

建信中证 500 指数量化增强型发起式证券
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
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	55
7.1 期末基金资产组合情况	55
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	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	90
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	90
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	90
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	90
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	91
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	91
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	91
7.12 投资组合报告附注	91
§ 8 基金份额持有人信息	93
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	93
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	93
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	93
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	94
§ 9 开放式基金份额变动	94
§ 10 重大事件揭示	95
10.1 基金份额持有人大会决议	95
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	95
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	95
10.4 基金投资策略的改变	95
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	95
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	95
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	96
10.8 其他重大事件	98
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	99
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	99
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	99
§ 12 备查文件目录	99
12.1 备查文件目录	99
12.2 存放地点	100
12.3 查阅方式	100

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金	
基金简称	建信中证 500 指数量化增强	
基金主代码	016267	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 月 23 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	188,883,712.38 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 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
下属分级基金的交易代码	016267	016268
报告期末下属分级基金的份额总额	143,999,583.07 份	44,884,129.31 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	本基金采用指数增强型投资策略，以标的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，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。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证 500 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。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	交通银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	吴曙明	陆志俊
	联系电话	010-66228888	95559
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-81-95533; 010-66228000	95559
传真		010-66228001	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银 城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		100033	200336
法定代表人		刘军	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英 蓝国际金融中心 16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
本期已实现收益	-1,872,747.31	-442,916.08
本期利润	-4,565,981.97	-993,088.03
加权平均基金份 额本期利润	-0.0404	-0.0315
本期加权平均净 值利润率	-3.82%	-2.97%
本期基金份额净 值增长率	3.91%	3.76%
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	1,813,348.53	497,458.51
期末可供分配基金份额利润	0.0126	0.0111
期末基金资产净值	149,941,094.71	46,668,521.35
期末基金份额净值	1.0413	1.0398
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	4.13%	3.98%

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。

4、本基金基金合同于 2022 年 12 月 23 日生效，截至报告期末未满一年。

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 指数量化增强发起 A

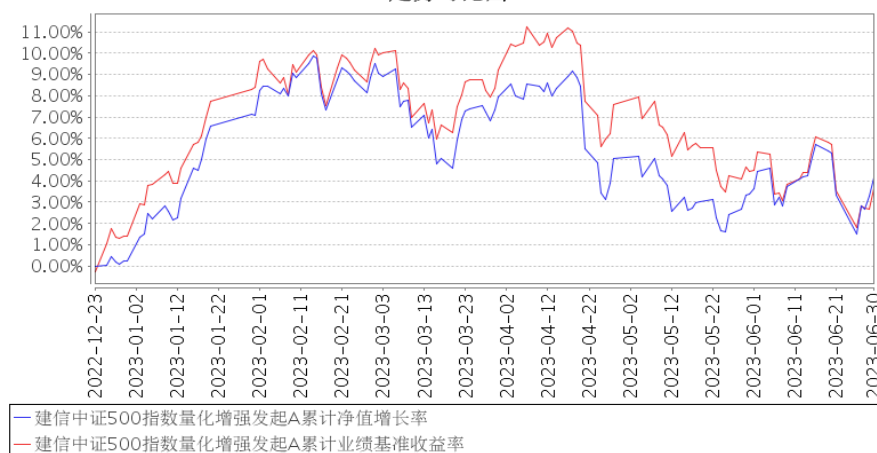
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.74%	0.89%	-0.77%	0.89%	1.51%	0.00%
过去三个月	-3.51%	0.78%	-5.10%	0.78%	1.59%	0.00%
过去六个月	3.91%	0.74%	2.20%	0.75%	1.71%	-0.01%
自基金合同生效起至今	4.13%	0.72%	3.64%	0.74%	0.49%	-0.02%

