,437.35	-411,891,038.41
本期基金份额交易产生的变动数	623,927,168.34	-40,420,818.20	583,506,350.14
其中：基金申购款	1,176,300,791.61	-112,755,531.07	1,063,545,260.54
基金赎回款	-552,373,623.27	72,334,712.87	-480,038,910.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,494,920,844.98	37,154,823.16	3,532,075,668.14

建信中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	196,521,024.07	11,960.58	196,532,984.65
本期利润	-33,313,906.95	14,308,833.63	-19,005,073.32
本期基金份额交易产生的变动数	77,489,789.71	-11,655,975.91	65,833,813.80
其中：基金申购款	121,838,942.99	-16,040,777.81	105,798,165.18
基金赎回款	-44,349,153.28	4,384,801.90	-39,964,351.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	240,696,906.83	2,664,818.30	243,361,725.13

## 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	1,059,336.27
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	4,120,907.68
其他	17,620.89
合计	5,197,864.84

## 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	-531,037,974.14
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	-531,037,974.14
----	-----------------

#### 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	8,716,266,338.29
减：卖出股票成本总额	9,220,351,584.43
减：交易费用	26,952,728.00
买卖股票差价收入	-531,037,974.14

#### 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	1,380.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	776,151.59
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	777,531.94

##### 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	5,898,582.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,120,934.34
减：应计利息总额	1,490.88
减：交易费用	5.79
买卖债券差价收入	776,151.59

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-23,639,608.95

## 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	56,349,560.31
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	56,349,560.31

## 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	82,172,106.81
股票投资	82,172,106.81
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	11,234,164.17
权证投资	-
期货投资	11,234,164.17
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	93,406,270.98

## 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	687,322.58

基金转换费收入	10,501.78
其他	5.52
合计	697,829.88

#### 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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,731.64
指数使用费	417,427.76
银行间账户维护费	9,000.00
合计	540,255.34

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	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	26,089,231.34	21,822,504.05
其中：支付销售机构的客户维护费	9,464,132.62	8,647,930.91

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	5,217,846.27	4,364,500.87

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，

按月支付。其计算公式为：

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C	合计
建信基金	-	332,481.22	332,481.22
合计	-	332,481.22	332,481.22
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C	合计
建信基金	-	32,331.88	32,331.88
合计	-	32,331.88	32,331.88

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.5%。销售服务费的计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。



## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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
中信银行-活期	298,070,355.41	1,059,336.27	404,427,362.84	1,445,281.09

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	635	35,286.95	19,069.05	-
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	6个月	新发未上市	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-

		14 日									
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新发未上市	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	-	
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	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	108.91	82.76	404	43,997.64	33,435.04	-	
301151	冠龙节能	2022 年 3 月 30 日	6 个月	新发未上市	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-	
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	2022	6 个月	新发未上市	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-	

	股份	年 4 月 11 日		上市							
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	57,324	218,977.68	218,977.68		-
301175	中科 环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新发未 上市	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40		-
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	271	17,365.68	10,167.92		-
301200	大族 数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新发未 上市	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44		-
301207	华兰 疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新发未 上市	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98		-
301212	联盛 化学	2022 年 4 月 7 日	6 个月	新发未 上市	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48		-
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	1,120	39,961.60	33,420.80		-
301219	腾远 钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新发未 上市	96.62	87.82	578	55,847.58	50,759.96		-
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	2,076	100,865.92	65,144.88	-
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	3,497	67,072.46	112,148.79	-
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	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新发未上市	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
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	295	14,248.50	12,295.60	-
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	641	18,268.50	22,351.67	-
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个月	新发未上市	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-

		6 日								
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	466	24,245.98	26,291.72	-
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	-
600941	中国移动	2021 年 12 月 24 日	6 个月	新发未上市	57.58	60.26	87,363	5,030,361.54	5,264,494.38	-
688163	赛伦生物	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新发未上市	33.03	23.56	3,607	119,139.21	84,980.92	-
688176	亚虹医药	2021 年 12 月 29 日	6 个月	新发未上市	22.98	12.53	37,990	873,010.20	476,014.70	-
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	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内(含)	新发未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人  
出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

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	-	4,928,935.18
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	4,928,935.18

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	298,070,355.41	-	-	-	298,070,355.41
结算备付金	587,519,453.64	-	-	-	587,519,453.64
存出保证金	79,505,838.05	-	-	-	79,505,838.05
交易性金融资产	-	-	-	4,801,854,227.77	4,801,854,227.77
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				4,313,453.36	4,313,453.36
其他资产				-	-
应收证券清算款				-	-
资产总计	965,095,647.10			-4,806,167,681.13	5,771,263,328.23
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				36,965.94	36,965.94
应付赎回款				12,272,813.82	12,272,813.82
应付管理人报酬				4,518,756.36	4,518,756.36
应付托管费				903,751.27	903,751.27
应付销售服务费				147,053.36	147,053.36
应付投资顾问费				-	-
应交税费				-	-
应付利润				-	-
其他负债				27,230,164.90	27,230,164.90
负债总计				45,109,505.65	45,109,505.65
利率敏感度缺口	965,095,647.10			-4,761,058,175.48	5,726,153,822.58
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	316,238,304.65				316,238,304.65
结算备付金	469,074,041.22				469,074,041.22
存出保证金	32,307,704.38				32,307,704.38
交易性金融资产			4,928,935.18	4,493,375,116.41	4,498,304,051.59
衍生金融资产					
买入返售金融资产					
应收证券清算款					
应收股利					
应收申购款				5,619,180.40	5,619,180.40
其他资产				323,961.72	323,961.72
资产总计	817,620,050.25		4,928,935.18	4,499,318,258.53	5,321,867,243.96
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				102,470,779.34	102,470,779.34
应付赎回款				9,164,898.21	9,164,898.21
应付管理人报酬				4,233,052.28	4,233,052.28
应付托管费				846,610.46	846,610.46
应付销售服务费				84,703.83	84,703.83

应交税费	-	-	-	51,165.40	51,165.40
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	23,659,139.70	23,659,139.70
负债总计	-	-	-	140,510,349.22	140,510,349.22
利率敏感度缺口	817,620,050.25	-	4,928,935.18	4,358,807,909.31	5,181,356,894.74

