

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资
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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	24
§ 7 投资组合报告	54
7.1 期末基金资产组合情况	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	66
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	68
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	69
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
10.8 其他重大事件	72
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金		
基金简称	建信中证 1000 指数增强		
基金主代码	006165		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018 年 11 月 22 日		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	128,893,717.43 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 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E
下属分级基金的交易代码	006165	006166	013442
报告期末下属分级基金的份额总额	95,001,691.74 份	32,591,282.84 份	1,300,742.85 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 1000 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，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，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。</p> <p>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。</p> <p>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	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
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、债券型基金、混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	胡波
	联系电话	010-66228888	021-61618888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95528
传真		010-66228001	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市北京东路 689 号
邮政编码		100033	200001
法定代表人		孙志晨	郑杨

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	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 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E
本期已实现 收益	-35,675,754.86	-11,964,799.56	-434,791.10

本期利润	-22,859,597.38	-5,362,094.30	-45,138.04
加权平均基金份额本期利润	-0.2239	-0.1567	-0.0370
本期加权平均净值利润率	-12.00%	-8.52%	-2.03%
本期基金份额净值增长率	-5.25%	-5.44%	-5.44%
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	62,110,342.33	20,542,982.83	820,318.40
期末可供分配基金份额利润	0.6538	0.6303	0.6307
期末基金资产净值	190,182,268.80	64,328,075.93	2,567,814.92
期末基金份额净值	2.0019	1.9738	1.9741
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	124.17%	121.00%	-4.27%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信中证 1000 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	13.42%	1.31%	9.59%	1.24%	3.83%	0.07%
过去三个月	8.12%	1.99%	3.20%	1.95%	4.92%	0.04%
过去六个月	-5.25%	1.82%	-11.98%	1.78%	6.73%	0.04%
过去一年	6.97%	1.54%	-1.02%	1.51%	7.99%	0.03%
过去三年	82.18%	1.45%	30.26%	1.44%	51.92%	0.01%
自基金合同生效起至今	124.17%	1.46%	42.53%	1.49%	81.64%	-0.03%

建信中证 1000 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	13.38%	1.31%	9.59%	1.24%	3.79%	0.07%
过去三个月	8.02%	1.99%	3.20%	1.95%	4.82%	0.04%
过去六个月	-5.44%	1.82%	-11.98%	1.78%	6.54%	0.04%
过去一年	6.54%	1.54%	-1.02%	1.51%	7.56%	0.03%
过去三年	80.08%	1.45%	30.26%	1.44%	49.82%	0.01%

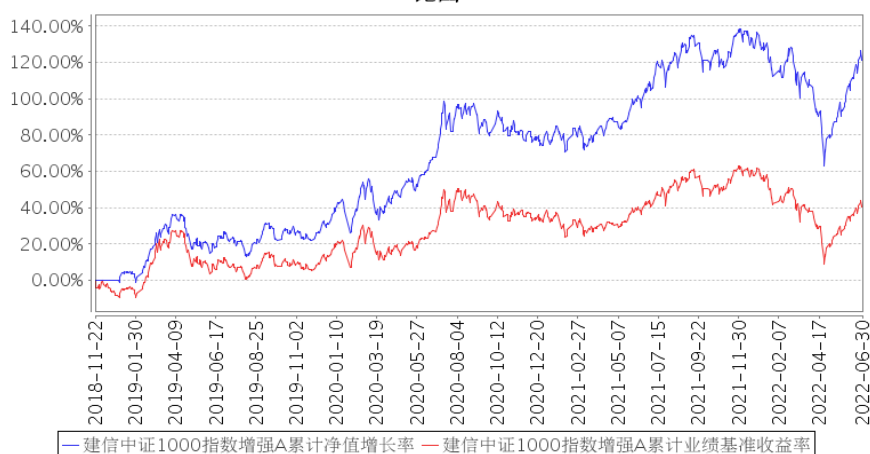
自基金合同生效起 至今	121.00%	1.46%	42.53%	1.49%	78.47%	-0.03%
----------------	---------	-------	--------	-------	--------	--------

建信中证 1000 指数增强发起 E

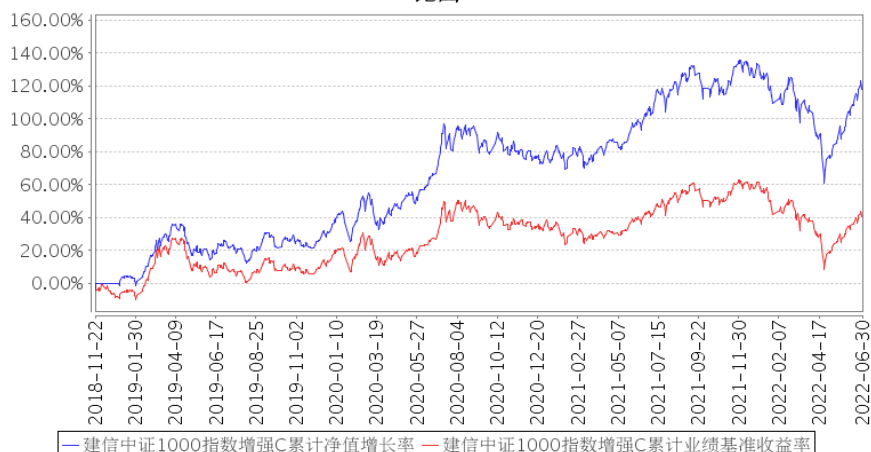
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	13.38%	1.31%	9.59%	1.24%	3.79%	0.07%
过去三个月	8.02%	1.99%	3.20%	1.95%	4.82%	0.04%
过去六个月	-5.44%	1.82%	-11.98%	1.78%	6.54%	0.04%
自基金合同生效起 至今	-4.27%	1.59%	-10.55%	1.56%	6.28%	0.03%

