

建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 年 8 月 28 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 2023 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	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63

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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 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 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	1,985,534,713.21 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	1,600,589,693.24 份	384,945,019.97 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		刘军	朱鹤新

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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 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	39,700,428.38	-4,991,557.69
本期利润	78,359,905.79	-5,054,391.40
加权平均基金份 额本期利润	0.0456	-0.0254
本期加权平均净 值利润率	1.64%	-0.94%
本期基金份额净 值增长率	1.12%	0.87%
3.1.2 期末数据	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

和指标		
期末可供分配利润	2,717,331,784.58	625,873,814.23
期末可供分配基金份额利润	1.6977	1.6259
期末基金资产净值	4,317,921,477.82	1,010,818,834.20
期末基金份额净值	2.6977	2.6259
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	169.77%	10.65%

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	0.23%	0.80%	-0.77%	0.89%	1.00%	-0.09%
过去三个月	-4.35%	0.70%	-5.10%	0.78%	0.75%	-0.08%
过去六个月	1.12%	0.68%	2.20%	0.75%	-1.08%	-0.07%
过去一年	-8.23%	0.90%	-6.65%	0.91%	-1.58%	-0.01%
过去三年	15.03%	1.19%	2.48%	1.13%	12.55%	0.06%
自基金合同生效起至今	169.77%	1.55%	53.60%	1.52%	116.17%	0.03%

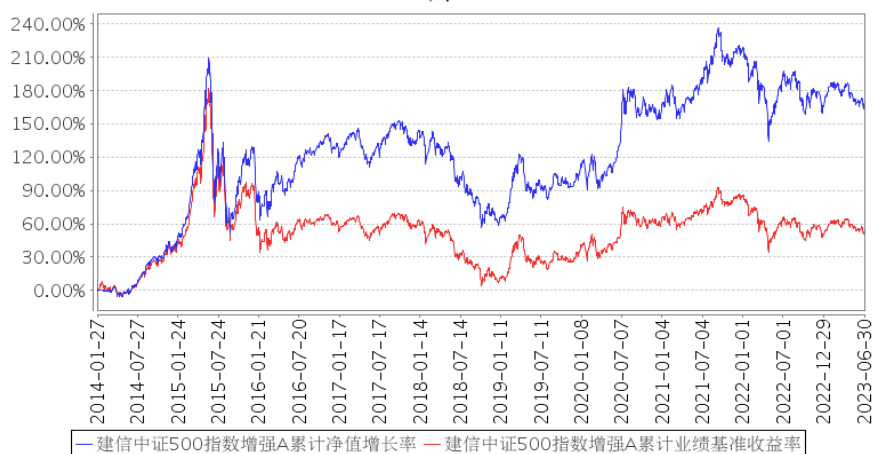
建信中证 500 指数增强 C

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

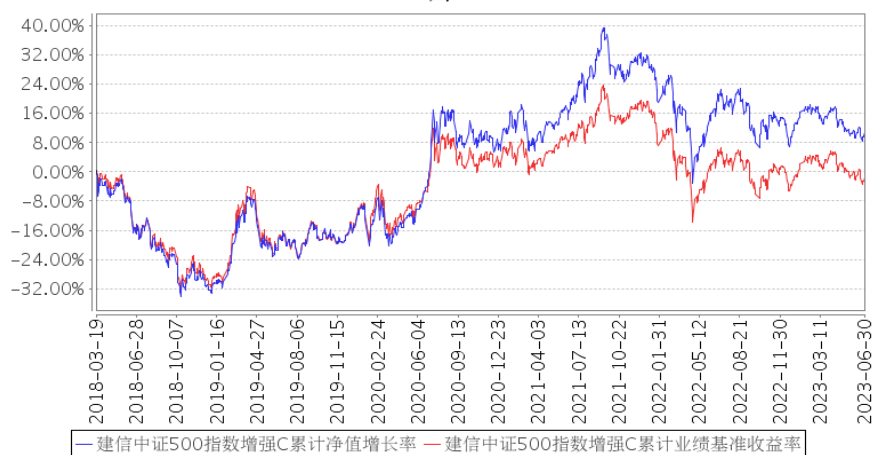
	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	0.19%	0.80%	-0.77%	0.89%	0.96%	-0.09%
过去三个月	-4.46%	0.70%	-5.10%	0.78%	0.64%	-0.08%
过去六个月	0.87%	0.68%	2.20%	0.75%	-1.33%	-0.07%
过去一年	-8.69%	0.90%	-6.65%	0.91%	-2.04%	-0.01%
过去三年	13.31%	1.19%	2.48%	1.13%	10.83%	0.06%
自基金合同生效起至今	10.65%	1.32%	-1.62%	1.30%	12.27%	0.02%

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，由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合资设立，注册资本 2 亿元。

公司拥有公开募集证券投资基金、私募资产管理计划、QDII、保险资金受托等业务资格，总部设在北京，下设北京、上海、广州、成都、深圳五家分公司，并分别在上海和香港设立了子公司——建信资本管理有限责任公司、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”。

公司以持续优秀的管理能力、完善周到的服务，为超过 7000 万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至 2023 年 6 月 30 日，公司管理运作 161 只公开募集证券投资基金以及多个私募资产管理计划，资产管理规模 1.11 余万亿元。

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	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2014 年 1 月 27 日	-	15	叶乐天先生，数量投资部副总经理，博士。曾任中国国际金融有限公司市场风险管理分析员、量化分析经理。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 日至 2022 年 8 月 9 日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 日至 2022 年 11 月 17 日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；2022 年 12 月 23 日起任建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《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。本基金从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。报告期内市场环境变化较大，指数增强策略阶段性有些失效，组合小幅跑输基准指数。

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 1.12%，波动率 0.68%，业绩比较基准收益率 2.20%，波动率 0.75%。本报告期本基金 C 净值增长率 0.87%，波动率 0.68%，业绩比较基准收益率 2.20%，波动率 0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在报告期内，宏观环境与去年有了很大的变化，随着疫情防控政策的退出，经济活动有了很大程度上的恢复，但由于内外部需求的短期不振，恢复程度不及预期，导致市场有所承压。同时以 ChatGPT 为代表的 AIGC 大模型的推出，给投资者带来了很大的想象空间。总体来说 2023 年上半年行业和风格轮动较快，投资难度相对较大，偏股型基金普遍跑输常见宽基指数。

展望下半年，我们认为市场仍将具有结构性行情，行业和风格的轮动仍将持续。当前在资管新规后时代，偏股型基金规模增长已至瓶颈，偏股型基金总体规模的下滑对重仓行业形成冲击，动量效应减弱，偏股基金形成负超额的情况预计仍会延续一段时期。选股策略上，我们认为需要适当规避基金重仓股，更加重视小市值股票的成长空间，并更加重视个股的估值水平。