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。

#### 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，按照成份股在中证 500 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。本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为不低于 90%，其中投资于中证 500 成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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	4,801,854,227.77	83.86	4,493,375,116.41	86.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	4,928,935.18	0.10
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	4,801,854,227.77	83.86	4,498,304,051.59	86.82

#### 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%	293,082,620.65	288,545,307.34
	业绩比较基准下降5%	-293,082,620.65	-288,545,307.34

#### 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	4,792,687,779.55	4,480,899,940.29
第二层次	1,126,306.41	7,464,959.73
第三层次	8,040,141.81	9,939,151.57
合计	4,801,854,227.77	4,498,304,051.59

#### 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	4,801,854,227.77	83.20
	其中：股票	4,801,854,227.77	83.20
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	885,589,809.05	15.34
8	其他各项资产	83,819,291.41	1.45
9	合计	5,771,263,328.23	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	32,151,166.00	0.56
B	采矿业	303,167,682.90	5.29
C	制造业	2,311,344,000.82	40.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88,356,024.00	1.54
E	建筑业	62,389,254.00	1.09
F	批发和零售业	94,724,929.56	1.65
G	交通运输、仓储和邮政业	134,110,437.02	2.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	281,575,680.16	4.92
J	金融业	195,843,138.67	3.42
K	房地产业	75,544,051.49	1.32
L	租赁和商务服务业	71,836,475.52	1.25
M	科学研究和技术服务业	34,837,707.80	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	24,981,684.36	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	35,691,697.30	0.62
R	文化、体育和娱乐业	78,095,286.18	1.36
S	综合	52,406,971.26	0.92
	合计	3,877,056,187.04	67.71

### 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	40,140,093.44	0.70
C	制造业	665,430,308.02	11.62

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,100,023.08	0.21
E	建筑业	13,855,329.00	0.24
F	批发和零售业	8,674,473.16	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	25,445,343.00	0.44
H	住宿和餐饮业	9,041,519.96	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,420,654.27	1.06
J	金融业	17,663,573.00	0.31
K	房地产业	7,712,061.93	0.13
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	24,845,534.56	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	16,064,403.62	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,859,614.69	0.10
R	文化、体育和娱乐业	17,545,109.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	924,798,040.73	16.15

### 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	600566	济川药业	2,752,390	74,754,912.40	1.31
2	600256	广汇能源	6,843,270	72,128,065.80	1.26
3	002557	洽洽食品	1,105,348	62,927,461.64	1.10
4	000519	中兵红箭	2,155,200	62,824,080.00	1.10
5	601615	明阳智能	1,671,700	56,503,460.00	0.99
6	300363	博腾股份	718,500	56,035,815.00	0.98
7	603456	九洲药业	1,057,100	54,652,070.00	0.95
8	600673	东阳光	5,829,474	52,406,971.26	0.92

9	600392	盛和资源	2,301,534	52,014,668.40	0.91
10	600141	兴发集团	1,180,214	51,917,613.86	0.91
11	000960	锡业股份	2,917,200	48,921,444.00	0.85
12	300017	网宿科技	8,595,036	46,069,392.96	0.80
13	600522	中天科技	1,924,100	44,446,710.00	0.78
14	600259	广晟有色	864,200	43,771,730.00	0.76
15	600867	通化东宝	4,058,310	41,962,925.40	0.73
16	300182	捷成股份	7,436,000	40,898,000.00	0.71
17	600563	法拉电子	193,026	39,601,214.16	0.69
18	000630	铜陵有色	11,600,900	37,818,934.00	0.66
19	300390	天华超净	427,700	37,380,980.00	0.65
20	603317	天味食品	1,295,380	36,879,468.60	0.64
21	600901	江苏租赁	7,121,630	36,533,961.90	0.64
22	002497	雅化集团	1,116,900	36,466,785.00	0.64
23	300482	万孚生物	879,200	35,792,232.00	0.63
24	002756	永兴材料	234,700	35,723,687.00	0.62
25	300244	迪安诊断	1,147,643	35,691,697.30	0.62
26	603127	昭衍新药	306,131	34,837,707.80	0.61
27	000970	中科三环	1,815,516	34,095,390.48	0.60
28	000887	中鼎股份	1,865,535	34,027,358.40	0.59
29	600348	华阳股份	2,146,300	33,181,798.00	0.58
30	600863	内蒙华电	8,957,900	32,696,335.00	0.57
31	601636	旗滨集团	2,502,536	31,907,334.00	0.56
32	603613	国联股份	358,170	31,733,862.00	0.55
33	600233	圆通速递	1,536,141	31,321,914.99	0.55
34	603198	迎驾贡酒	462,700	30,140,278.00	0.53
35	000629	攀钢钒钛	7,874,442	29,922,879.60	0.52
36	000999	华润三九	654,043	29,431,935.00	0.51
37	000402	金融街	4,929,600	29,331,120.00	0.51
38	603868	飞科电器	384,069	29,093,226.75	0.51
39	600486	扬农化工	206,200	27,482,336.00	0.48
40	600390	五矿资本	5,565,900	27,217,251.00	0.48
41	002212	天融信	2,674,500	27,146,175.00	0.47
42	600642	申能股份	4,770,100	27,094,168.00	0.47
43	000987	越秀金控	3,809,425	26,780,257.75	0.47
44	300630	普利制药	757,400	26,622,610.00	0.46
45	600765	中航重机	826,260	26,589,046.80	0.46
46	002572	索菲亚	939,234	25,828,935.00	0.45
47	002002	鸿达兴业	6,942,700	25,757,417.00	0.45
48	000553	安道麦 A	2,121,649	25,693,169.39	0.45
49	601828	美凯龙	4,234,800	25,662,888.00	0.45
50	601577	长沙银行	3,210,853	25,462,064.29	0.44