建信中证 500 指数量化增强发起 C

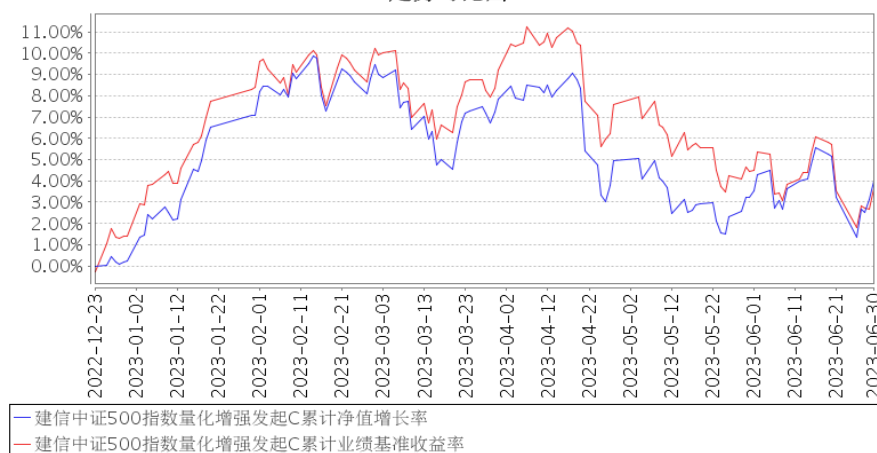
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.71%	0.89%	-0.77%	0.89%	1.48%	0.00%
过去三个月	-3.59%	0.78%	-5.10%	0.78%	1.51%	0.00%
过去六个月	3.76%	0.74%	2.20%	0.75%	1.56%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.98%	0.72%	3.64%	0.74%	0.34%	-0.02%

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指数量化增强发起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指数量化增强发起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：本基金基金合同于 2022 年 12 月 23 日生效，截至报告期末未满一年。本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

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		
刘明辉	本基金的基金经理	2022 年 12 月 23 日	-	7	刘明辉先生，硕士。2015 年 7 月毕业于北京大学应用统计专业，同年 7 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部助理研究员、研究员兼投资经理助理、投资经理、基金经理职务。2021 年 10 月 27 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；2022 年 10 月 17 日起任建信恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理；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。
叶乐天	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2022 年 12 月 23 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 指数量化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

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。在市场变化迅速的上半年，我们在模型中增大了高频数据的使用权重，并叠加了人工智能因子，以适应变化迅速的市场环境。

在报告期内，本基金保持与标的指数相近的行业分布和风格特征，在个股选择上做了一定的主动暴露，在报告期间获得了一定超额收益。

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 3.91%，波动率 0.74%，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 3.76%，波动率 0.74%，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

由于去年疫情管制对经济活动存在明显抑制，全年经济数据都有极强的基数效应。从两年复合增速角度来看，主要月度数据，包括工业增加值、出口、地产投资、基建投资等，表现偏弱，各项需求普遍偏弱。

在报告期间，市场风格有了巨大改变，出现结构性行情。以 TMT 为主的科技板块涨幅明显，而传统的消费、医药、新能源、房地产等相对表现较弱。市场中情绪化程度相对较高。随着各项稳增长政策的推出，我们认为短期政策预期升温，前期跌幅已经充分反映悲观预期，短期赔率较高。我们认为中国经济有强大的韧性和修复能力。随后疫情时代各方面数据进一步修复，结合政策的扶持，我们相信 A 股会有稳健的表现。

随着市场个股增多，同时个股的差异性越来越大，需要针对不同的标的指数采用不同的因子进行选股，对量化模型也提出了更高的要求。我们会基于最新的市场环境适时调整行业和风格偏离，并基于量化模型精选个股，同时扩充投资维度，结合主动的研究方法，精选股票力争取得稳定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

求履行估值及净值计算的复核责任。

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

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，建信基金管理有限责任公司在建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金投资运作、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、基金收益分

配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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并经托管人复核审查的有关建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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 500 指数量化增强型发起式证券投资基金

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	21,656,763.81	264,095.38
结算备付金		2,821,386.79	-
存出保证金		1,539,256.89	-
交易性金融资产	6.4.7.2	173,485,950.76	6,109,929.26
其中：股票投资		173,485,950.76	6,109,929.26
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	-	6,598,268.22
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		351,162.14	403,463.56
应收股利		-	-
应收申购款		7,165,545.77	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		207,020,066.16	13,375,756.42
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		8,638,767.09	-
应付赎回款		688,142.28	-
应付管理人报酬		152,661.21	2,926.83
应付托管费		15,266.12	292.68
应付销售服务费		9,446.95	81.53
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	906,166.45	6,079.92
负债合计		10,410,450.10	9,380.96
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	188,883,712.38	13,337,950.88
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	7,725,903.68	28,424.58
净资产合计		196,609,616.06	13,366,375.46
负债和净资产总计		207,020,066.16	13,375,756.42

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 188,883,712.38 份，其中建信中证 500 指数量化增强发起 A 基金份额总额 143,999,583.07 份，基金份额净值人民币 1.0413 元；建信中证 500 指数量化增强发起 C 基金份额总额 44,884,129.31 份，基金份额净值人民币 1.0398 元。