本基金管理人将持续改进量化模型，积极捕捉市场可能的机会，并控制好交易成本，力争超越基准指数。

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、投资风险管理部和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 2023 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遵规守信、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 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	268,623,757.12	287,945,054.19
结算备付金		659,490,297.63	538,214,825.41
存出保证金		64,041,457.07	52,143,236.42
交易性金融资产	6.4.7.2	4,382,707,511.31	4,356,775,198.29
其中：股票投资		4,382,707,511.31	4,356,775,198.29
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		29,120,535.88	209,446.68
应收股利		-	-
应收申购款		2,218,368.02	2,757,191.88

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		5,406,201,927.03	5,238,044,952.87
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		36,782,592.86	-
应付赎回款		3,154,900.53	2,045,907.75
应付管理人报酬		4,275,614.21	4,483,145.66
应付托管费		855,122.85	896,629.10
应付销售服务费		350,804.89	147,200.13
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	32,042,579.67	32,455,994.57
负债合计		77,461,615.01	40,028,877.21
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	1,985,534,713.21	1,951,566,158.04
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,343,205,598.81	3,246,449,917.62
净资产合计		5,328,740,312.02	5,198,016,075.66
负债和净资产总计		5,406,201,927.03	5,238,044,952.87

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,985,534,713.21 份，其中建信中证 500 指数增强 A 基金份额总额 1,600,589,693.24 份，基金份额净值 2.6977 元；建信中证 500 指数增强 C 基金份额总额 384,945,019.97 份，基金份额净值 2.6259 元。

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
一、营业总收入		106,855,279.58	-398,248,525.14
1. 利息收入		5,291,966.83	5,197,864.84
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,291,966.83	5,197,864.84
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		62,314,382.64	-497,550,490.84
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,878,785.16	-531,037,974.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	777,531.94
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	14,596,678.83	-23,639,608.95
股利收益	6.4.7.19	53,596,488.97	56,349,560.31
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	38,596,643.70	93,406,270.98
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	652,286.41	697,829.88
减：二、营业总支出		33,549,765.19	32,647,586.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,356,389.28	26,089,231.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,271,277.81	5,217,846.27
3. 销售服务费		1,320,828.37	795,547.84
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		61,107.83	4,705.80
8. 其他费用	6.4.7.23	540,161.90	540,255.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		73,305,514.39	-430,896,111.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		73,305,514.39	-430,896,111.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		73,305,514.39	-430,896,111.73
----------	--	---------------	-----------------

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	1,951,566,158.04	-	3,246,449,917.62	5,198,016,075.66
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）	1,951,566,158.04	-	3,246,449,917.62	5,198,016,075.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	33,968,555.17	-	96,755,681.19	130,724,236.36
（一）、综合收益总额	-	-	73,305,514.39	73,305,514.39
（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）	33,968,555.17	-	23,450,166.80	57,418,721.97
其中：1. 基金申购款	387,222,921.26	-	657,108,700.58	1,044,331,621.84
2. 基金赎回款	-353,254,366.09	-	-633,658,533.78	-986,912,899.87
（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)	1,985,534,713.21	-	3,343,205,598.81	5,328,740,312.02
项目	上年度可比期间 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、本期期末净资产(基金净值)	1,950,716,429. 31	-	3,775,437,393. 27	5,726,153,822.5 8

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：

<u>张军红</u>	<u>张力铮</u>	<u>丁颖</u>
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 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 $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税前）}$ 。

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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

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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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
	2023 年 6 月 30 日
活期存款	268,623,757.12
等于：本金	268,561,661.08
加：应计利息	62,096.04
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	268,623,757.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,557,246,331.90	-	4,382,707,511.31	-174,538,820.59
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	4,557,246,331.90	-	4,382,707,511.31	-174,538,820.59

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			备注
	合同/名义 金额	2023 年 6 月 30 日 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	519,203,720.00	-	-	-
其中：股指期货投资	519,203,720.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	519,203,720.00	-	-	-

注：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。

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
IC2307	IC2307	279.00	334,286,640.00	4,543,560.00
IM2307	IM2307	147.00	193,299,120.00	3,838,480.00
合计				8,382,040.00
减：可抵销期货暂收款				8,382,040.00
净额				-

注：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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,667.65
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	31,632,258.23
其中：交易所市场	31,632,258.23

银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	208,015.44
预提费用	198,638.35
合计	32,042,579.67

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,821,863,684.93	1,821,863,684.93
本期申购	115,300,993.05	115,300,993.05
本期赎回（以“-”号填列）	-336,574,984.74	-336,574,984.74
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	1,600,589,693.24	1,600,589,693.24

建信中证 500 指数增强 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	129,702,473.11	129,702,473.11
本期申购	271,921,928.21	271,921,928.21
本期赎回（以“-”号填列）	-16,679,381.35	-16,679,381.35
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	384,945,019.97	384,945,019.97

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
上年度末	3,446,665,697.12	-408,153,140.43	3,038,512,556.69

本期利润	39,700,428.38	38,659,477.41	78,359,905.79
本期基金份额交易产生的变动数	-429,029,482.50	29,488,804.60	-399,540,677.90
其中：基金申购款	222,665,489.84	-17,466,862.58	205,198,627.26
基金赎回款	-651,694,972.34	46,955,667.18	-604,739,305.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,057,336,643.00	-340,004,858.42	2,717,331,784.58

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
上年度末	236,270,564.16	-28,333,203.23	207,937,360.93
本期利润	-4,991,557.69	-62,833.71	-5,054,391.40
本期基金份额交易产生的变动数	474,270,677.76	-51,279,833.06	422,990,844.70
其中：基金申购款	505,234,761.92	-53,324,688.60	451,910,073.32
基金赎回款	-30,964,084.16	2,044,855.54	-28,919,228.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	705,549,684.23	-79,675,870.00	625,873,814.23

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	1,075,746.14
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	4,210,133.38
其他	6,087.31
合计	5,291,966.83

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,878,785.16
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	-5,878,785.16

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
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,381,819,226.13
减：卖出股票成本总额	10,357,033,973.69
减：交易费用	30,664,037.60
买卖股票差价收入	-5,878,785.16

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	14,596,678.83

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	53,596,488.97
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	53,596,488.97

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	19,661,299.09
股票投资	19,661,299.09
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	18,935,344.61
权证投资	-
期货投资	18,935,344.61
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	38,596,643.70

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	646,952.38
基金转换费收入	5,334.03
合计	652,286.41

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	5,321.36
指数使用费	421,702.19
银行间账户维护费	9,000.00
合计	540,161.90

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	26,356,389.28	26,089,231.34
其中：支付销售机构的客户维护费	9,586,158.01	9,464,132.62

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,271,277.81	5,217,846.27

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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	建信中证 500 指数增强	合计
	A	C	
建信基金	-	467,876.72	467,876.72
合计	-	467,876.72	467,876.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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	建信中证 500 指数增强	合计
	A	C	
建信基金	-	332,481.22	332,481.22
合计	-	332,481.22	332,481.22

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 0.50%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值×约定年费率/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

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	268,623,757.12	1,075,746.14	298,070,355.41	1,059,336.27

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（2023 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
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新发未上市	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新发未上市	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新发未上市	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新发未上市	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新发未上市	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新发未上市	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新发未上市	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-

301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新发未上市	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新发未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新发未上市	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新发未上市	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新发未上市	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新发未上市	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新发未上市	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新发未上市	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新发未上市	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新发未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新发未上市	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-