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

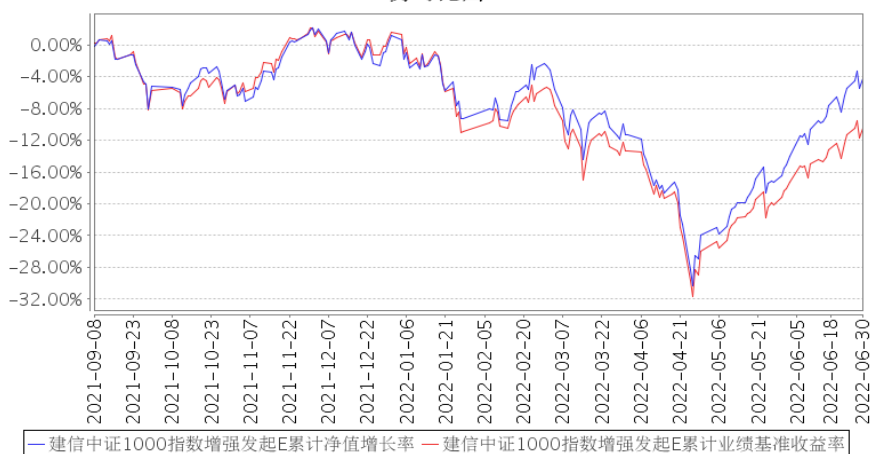
建信中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信中证1000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



建信中证1000指数增强发起E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		
赵云煜	金融工程及指数投资部总经理助理，本	2018年11月22日	-	9年	赵云煜先生，金融工程及指数投资部总经理助理，硕士。2012年11月加入太平资产管理有限公司，任风险管理分析师；2014年7月加入建信基金，历任助理研究员、研究员、基金经理助理、基金经理。2016年6月22日至2018年11月7日任专户投资经

	基金的基金经理				理。2018 年 11 月 16 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 9 月 11 日起任建信中证红利潜力指数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。
叶乐天	金融工程及指数投资部副总经理，本基金的基金经理	2018 年 11 月 22 日	-	14 年	叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理，博士。2008 年 5 月至 2011 年 9 月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。2011 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理。2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理，该基金自 2021 年 1 月 1 日起转型为建信央视财经 50 指数证券投资基金（LOF），叶乐天继续担任该基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 4 月 18 日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 22 日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 1 月 10 日起任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 8 月 24 日起任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日起任建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日起任建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2021 年 9 月 15 日起任建信灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期间，产品基准指数中证 1000 先下跌而后反弹，整体仍偏弱势。本基金平稳开展投资运作。本基金为指数增强基金，目标是在跟踪指数的基础上，力争超越指数本身的收益。基金主要采用以建信多因子模型为主的量化选股模型进行个股选择，并采用量化模型严格管理组合与基准的偏离。报告期间，从相对风险角度，基金组合与基准指数基本保持了行业和风格配置的中性，较好地控制了基金的跟踪误差。同时，从超额收益角度，本基金成功超越了基准，获取了较高的

超额回报。此外，本基金积极参与新股申购力争进一步增厚产品收益。

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-5.25%，波动率 1.82%，业绩比较基准收益率-11.98%，波动率 1.78%。本报告期本基金 C 净值增长率-5.44%，波动率 1.82%，业绩比较基准收益率-11.98%，波动率 1.78%。本报告期本基金 E 净值增长率-5.44%，波动率 1.82%，业绩比较基准收益率-11.98%，波动率 1.78%。

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 年上半年，受到美债上行，俄乌冲突，通胀和疫情等因素的影响，权益市场整体先下跌后反弹。细分来看，权益市场 4 月底前主要下行为主，5 月后进入反弹区间；风格层面，中小市值股票下跌程度更大，反弹也相对更高，最终大小盘差异不大；煤炭行业一枝独秀，其它行业整体下跌为主，科技板块跌幅相对更大。展望下半年，经济预计仍将面临一些考验，稳增长仍有较强的诉求。全年来看，A 股的盈利增速预计将保持在中性稍弱的水平，整体呈现见底的走势。流动性方面，预计资金面将保持较为中性偏宽松的环境，但需要密切关注社融的增速和结构。对于股票市场，当前的估值情况整体较为合适，市场仍将寻找景气的行业作为下一阶段的方向。本基金将密切跟踪市场动态，持续提升模型的效果，精选个券，谨慎管理组合风险，力争为投资者提供稳健超越业绩基准的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《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、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《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、托管协议的规定，对建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由建信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	19,925,576.01	21,957,946.40
结算备付金		719,227.55	869,415.86
存出保证金		66,772.88	66,634.44

交易性金融资产	6.4.7.2	238,000,768.40	272,509,228.98
其中：股票投资		238,000,768.40	272,509,228.98
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		73,480.73	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,990,631.23	1,903,766.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,689.35
资产总计		260,776,456.80	297,309,681.58
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		-	2,137,491.22
应付赎回款		2,425,245.37	798,313.46
应付管理人报酬		188,064.92	235,408.62
应付托管费		37,612.99	47,081.71
应付销售服务费		20,405.80	23,096.50
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	1,026,968.07	862,451.94
负债合计		3,698,297.15	4,103,843.45
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.10	128,893,717.43	139,225,296.27
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	128,184,442.22	153,980,541.86
净资产合计		257,078,159.65	293,205,838.13

负债和净资产总计		260,776,456.80	297,309,681.58
----------	--	----------------	----------------

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 128,893,717.43 份，其中建信中证 1000 指数增强 A 基金份额总额 95,001,691.74 份，基金份额净值 2.0019 元；建信中证 1000 指数增强 C 基金份额总额 32,591,282.84 份，基金份额净值 1.9738 元；建信中证 1000 指数增强发起 E 基金份额总额 1,300,742.85 份，基金份额净值 1.9741 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 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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
一、营业总收入		-26,471,578.48	12,190,845.89
1. 利息收入		44,438.89	22,814.14
其中：存款利息收入	6.4.7.13	44,438.89	22,807.01
债券利息收入		-	7.13
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）		-46,547,563.71	6,105,391.33
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-47,898,642.50	5,687,475.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	132.81
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,351,078.79	417,783.00
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	19,808,515.80	5,972,598.06
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	223,030.54	90,042.36
减：二、营业总支出		1,795,251.24	1,113,207.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,265,229.57	344,342.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	253,045.92	68,868.43
3. 销售服务费		129,215.38	46,956.83
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	147,760.37	653,040.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-28,266,829.72	11,077,638.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-28,266,829.72	11,077,638.09
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-28,266,829.72	11,077,638.09

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 1000 指数增强型发起式证券投资基金

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)	139,225,296.27	-	153,980,541.86	293,205,838.13