6.2 利润表

会计主体：建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金

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
一、营业总收入		-4,672,481.92
1. 利息收入		40,056.72
其中：存款利息收入	6.4.7.13	37,782.47

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		2,274.25
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,593,133.03
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,458,420.14
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	48,550.04
股利收益	6.4.7.19	1,816,737.07
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	-3,243,406.61
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	124,001.00
减：二、营业总支出		886,588.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	736,027.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	73,602.65
3. 销售服务费		48,057.35
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		507.91
8. 其他费用	6.4.7.23	28,393.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,559,070.00
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,559,070.00
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-5,559,070.00

注：本基金基金合同生效日为 2022 年 12 月 23 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金

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)	13,337,950.88	-	28,424.58	13,366,375.46
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)	13,337,950.88	-	28,424.58	13,366,375.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	175,545,761.50	-	7,697,479.10	183,243,240.60
(一)、综合收益总额	-	-	-5,559,070.00	-5,559,070.00
(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)	175,545,761.50	-	13,256,549.10	188,802,310.60
其中：1. 基金申购款	341,212,273.56	-	25,367,551.64	366,579,825.20
2. 基金赎回款	-165,666,512.06	-	-12,111,002.54	-177,777,514.60
(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)	188,883,712.38	-	7,725,903.68	196,609,616.06

注：本基金基金合同生效日为 2022 年 12 月 23 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

基金管理人负责人

张力铮

主管会计工作负责人

丁颖

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信中证 500 指数量化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[2022]1423 号《关于准予建信中证 500 指数量化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 500 指数量化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 13,334,913.62 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 61490173_A104 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 12 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 13,337,950.88 份基金份额，其中认购资金利息折合 3,037.26 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式等不同，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；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/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。A 类基金份额、C 类基金份额分设不同的基金代码，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将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。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,001,889.08 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数量化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（包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券

(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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%,投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证 500 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《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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值

日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一

项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负

债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 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) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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。

6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	21,656,763.81
等于：本金	21,655,793.17

加：应计利息	970.64
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	21,656,763.81

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	176,668,947.56	-	173,485,950.76	-3,182,996.80
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	176,668,947.56	-	173,485,950.76	-3,182,996.80

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 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍	-	-	-	-

生工具				
权益衍生工具	12,132,040.00	-	-	-
其中：股指期货投资	12,132,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	12,132,040.00	-	-	-

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	9.00	10,783,440.00	-40,680.00
IM2307	IM2307	1.00	1,314,960.00	7,040.00
合计				-33,640.00
减：可抵销期货暂收款				-33,640.00
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	1.84
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	886,328.82
其中：交易所市场	886,328.82
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	19,835.79
合计	906,166.45

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 500 指数量化增强发起 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	12,099,599.84	12,099,599.84
本期申购	215,030,283.51	215,030,283.51
本期赎回（以“-”号填列）	-83,130,300.28	-83,130,300.28
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	143,999,583.07	143,999,583.07

建信中证 500 指数量化增强发起 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	1,238,351.04	1,238,351.04
本期申购	126,181,990.05	126,181,990.05
本期赎回（以“-”号填列）	-82,536,211.78	-82,536,211.78
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	44,884,129.31	44,884,129.31

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 指数量化增强发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,575.11	24,284.42	25,859.53
本期利润	-1,872,747.31	-2,693,234.66	-4,565,981.97
本期基金份额交易产生的变动数	3,684,520.73	6,797,113.35	10,481,634.08
其中：基金申购款	6,513,077.27	10,078,274.74	16,591,352.01
基金赎回款	-2,828,556.54	-3,281,161.39	-6,109,717.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,813,348.53	4,128,163.11	5,941,511.64

建信中证 500 指数量化增强发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	79.66	2,485.39	2,565.05
本期利润	-442,916.08	-550,171.95	-993,088.03
本期基金份额交易产生的变动数	940,294.93	1,834,620.09	2,774,915.02
其中：基金申购款	3,631,889.81	5,144,309.82	8,776,199.63
基金赎回款	-2,691,594.88	-3,309,689.73	-6,001,284.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	497,458.51	1,286,933.53	1,784,392.04

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	18,112.37
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	19,274.81
其他	395.29

合计	37,782.47
----	-----------

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	-3,458,420.14
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-3,458,420.14

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	546,634,302.56
减：卖出股票成本总额	548,355,059.99
减：交易费用	1,737,662.71
买卖股票差价收入	-3,458,420.14