301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新发未上市	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新发未上市	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新发未上市	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新发未上市	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新发未上市	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新发未上市	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新发未上市	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新发未上市	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新发未上市	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新发未上市	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新发未上市	87.30	53.24	392	34,219.71	20,870.08	-

301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新发未上市	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新发未上市	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新发未上市	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新发未上市	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新发未上市	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新发未上市	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新发未上市	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新发未上市	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新发未上市	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新发未上市	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新发未上市	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-

301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新发未上市	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新发未上市	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新发未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新发未上市	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新发未上市	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新发未上市	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新发未上市	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新发未上市	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新发未上市	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新发未上市	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新发未上市	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-

601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新发未上市	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新发未上市	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新发未上市	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新发未上市	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新发未上市	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新发未上市	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新发未上市	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新发未上市	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新发未上市	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新发未上市	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新发未上市	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-

688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新发未上市	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新发未上市	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新发未上市	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新发未上市	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新发未上市	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新发未上市	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新发未上市	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新发未上市	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新发未上市	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新发未上市	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新发未上市	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-

688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新发未上市	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新发未上市	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新发未上市	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新发未上市	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新发未上市	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新发未上市	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023年6月28日	重大资产重组	6.97	2023年7月3日	7.40	179,300	1,073,612.90	1,249,721.00	-

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 2023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	268,623,757.12	-	-	-	268,623,757.12
结算备付金	659,490,297.63	-	-	-	659,490,297.63
存出保证金	64,041,457.07	-	-	-	64,041,457.07
交易性金融资产	-	-	-	4,382,707,511.31	4,382,707,511.31
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	29,120,535.88	29,120,535.88
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,218,368.02	2,218,368.02

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	992,155,511.82	-	-	-4,414,046,415.21	5,406,201,927.03
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	-	-	-	36,782,592.86	36,782,592.86
应付赎回款	-	-	-	3,154,900.53	3,154,900.53
应付管理人报酬	-	-	-	4,275,614.21	4,275,614.21
应付托管费	-	-	-	855,122.85	855,122.85
应付销售服务费	-	-	-	350,804.89	350,804.89
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	32,042,579.67	32,042,579.67
负债总计	-	-	-	77,461,615.01	77,461,615.01
利率敏感度缺口	992,155,511.82	-	-	-4,336,584,800.20	5,328,740,312.02
上年度末 2022 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	287,945,054.19	-	-	-	287,945,054.19
结算备付金	538,214,825.41	-	-	-	538,214,825.41
存出保证金	52,143,236.42	-	-	-	52,143,236.42
交易性金融资产	-	-	-	-4,356,775,198.29	4,356,775,198.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	209,446.68	209,446.68
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,757,191.88	2,757,191.88
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	878,303,116.02	-	-	-4,359,741,836.85	5,238,044,952.87
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	-	-	-	2,045,907.75	2,045,907.75
应付管理人报酬	-	-	-	4,483,145.66	4,483,145.66
应付托管费	-	-	-	896,629.10	896,629.10
应付销售服务费	-	-	-	147,200.13	147,200.13
应付投资顾问费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	32,455,994.57	32,455,994.57
负债总计	-	-	-	40,028,877.21	40,028,877.21
利率敏感度缺口	878,303,116.02	-	-	-4,319,712,959.64	5,198,016,075.66

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为以完全复制为目标的被动型指数基金，按照成份股在中证 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	4,382,707,511.31	82.25	4,356,775,198.29	83.82
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	4,382,707,511.31	82.25	4,356,775,198.29	83.82

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	256,614,713.42	257,520,174.91
	业绩比较基准下降5%	-256,614,713.42	-257,520,174.91

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	4,379,632,655.89	4,339,438,190.93
第二层次	1,616,668.18	15,712,813.40
第三层次	1,458,187.24	1,624,193.96
合计	4,382,707,511.31	4,356,775,198.29

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	4,382,707,511.31	81.07
	其中：股票	4,382,707,511.31	81.07
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	928,114,054.75	17.17
8	其他各项资产	95,380,360.97	1.76
9	合计	5,406,201,927.03	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	27,539,654.00	0.52
B	采矿业	230,451,386.86	4.32
C	制造业	2,230,088,569.45	41.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	149,716,135.69	2.81
E	建筑业	46,190,033.32	0.87
F	批发和零售业	54,323,273.48	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	62,075,253.00	1.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	213,784,806.50	4.01
J	金融业	325,685,025.14	6.11
K	房地产业	57,693,194.89	1.08
L	租赁和商务服务业	25,378,822.20	0.48
M	科学研究和技术服务业	6,257,413.70	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	315,625.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	103,413,360.20	1.94
S	综合	3,776,703.00	0.07
	合计	3,536,689,256.43	66.37

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	184,190.00	0.00
B	采矿业	1,900,814.80	0.04
C	制造业	642,991,139.34	12.07

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,629,795.47	0.18
E	建筑业	33,490,902.85	0.63
F	批发和零售业	6,387,539.49	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	19,467,246.60	0.37
H	住宿和餐饮业	33,400.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,879,255.46	0.95
J	金融业	11,493,751.00	0.22
K	房地产业	21,538,656.00	0.40
L	租赁和商务服务业	1,819,164.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	15,022,433.74	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	11,042,418.57	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,940,955.56	0.24
R	文化、体育和娱乐业	7,196,592.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	846,018,254.88	15.88

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	002600	领益智造	7,662,450	52,947,529.50	0.99
2	601928	凤凰传媒	4,618,600	52,652,040.00	0.99
3	600498	烽火通信	2,561,500	52,177,755.00	0.98
4	002373	千方科技	3,663,045	49,963,933.80	0.94
5	601958	金钼股份	4,331,200	48,292,880.00	0.91
6	600517	国网英大	8,443,900	48,130,230.00	0.90
7	600566	济川药业	1,583,090	45,972,933.60	0.86