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)	139,225,296.27	-	153,980,541.86	293,205,838.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-10,331,578.84	-	-25,796,099.64	-36,127,678.48
(一)、综合收益总额	-	-	-28,266,829.72	-28,266,829.72
(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)	-10,331,578.84	-	2,470,730.08	-7,860,848.76
其中:1.基金申购款	88,090,864.09	-	79,354,174.33	167,445,038.42
2.基金赎回款	-98,422,442.93	-	-76,883,444.25	-175,305,887.18
(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)	128,893,717.43	-	128,184,442.22	257,078,159.65
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)	37,870,530.32	-	25,612,855.68	63,483,386.00
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)	37,870,530.32	-	25,612,855.68	63,483,386.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,251,167.69	-	12,927,655.30	15,178,822.99
(一)、综合收益总额	-	-	11,077,638.09	11,077,638.09
(二)、本期基金份额交易产	2,251,167.69	-	1,850,017.21	4,101,184.90

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	34,022,918.83	-	24,951,030.95	58,973,949.78
2. 基金赎回款	-31,771,751.14	-	-23,101,013.74	-54,872,764.88
（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）	40,121,698.01	-	38,540,510.98	78,662,208.99

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

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（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 [2018]1029 号《关于准予建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 1000 指数增强型发起式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 99,635,875.53 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（2018）第 0686 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 99,645,967.84 份基金份额，其中认购资金利息折合 10,092.31 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/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；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2021 年 9 月 6 日起本基金新增 E 类基金份额，从本类别基金资产中计提销售服务费，且在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用。根据更新的《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金份额包括建信中证 1000 指数增强基金之 A 类份额、建信中证 1000 指数增强基金之 C 类份额和建信中证 1000 指数增强发起基金之 E 类份额。本基金各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 1000 指数增强型发起式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（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、

中期票据、短期融资券等)、货币市场工具(含同业存单)、银行存款、债券回购、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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%,投资于中证 1000 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;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)占基金资产的比例不低于 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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。本基金业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 \times 95%+银行活期存款税后利率 \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特

征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即

可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

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

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

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

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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

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

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

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

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

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

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 21,957,946.40 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,226.43 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 21,960,172.83 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 869,415.86 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 429.92 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 869,845.78 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 66,634.44 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 33.00 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 66,667.44 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 2,689.35 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 2,226.43 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 429.92 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 33.00 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	19,925,576.01
等于：本金	19,923,691.54
加：应计利息	1,884.47
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	19,925,576.01

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	220,842,481.82	-	238,000,768.40	17,158,286.58
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	220,842,481.82	-	238,000,768.40	17,158,286.58

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	3,502.26
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	857,268.08
其中：交易所市场	857,268.08

银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	31,895.17
预提费用	134,302.56
合计	1,026,968.07

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 1000 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	102,140,693.80	102,140,693.80
本期申购	53,829,113.74	53,829,113.74
本期赎回（以“-”号填列）	-60,968,115.80	-60,968,115.80
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	95,001,691.74	95,001,691.74

建信中证 1000 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	36,093,961.66	36,093,961.66
本期申购	26,500,224.04	26,500,224.04
本期赎回（以“-”号填列）	-30,002,902.86	-30,002,902.86
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	32,591,282.84	32,591,282.84

建信中证 1000 指数增强发起 E

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	990,640.81	990,640.81
本期申购	7,761,526.31	7,761,526.31
本期赎回（以“-”号填列）	-7,451,424.27	-7,451,424.27
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	1,300,742.85	1,300,742.85
-----	--------------	--------------

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 1000 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	102,870,945.33	10,788,452.08	113,659,397.41
本期利润	-35,675,754.86	12,816,157.48	-22,859,597.38
本期基金份额交易产生的变动数	-5,084,848.14	9,465,625.17	4,380,777.03
其中：基金申购款	47,015,306.24	2,729,307.85	49,744,614.09
基金赎回款	-52,100,154.38	6,736,317.32	-45,363,837.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,110,342.33	33,070,234.73	95,180,577.06

建信中证 1000 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	35,469,779.26	3,773,947.50	39,243,726.76
本期利润	-11,964,799.56	6,602,705.26	-5,362,094.30
本期基金份额交易产生的变动数	-2,961,996.87	817,157.50	-2,144,839.37
其中：基金申购款	22,394,430.06	747,288.29	23,141,718.35
基金赎回款	-25,356,426.93	69,869.21	-25,286,557.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,542,982.83	11,193,810.26	31,736,793.09

建信中证 1000 指数增强发起 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	973,879.18	103,538.51	1,077,417.69
本期利润	-434,791.10	389,653.06	-45,138.04
本期基金份额交易产生的变动数	281,230.32	-46,437.90	234,792.42
其中：基金申购款	6,276,411.73	191,430.16	6,467,841.89
基金赎回款	-5,995,181.41	-237,868.06	-6,233,049.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	820,318.40	446,753.67	1,267,072.07

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	34,980.17
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	7,953.29
其他	1,505.43
合计	44,438.89

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	-47,898,642.50
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-47,898,642.50

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	690,311,613.91
减：卖出股票成本总额	736,375,904.96
减：交易费用	1,834,351.45
买卖股票差价收入	-47,898,642.50

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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	1,351,078.79
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	1,351,078.79

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	19,808,515.80
股票投资	19,808,515.80
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	19,808,515.80

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	195,435.23
基金转换费收入	27,595.31
合计	223,030.54

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	2,155.85
指数使用费	21,301.96
律师费	25,000.00
持有人大会费用	15,000.00
合计	147,760.37

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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	1,265,229.57	344,342.25
其中：支付销售机构的客户维护费	261,400.67	102,520.93

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	253,045.92	68,868.43

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 1000 指 数增强 A	建信中证 1000 指 数增强 C	建信中证 1000 指 数增强发起 E	合计
建信基金	-	10,476.21	215.93	10,692.14
浦发银行	-	363.67	-	363.67
中国建设银行	-	16,232.55	-	16,232.55
合计	-	27,072.43	215.93	27,288.36
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 1000 指 数增强 A	建信中证 1000 指 数增强 C	建信中证 1000 指 数增强发起 E	合计
建信基金	-	100.96	-	100.96
上海浦东发展银行	-	661.02	-	661.02
中国建设银行	-	14,109.81	-	14,109.81
合计	-	14,871.79	-	14,871.79

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。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额和 E 类基金份额的销售服务费年费率均为 0.40%。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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数 增强 C	建信中证 1000 指数 增强发起 E
基金合同生效日 (2018 年 11 月 22 日)持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金 份额	11,190,038.89	-	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动 份额	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖 出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金 份额	11,190,038.89	-	-
报告期末持有的基金 份额 占基金总份额比例	11.78%	-	-
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	上年度可比期间 -
	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数 增强 C	建信中证 1000 指数 增强发起 E
基金合同生效日	-	-	-