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

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	48,550.04

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	1,816,737.07
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	1,816,737.07

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	-3,209,766.61
股票投资	-3,209,766.61
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	-33,640.00
权证投资	-
期货投资	-33,640.00
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	-3,243,406.61

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	124,001.00
合计	124,001.00

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	19,835.79
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	8,536.42
证券组合费	20.94
合计	28,393.15

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	736,027.02
其中：支付销售机构的客户维护费	81,318.90

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，逐日累计每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00 / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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托管费	73,602.65

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10 / \text{当年天数}。$$

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 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 指数量化 增强发起 A	建信中证 500 指数量化 增强发起 C	合计
建信基金	-	0.20	0.20
交通银行	-	0.50	0.50
中国建设银行	-	4,077.69	4,077.69
合计	-	4,078.39	4,078.39

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 0.30%。销售服务费的计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
基金合同生效日(2022 年 12 月 23 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,889.08	-
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	10,001,889.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.95%	-

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	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期	21,656,763.81	18,112.37

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	237	2,815.56	4,981.74	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新发未上市	15.38	14.87	115	1,768.70	1,710.05	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新发未上市	44.48	39.48	39	1,734.72	1,539.72	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新发未上市	28.84	30.78	112	3,230.08	3,447.36	-
300804	广	2023	6个月	新发	42.45	32.97	160	6,792.00	5,275.20	-

	康生化	年 6 月 15 日		未上市						
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新发未上市	41.20	42.69	178	7,333.60	7,598.82	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新发未上市	34.00	34.93	138	4,692.00	4,820.34	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新发未上市	46.13	34.40	139	6,412.07	4,781.60	-
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	57.88	49.17	122	7,061.36	5,998.74	-
301225	恒勃股份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新发未上市	35.66	33.26	200	7,132.00	6,652.00	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新发未上市	72.50	58.42	87	6,307.50	5,082.54	-
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新发未上市	30.22	25.50	245	7,403.90	6,247.50	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	38.13	31.03	238	9,074.94	7,385.14	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新发未上市	29.60	71.42	197	5,831.20	14,069.74	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新发未上市	37.40	36.07	202	7,554.80	7,286.14	-
301305	朗	2023	6 个月	新发	25.25	19.69	272	6,868.00	5,355.68	-

	坤环境	年 5 月 15 日		未上市						
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新发未上市	32.34	31.86	229	7,405.86	7,295.94	-
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新发未上市	67.28	65.43	147	9,890.16	9,618.21	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新发未上市	32.29	51.12	158	5,101.82	8,076.96	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新发未上市	13.06	20.62	557	7,274.42	11,485.34	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新发未上市	39.06	39.36	106	4,140.36	4,172.16	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新发未上市	76.80	107.95	109	8,371.20	11,766.55	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新发未上市	14.81	13.73	380	5,627.80	5,217.40	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新发未上市	32.60	30.37	134	4,368.40	4,069.58	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新发未上市	17.55	16.75	327	5,738.85	5,477.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新发未上市	50.00	48.39	108	5,400.00	5,226.12	-
301360	荣	2023	6 个月	新发	71.88	92.60	84	6,037.92	7,778.40	-

	旗科技	年 4 月 17 日		未上市						
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新发未上市	24.66	22.51	231	5,696.46	5,199.81	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新发未上市	23.80	32.84	216	5,140.80	7,093.44	-
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新发未上市	46.16	35.72	215	9,924.40	7,679.80	-
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新发未上市	58.32	45.36	165	9,622.80	7,484.40	-
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	2,338	62,377.84	62,377.84	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	26.68	26.68	260	6,936.80	6,936.80	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新发未上市	53.27	40.20	136	7,244.72	5,467.20	-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新发未上市	43.99	51.57	153	6,730.47	7,890.21	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新发未上市	26.35	30.60	178	4,690.30	5,446.80	-
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新发未上市	28.75	21.02	327	9,401.25	6,873.54	-
301488	豪	2023	1 个月	新发	39.78	39.78	1,480	58,874.40	58,874.40	-