8	600535	天士力	3,078,100	44,663,231.00	0.84
9	000997	新大陆	2,322,675	43,898,557.50	0.82
10	300308	中际旭创	292,160	43,078,992.00	0.81
11	600901	江苏金租	10,080,558	41,632,704.54	0.78
12	600339	中油工程	10,070,400	40,986,528.00	0.77
13	600271	航天信息	2,984,900	40,863,281.00	0.77
14	603737	三棵树	613,868	40,159,244.56	0.75
15	002867	周大生	2,245,531	39,925,541.18	0.75
16	600038	中直股份	976,200	38,872,284.00	0.73
17	601991	大唐发电	11,703,000	38,736,930.00	0.73
18	603355	莱克电气	1,508,443	38,329,536.63	0.72
19	000878	云南铜业	3,467,914	38,320,449.70	0.72
20	600967	内蒙一机	3,727,500	37,647,750.00	0.71
21	601139	深圳燃气	5,159,980	37,616,254.20	0.71
22	000869	张裕 A	1,201,266	36,830,815.56	0.69
23	603688	石英股份	321,086	36,552,430.24	0.69
24	603228	景旺电子	1,402,600	35,976,690.00	0.68
25	600329	达仁堂	788,335	35,388,358.15	0.66
26	603218	日月股份	1,859,000	35,302,410.00	0.66
27	600563	法拉电子	253,726	34,836,579.80	0.65
28	000898	鞍钢股份	12,444,030	34,594,403.40	0.65
29	603456	九洲药业	1,263,390	34,591,618.20	0.65
30	000987	越秀资本	5,438,476	34,534,322.60	0.65
31	002966	苏州银行	5,260,319	34,455,089.45	0.65
32	000623	吉林敖东	2,104,351	33,753,790.04	0.63
33	600582	天地科技	5,764,307	33,605,909.81	0.63
34	600871	石化油服	16,836,300	33,335,874.00	0.63
35	002563	森马服饰	5,337,700	33,200,494.00	0.62
36	601717	郑煤机	2,657,400	33,084,630.00	0.62
37	002131	利欧股份	14,030,600	32,270,380.00	0.61
38	000630	铜陵有色	10,788,100	31,177,609.00	0.59
39	600315	上海家化	1,064,600	30,884,046.00	0.58
40	002673	西部证券	4,669,600	29,651,960.00	0.56
41	301029	怡合达	650,644	29,070,773.92	0.55
42	688006	杭可科技	935,713	28,511,175.11	0.54
43	002653	海思科	1,198,200	28,277,520.00	0.53
44	601869	长飞光纤	754,145	27,910,906.45	0.52
45	601128	常熟银行	4,064,346	27,718,839.72	0.52
46	000937	冀中能源	4,343,300	27,710,254.00	0.52
47	002531	天顺风能	1,754,900	26,727,127.00	0.50
48	000960	锡业股份	1,704,011	26,497,371.05	0.50
49	600109	国金证券	3,031,300	26,281,371.00	0.49
50	002568	百润股份	722,260	26,254,151.00	0.49

51	603885	吉祥航空	1,682,100	25,954,803.00	0.49
52	002422	科伦药业	872,400	25,892,832.00	0.49
53	300003	乐普医疗	1,124,900	25,433,989.00	0.48
54	601611	中国核建	2,952,300	24,946,935.00	0.47
55	002299	圣农发展	1,294,500	24,789,675.00	0.47
56	000031	大悦城	6,765,777	24,762,743.82	0.46
57	000415	渤海租赁	11,611,402	24,383,944.20	0.46
58	600160	巨化股份	1,761,060	24,267,406.80	0.46
59	000778	新兴铸管	5,886,100	24,015,288.00	0.45
60	600879	航天电子	2,757,665	23,412,575.85	0.44
61	600095	湘财股份	2,926,700	22,828,260.00	0.43
62	300438	鹏辉能源	472,800	22,713,312.00	0.43
63	600167	联美控股	3,254,900	22,686,653.00	0.43
64	002925	盈趣科技	1,156,400	22,434,160.00	0.42
65	688819	天能股份	608,550	22,418,982.00	0.42
66	601231	环旭电子	1,456,239	21,785,335.44	0.41
67	600373	中文传媒	1,630,200	21,714,264.00	0.41
68	002152	广电运通	1,833,500	21,488,620.00	0.40
69	688385	复旦微电	424,900	21,287,490.00	0.40
70	603596	伯特利	266,200	21,099,012.00	0.40
71	600161	天坛生物	772,240	20,966,316.00	0.39
72	688390	固德威	122,605	20,457,870.30	0.38
73	002745	木林森	2,207,823	20,311,971.60	0.38
74	688009	中国通号	3,488,633	20,234,071.40	0.38
75	600060	海信视像	808,300	20,005,425.00	0.38
76	300144	宋城演艺	1,580,203	19,594,517.20	0.37
77	603650	彤程新材	563,500	18,482,800.00	0.35
78	600637	东方明珠	2,356,741	18,429,714.62	0.35
79	300146	汤臣倍健	766,200	18,373,476.00	0.34
80	603317	天味食品	1,256,381	18,355,726.41	0.34
81	600998	九州通	1,733,281	17,991,456.78	0.34
82	688029	南微医学	209,547	17,090,653.32	0.32
83	600546	山煤国际	1,171,700	16,954,499.00	0.32
84	002056	横店东磁	924,798	16,840,571.58	0.32
85	002444	巨星科技	763,400	16,703,192.00	0.31
86	600497	驰宏锌锗	3,238,600	16,257,772.00	0.31
87	600528	中铁工业	1,641,300	16,216,044.00	0.30
88	002244	滨江集团	1,812,400	15,985,368.00	0.30
89	002025	航天电器	246,000	15,694,800.00	0.29
90	600827	百联股份	1,172,100	15,670,977.00	0.29
91	603707	健友股份	1,156,442	15,611,967.00	0.29
92	603156	养元饮品	612,900	15,138,630.00	0.28
93	300866	安克创新	172,650	15,106,875.00	0.28

94	002372	伟星新材	731,802	15,031,213.08	0.28
95	601598	中国外运	3,218,700	14,999,142.00	0.28
96	300832	新产业	251,200	14,820,800.00	0.28
97	300017	网宿科技	2,078,134	14,775,532.74	0.28
98	000959	首钢股份	4,044,600	14,156,100.00	0.27
99	600435	北方导航	1,220,200	14,020,098.00	0.26
100	688072	拓荆科技	32,723	13,939,016.31	0.26
101	000060	中金岭南	2,933,200	13,932,700.00	0.26
102	002155	湖南黄金	1,133,900	13,833,580.00	0.26
103	002081	金螳螂	2,952,400	13,315,324.00	0.25
104	600642	申能股份	1,899,200	13,275,408.00	0.25
105	603379	三美股份	549,106	12,909,482.06	0.24
106	600066	宇通客车	860,600	12,685,244.00	0.24
107	600699	均胜电子	717,519	12,657,035.16	0.24
108	600985	淮北矿业	1,092,300	12,583,296.00	0.24
109	600500	中化国际	2,247,260	12,494,765.60	0.23
110	300383	光环新网	1,161,200	12,482,900.00	0.23
111	688208	道通科技	401,000	12,154,310.00	0.23
112	002203	海亮股份	1,000,800	12,019,608.00	0.23
113	600968	海油发展	3,892,100	11,948,747.00	0.22
114	300212	易华录	356,357	11,841,743.11	0.22
115	000027	深圳能源	1,791,501	11,805,991.59	0.22
116	300861	美畅股份	270,380	11,726,380.60	0.22
117	603056	德邦股份	746,500	11,511,030.00	0.22
118	600764	中国海防	418,730	11,397,830.60	0.21
119	600737	中粮糖业	1,410,600	11,355,330.00	0.21
120	002683	广东宏大	380,639	11,206,012.16	0.21
121	002110	三钢闽光	2,647,300	11,171,606.00	0.21
122	603338	浙江鼎力	198,220	11,102,302.20	0.21
123	600707	彩虹股份	2,225,200	10,591,952.00	0.20
124	002273	水晶光电	878,386	10,487,928.84	0.20
125	300136	信维通信	512,100	10,282,968.00	0.19
126	000739	普洛药业	574,500	10,191,630.00	0.19
127	002223	鱼跃医疗	271,700	9,778,483.00	0.18
128	002384	东山精密	372,700	9,652,930.00	0.18
129	600399	抚顺特钢	933,700	9,523,740.00	0.18
130	600863	内蒙华电	2,289,000	9,499,350.00	0.18
131	603444	吉比特	18,733	9,199,963.63	0.17
132	600663	陆家嘴	878,220	8,668,031.40	0.16
133	002423	中粮资本	1,077,300	8,618,400.00	0.16
134	002608	江苏国信	1,053,100	7,971,967.00	0.15
135	600170	上海建工	2,947,128	7,927,774.32	0.15
136	002738	中矿资源	152,146	7,750,317.24	0.15