(2018 年 11 月 22 日)持有的基金份额			
报告期初持有的基金份额	10,646,056.75	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	10,646,056.75	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	41.42%	-	-

注: 分级持有份额占总份额比例的计算中, 对下属分级基金, 比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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
上海浦东发展银行-活期存款	19,925,576.01	34,980.17	5,952,749.85	19,731.94

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	161	8,946.77	4,834.83	-
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	32.69	32.02	312	10,200.00	9,990.24	-
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新发未上市	23.21	16.14	681	15,803.74	10,991.34	-
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新发未上市	27.53	45.04	319	8,782.07	14,367.76	-
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	2,847	109,495.62	109,495.62	-

301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新发未上市	38.46	38.46	317	12,191.82	12,191.82	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新发未上市	38.39	23.90	374	14,357.86	8,938.60	-
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新发未上市	109.04	82.76	120	13,084.80	9,931.20	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新发未上市	30.82	21.46	361	11,126.02	7,747.06	-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新发未上市	33.68	43.98	239	8,049.52	10,511.22	-
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	23,550	89,961.00	89,961.00	-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新发未上市	3.82	3.82	2,617	9,996.94	9,996.94	-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新发未上市	40.25	30.59	238	9,579.50	7,280.42	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新发未上市	64.08	37.52	100	6,408.00	3,752.00	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新发未上市	76.56	51.92	189	14,469.84	9,812.88	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新发未上市	56.88	56.42	184	10,465.92	10,381.28	-
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新发未上市	29.67	33.28	393	11,660.31	13,079.04	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新发未上市	3.80	6.39	3,399	12,916.20	21,719.61	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新发未上市	35.68	29.84	322	11,488.96	9,608.48	-

		日								
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新发未上市	96.90	87.82	79	7,655.12	6,937.78	-
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	309	10,499.82	8,948.64	-
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	363	17,636.96	11,390.94	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新发未上市	56.69	41.86	192	10,884.48	8,037.12	-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新发未上市	19.18	32.07	639	12,256.02	20,492.73	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新发未上市	33.65	33.65	2,327	78,303.55	78,303.55	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新发未上市	33.65	33.65	259	8,715.35	8,715.35	-
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	新发未上市	39.07	29.87	348	13,596.36	10,394.76	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新发未上市	8.05	10.08	1,388	11,173.40	13,991.04	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新发未上市	48.30	41.68	195	9,418.50	8,127.60	-
301259	艾布	2022年	6个月	新发未	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-

	鲁	4月18日		上市							
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新发未上市	19.93	31.38	507	10,104.51	15,909.66		-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新发未上市	26.86	47.07	385	10,341.10	18,121.95		-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新发未上市	28.50	34.87	348	9,918.00	12,134.76		-
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	606	10,247.46	11,992.74		-
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	201	10,458.03	11,340.42		-
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	新发未上市	10.80	15.86	42,002	453,621.60	666,151.72		-
688072	拓荆科技	2022年4月12日	6个月	新发未上市	71.88	139.78	1,908	137,147.04	266,700.24		-
688176	亚虹医药	2021年12月29日	6个月	新发未上市	22.98	12.53	9,859	226,559.82	123,533.27		-
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	2,224	91,784.48	91,784.48		-
688267	中触媒	2022年2月9日	6个月	新发未上市	41.90	31.90	1,382	57,905.80	44,085.80		-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新发未上市	21.93	21.93	4,023	88,224.39	88,224.39		-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000881	中广核技	2022 年 06 月 28 日	重大事项	9.02	2022 年 7 月 1 日	9.56	84,400	726,629.00	761,288.00	-

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。基金管理人对于基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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	19,925,576.01	-	-	-	19,925,576.01
结算备付金	719,227.55	-	-	-	719,227.55
存出保证金	66,772.88	-	-	-	66,772.88
交易性金融资产	-	-	-	-238,000,768.40	238,000,768.40
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	-	-	-	1,990,631.23	1,990,631.23
其他资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	73,480.73	73,480.73
资产总计	20,711,576.44	-	-	-240,064,880.36	260,776,456.80
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	-	-	-	2,425,245.37	2,425,245.37
应付管理人报酬	-	-	-	188,064.92	188,064.92
应付托管费	-	-	-	37,612.99	37,612.99
应付销售服务费	-	-	-	20,405.80	20,405.80
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,026,968.07	1,026,968.07
负债总计	-	-	-	3,698,297.15	3,698,297.15
利率敏感度缺口	20,711,576.44	-	-	-236,366,583.21	257,078,159.65
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	21,957,946.40	-	-	-	21,957,946.40
结算备付金	869,415.86	-	-	-	869,415.86
存出保证金	66,634.44	-	-	-	66,634.44
交易性金融资产	-	-	-	-272,509,228.98	272,509,228.98
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	-	-	-	1,903,766.55	1,903,766.55
其他资产	-	-	-	2,689.35	2,689.35
资产总计	22,893,996.70	-	-	-274,415,684.88	297,309,681.58
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	-	-	-	2,137,491.22	2,137,491.22
应付赎回款	-	-	-	798,313.46	798,313.46
应付管理人报酬	-	-	-	235,408.62	235,408.62
应付托管费	-	-	-	47,081.71	47,081.71
应付销售服务费	-	-	-	23,096.50	23,096.50
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	862,451.94	862,451.94
负债总计	-	-	-	4,103,843.45	4,103,843.45
利率敏感度缺口	22,893,996.70	-	-	-270,311,841.43	293,205,838.13

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的股票，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。

本基金采用指数增强型投资策略，以中证 1000 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于中证 1000 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；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）占基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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	238,000,768.40	92.58	272,509,228.98	92.94
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	238,000,768.40	92.58	272,509,228.98	92.94

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%	12,824,278.15	14,626,519.46
	业绩比较基准下降 5%	-12,824,278.15	-14,626,519.46

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	235,128,624.21	271,203,693.56
第二层次	1,315,396.67	180,152.67
第三层次	1,556,747.52	1,125,382.75
合计	238,000,768.40	272,509,228.98