51	600039	四川路桥	2,413,200	25,410,996.00	0.44
52	600885	宏发股份	603,577	25,259,697.45	0.44
53	601872	招商轮船	4,347,054	25,039,031.04	0.44
54	000559	万向钱潮	4,176,535	24,808,617.90	0.43
55	601869	长飞光纤	766,300	23,693,996.00	0.41
56	002078	太阳纸业	1,904,093	23,439,384.83	0.41
57	601717	郑煤机	1,611,500	23,221,715.00	0.41
58	600623	华谊集团	2,777,800	23,055,740.00	0.40
59	600155	华创阳安	2,686,648	22,782,775.04	0.40
60	603589	口子窖	386,587	22,657,864.07	0.40
61	002745	木林森	2,297,197	22,443,614.69	0.39
62	000937	冀中能源	2,978,835	22,222,109.10	0.39
63	002299	圣农发展	1,156,300	22,177,834.00	0.39
64	603883	老百姓	649,281	21,997,640.28	0.38
65	000878	云南铜业	1,922,400	21,896,136.00	0.38
66	000983	山西焦煤	1,632,000	21,852,480.00	0.38
67	688099	晶晨股份	213,147	21,527,847.00	0.38
68	600299	安迪苏	2,246,300	21,519,554.00	0.38
69	002468	申通快递	1,789,100	21,326,072.00	0.37
70	002387	维信诺	3,151,200	21,176,064.00	0.37
71	002004	华邦健康	3,635,400	20,285,532.00	0.35
72	601992	金隅集团	7,268,800	20,134,576.00	0.35
73	002384	东山精密	873,300	20,024,769.00	0.35
74	601000	唐山港	7,546,900	19,471,002.00	0.34
75	002506	协鑫集成	5,232,200	19,463,784.00	0.34
76	601958	金钼股份	2,198,300	19,432,972.00	0.34
77	002019	亿帆医药	1,385,400	19,367,892.00	0.34
78	600373	中文传媒	1,902,682	19,007,793.18	0.33
79	002191	劲嘉股份	1,754,700	18,810,384.00	0.33
80	000997	新大陆	1,423,100	18,799,151.00	0.33
81	002268	卫士通	431,700	18,524,247.00	0.32
82	600985	淮北矿业	1,264,700	18,414,032.00	0.32
83	000415	渤海租赁	8,411,202	18,252,308.34	0.32
84	688256	寒武纪	274,400	17,753,680.00	0.31
85	300253	卫宁健康	2,002,600	17,582,828.00	0.31
86	601568	北元集团	2,745,265	17,404,980.10	0.30
87	688006	杭可科技	247,505	17,340,200.30	0.30
88	300308	中际旭创	548,844	17,041,606.20	0.30
89	002010	传化智联	2,648,533	17,030,067.19	0.30
90	600201	生物股份	1,855,100	16,992,716.00	0.30
91	603707	健友股份	600,485	16,933,677.00	0.30
92	601969	海南矿业	1,967,000	16,896,530.00	0.30



93	603568	伟明环保	506,218	16,892,494.66	0.30
94	600497	驰宏锌锗	3,225,600	16,740,864.00	0.29
95	600998	九州通	1,399,360	16,666,377.60	0.29
96	600572	康恩贝	3,643,900	16,142,477.00	0.28
97	600970	中材国际	1,643,800	15,928,422.00	0.28
98	600718	东软集团	1,382,700	15,914,877.00	0.28
99	002422	科伦药业	850,200	15,898,740.00	0.28
100	300618	寒锐钴业	272,700	15,794,784.00	0.28
101	603379	三美股份	698,500	15,541,625.00	0.27
102	600380	健康元	1,253,798	15,484,405.30	0.27
103	000537	广宇发展	1,165,723	15,142,741.77	0.26
104	300463	迈克生物	732,500	15,008,925.00	0.26
105	600737	中粮糖业	1,980,900	14,896,368.00	0.26
106	601098	中南传媒	1,576,700	14,884,048.00	0.26
107	600704	物产中大	2,897,500	14,864,175.00	0.26
108	603225	新凤鸣	1,266,135	14,611,197.90	0.26
109	600216	浙江医药	1,062,800	14,507,220.00	0.25
110	000988	华工科技	608,600	14,101,262.00	0.25
111	000729	燕京啤酒	1,450,200	14,008,932.00	0.24
112	601866	中远海发	4,613,100	13,839,300.00	0.24
113	600667	太极实业	1,824,700	13,466,286.00	0.24
114	300212	易华录	771,700	13,427,580.00	0.23
115	300769	德方纳米	32,300	13,200,364.00	0.23
116	300257	开山股份	880,147	13,166,999.12	0.23
117	002128	电投能源	918,400	13,151,488.00	0.23
118	601598	中国外运	3,377,304	13,103,939.52	0.23
119	002430	杭氧股份	401,904	12,563,519.04	0.22
120	600282	南钢股份	3,975,200	12,521,880.00	0.22
121	603444	吉比特	31,133	12,079,604.00	0.21
122	603355	莱克电气	476,020	12,009,984.60	0.21
123	002595	豪迈科技	534,600	11,942,964.00	0.21
124	600339	中油工程	4,035,100	11,661,439.00	0.20
125	300072	海新能科	2,294,400	11,609,664.00	0.20
126	002156	通富微电	745,400	11,479,160.00	0.20
127	600167	联美控股	1,517,800	11,368,322.00	0.20
128	300296	利亚德	1,556,800	11,364,640.00	0.20
129	000959	首钢股份	2,370,200	11,282,152.00	0.20
130	002815	崇达技术	872,600	11,178,006.00	0.20
131	600177	雅戈尔	1,685,900	11,177,517.00	0.20
132	601128	常熟银行	1,447,700	11,060,428.00	0.19
133	000932	华菱钢铁	2,168,763	11,039,003.67	0.19
134	002408	齐翔腾达	1,349,600	10,945,256.00	0.19