137	002128	电投能源	576,800	7,625,296.00	0.14
138	603589	口子窖	150,042	7,404,572.70	0.14
139	000887	中鼎股份	561,556	7,350,768.04	0.14
140	600079	人福医药	271,579	7,316,338.26	0.14
141	000553	安道麦 A	832,949	7,030,089.56	0.13
142	600556	天下秀	980,600	6,952,454.00	0.13
143	600885	宏发股份	217,715	6,934,222.75	0.13
144	300558	贝达药业	143,310	6,883,179.30	0.13
145	300251	光线传媒	849,100	6,869,219.00	0.13
146	000563	陕国投 A	2,239,580	6,830,719.00	0.13
147	002250	联化科技	630,740	6,597,540.40	0.12
148	603127	昭衍新药	152,993	6,257,413.70	0.12
149	601555	东吴证券	886,600	6,153,004.00	0.12
150	000636	风华高科	401,101	6,152,889.34	0.12
151	002518	科士达	148,700	5,949,487.00	0.11
152	002500	山西证券	1,041,800	5,813,244.00	0.11
153	000728	国元证券	880,550	5,741,186.00	0.11
154	002028	思源电气	118,500	5,536,320.00	0.10
155	603225	新凤鸣	496,035	5,481,186.75	0.10
156	002138	顺络电子	229,100	5,477,781.00	0.10
157	002294	信立泰	171,708	5,355,572.52	0.10
158	000537	广宇发展	452,801	5,284,187.67	0.10
159	601636	旗滨集团	605,236	5,217,134.32	0.10
160	600377	宁沪高速	527,800	5,188,274.00	0.10
161	600623	华谊集团	809,800	5,045,054.00	0.09
162	601608	中信重工	1,139,500	4,797,295.00	0.09
163	688234	天岳先进	61,400	4,539,916.00	0.09
164	000807	云铝股份	355,300	4,522,969.00	0.08
165	600390	五矿资本	794,220	4,272,903.60	0.08
166	603712	七一二	141,100	4,262,631.00	0.08
167	002192	融捷股份	60,900	4,069,947.00	0.08
168	603026	胜华新材	68,200	4,040,850.00	0.08
169	603868	飞科电器	63,269	3,991,641.21	0.07
170	002670	国盛金控	453,900	3,985,242.00	0.07
171	603786	科博达	59,500	3,909,150.00	0.07
172	000783	长江证券	652,800	3,786,240.00	0.07
173	000009	中国宝安	312,900	3,776,703.00	0.07
174	002078	太阳纸业	350,693	3,748,908.17	0.07
175	000683	远兴能源	514,500	3,699,255.00	0.07
176	688779	长远锂科	315,000	3,550,050.00	0.07
177	000423	东阿阿胶	66,000	3,527,700.00	0.07
178	600369	西南证券	965,700	3,524,805.00	0.07
179	688002	睿创微纳	76,291	3,417,836.80	0.06

180	688516	奥特维	18,017	3,394,402.80	0.06
181	002797	第一创业	564,400	3,228,368.00	0.06
182	601990	南京证券	389,500	3,186,110.00	0.06
183	600906	财达证券	441,400	3,178,080.00	0.06
184	600208	新湖中宝	1,206,800	2,992,864.00	0.06
185	603927	中科软	77,200	2,976,832.00	0.06
186	603826	坤彩科技	59,200	2,960,000.00	0.06
187	300253	卫宁健康	257,700	2,788,314.00	0.05
188	600598	北大荒	206,300	2,749,979.00	0.05
189	603883	老百姓	91,422	2,728,946.70	0.05
190	600027	华电国际	405,700	2,714,133.00	0.05
191	002690	美亚光电	104,183	2,682,712.25	0.05
192	300604	长川科技	56,100	2,664,189.00	0.05
193	688200	华峰测控	17,000	2,601,000.00	0.05
194	688099	晶晨股份	30,660	2,585,251.20	0.05
195	601098	中南传媒	222,700	2,583,320.00	0.05
196	688188	柏楚电子	13,588	2,562,153.28	0.05
197	601106	中国一重	755,200	2,537,472.00	0.05
198	002557	洽洽食品	56,600	2,351,730.00	0.04
199	002399	海普瑞	202,353	2,320,988.91	0.04
200	300724	捷佳伟创	20,500	2,303,175.00	0.04
201	000883	湖北能源	448,300	2,044,248.00	0.04
202	300699	光威复材	65,400	2,017,590.00	0.04
203	600166	福田汽车	530,500	1,803,700.00	0.03
204	601000	唐山港	510,900	1,803,477.00	0.03
205	002429	兆驰股份	317,200	1,744,600.00	0.03
206	300618	寒锐钴业	53,300	1,727,453.00	0.03
207	688536	思瑞浦	7,818	1,704,324.00	0.03
208	600516	方大炭素	213,400	1,323,080.00	0.02
209	600481	双良节能	94,000	1,314,120.00	0.02
210	688777	中控技术	20,929	1,313,922.62	0.02
211	601298	青岛港	179,300	1,249,721.00	0.02
212	300363	博腾股份	40,600	1,201,354.00	0.02
213	600021	上海电力	109,800	1,182,546.00	0.02
214	002926	华西证券	137,533	1,142,899.23	0.02
215	002595	豪迈科技	32,200	1,131,186.00	0.02
216	002409	雅克科技	15,200	1,107,776.00	0.02
217	601778	晶科科技	219,000	1,081,860.00	0.02
218	000591	太阳能	156,800	1,063,104.00	0.02
219	002985	北摩高科	23,990	1,058,438.80	0.02
220	000089	深圳机场	149,000	1,035,550.00	0.02
221	002625	光启技术	65,847	1,004,825.22	0.02
222	002939	长城证券	121,900	991,047.00	0.02