	恩 汽 电	年 6 月 26 日	内(含)	未上 市						
301488	豪 恩 汽 电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新发 未上 市	39.78	39.78	165	6,563.70	6,563.70	-
601061	中 信 金 属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新发 未上 市	6.58	7.58	565	3,717.70	4,282.70	-
601065	江 盐 集 团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新发 未上 市	10.36	11.84	207	2,144.52	2,450.88	-
601133	柏 诚 股 份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新发 未上 市	11.66	12.26	186	2,168.76	2,280.36	-
603125	常 青 科 技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新发 未上 市	25.98	24.53	65	1,688.70	1,594.45	-
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	199	7,193.85	7,587.87	-
688352	顾 中 科 技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新发 未上 市	12.10	12.07	579	7,005.90	6,988.53	-
688429	时 创 能 源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新发 未上 市	19.20	25.53	195	3,744.00	4,978.35	-
688433	华	2023	6 个月	新发	26.66	31.50	167	4,452.22	5,260.50	-

	曙 高 科	年 4 月 7 日		未上 市							
688443	智 翔 金 泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新发 未上 市	37.88	29.49	364	13,788.32	10,734.36	-	
688458	美 芯 晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新发 未上 市	75.00	90.76	74	5,550.00	6,716.24	-	
688469	中 芯 集 成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新发 未上 市	5.69	5.41	2,174	12,370.06	11,761.34	-	
688472	阿 特 斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新发 未上 市	11.10	17.04	731	8,114.10	12,456.24	-	
688479	友 车 科 技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新发 未上 市	33.99	29.49	133	4,520.67	3,922.17	-	
688484	南 芯 科 技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新发 未上 市	39.99	36.71	211	8,437.89	7,745.81	-	
688512	慧 智 微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新发 未上 市	20.92	19.16	278	5,815.76	5,326.48	-	
688523	航 天 环 宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新发 未上 市	21.86	23.85	252	5,508.72	6,010.20	-	
688543	国 科 军 工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新发 未上 市	43.67	53.05	134	5,851.78	7,108.70	-	
688552	航 天 南 湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新发 未上 市	21.17	23.50	239	5,059.63	5,616.50	-	
688562	航	2023	6 个月	新发	12.68	22.31	369	4,678.92	8,232.39	-	

	天软件	年 5 月 15 日		未上市						
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新发未上市	30.26	25.33	200	6,052.00	5,066.00	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新发未上市	135.80	120.41	69	9,370.20	8,308.29	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新发未上市	125.80	118.03	46	5,786.80	5,429.38	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	26.74	40.68	205	5,481.70	8,339.40	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新发未上市	11.18	14.59	460	5,142.80	6,711.40	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新发未上市	125.88	86.79	52	6,545.76	4,513.08	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新发未上市	9.26	18.59	551	5,102.26	10,243.09	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新发未上市	25.28	29.87	145	3,665.60	4,331.15	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基
金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清

算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临

每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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	21,656,763.81	-	-	-	21,656,763.81
结算备付金	2,821,386.79	-	-	-	2,821,386.79
存出保证金	1,539,256.89	-	-	-	1,539,256.89
交易性金融资产	-	-	-	173,485,950.76	173,485,950.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	351,162.14	351,162.14
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,165,545.77	7,165,545.77
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	26,017,407.49	-	-	181,002,658.67	207,020,066.16
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	-	-	-	8,638,767.09	8,638,767.09
应付赎回款	-	-	-	688,142.28	688,142.28
应付管理人报酬	-	-	-	152,661.21	152,661.21
应付托管费	-	-	-	15,266.12	15,266.12
应付销售服务费	-	-	-	9,446.95	9,446.95
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	906,166.45	906,166.45
负债总计	-	-	-	10,410,450.10	10,410,450.10
利率敏感度缺口	26,017,407.49	-	-	170,592,208.57	196,609,616.06
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	264,095.38	-	-	-	264,095.38
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	6,109,929.26	6,109,929.26
衍生金融资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	403,463.56	403,463.56
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	6,598,268.22	-	-	-	6,598,268.22
资产总计	6,862,363.60	-	-	6,513,392.82	13,375,756.42
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	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	6,079.92	6,079.92
应付托管费	-	-	-	292.68	292.68
应付销售服务费	-	-	-	81.53	81.53
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,926.83	2,926.83
负债总计	-	-	-	9,380.96	9,380.96
利率敏感度缺口	6,862,363.60	-	-	6,504,011.86	13,366,375.46

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。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

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%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时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	173,485,950.76	88.24	6,109,929.26	45.71
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	173,485,950.76	88.24	6,109,929.26	45.71

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金成立不满一年，尚无足够经验数据。

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	172,911,859.90	6,109,929.26
第二层次	134,752.74	-
第三层次	439,338.12	-
合计	173,485,950.76	6,109,929.26