135	688188	柏楚电子	48,810	10,740,152.40	0.19
136	600415	小商品城	1,915,700	10,670,449.00	0.19
137	601168	西部矿业	892,700	10,560,641.00	0.18
138	002701	奥瑞金	2,020,500	10,506,600.00	0.18
139	002532	天山铝业	1,596,900	10,427,757.00	0.18
140	600118	中国卫星	506,200	10,164,496.00	0.18
141	600598	北大荒	675,700	9,973,332.00	0.17
142	000656	金科股份	3,329,100	9,521,226.00	0.17
143	002867	周大生	609,161	9,460,270.33	0.17
144	000738	航发控制	330,000	9,273,000.00	0.16
145	600153	建发股份	697,600	9,117,632.00	0.16
146	600967	内蒙一机	946,100	8,628,432.00	0.15
147	002153	石基信息	540,120	8,571,704.40	0.15
148	002508	老板电器	237,800	8,567,934.00	0.15
149	600325	华发股份	1,112,500	8,421,625.00	0.15
150	002294	信立泰	297,808	8,368,404.80	0.15
151	002936	郑州银行	3,100,491	8,340,320.79	0.15
152	600096	云天化	258,300	8,131,284.00	0.14
153	688819	天能股份	221,000	7,642,180.00	0.13
154	600739	辽宁成大	515,100	7,510,158.00	0.13
155	002399	海普瑞	424,300	7,459,194.00	0.13
156	002429	兆驰股份	1,912,458	7,343,838.72	0.13
157	002240	盛新锂能	119,300	7,200,948.00	0.13
158	300001	特锐德	410,400	7,104,024.00	0.12
159	300474	景嘉微	101,500	6,941,585.00	0.12
160	300418	昆仑万维	431,300	6,900,800.00	0.12
161	601860	紫金银行	2,398,400	6,883,408.00	0.12
162	600398	海澜之家	1,442,800	6,853,300.00	0.12
163	603077	和邦生物	1,608,700	6,853,062.00	0.12
164	300724	捷佳伟创	74,800	6,683,380.00	0.12
165	002505	鹏都农牧	1,934,400	6,557,616.00	0.11
166	002326	永太科技	196,000	6,454,280.00	0.11
167	688180	君实生物	81,000	6,102,540.00	0.11
168	300009	安科生物	595,880	6,024,346.80	0.11
169	600879	航天电子	860,400	5,583,996.00	0.10
170	000027	深圳能源	869,200	5,571,572.00	0.10
171	603638	艾迪精密	257,300	5,274,650.00	0.09
172	000967	盈峰环境	988,800	5,003,328.00	0.09
173	600909	华安证券	1,075,800	4,894,890.00	0.09
174	600875	东方电气	295,573	4,862,175.85	0.08
175	600546	山煤国际	247,583	4,817,965.18	0.08
176	600120	浙江东方	1,175,600	4,714,156.00	0.08

177	002249	大洋电机	763,700	4,689,118.00	0.08
178	000869	张裕 A	157,200	4,675,128.00	0.08
179	000709	河钢股份	2,059,128	4,653,629.28	0.08
180	600126	杭钢股份	907,100	4,644,352.00	0.08
181	000598	兴蓉环境	871,800	4,454,898.00	0.08
182	603515	欧普照明	255,160	4,452,542.00	0.08
183	601611	中国核建	517,400	4,340,986.00	0.08
184	603345	安井食品	24,800	4,163,176.00	0.07
185	600823	世茂股份	1,391,100	4,145,478.00	0.07
186	600528	中铁工业	494,200	3,978,310.00	0.07
187	600511	国药股份	146,400	3,920,592.00	0.07
188	600482	中国动力	236,400	3,713,844.00	0.06
189	000990	诚志股份	337,920	3,700,224.00	0.06
190	601333	广深铁路	1,684,536	3,672,288.48	0.06
191	600376	首开股份	740,300	3,634,873.00	0.06
192	600536	中国软件	88,420	3,588,967.80	0.06
193	300037	新宙邦	66,740	3,507,854.40	0.06
194	300024	机器人	337,700	3,404,016.00	0.06
195	603228	景旺电子	145,400	3,392,182.00	0.06
196	000021	深科技	289,800	3,373,272.00	0.06
197	601928	凤凰传媒	462,300	3,305,445.00	0.06
198	002396	星网锐捷	146,000	3,305,440.00	0.06
199	600307	酒钢宏兴	1,682,000	3,263,080.00	0.06
200	002081	金螳螂	638,300	3,242,564.00	0.06
201	002180	纳思达	63,200	3,199,184.00	0.06
202	601699	潞安环能	215,700	3,153,534.00	0.06
203	600705	中航产融	904,500	3,129,570.00	0.05
204	002797	第一创业	484,100	3,103,081.00	0.05
205	000898	鞍钢股份	961,300	3,095,386.00	0.05
206	002266	浙富控股	644,230	3,085,861.70	0.05
207	601156	东航物流	153,826	3,045,754.80	0.05
208	300376	易事特	369,800	3,002,776.00	0.05
209	688521	芯原股份	60,709	2,999,024.60	0.05
210	002926	华西证券	380,800	2,985,472.00	0.05
211	601077	渝农商行	784,000	2,900,800.00	0.05
212	000563	陕国投 A	919,700	2,869,464.00	0.05
213	002195	二三四五	1,269,100	2,855,475.00	0.05
214	601016	节能风电	593,700	2,849,760.00	0.05
215	600160	巨化股份	215,500	2,833,825.00	0.05
216	603267	鸿远电子	21,000	2,820,930.00	0.05
217	600297	广汇汽车	1,065,400	2,780,694.00	0.05
218	603605	珀莱雅	16,680	2,755,202.40	0.05