223	600056	中国医药	75,300	977,394.00	0.02
224	000975	银泰黄金	83,200	973,440.00	0.02
225	601969	海南矿业	142,865	940,051.70	0.02
226	300115	长盈精密	78,600	936,126.00	0.02
227	600415	小商品城	94,300	804,379.00	0.02
228	600062	华润双鹤	44,814	780,659.88	0.01
229	600118	中国卫星	25,500	719,355.00	0.01
230	001203	大中矿业	61,900	687,709.00	0.01
231	002032	苏泊尔	13,100	655,000.00	0.01
232	000738	航发控制	23,500	573,400.00	0.01
233	603638	艾迪精密	26,000	533,520.00	0.01
234	600096	云天化	30,500	520,635.00	0.01
235	002465	海格通信	41,500	429,110.00	0.01
236	002468	申通快递	30,800	333,256.00	0.01
237	000967	盈峰环境	62,500	315,625.00	0.01
238	603893	瑞芯微	3,000	218,550.00	0.00
239	300058	蓝色光标	19,700	190,499.00	0.00
240	002065	东华软件	5,500	38,830.00	0.00
241	601016	节能风电	10,270	37,690.90	0.00
242	300474	景嘉微	400	35,996.00	0.00
243	688301	奕瑞科技	126	35,586.18	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	603305	旭升集团	1,294,855	36,087,608.85	0.68
2	601800	中国交建	2,974,700	32,453,977.00	0.61
3	688639	华恒生物	301,003	27,234,751.44	0.51
4	688012	中微公司	173,215	27,099,486.75	0.51
5	601003	柳钢股份	6,006,700	24,267,068.00	0.46
6	600363	联创光电	579,000	21,480,900.00	0.40
7	688310	迈得医疗	573,495	18,793,431.15	0.35
8	688510	航亚科技	938,581	18,668,376.09	0.35
9	603556	海兴电力	690,230	17,421,405.20	0.33
10	601333	广深铁路	4,182,700	16,563,492.00	0.31
11	603898	好莱客	1,646,600	16,004,952.00	0.30
12	688670	金迪克	327,849	15,435,130.92	0.29
13	688060	云涌科技	277,163	15,271,681.30	0.29
14	600223	福瑞达	1,483,100	15,216,606.00	0.29
15	002990	盛视科技	405,400	14,918,720.00	0.28
16	688718	唯赛勃	796,802	13,792,642.62	0.26
17	603197	保隆科技	251,700	13,654,725.00	0.26
18	688236	春立医疗	548,401	13,435,824.50	0.25
19	002275	桂林三金	715,000	12,877,150.00	0.24

20	688622	禾信仪器	346,401	12,297,235.50	0.23
21	002603	以岭药业	453,600	11,652,984.00	0.22
22	600129	太极集团	194,008	11,541,535.92	0.22
23	603567	珍宝岛	761,800	11,396,528.00	0.21
24	600276	恒瑞医药	229,700	11,002,630.00	0.21
25	300015	爱尔眼科	571,194	10,595,648.70	0.20
26	603259	药明康德	169,500	10,561,545.00	0.20
27	603585	苏利股份	705,700	10,500,816.00	0.20
28	603345	安井食品	71,053	10,430,580.40	0.20
29	603701	德宏股份	733,800	10,412,622.00	0.20
30	600475	华光环能	865,600	10,283,328.00	0.19
31	000048	京基智农	504,003	9,838,138.56	0.18
32	300896	爱美客	22,000	9,788,900.00	0.18
33	600061	国投资本	1,356,200	9,656,144.00	0.18
34	603508	思维列控	519,100	8,850,655.00	0.17
35	300745	欣锐科技	190,400	8,409,968.00	0.16
36	002782	可立克	538,701	8,236,738.29	0.15
37	300633	开立医疗	135,000	7,357,500.00	0.14
38	002158	汉钟精机	290,400	7,248,384.00	0.14
39	603236	移远通信	123,800	7,144,498.00	0.13
40	603499	翔港科技	747,900	7,134,966.00	0.13
41	603279	景津装备	212,500	6,664,000.00	0.13
42	600483	福能股份	575,800	6,650,490.00	0.12
43	300884	狄耐克	500,700	6,629,268.00	0.12
44	002881	美格智能	190,500	6,505,575.00	0.12
45	600665	天地源	1,561,000	6,322,050.00	0.12
46	600961	株冶集团	778,300	6,296,447.00	0.12
47	603613	国联股份	167,236	6,176,025.48	0.12
48	603378	亚士创能	661,815	6,029,134.65	0.11
49	688599	天合光能	137,169	5,844,771.09	0.11
50	301153	中科江南	77,700	5,824,392.00	0.11
51	603096	新经典	281,500	5,731,340.00	0.11
52	688676	金盘科技	184,294	5,582,265.26	0.10
53	603222	济民医疗	533,300	5,562,319.00	0.10
54	688707	振华新材	179,000	5,511,410.00	0.10
55	600572	康恩贝	780,600	5,347,110.00	0.10
56	600085	同仁堂	91,400	5,260,984.00	0.10
57	688378	奥来德	104,361	5,155,433.40	0.10
58	688117	圣诺生物	175,175	5,062,557.50	0.10
59	688233	神工股份	148,400	4,686,472.00	0.09
60	688569	铁科轨道	106,340	4,473,723.80	0.08
61	688173	希荻微	193,098	4,418,082.24	0.08
62	600861	北京人力	188,600	4,375,520.00	0.08

63	688131	皓元医药	72,277	4,118,343.46	0.08
64	002242	九阳股份	258,700	3,867,565.00	0.07
65	000951	中国重汽	225,600	3,801,360.00	0.07
66	301076	新瀚新材	185,583	3,641,138.46	0.07
67	603320	迪贝电气	241,080	3,505,303.20	0.07
68	603997	继峰股份	241,600	3,454,880.00	0.06
69	603032	德新科技	93,940	3,244,687.60	0.06
70	603983	丸美股份	97,600	3,157,360.00	0.06
71	688013	天臣医疗	132,096	3,131,996.16	0.06
72	688625	呈和科技	79,901	3,131,320.19	0.06
73	688215	瑞晟智能	77,529	3,057,743.76	0.06
74	000999	华润三九	48,107	2,918,170.62	0.05
75	603877	太平鸟	111,000	2,806,080.00	0.05
76	002890	弘宇股份	162,920	2,406,328.40	0.05
77	002952	亚世光电	133,600	2,368,728.00	0.04
78	300856	科思股份	28,300	2,229,191.00	0.04
79	002215	诺普信	288,200	2,164,382.00	0.04
80	603579	荣泰健康	103,200	2,158,944.00	0.04
81	300717	华信新材	126,300	2,153,415.00	0.04
82	300515	三德科技	130,200	2,098,824.00	0.04
83	688210	统联精密	104,602	2,041,831.04	0.04
84	300751	迈为股份	11,676	1,977,680.88	0.04
85	603551	奥普家居	143,000	1,848,990.00	0.03
86	605086	龙高股份	85,100	1,768,378.00	0.03
87	688558	国盛智科	48,567	1,736,755.92	0.03
88	688063	派能科技	8,622	1,709,311.50	0.03
89	688425	铁建重工	347,400	1,670,994.00	0.03
90	688618	三旺通信	24,348	1,648,846.56	0.03
91	300969	恒帅股份	18,700	1,648,405.00	0.03
92	600674	川投能源	109,500	1,647,975.00	0.03
93	603239	浙江仙通	99,800	1,623,746.00	0.03
94	600012	皖通高速	151,500	1,587,720.00	0.03
95	603289	泰瑞机器	140,200	1,573,044.00	0.03
96	603311	金海高科	125,800	1,559,920.00	0.03
97	603290	斯达半导	7,200	1,549,440.00	0.03
98	688368	晶丰明源	11,526	1,466,222.46	0.03
99	603283	赛腾股份	32,700	1,455,150.00	0.03
100	301319	唯特偶	23,900	1,430,415.00	0.03
101	300045	华力创通	123,100	1,427,960.00	0.03
102	605300	佳禾食品	64,900	1,410,926.00	0.03
103	603093	南华期货	124,000	1,350,360.00	0.03
104	600023	浙能电力	248,700	1,260,909.00	0.02
105	000534	万泽股份	75,000	1,257,750.00	0.02