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	238,000,768.40	91.27
	其中：股票	238,000,768.40	91.27
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	20,644,803.56	7.92
8	其他各项资产	2,130,884.84	0.82
9	合计	260,776,456.80	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	976,467.00	0.38
B	采矿业	10,154,015.00	3.95
C	制造业	143,017,656.77	55.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,656,946.00	2.20
E	建筑业	3,669,754.00	1.43
F	批发和零售业	5,231,332.25	2.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,863,990.00	1.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,141,458.24	4.72
J	金融业	1,716,376.00	0.67
K	房地产业	2,759,755.31	1.07
L	租赁和商务服务业	2,247,119.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	822,312.00	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	1,327,004.00	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,779,680.00	0.69
R	文化、体育和娱乐业	1,284,815.00	0.50
S	综合	-	-
	合计	195,648,680.57	76.10

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	666,151.72	0.26
C	制造业	29,772,248.08	11.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,233,070.00	0.87
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	928,401.66	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,913,081.90	1.91
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	29,306.43	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,482,933.90	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	97,009.14	0.04
R	文化、体育和娱乐业	2,229,885.00	0.87
S	综合	-	-
	合计	42,352,087.83	16.47

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	002176	江特电机	179,700	4,499,688.00	1.75
2	300123	亚光科技	641,900	3,979,780.00	1.55
3	000034	神州数码	222,800	3,391,016.00	1.32

4	002792	通宇通讯	272,814	3,290,136.84	1.28
5	688388	嘉元科技	36,600	3,106,242.00	1.21
6	300346	南大光电	79,510	2,860,769.80	1.11
7	002738	中矿资源	28,980	2,683,837.80	1.04
8	002085	万丰奥威	473,200	2,541,084.00	0.99
9	688339	亿华通	23,920	2,353,249.60	0.92
10	600428	中远海特	484,100	2,304,316.00	0.90
11	603313	梦百合	187,900	2,254,800.00	0.88
12	601666	平煤股份	163,500	2,221,965.00	0.86
13	002413	雷科防务	391,800	2,174,490.00	0.85
14	603063	禾望电气	54,900	2,110,905.00	0.82
15	300151	昌红科技	111,100	2,099,790.00	0.82
16	002267	陕天然气	287,000	2,006,130.00	0.78
17	002192	融捷股份	12,600	1,936,620.00	0.75
18	600639	浦东金桥	142,309	1,933,979.31	0.75
19	603876	鼎胜新材	41,800	1,889,360.00	0.73
20	300143	盈康生命	156,800	1,779,680.00	0.69
21	300170	汉得信息	191,300	1,723,613.00	0.67
22	300803	指南针	29,200	1,716,376.00	0.67
23	300352	北信源	367,400	1,697,388.00	0.66
24	000543	皖能电力	424,200	1,692,558.00	0.66
25	300409	道氏技术	61,700	1,602,966.00	0.62
26	000762	西藏矿业	27,300	1,526,889.00	0.59
27	603416	信捷电气	36,200	1,489,268.00	0.58
28	002597	金禾实业	34,300	1,486,219.00	0.58
29	300568	星源材质	51,113	1,484,321.52	0.58
30	600590	泰豪科技	226,200	1,477,086.00	0.57
31	600389	江山股份	24,100	1,463,593.00	0.57
32	300068	南都电源	94,200	1,445,028.00	0.56
33	300233	金城医药	50,600	1,443,618.00	0.56
34	603306	华懋科技	42,200	1,430,580.00	0.56
35	300634	彩讯股份	111,800	1,419,860.00	0.55
36	601677	明泰铝业	59,320	1,411,816.00	0.55
37	603766	隆鑫通用	303,700	1,400,057.00	0.54
38	002344	海宁皮城	293,400	1,370,178.00	0.53
39	600746	江苏索普	117,500	1,360,650.00	0.53
40	300131	英唐智控	258,700	1,355,588.00	0.53
41	002545	东方铁塔	118,524	1,348,803.12	0.52
42	002573	清新环境	228,400	1,327,004.00	0.52
43	002215	诺普信	235,300	1,315,327.00	0.51
44	600481	双良节能	77,900	1,312,615.00	0.51
45	000090	天健集团	190,500	1,312,545.00	0.51

46	300394	天孚通信	48,300	1,307,481.00	0.51
47	603387	基蛋生物	91,140	1,299,656.40	0.51
48	300438	鹏辉能源	20,837	1,280,433.65	0.50
49	300393	中来股份	75,100	1,276,700.00	0.50
50	603508	思维列控	93,360	1,250,090.40	0.49
51	300423	昇辉科技	115,500	1,249,710.00	0.49
52	600850	电科数字	66,310	1,237,344.60	0.48
53	600877	声光电科	108,100	1,208,558.00	0.47
54	300502	新易盛	45,300	1,186,860.00	0.46
55	002585	双星新材	65,400	1,183,086.00	0.46
56	600777	新潮能源	426,100	1,137,687.00	0.44
57	002610	爱康科技	273,900	1,133,946.00	0.44
58	601777	力帆科技	199,800	1,108,890.00	0.43
59	600882	妙可蓝多	23,600	1,104,480.00	0.43
60	600211	西藏药业	26,600	1,104,166.00	0.43
61	300130	新国都	89,400	1,096,044.00	0.43
62	300910	瑞丰新材	17,200	1,087,384.00	0.42
63	300607	拓斯达	82,100	1,085,362.00	0.42
64	601886	江河集团	127,900	1,080,755.00	0.42
65	300432	富临精工	48,600	1,069,200.00	0.42
66	688586	江航装备	40,000	1,064,400.00	0.41
67	603348	文灿股份	19,500	1,045,200.00	0.41
68	603606	东方电缆	13,600	1,041,760.00	0.41
69	002216	三全食品	52,610	1,030,629.90	0.40
70	603308	应流股份	63,000	1,025,640.00	0.40
71	601567	三星医疗	76,300	1,013,264.00	0.39
72	002747	埃斯顿	41,200	1,009,400.00	0.39
73	300101	振芯科技	48,400	998,976.00	0.39
74	603979	金诚信	51,100	986,741.00	0.38
75	002041	登海种业	46,300	976,467.00	0.38
76	000968	蓝焰控股	92,700	968,715.00	0.38
77	002567	唐人神	113,000	961,630.00	0.37
78	600873	梅花生物	84,500	953,160.00	0.37
79	600929	雪天盐业	102,000	946,560.00	0.37
80	603258	电魂网络	46,500	941,625.00	0.37
81	300657	弘信电子	80,300	933,086.00	0.36
82	688166	博瑞医药	38,600	932,190.00	0.36
83	603906	龙蟠科技	25,100	927,194.00	0.36
84	002261	拓维信息	143,600	920,476.00	0.36
85	600458	时代新材	93,600	917,280.00	0.36
86	300298	三诺生物	32,500	913,250.00	0.36
87	688033	天宜上佳	42,676	906,438.24	0.35