219	601778	晶科科技	509,100	2,749,140.00	0.05
220	002203	海亮股份	235,254	2,717,183.70	0.05
221	600648	外高桥	196,200	2,668,320.00	0.05
222	600037	歌华有线	274,600	2,578,494.00	0.05
223	600959	江苏有线	783,100	2,552,906.00	0.04
224	603719	良品铺子	87,500	2,505,125.00	0.04
225	600699	均胜电子	149,400	2,347,074.00	0.04
226	002948	青岛银行	647,600	2,344,312.00	0.04
227	601990	南京证券	252,400	2,105,016.00	0.04
228	002244	滨江集团	241,200	2,086,380.00	0.04
229	002152	广电运通	220,200	2,041,254.00	0.04
230	600862	中航高科	71,200	2,000,720.00	0.03
231	600663	陆家嘴	192,427	1,993,543.72	0.03
232	688321	微芯生物	70,042	1,764,357.98	0.03
233	600236	桂冠电力	258,100	1,571,829.00	0.03
234	600060	海信视像	117,200	1,465,000.00	0.03
235	600350	山东高速	273,700	1,436,925.00	0.03
236	002925	盈趣科技	59,500	1,280,440.00	0.02
237	002966	苏州银行	206,179	1,257,691.90	0.02
238	001965	招商公路	159,900	1,220,037.00	0.02
239	600582	天地科技	252,400	1,206,472.00	0.02
240	000031	大悦城	300,601	1,202,404.00	0.02
241	600195	中牧股份	97,000	1,189,220.00	0.02
242	600500	中化国际	168,860	1,122,919.00	0.02
243	002653	海思科	66,800	1,076,148.00	0.02
244	000062	深圳华强	76,735	974,534.50	0.02
245	600717	天津港	116,500	467,165.00	0.01
246	600487	亨通光电	30,400	442,016.00	0.01
247	002372	伟星新材	18,112	435,412.48	0.01
248	002416	爱施德	37,000	344,100.00	0.01
249	600835	上海机电	24,600	337,758.00	0.01
250	002945	华林证券	18,900	288,225.00	0.01
251	600271	航天信息	25,213	275,830.22	0.00
252	603866	桃李面包	15,400	254,870.00	0.00
253	603026	石大胜华	1,700	247,095.00	0.00
254	002183	怡亚通	30,619	220,762.99	0.00
255	002185	华天科技	21,700	203,546.00	0.00
256	300168	万达信息	20,300	191,632.00	0.00
257	002500	山西证券	33,100	189,994.00	0.00
258	601718	际华集团	53,900	167,090.00	0.00
259	600787	中储股份	29,351	167,007.19	0.00
260	000807	云铝股份	15,400	152,152.00	0.00

261	002223	鱼跃医疗	5,900	151,394.00	0.00
262	600006	东风汽车	14,900	112,495.00	0.00
263	688289	圣湘生物	3,621	107,217.81	0.00
264	000961	中南建设	21,200	64,660.00	0.00
265	300088	长信科技	6,100	45,262.00	0.00
266	002439	启明星辰	1,400	27,902.00	0.00
267	300383	光环新网	900	9,378.00	0.00

### 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	300751	迈为股份	109,560	53,783,004.00	0.94
2	603290	斯达半导	107,900	41,638,610.00	0.73
3	605358	立昂微	489,876	33,007,844.88	0.58
4	688536	思瑞浦	50,537	28,381,073.83	0.50
5	000733	振华科技	123,444	16,784,680.68	0.29
6	601231	环旭电子	1,137,800	16,338,808.00	0.29
7	600188	兖矿能源	371,900	14,682,612.00	0.26
8	002773	康弘药业	934,200	13,956,948.00	0.24
9	002545	东方铁塔	1,107,000	12,597,660.00	0.22
10	600941	中国移动	187,363	11,314,494.38	0.20
11	300681	英搏尔	195,420	11,289,413.40	0.20
12	300636	同和药业	455,600	10,934,400.00	0.19
13	002850	科达利	63,100	10,032,900.00	0.18
14	300389	艾比森	949,900	9,869,461.00	0.17
15	002405	四维图新	639,900	9,643,293.00	0.17
16	600416	湘电股份	507,400	9,620,304.00	0.17
17	002738	中矿资源	99,300	9,196,173.00	0.16
18	603676	卫信康	899,000	9,061,920.00	0.16
19	301073	君亭酒店	130,394	9,041,519.96	0.16
20	688339	亿华通	87,107	8,569,586.66	0.15
21	000617	中油资本	1,721,700	8,281,377.00	0.14
22	603078	江化微	288,430	8,240,445.10	0.14
23	600639	浦东金桥	563,263	7,654,744.17	0.13
24	601811	新华文轩	822,400	7,516,736.00	0.13
25	002466	天齐锂业	60,190	7,511,712.00	0.13
26	300575	中旗股份	369,250	7,458,850.00	0.13
27	603929	亚翔集成	690,100	7,349,565.00	0.13
28	603558	健盛集团	594,800	7,268,456.00	0.13
29	600009	上海机场	125,900	7,138,530.00	0.12
30	601801	皖新传媒	1,467,200	7,086,576.00	0.12
31	600029	南方航空	953,200	6,967,892.00	0.12

32	688575	亚辉龙	320,600	6,706,952.00	0.12
33	603099	长白山	700,100	6,678,954.00	0.12
34	300149	睿智医药	563,254	6,353,505.12	0.11
35	000893	亚钾国际	183,100	6,300,471.00	0.11
36	605138	盛泰集团	499,700	6,236,256.00	0.11
37	002216	三全食品	310,700	6,086,613.00	0.11
38	002539	云图控股	364,000	5,820,360.00	0.10
39	688063	派能科技	18,400	5,744,480.00	0.10
40	300260	新莱应材	111,500	5,672,005.00	0.10
41	603063	禾望电气	147,200	5,659,840.00	0.10
42	301058	中粮工科	324,285	5,639,316.15	0.10
43	601898	中煤能源	542,500	5,631,150.00	0.10
44	600389	江山股份	92,300	5,605,379.00	0.10
45	300155	安居宝	1,008,600	5,597,730.00	0.10
46	601838	成都银行	328,600	5,448,188.00	0.10
47	603277	银都股份	252,100	5,321,831.00	0.09
48	603688	石英股份	39,686	5,262,760.46	0.09
49	688668	鼎通科技	66,800	4,698,712.00	0.08
50	002066	瑞泰科技	403,600	4,588,932.00	0.08
51	603669	灵康药业	697,100	4,559,034.00	0.08
52	002050	三花智控	162,800	4,473,744.00	0.08
53	688556	高测股份	54,884	4,429,138.80	0.08
54	603327	福蓉科技	319,830	4,397,662.50	0.08
55	603038	华立股份	512,700	4,342,569.00	0.08
56	002996	顺博合金	285,500	4,339,600.00	0.08
57	002549	凯美特气	236,300	4,277,030.00	0.07
58	603529	爱玛科技	79,860	4,183,066.80	0.07
59	002009	天奇股份	219,000	4,051,500.00	0.07
60	002518	科士达	130,100	3,981,060.00	0.07
61	600481	双良节能	235,900	3,974,915.00	0.07
62	300595	欧普康视	69,000	3,946,110.00	0.07
63	002192	融捷股份	25,600	3,934,720.00	0.07
64	300573	兴齐眼药	25,600	3,924,992.00	0.07
65	603177	德创环保	256,345	3,883,626.75	0.07
66	300861	美畅股份	41,800	3,874,442.00	0.07
67	300926	博俊科技	164,200	3,834,070.00	0.07
68	688234	天岳先进	57,068	3,823,556.00	0.07
69	000567	海德股份	248,660	3,680,168.00	0.06
70	002832	比音勒芬	143,700	3,621,240.00	0.06
71	603212	赛伍技术	135,000	3,592,350.00	0.06
72	601799	星宇股份	21,000	3,591,000.00	0.06
73	300512	中亚股份	433,350	3,553,470.00	0.06