106	300976	达瑞电子	24,800	1,257,360.00	0.02
107	301011	华立科技	53,400	1,251,162.00	0.02
108	600458	时代新材	101,500	1,216,985.00	0.02
109	002641	公元股份	215,700	1,216,548.00	0.02
110	301239	普瑞眼科	12,100	1,186,768.00	0.02
111	688556	高测股份	22,300	1,185,022.00	0.02
112	300274	阳光电源	9,900	1,154,637.00	0.02
113	000922	佳电股份	87,100	1,146,236.00	0.02
114	002044	美年健康	159,600	1,134,756.00	0.02
115	603466	风语筑	81,220	1,128,958.00	0.02
116	300275	梅安森	80,460	1,118,394.00	0.02
117	300389	艾比森	54,500	1,110,165.00	0.02
118	300129	泰胜风能	112,700	1,080,793.00	0.02
119	300458	全志科技	39,000	1,062,750.00	0.02
120	300592	华凯易佰	38,600	1,050,692.00	0.02
121	688020	方邦股份	21,017	1,050,219.49	0.02
122	301087	可孚医疗	21,200	1,045,160.00	0.02
123	600026	中远海能	82,200	1,039,008.00	0.02
124	603226	菲林格尔	203,100	1,035,810.00	0.02
125	601766	中国中车	155,600	1,011,400.00	0.02
126	603129	春风动力	6,100	987,590.00	0.02
127	600429	三元股份	200,600	956,862.00	0.02
128	600138	中青旅	75,400	943,254.00	0.02
129	688126	沪硅产业	44,600	932,140.00	0.02
130	688036	传音控股	6,200	911,400.00	0.02
131	002963	豪尔赛	60,200	875,910.00	0.02
132	300795	米奥会展	21,000	875,910.00	0.02
133	603580	艾艾精工	60,400	859,492.00	0.02
134	600728	佳都科技	117,500	814,275.00	0.02
135	603719	良品铺子	32,500	812,825.00	0.02
136	300855	图南股份	22,570	797,172.40	0.01
137	603605	珀莱雅	7,019	788,935.60	0.01
138	300775	三角防务	23,100	780,318.00	0.01
139	300965	恒宇信通	16,300	771,642.00	0.01
140	600419	天润乳业	47,200	765,584.00	0.01
141	688101	三达膜	57,057	761,140.38	0.01
142	688466	金科环境	36,900	736,524.00	0.01
143	688386	泛亚微透	16,668	700,056.00	0.01
144	688021	奥福环保	26,060	675,475.20	0.01
145	300417	南华仪器	60,600	650,844.00	0.01
146	688278	特宝生物	14,600	641,086.00	0.01
147	603661	恒林股份	18,800	623,408.00	0.01
148	603217	元利科技	23,500	605,125.00	0.01

149	002283	天润工业	90,800	582,936.00	0.01
150	603639	海利尔	32,500	582,400.00	0.01
151	002988	豪美新材	32,400	553,716.00	0.01
152	300927	江天化学	31,300	512,381.00	0.01
153	688682	霍莱沃	5,977	500,513.98	0.01
154	300881	盛德鑫泰	14,820	488,319.00	0.01
155	000617	中油资本	62,900	454,767.00	0.01
156	688203	海正生材	32,600	449,228.00	0.01
157	603367	辰欣药业	29,200	443,256.00	0.01
158	603698	航天工程	20,700	341,550.00	0.01
159	601595	上海电影	11,900	336,294.00	0.01
160	002698	博实股份	16,600	290,334.00	0.01
161	002937	兴瑞科技	11,100	273,060.00	0.01
162	003041	真爱美家	15,660	248,367.60	0.00
163	601107	四川成渝	60,500	246,235.00	0.00
164	600986	浙文互联	33,200	212,480.00	0.00
165	688015	交控科技	11,800	206,146.00	0.00
166	002772	众兴菌业	16,300	184,190.00	0.00
167	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
168	601699	潞安环能	8,115	132,436.80	0.00
169	002811	郑中设计	14,650	116,174.50	0.00
170	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
171	605566	福莱茵特	4,600	105,800.00	0.00
172	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
173	688345	博力威	2,400	89,064.00	0.00
174	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
175	300428	立中集团	3,700	85,322.00	0.00
176	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
177	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
178	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
179	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
180	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
181	603192	汇得科技	3,300	62,997.00	0.00
182	603368	柳药集团	1,599	39,511.29	0.00
183	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
184	600976	健民集团	500	38,545.00	0.00
185	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
186	688401	路维光电	980	36,789.20	0.00
187	600660	福耀玻璃	1,000	35,850.00	0.00
188	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
189	000404	长虹华意	5,100	35,292.00	0.00
190	688120	华海清科	140	35,287.00	0.00
191	603992	松霖科技	2,300	35,282.00	0.00

192	600207	安彩高科	5,800	34,974.00	0.00
193	601668	中国建筑	5,980	34,325.20	0.00
194	002965	祥鑫科技	600	33,408.00	0.00
195	605108	同庆楼	1,000	33,400.00	0.00
196	002997	瑞鹄模具	1,100	32,703.00	0.00
197	601318	中国平安	700	32,480.00	0.00
198	301330	熵基科技	902	32,273.56	0.00
199	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
200	603219	富佳股份	2,240	31,920.00	0.00
201	603369	今世缘	600	31,680.00	0.00
202	600570	恒生电子	700	31,003.00	0.00
203	605088	冠盛股份	1,800	30,870.00	0.00
204	603871	嘉友国际	1,960	30,791.60	0.00
205	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
206	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
207	000733	振华科技	300	28,755.00	0.00
208	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
209	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
210	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
211	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
212	688543	国科军工	494	26,467.10	0.00
213	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
214	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
215	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
216	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
217	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
218	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
219	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
220	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
221	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
222	300502	新易盛	280	19,031.60	0.00
223	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
224	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
225	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
226	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
227	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
228	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
229	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
230	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
231	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
232	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
233	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
234	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00

235	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
236	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
237	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
238	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
239	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
240	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
241	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
242	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
243	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
244	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
245	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
246	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
247	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
248	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
249	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
250	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
251	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
252	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
253	600050	中国联通	1,900	9,120.00	0.00
254	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
255	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
256	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
257	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
258	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
259	301269	华大九天	68	8,353.12	0.00
260	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
261	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
262	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
263	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
264	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
265	688680	海优新材	54	6,578.28	0.00
266	300341	麦克奥迪	500	5,945.00	0.00
267	688608	恒玄科技	46	5,567.38	0.00
268	688195	腾景科技	98	5,236.14	0.00
269	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
270	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
271	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
272	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
273	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
274	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
275	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
276	688081	兴图新科	85	1,629.45	0.00
277	603867	新化股份	40	1,620.00	0.00