88	300857	协创数据	44,200	905,658.00	0.35
89	300476	胜宏科技	48,900	897,804.00	0.35
90	300573	兴齐眼药	5,800	889,256.00	0.35
91	300662	科锐国际	16,900	876,941.00	0.34
92	300397	天和防务	82,300	856,743.00	0.33
93	002759	天际股份	31,500	856,170.00	0.33
94	600273	嘉化能源	78,400	851,424.00	0.33
95	688298	东方生物	7,360	840,144.00	0.33
96	000893	亚钾国际	24,300	836,163.00	0.33
97	002646	天佑德酒	43,200	827,280.00	0.32
98	002488	金固股份	122,900	827,117.00	0.32
99	600604	市北高新	141,400	825,776.00	0.32
100	300829	金丹科技	25,400	823,468.00	0.32
101	300149	睿智医药	72,900	822,312.00	0.32
102	002432	九安医疗	13,300	798,798.00	0.31
103	600172	黄河旋风	91,600	798,752.00	0.31
104	688389	普门科技	45,400	794,046.00	0.31
105	300171	东富龙	23,300	790,103.00	0.31
106	600363	联创光电	35,000	786,100.00	0.31
107	002645	华宏科技	35,700	778,974.00	0.30
108	603187	海容冷链	21,100	771,205.00	0.30
109	000881	中广核技	84,400	761,288.00	0.30
110	300860	锋尚文化	16,100	760,403.00	0.30
111	300470	中密控股	21,500	758,735.00	0.30
112	300035	中科电气	27,000	754,650.00	0.29
113	688617	惠泰医疗	3,400	744,872.00	0.29
114	300398	飞凯材料	32,200	736,092.00	0.29
115	300702	天宇股份	25,900	735,819.00	0.29
116	000539	粤电力 A	173,400	728,280.00	0.28
117	603098	森特股份	20,300	727,958.00	0.28
118	002984	森麒麟	23,200	721,752.00	0.28
119	600711	盛屯矿业	91,400	709,264.00	0.28
120	603169	兰石重装	104,600	693,498.00	0.27
121	600490	鹏欣资源	178,600	687,610.00	0.27
122	002258	利尔化学	28,040	662,304.80	0.26
123	603489	八方股份	3,400	661,266.00	0.26
124	000933	神火股份	50,200	656,616.00	0.26
125	300378	鼎捷软件	39,700	653,859.00	0.25
126	300457	赢合科技	23,000	653,430.00	0.25
127	002472	双环传动	20,400	649,536.00	0.25
128	300477	合纵科技	84,000	646,800.00	0.25
129	601137	博威合金	36,500	646,050.00	0.25

130	002850	科达利	4,000	636,000.00	0.25
131	603583	捷昌驱动	18,400	614,376.00	0.24
132	300428	立中集团	18,300	604,815.00	0.24
133	000683	远兴能源	56,800	596,968.00	0.23
134	600063	皖维高新	78,100	591,998.00	0.23
135	601686	友发集团	76,200	582,168.00	0.23
136	600797	浙大网新	97,900	579,568.00	0.23
137	688100	威胜信息	27,400	575,126.00	0.22
138	603690	至纯科技	13,900	560,170.00	0.22
139	603128	华贸物流	55,800	559,674.00	0.22
140	000813	德展健康	162,200	559,590.00	0.22
141	002378	章源钨业	68,900	556,712.00	0.22
142	300232	洲明科技	85,300	556,156.00	0.22
143	603229	奥翔药业	14,500	551,870.00	0.21
144	300055	万邦达	58,600	548,496.00	0.21
145	300604	长川科技	11,810	533,221.50	0.21
146	600715	文投控股	208,100	524,412.00	0.20
147	300348	长亮科技	53,900	520,674.00	0.20
148	601619	嘉泽新能	126,100	517,010.00	0.20
149	603279	景津装备	16,620	515,386.20	0.20
150	002123	梦网科技	43,900	510,996.00	0.20
151	300224	正海磁材	33,100	506,430.00	0.20
152	300206	理邦仪器	49,000	502,250.00	0.20
153	688399	硕世生物	4,400	501,688.00	0.20
154	300373	扬杰科技	7,000	498,750.00	0.19
155	002782	可立克	29,200	497,568.00	0.19
156	600996	贵广网络	71,700	493,296.00	0.19
157	002099	海翔药业	70,800	490,644.00	0.19
158	002091	江苏国泰	45,091	484,728.25	0.19
159	300205	天喻信息	39,800	480,386.00	0.19
160	688158	优刻得	32,788	476,409.64	0.19
161	300765	新诺威	32,700	466,629.00	0.18
162	000875	吉电股份	65,000	451,750.00	0.18
163	600812	华北制药	65,900	442,848.00	0.17
164	300666	江丰电子	7,100	433,100.00	0.17
165	688200	华峰测控	1,200	427,680.00	0.17
166	600456	宝钛股份	7,100	421,740.00	0.16
167	603596	伯特利	5,200	416,936.00	0.16
168	688127	蓝特光学	18,200	408,772.00	0.16
169	603179	新泉股份	13,900	403,100.00	0.16
170	688680	海优新材	2,000	397,400.00	0.15
171	603208	江山欧派	5,500	397,265.00	0.15