74	605016	百龙创园	84,200	3,538,084.00	0.06
75	600273	嘉化能源	325,100	3,530,586.00	0.06
76	300019	硅宝科技	157,900	3,510,117.00	0.06
77	603896	寿仙谷	89,380	3,466,156.40	0.06
78	603815	交建股份	384,200	3,465,484.00	0.06
79	002895	川恒股份	102,300	3,458,763.00	0.06
80	601677	明泰铝业	144,400	3,436,720.00	0.06
81	601609	金田股份	450,800	3,385,508.00	0.06
82	603128	华贸物流	336,500	3,375,095.00	0.06
83	000034	神州数码	221,600	3,372,752.00	0.06
84	300938	信测标准	121,680	3,369,319.20	0.06
85	603217	元利科技	114,008	3,352,975.28	0.06
86	688139	海尔生物	45,919	3,344,280.77	0.06
87	600063	皖维高新	441,000	3,342,780.00	0.06
88	688187	时代电气	51,200	3,327,488.00	0.06
89	002916	深南电路	35,400	3,317,334.00	0.06
90	605368	蓝天燃气	259,708	3,272,320.80	0.06
91	301029	怡合达	40,000	3,260,000.00	0.06
92	300453	三鑫医疗	326,500	3,245,410.00	0.06
93	600018	上港集团	552,200	3,219,326.00	0.06
94	300462	华铭智能	332,400	3,201,012.00	0.06
95	300327	中颖电子	63,820	3,178,874.20	0.06
96	300887	谱尼测试	74,380	3,176,769.80	0.06
97	605169	洪通燃气	282,028	3,175,635.28	0.06
98	300015	爱尔眼科	70,700	3,165,239.00	0.06
99	000423	东阿阿胶	85,000	3,140,750.00	0.05
100	688179	阿拉丁	61,240	3,137,937.60	0.05
101	002645	华宏科技	141,900	3,096,258.00	0.05
102	300181	佐力药业	309,700	3,078,418.00	0.05
103	002947	恒铭达	165,880	3,052,192.00	0.05
104	002880	卫光生物	115,600	3,042,592.00	0.05
105	300196	长海股份	160,800	3,037,512.00	0.05
106	000848	承德露露	313,500	3,034,680.00	0.05
107	688105	诺唯赞	35,419	3,007,073.10	0.05
108	688385	复旦微电	46,000	2,998,740.00	0.05
109	002853	皮阿诺	249,900	2,986,305.00	0.05
110	600123	兰花科创	181,400	2,984,030.00	0.05
111	000876	新希望	195,000	2,983,500.00	0.05
112	601666	平煤股份	218,700	2,972,133.00	0.05
113	601225	陕西煤业	139,800	2,960,964.00	0.05
114	603486	科沃斯	24,200	2,949,738.00	0.05
115	600795	国电电力	751,700	2,939,147.00	0.05

116	603583	捷昌驱动	87,600	2,924,964.00	0.05
117	688690	纳微科技	36,122	2,919,018.82	0.05
118	601606	长城军工	247,700	2,875,797.00	0.05
119	600887	伊利股份	73,600	2,866,720.00	0.05
120	002938	鹏鼎控股	94,500	2,854,845.00	0.05
121	600508	上海能源	156,900	2,838,321.00	0.05
122	603565	中谷物流	178,600	2,834,382.00	0.05
123	601088	中国神华	84,200	2,803,860.00	0.05
124	603599	广信股份	99,480	2,800,362.00	0.05
125	000933	神火股份	213,000	2,786,040.00	0.05
126	000063	中兴通讯	109,100	2,785,323.00	0.05
127	603977	国泰集团	320,000	2,774,400.00	0.05
128	603236	移远通信	20,540	2,745,376.40	0.05
129	688363	华熙生物	19,200	2,729,856.00	0.05
130	300682	朗新科技	107,800	2,715,482.00	0.05
131	603155	新亚强	72,800	2,712,528.00	0.05
132	605599	莱百股份	249,100	2,710,208.00	0.05
133	300918	南山智尚	315,300	2,695,815.00	0.05
134	003816	中国广核	958,100	2,682,680.00	0.05
135	300138	晨光生物	171,400	2,668,698.00	0.05
136	601689	拓普集团	38,723	2,649,814.89	0.05
137	603337	杰克股份	120,400	2,586,192.00	0.05
138	300628	亿联网络	33,800	2,573,870.00	0.04
139	603348	文灿股份	48,000	2,572,800.00	0.04
140	601668	中国建筑	483,200	2,570,624.00	0.04
141	002241	歌尔股份	76,500	2,570,400.00	0.04
142	601086	国芳集团	662,400	2,570,112.00	0.04
143	300689	澄天伟业	146,500	2,535,915.00	0.04
144	603882	金域医学	30,100	2,484,755.00	0.04
145	002932	明德生物	36,115	2,476,044.40	0.04
146	603968	醋化股份	117,100	2,412,260.00	0.04
147	300413	芒果超媒	72,200	2,408,592.00	0.04
148	300661	圣邦股份	13,100	2,384,462.00	0.04
149	600295	鄂尔多斯	131,500	2,373,575.00	0.04
150	002555	三七互娱	109,190	2,318,103.70	0.04
151	002737	葵花药业	147,600	2,308,464.00	0.04
152	300813	泰林生物	56,240	2,288,405.60	0.04
153	002438	江苏神通	153,700	2,267,075.00	0.04
154	003015	日久光电	232,700	2,189,707.00	0.04
155	688191	智洋创新	127,800	2,172,600.00	0.04
156	603657	春光科技	136,600	2,035,340.00	0.04
157	600883	博闻科技	262,400	2,007,360.00	0.04