278	300813	泰林生物	52	1,485.64	0.00
279	605056	咸亨国际	100	1,417.00	0.00
280	300759	康龙化成	26	995.28	0.00
281	003011	海象新材	25	806.25	0.00
282	688609	九联科技	49	583.10	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	603444	吉比特	84,799,581.64	1.63
2	600498	烽火通信	82,611,453.67	1.59
3	300308	中际旭创	81,615,468.00	1.57
4	600535	天士力	78,543,393.00	1.51
5	601928	凤凰传媒	71,998,937.89	1.39
6	601958	金铂股份	69,380,357.79	1.33
7	603688	石英股份	66,514,557.00	1.28
8	688385	复旦微电	66,095,298.42	1.27
9	002603	以岭药业	61,105,988.34	1.18
10	688390	固德威	59,546,555.49	1.15
11	600271	航天信息	57,185,351.00	1.10
12	600161	天坛生物	56,568,398.52	1.09
13	300438	鹏辉能源	56,387,961.26	1.08
14	603650	彤程新材	54,848,914.31	1.06
15	600329	达仁堂	54,817,945.00	1.05
16	000630	铜陵有色	52,711,573.00	1.01
17	002155	湖南黄金	51,901,555.00	1.00
18	002600	领益智造	51,743,593.50	1.00
19	601699	潞安环能	51,676,228.25	0.99
20	600373	中文传媒	51,146,587.54	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	300308	中际旭创	109,229,377.70	2.10
2	603444	吉比特	105,756,605.24	2.03
3	601699	潞安环能	98,768,660.20	1.90
4	300115	长盈精密	91,148,949.00	1.75
5	688390	固德威	86,121,545.48	1.66
6	002384	东山精密	75,572,124.53	1.45
7	600160	巨化股份	73,282,404.03	1.41

8	603688	石英股份	73,266,118.00	1.41
9	600131	国网信通	67,351,938.55	1.30
10	600895	张江高科	64,118,818.60	1.23
11	002625	光启技术	59,825,962.00	1.15
12	000878	云南铜业	59,724,198.00	1.15
13	603228	景旺电子	59,014,910.24	1.14
14	603613	国联股份	58,557,723.04	1.13
15	603379	三美股份	57,870,455.51	1.11
16	300017	网宿科技	57,351,490.00	1.10
17	600566	济川药业	55,717,171.00	1.07
18	601928	凤凰传媒	54,892,891.60	1.06
19	601098	中南传媒	53,984,339.82	1.04
20	002409	雅克科技	51,509,633.03	0.99

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	10,363,304,987.62
卖出股票收入（成交）总额	10,381,819,226.13

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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是否超出基金合同规定的备选股票库

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	64,041,457.07
2	应收清算款	29,120,535.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,218,368.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	95,380,360.97

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	353,919	4,522.47	180,053,715.87	11.25	1,420,535,977.37	88.75
建信中证 500 指数增强 C	35,430	10,864.95	340,806,756.37	88.53	44,138,263.60	11.47
合计	389,349	5,099.63	520,860,472.24	26.23	1,464,674,240.97	73.77

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	365,727.63	0.02
	建信中证 500 指数增强 C	19,770.01	0.01
	合计	385,497.64	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	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
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	1,821,863,684.93	129,702,473.11
本报告期基金总申购份额	115,300,993.05	271,921,928.21
减：本报告期基金总赎回份额	336,574,984.74	16,679,381.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,600,589,693.24	384,945,019.97

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

本报告期内，基金管理人于 2023 年 1 月 19 日发布公告，自 2023 年 1 月 17 日起吴灵玲女

士不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起刘军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；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 3 月 18 日发布公告，自 2023 年 3 月 17 日起聘任张力铮先生担任建信基金管理有限责任公司副总裁，张威威先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁、首席信息官。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。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到董事长、非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举本行党委书记、副董事长、董事方合英先生为本行董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于 2023 年 4 月 17 日收到本行行长方合英先生的辞呈。董事会聘任本行党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为本行行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

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财产、基金管理业务、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

10.6.1 管理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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 (%)	
中金公司	2	3,861,942,827.94	18.63	3,575,939.37	19.18	-
东方财富证券	2	2,970,090,759.50	14.33	2,741,898.22	14.70	-
华创证券	2	1,611,151,973.39	7.77	1,484,359.89	7.96	-
中泰证券	2	1,325,020,871.63	6.39	1,083,879.03	5.81	-
宏信证券	1	1,121,203,636.06	5.41	1,044,187.52	5.60	-
国金证券	2	1,111,820,085.64	5.36	1,035,439.34	5.55	-
广发证券	2	1,110,578,193.12	5.36	1,024,599.47	5.49	-
国泰君安证券	1	1,047,502,748.71	5.05	965,060.81	5.18	-
方正证券	3	846,472,469.46	4.08	788,329.36	4.23	-
中信建投	1	785,543,404.41	3.79	723,727.60	3.88	-
东方证券	3	776,039,280.14	3.74	326,940.59	1.75	-
上海证券	1	735,428,454.89	3.55	677,562.25	3.63	-
安信证券	2	718,726,616.76	3.47	669,356.85	3.59	-
中信证券	4	663,976,725.22	3.20	611,697.74	3.28	-
信达证券	2	541,649,646.67	2.61	499,033.25	2.68	-
海通证券	1	397,804,025.38	1.92	370,475.49	1.99	-
长江证券	3	372,788,974.55	1.80	347,182.18	1.86	-
东北证券	1	253,888,440.14	1.22	236,446.79	1.27	-
中金财富证券	1	166,784,473.13	0.80	153,650.16	0.82	-
民生证券	1	165,632,258.88	0.80	154,253.48	0.83	-

光大证券	2	145,631,231.68	0.70	134,169.18	0.72	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
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、个股等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；

（4）佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内新增东方证券一个交易单元，无剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
民生证	-	-	-	-	-	-

券						
光大证 券	-	-	-	-	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
高华证 券	-	-	-	-	-	-
广州证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
宏源证 券	-	-	-	-	-	-
华融证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 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	关于新增安信证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 04 月 11 日

2	关于增加上海陆享基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 03 月 01 日
3	关于增加博时财富基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 24 日
4	关于新增深圳前海微众银行股份有限公司为建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金等代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 24 日
5	关于更新建信基金旗下公募基金产品适当性风险等级评定结果的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 15 日
6	关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 07 日
7	关于新增东兴证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 01 日
8	关于新增和耕传承基金销售有限公司为建信中证 500 指数增强型证券投资基金等代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 01 月 05 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2023 年 06 月 28 日-2023 年 06 月 30 日	206,489,474.06	216,858,544.23	-	423,348,018.29	21.32
产品特有风险							
<p>本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。</p>							

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

2023 年 8 月 30 日