172	603337	杰克股份	17,500	375,900.00	0.15
173	301031	中熔电气	2,600	372,788.00	0.15
174	300343	联创股份	24,000	364,560.00	0.14
175	002301	齐心集团	54,900	362,340.00	0.14
176	600123	兰花科创	21,800	358,610.00	0.14
177	603595	东尼电子	8,500	350,965.00	0.14
178	688016	心脉医疗	1,800	350,658.00	0.14
179	002847	盐津铺子	3,900	342,966.00	0.13
180	600328	中盐化工	14,300	336,765.00	0.13
181	300078	思创医惠	62,500	319,375.00	0.12
182	600449	宁夏建材	25,900	315,203.00	0.12
183	002467	二六三	76,000	314,640.00	0.12
184	000688	国城矿业	19,600	307,524.00	0.12
185	300134	大富科技	37,700	307,255.00	0.12
186	688233	神工股份	5,400	303,480.00	0.12
187	000597	东北制药	54,800	301,400.00	0.12
188	603920	世运电路	16,700	288,910.00	0.11
189	600073	上海梅林	36,000	286,920.00	0.11
190	002810	山东赫达	7,700	280,203.00	0.11
191	603688	石英股份	2,000	265,220.00	0.10
192	300382	斯莱克	16,800	263,256.00	0.10
193	000600	建投能源	61,900	261,218.00	0.10
194	603212	赛伍技术	9,700	258,117.00	0.10
195	600110	诺德股份	21,400	248,668.00	0.10
196	300709	精研科技	8,100	239,679.00	0.09
197	688598	金博股份	800	235,760.00	0.09
198	688018	乐鑫科技	2,000	224,800.00	0.09
199	300768	迪普科技	13,800	222,870.00	0.09
200	603989	艾华集团	7,800	219,960.00	0.09
201	002741	光华科技	10,700	213,251.00	0.08
202	300682	朗新科技	8,100	204,039.00	0.08
203	002239	奥特佳	6,100	18,605.00	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	603096	新经典	120,300	2,219,535.00	0.86
2	688228	开普云	64,576	2,012,833.92	0.78
3	300390	天华超净	19,900	1,739,260.00	0.68
4	002756	永兴材料	11,300	1,719,973.00	0.67
5	600392	盛和资源	64,200	1,450,920.00	0.56
6	002947	恒铭达	69,700	1,282,480.00	0.50

7	603787	新日股份	83,000	1,231,720.00	0.48
8	002466	天齐锂业	9,300	1,160,640.00	0.45
9	300332	天壕环境	92,200	1,032,640.00	0.40
10	002497	雅化集团	30,800	1,005,620.00	0.39
11	688636	智明达	8,800	997,832.00	0.39
12	300689	澄天伟业	57,169	989,595.39	0.38
13	600863	内蒙华电	269,800	984,770.00	0.38
14	002549	凯美特气	52,400	948,440.00	0.37
15	300592	华凯易佰	61,200	912,492.00	0.35
16	002623	亚玛顿	22,600	905,356.00	0.35
17	300572	安车检测	58,700	878,739.00	0.34
18	300396	迪瑞医疗	61,700	878,608.00	0.34
19	300575	中旗股份	40,400	816,080.00	0.32
20	688575	亚辉龙	37,800	790,776.00	0.31
21	603556	海兴电力	49,900	759,478.00	0.30
22	600636	国新文化	102,900	757,344.00	0.29
23	688819	天能股份	21,200	733,096.00	0.29
24	300218	安利股份	51,000	727,770.00	0.28
25	688468	科美诊断	55,000	678,150.00	0.26
26	600938	中国海油	42,002	666,151.72	0.26
27	002381	双箭股份	102,800	659,976.00	0.26
28	300211	亿通科技	64,100	551,901.00	0.21
29	300302	同有科技	66,400	537,840.00	0.21
30	688510	航亚科技	27,400	524,984.00	0.20
31	000985	大庆华科	32,000	524,160.00	0.20
32	688123	聚辰股份	4,800	511,296.00	0.20
33	600141	兴发集团	11,500	505,885.00	0.20
34	300389	艾比森	46,000	477,940.00	0.19
35	000408	藏格矿业	13,900	457,866.00	0.18
36	300681	英搏尔	7,660	442,518.20	0.17
37	603617	君禾股份	44,200	423,436.00	0.16
38	688058	宝兰德	7,560	410,659.20	0.16
39	603895	天永智能	14,400	402,912.00	0.16
40	300614	百川畅银	16,000	402,560.00	0.16
41	301007	德迈仕	23,400	352,638.00	0.14
42	603880	南卫股份	59,100	346,326.00	0.13
43	002066	瑞泰科技	30,200	343,374.00	0.13
44	688611	杭州柯林	5,800	340,924.00	0.13
45	300482	万孚生物	8,200	333,822.00	0.13
46	603931	格林达	16,500	331,650.00	0.13
47	300920	润阳科技	14,900	318,264.00	0.12
48	688191	智洋创新	18,600	316,200.00	0.12

49	603968	醋化股份	14,400	296,640.00	0.12
50	688606	奥泰生物	2,400	291,888.00	0.11
51	002940	昂利康	7,600	283,632.00	0.11
52	300636	同和药业	11,400	273,600.00	0.11
53	688077	大地熊	3,200	269,792.00	0.10
54	688072	拓荆科技	1,908	266,700.24	0.10
55	300559	佳发教育	26,700	262,728.00	0.10
56	300260	新莱应材	5,000	254,350.00	0.10
57	688283	坤恒顺维	5,000	238,350.00	0.09
58	688682	霍莱沃	2,800	232,484.00	0.09
59	688078	龙软科技	4,400	217,668.00	0.08
60	600780	通宝能源	41,000	215,660.00	0.08
61	600499	科达制造	10,400	214,656.00	0.08
62	688176	亚虹医药	9,859	123,533.27	0.05
63	301139	元道通信	3,164	121,687.44	0.05
64	301175	中科环保	26,167	99,957.94	0.04
65	688237	超卓航科	2,224	91,784.48	0.04
66	688400	凌云光	4,023	88,224.39	0.03
67	301239	普瑞眼科	2,586	87,018.90	0.03
68	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.03
69	688267	中触媒	1,382	44,085.80	0.02
70	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
71	301215	中汽股份	3,399	21,719.61	0.01
72	301238	瑞泰新材	639	20,492.73	0.01
73	301266	宇邦新材	385	18,121.95	0.01
74	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.01
75	301263	泰恩康	507	15,909.66	0.01
76	301112	信邦智能	319	14,367.76	0.01
77	301256	华融化学	1,388	13,991.04	0.01
78	301298	东利机械	634	13,206.22	0.01
79	301212	联盛化学	393	13,079.04	0.01
80	301268	铭利达	348	12,134.76	0.00
81	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
82	301286	侨源股份	606	11,992.74	0.00
83	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
84	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
85	301236	软通动力	363	11,390.94	0.00
86	301302	华如科技	201	11,340.42	0.00
87	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
88	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
89	301109	军信股份	681	10,991.34	0.00
90	301153	中科江南	239	10,511.22	0.00