158	600449	宁夏建材	162,800	1,981,276.00	0.03
159	688355	明志科技	91,447	1,957,880.27	0.03
160	688216	气派科技	63,800	1,841,268.00	0.03
161	600873	梅花生物	154,100	1,738,248.00	0.03
162	300501	海顺新材	115,100	1,721,896.00	0.03
163	603313	梦百合	140,600	1,687,200.00	0.03
164	003004	声迅股份	80,400	1,677,144.00	0.03
165	002952	亚世光电	133,300	1,631,592.00	0.03
166	603585	苏利股份	80,600	1,566,058.00	0.03
167	688609	九联科技	164,800	1,374,432.00	0.02
168	601518	吉林高速	509,100	1,359,297.00	0.02
169	603385	惠达卫浴	176,400	1,335,348.00	0.02
170	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.02
171	603229	奥翔药业	33,900	1,290,234.00	0.02
172	002394	联发股份	161,700	1,182,027.00	0.02
173	603079	圣达生物	88,800	1,181,928.00	0.02
174	688228	开普云	36,906	1,150,360.02	0.02
175	300840	酷特智能	112,700	1,019,935.00	0.02
176	603726	朗迪集团	83,200	998,400.00	0.02
177	603725	天安新材	140,000	989,800.00	0.02
178	603687	大胜达	105,976	987,696.32	0.02
179	002573	清新环境	156,400	908,684.00	0.02
180	300971	博亚精工	36,000	887,400.00	0.02
181	688076	诺泰生物	34,000	879,920.00	0.02
182	300265	通光线缆	96,000	844,800.00	0.01
183	603679	华体科技	69,000	756,240.00	0.01
184	002678	珠江钢琴	126,400	734,384.00	0.01
185	603808	歌力思	71,700	694,056.00	0.01
186	002543	万和电气	97,600	685,152.00	0.01
187	688519	南亚新材	23,893	676,888.69	0.01
188	002301	齐心集团	101,200	667,920.00	0.01
189	000683	远兴能源	60,400	634,804.00	0.01
190	601566	九牧王	73,800	624,348.00	0.01
191	688118	普元信息	37,000	617,160.00	0.01
192	603880	南卫股份	101,930	597,309.80	0.01
193	003036	泰坦股份	55,100	590,121.00	0.01
194	002796	世嘉科技	68,900	534,664.00	0.01
195	603096	新经典	28,900	533,205.00	0.01
196	300396	迪瑞医疗	36,900	525,456.00	0.01
197	002597	金禾实业	12,100	524,293.00	0.01
198	600843	上工申贝	92,600	500,966.00	0.01
199	688217	睿昂基因	12,200	495,442.00	0.01

200	688176	亚虹医药	37,990	476,014.70	0.01
201	600606	绿地控股	118,600	469,656.00	0.01
202	688123	聚辰股份	4,400	468,688.00	0.01
203	001206	依依股份	14,000	464,100.00	0.01
204	002475	立讯精密	13,200	446,028.00	0.01
205	600688	上海石化	131,274	417,451.32	0.01
206	300566	激智科技	21,900	396,390.00	0.01
207	300920	润阳科技	18,100	386,616.00	0.01
208	300857	协创数据	18,700	383,163.00	0.01
209	002855	捷荣技术	45,700	358,745.00	0.01
210	300965	恒宇信通	7,500	353,775.00	0.01
211	300955	嘉亨家化	13,700	335,924.00	0.01
212	603969	银龙股份	77,300	325,433.00	0.01
213	603813	原尚股份	21,300	323,121.00	0.01
214	603678	火炬电子	6,900	322,989.00	0.01
215	003018	金富科技	34,800	321,900.00	0.01
216	003023	彩虹集团	18,600	319,920.00	0.01
217	603829	洛凯股份	29,100	303,804.00	0.01
218	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
219	300735	光弘科技	27,500	287,375.00	0.01
220	600557	康缘药业	19,200	282,048.00	0.00
221	000408	藏格矿业	8,500	279,990.00	0.00
222	600888	新疆众和	29,100	267,720.00	0.00
223	688510	航亚科技	13,800	264,408.00	0.00
224	603958	哈森股份	40,400	247,248.00	0.00
225	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.00
226	601107	四川成渝	57,500	227,700.00	0.00
227	300818	耐普矿机	5,400	219,024.00	0.00
228	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.00
229	002953	日丰股份	12,220	208,228.80	0.00
230	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.00
231	300314	戴维医疗	18,100	192,222.00	0.00
232	605318	法狮龙	13,200	192,060.00	0.00
233	002634	棒杰股份	38,200	183,360.00	0.00
234	688630	芯碁微装	2,800	181,160.00	0.00
235	002917	金奥博	14,700	166,110.00	0.00
236	600919	江苏银行	23,000	163,760.00	0.00
237	688020	方邦股份	3,904	152,216.96	0.00
238	688308	欧科亿	2,234	148,695.04	0.00
239	600933	爱柯迪	7,700	126,126.00	0.00
240	002391	长青股份	16,900	119,990.00	0.00
241	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00

242	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
243	603860	中公高科	4,900	106,820.00	0.00
244	603912	佳力图	9,100	105,196.00	0.00
245	603358	华达科技	5,200	102,960.00	0.00
246	300964	本川智能	3,000	93,570.00	0.00
247	600908	无锡银行	16,000	90,080.00	0.00
248	603730	岱美股份	6,642	87,076.62	0.00
249	688163	赛伦生物	3,607	84,980.92	0.00
250	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
251	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
252	688206	概伦电子	2,000	60,800.00	0.00
253	600649	城投控股	13,392	57,317.76	0.00
254	002534	西子洁能	3,400	55,386.00	0.00
255	603609	禾丰股份	5,337	51,395.31	0.00
256	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
257	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
258	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
259	002698	博实股份	3,000	35,490.00	0.00
260	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
261	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
262	603666	亿嘉和	480	32,928.00	0.00
263	002843	泰嘉股份	2,300	32,200.00	0.00
264	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
265	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
266	300332	天壕环境	2,700	30,240.00	0.00
267	002777	久远银海	2,070	29,766.60	0.00
268	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
269	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
270	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
271	002988	豪美新材	1,500	24,105.00	0.00
272	301220	亚香股份	549	22,491.27	0.00
273	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
274	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
275	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
276	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
277	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
278	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
279	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
280	300928	华安鑫创	300	16,899.00	0.00
281	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
282	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
283	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00