91	301248	杰创智能	348	10,394.76	0.00
92	301207	华兰疫苗	184	10,381.28	0.00
93	002858	力盛体育	900	10,350.00	0.00
94	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
95	301103	何氏眼科	312	9,990.24	0.00
96	301150	中一科技	120	9,931.20	0.00
97	301200	大族数控	189	9,812.88	0.00
98	301216	万凯新材	322	9,608.48	0.00
99	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
100	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
101	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
102	301222	浙江恒威	309	8,948.64	0.00
103	301148	嘉戎技术	374	8,938.60	0.00
104	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
105	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
106	301258	富士莱	195	8,127.60	0.00
107	301237	和顺科技	192	8,037.12	0.00
108	301151	冠龙节能	361	7,747.06	0.00
109	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
110	301181	标榜股份	238	7,280.42	0.00
111	301219	腾远钴业	79	6,937.78	0.00
112	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
113	300834	星辉环材	161	4,834.83	0.00
114	301196	唯科科技	100	3,752.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000917	电广传媒	4,031,393.00	1.37
2	000035	中国天楹	3,733,074.11	1.27
3	002176	江特电机	3,673,677.00	1.25
4	300123	亚光科技	3,478,217.49	1.19
5	002625	光启技术	3,424,535.00	1.17
6	600750	江中药业	3,384,749.00	1.15
7	000034	神州数码	3,300,350.00	1.13
8	000762	西藏矿业	3,242,402.00	1.11
9	002497	雅化集团	3,224,607.00	1.10
10	002344	海宁皮城	3,180,099.00	1.08
11	300327	中颖电子	3,176,205.00	1.08
12	300109	新开源	3,141,879.00	1.07
13	002792	通宇通讯	3,104,518.54	1.06

14	300662	科锐国际	3,048,516.00	1.04
15	601677	明泰铝业	3,034,003.00	1.03
16	000657	中钨高新	2,979,152.00	1.02
17	000968	蓝焰控股	2,948,488.00	1.01
18	688339	亿华通	2,921,837.35	1.00
19	300476	胜宏科技	2,890,096.00	0.99
20	603279	景津装备	2,871,420.95	0.98

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	300327	中颖电子	5,486,478.30	1.87
2	000917	电广传媒	5,465,825.00	1.86
3	600750	江中药业	5,162,240.27	1.76
4	002497	雅化集团	5,047,226.20	1.72
5	000498	山东路桥	4,314,426.00	1.47
6	600502	安徽建工	4,202,423.02	1.43
7	000567	海德股份	4,106,112.10	1.40
8	000544	中原环保	3,966,963.00	1.35
9	600455	博通股份	3,916,072.00	1.34
10	600248	陕西建工	3,891,613.00	1.33
11	300775	三角防务	3,845,451.00	1.31
12	603610	麒盛科技	3,695,701.40	1.26
13	002839	张家港行	3,693,509.00	1.26
14	000683	远兴能源	3,575,853.00	1.22
15	300723	一品红	3,573,933.00	1.22
16	002625	光启技术	3,563,698.00	1.22
17	002929	润建股份	3,524,577.00	1.20
18	002539	云图控股	3,448,641.00	1.18
19	002407	多氟多	3,427,428.00	1.17
20	002344	海宁皮城	3,354,694.00	1.14

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	682,058,928.58
卖出股票收入（成交）总额	690,311,613.91

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，江西特种电机股份有限公司（002176）于 2021 年 12 月 9 日收到了中国证券监督管理委员会《立案告知书》（证监立案字 0252021009 号），因涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会决定对公司立案。

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	66,772.88
2	应收清算款	73,480.73
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,990,631.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,130,884.84

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 1000 指数 增强 A	7,959	11,936.39	49,696,226.83	52.31	45,305,464.91	47.69

建信中证 1000 指数增强 C	6,614	4,927.62	5,446,648.23	16.71	27,144,634.61	83.29
建信中证 1000 指数增强发起 E	446	2,916.46	-	-	1,300,742.85	100.00
合计	15,019	8,582.04	55,142,875.06	42.78	73,750,842.37	57.22

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 1000 指数增强 A	52,691.09	0.06
	建信中证 1000 指数增强 C	32,409.27	0.10
	建信中证 1000 指数增强发起 E	46.14	0.00
	合计	85,146.50	0.07

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信中证 1000 指数增强 A	-
	建信中证 1000 指数增强 C	0~10
	建信中证 1000 指数增强发起 E	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	建信中证 1000 指数增强 A	0~10
	建信中证 1000 指数增强 C	0~10
	建信中证 1000 指数增强发起 E	-
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	11,190,038.89	8.68	11,190,038.89	8.68	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,190,038.89	8.68	11,190,038.89	8.68	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E
基金合同生效日（2018 年 11 月 22 日）基金份额总额	50,945,615.13	48,700,352.71	-
本报告期期初基金份额总额	102,140,693.80	36,093,961.66	990,640.81
本报告期基金总申购份额	53,829,113.74	26,500,224.04	7,761,526.31
减：本报告期基金总赎回份额	60,968,115.80	30,002,902.86	7,451,424.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	95,001,691.74	32,591,282.84	1,300,742.85

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

本基金基金份额持有人大会于 2022 年 1 月 10 日表决通过了《关于建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金投资范围增加存托凭证与转融通证券出借并修改基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

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 年第一次临时股东大会和第六届董事会第五次会议审议通过，自 2022 年 5 月 11 日起，孙志晨先生不再担任建信基金管理有限责任公司董事长，暂由总裁张军红先生代为履行董事长职务。经本基金管理人建信基金管理有限责任公司第六届董事会第五次会议审议通过，自 2022 年 5 月 11 日起，马勇先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁。上述事项均已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案并于 2022 年 5 月 13 日公告。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金管理人于 2022 年 1 月 11 日发布《关于建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金基金份额持有人大会于 2022 年 1 月 10 日表决通过了《关于建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金投资范围增加存托凭证与转融通证券出借并修改基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效，故该基金本报告期内投资策略增加存托凭证投资策略及转融通证券出借策略。

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。

本报告期托管人及其高级管理人员没有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 (%)	
西部证券	1	713,092,320.09	52.34	521,502.76	51.81	-
长江证券	1	453,653,410.15	33.30	413,968.27	41.13	-
天风证券	1	120,625,539.22	8.85	38,725.40	3.85	-
华安证券	1	75,102,892.56	5.51	32,392.63	3.22	-
长城证券	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 (%)

西部证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

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
2	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
3	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
4	关于新增国泰君安证券股份有限公司为建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 03 月 31 日
5	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
6	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 03 月 08 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	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
9	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
10	关于新增京东肯特瑞为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 01 月 25 日
11	关于新增天风证券股份有限公司为建信旗下部分开放式基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 01 月 20 日
12	关于建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 01 月 11 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 1000 指数增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 1000 指数增强型发起式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