284	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
285	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
286	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
287	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
288	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
289	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
290	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
291	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
292	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
293	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
294	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
295	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
296	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
297	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
298	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
299	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
300	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
301	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
302	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
303	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
304	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
305	301279	金道科技	296	6,751.76	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	600233	圆通速递	79,594,481.25	1.54
2	002557	洽洽食品	71,790,842.13	1.39
3	603290	斯达半导	66,319,407.05	1.28
4	600566	济川药业	65,758,676.00	1.27
5	300363	博腾股份	64,555,711.90	1.25
6	603456	九洲药业	63,214,677.66	1.22
7	300751	迈为股份	61,771,586.60	1.19
8	603613	国联股份	60,328,138.97	1.16
9	603127	昭衍新药	59,980,097.80	1.16
10	600718	东软集团	59,657,902.53	1.15
11	600392	盛和资源	57,538,127.22	1.11
12	688536	思瑞浦	56,921,272.81	1.10
13	600188	兖矿能源	54,804,470.63	1.06
14	600256	广汇能源	54,496,914.28	1.05
15	300390	天华超净	53,866,166.22	1.04

16	300017	网宿科技	52,235,179.00	1.01
17	600563	法拉电子	52,113,794.00	1.01
18	601636	旗滨集团	49,953,611.52	0.96
19	600522	中天科技	49,916,796.86	0.96
20	600486	扬农化工	48,510,454.52	0.94

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	600188	兖矿能源	72,833,657.69	1.41
2	601699	潞安环能	70,860,192.17	1.37
3	600546	山煤国际	68,456,531.62	1.32
4	600487	亨通光电	66,319,368.00	1.28
5	600884	杉杉股份	66,170,979.62	1.28
6	688005	容百科技	65,690,387.44	1.27
7	603198	迎驾贡酒	58,461,964.06	1.13
8	300763	锦浪科技	56,187,487.55	1.08
9	600233	圆通速递	54,731,344.00	1.06
10	600141	兴发集团	52,838,131.36	1.02
11	603127	昭衍新药	52,201,074.31	1.01
12	000988	华工科技	51,436,195.00	0.99
13	000970	中科三环	49,975,342.02	0.96
14	600256	广汇能源	47,653,790.00	0.92
15	002056	横店东磁	44,817,876.34	0.86
16	002396	星网锐捷	44,673,682.64	0.86
17	002572	索菲亚	43,193,494.46	0.83
18	600765	中航重机	43,037,412.47	0.83
19	002867	周大生	42,391,365.52	0.82
20	300751	迈为股份	42,222,582.30	0.81

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	9,446,658,588.98
卖出股票收入（成交）总额	8,716,266,338.29

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

无。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

无。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

无。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

无。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1**

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	79,505,838.05

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,313,453.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	83,819,291.41

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
建信中证 500 指数 增强 A	386,202	4,715.08	356,832,097.19	19.60	1,464,140,285.64	80.40
建信中证 500 指数 增强 C	23,414	5,541.30	85,811,152.09	66.14	43,932,894.39	33.86

合计	409,616	4,762.31	442,643,249.28	22.69	1,508,073,180.03	77.31
----	---------	----------	----------------	-------	------------------	-------

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信中证 500 指数增强 A	299,851.51	0.02
	建信中证 500 指数增强 C	28,731.53	0.02
	合计	328,583.04	0.02

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	建信中证 500 指数增强 A	-
	建信中证 500 指数增强 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	建信中证 500 指数增强 A	0~10
	建信中证 500 指数增强 C	-
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 （2014 年 1 月 27 日） 基金份额总额	308,165,342.91	-
本报告期期初基金份额总额	1,532,162,483.85	92,201,069.83
本报告期基金总申购份额	558,126,917.52	59,741,960.01



减：本报告期基金总赎回份额	269,317,018.54	22,198,983.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,820,972,382.83	129,744,046.48

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未发生重大人事变动。

### 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未受到稽查或处罚等情况。

## 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	3	4,067,988,153.87	22.43	3,756,331.37	22.62	-
方正证券	3	3,527,576,704.39	19.45	3,285,244.49	19.78	-
东方财富证券	2	2,044,061,190.38	11.27	1,871,792.32	11.27	-
广发证券	2	1,254,791,192.21	6.92	1,161,617.34	7.00	-
中泰证券	2	1,115,897,458.60	6.15	918,717.86	5.53	-
中金财富证券	1	1,051,708,541.66	5.80	958,416.28	5.77	-
中金公司	2	1,002,349,195.15	5.53	917,484.84	5.52	-
信达证券	2	982,458,350.05	5.42	895,330.18	5.39	-
兴业证券	2	817,861,860.25	4.51	745,311.65	4.49	-
国金证券	2	620,289,589.42	3.42	577,683.51	3.48	-
中信证券	4	530,242,170.29	2.92	488,500.86	2.94	-
华创证券	2	448,833,138.88	2.47	409,020.93	2.46	-
国盛证券	1	383,184,705.94	2.11	356,866.44	2.15	-
安信证券	2	165,780,844.08	0.91	152,729.52	0.92	-
中信建投	1	121,977,004.53	0.67	111,158.63	0.67	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	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、本基金本报告期内剔除中信华南一个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

#### 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	30,555.50	0.50	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	6,060,027.10	99.50	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

## 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平安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 06 月 15 日
2	建信基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金申购、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 05 月 30 日
3	关于新增广发证券股份有限公司为建信旗下部分开放式基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 05 月 17 日
4	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
5	建信基金管理有限责任公司关于新增宁波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
6	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
7	关于新增国金证券股份有限公司为建信旗下部分开放式基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 03 月 08 日
8	关于新增华宝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 01 月 26 日
9	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 24 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中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 500 指数增强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