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、境内股票涨跌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	173,485,950.76	83.80
	其中：股票	173,485,950.76	83.80
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	24,478,150.60	11.82
8	其他各项资产	9,055,964.80	4.37
9	合计	207,020,066.16	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	1,202,620.00	0.61
B	采矿业	12,592,384.00	6.40

C	制造业	76,830,815.89	39.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,628,074.28	2.35
E	建筑业	2,748,095.00	1.40
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,671,274.00	1.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,650,237.88	4.40
J	金融业	10,891,697.90	5.54
K	房地产业	4,793,510.07	2.44
L	租赁和商务服务业	1,026,921.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	284,086.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	1,047,875.00	0.53
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	4,900,154.00	2.49
S	综合	-	-
	合计	132,267,745.02	67.27

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	238,430.00	0.12
B	采矿业	961,316.00	0.49
C	制造业	30,152,330.31	15.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	407,699.47	0.21
E	建筑业	961,462.87	0.49
F	批发和零售业	204,687.65	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	13,196.70	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,625,480.12	0.83

J	金融业	3,856,175.00	1.96
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	1,237,800.50	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	10,137.28	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	1,239,519.84	0.63
R	文化、体育和娱乐业	309,970.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	41,218,205.74	20.96

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	601611	中国核建	313,600	2,649,920.00	1.35
2	002926	华西证券	315,200	2,619,312.00	1.33
3	002128	电投能源	196,700	2,600,374.00	1.32
4	600582	天地科技	442,900	2,582,107.00	1.31
5	600517	国网英大	440,600	2,511,420.00	1.28
6	600271	航天信息	181,500	2,484,735.00	1.26
7	600339	中油工程	609,600	2,481,072.00	1.26
8	600167	联美控股	349,200	2,433,924.00	1.24
9	688009	中国通号	418,698	2,428,448.40	1.24
10	000898	鞍钢股份	869,800	2,418,044.00	1.23
11	600498	烽火通信	118,700	2,417,919.00	1.23

12	600535	天士力	166,400	2,414,464.00	1.23
13	600038	中直股份	60,000	2,389,200.00	1.22
14	000869	张裕 A	77,200	2,366,952.00	1.20
15	600663	陆家嘴	237,961	2,348,675.07	1.19
16	601928	凤凰传媒	203,400	2,318,760.00	1.18
17	002373	千方科技	166,600	2,272,424.00	1.16
18	000987	越秀资本	352,582	2,238,895.70	1.14
19	002600	领益智造	312,600	2,160,066.00	1.10
20	601231	环旭电子	136,800	2,046,528.00	1.04
21	002531	天顺风能	128,800	1,961,624.00	1.00
22	600528	中铁工业	196,700	1,943,396.00	0.99
23	300308	中际旭创	11,974	1,765,566.30	0.90
24	603355	莱克电气	69,400	1,763,454.00	0.90
25	600373	中文传媒	126,200	1,680,984.00	0.85
26	002867	周大生	91,600	1,628,648.00	0.83
27	601598	中国外运	345,200	1,608,632.00	0.82
28	601991	大唐发电	485,000	1,605,350.00	0.82
29	002563	森马服饰	247,700	1,540,694.00	0.78
30	600563	法拉电子	11,100	1,524,030.00	0.78
31	000031	大悦城	414,500	1,517,070.00	0.77
32	301029	怡合达	33,500	1,496,780.00	0.76
33	000553	安道麦 A	173,500	1,464,340.00	0.74
34	603218	日月股份	74,900	1,422,351.00	0.72
35	601179	中国西电	253,800	1,373,058.00	0.70
36	600489	中金黄金	126,600	1,307,778.00	0.67
37	002299	圣农发展	62,800	1,202,620.00	0.61
38	600871	石化油服	606,300	1,200,474.00	0.61
39	002152	广电运通	102,300	1,198,956.00	0.61
40	002423	中粮资本	149,700	1,197,600.00	0.61
41	601958	金钼股份	107,200	1,195,280.00	0.61
42	603786	科博达	17,900	1,176,030.00	0.60
43	600131	国网信通	58,200	1,175,058.00	0.60
44	688208	道通科技	35,200	1,066,912.00	0.54
45	300558	贝达药业	22,100	1,061,463.00	0.54
46	000967	盈峰环境	207,500	1,047,875.00	0.53
47	600901	江苏金租	252,840	1,044,229.20	0.53
48	002368	太极股份	23,000	946,910.00	0.48
49	603228	景旺电子	36,900	946,485.00	0.48
50	002372	伟星新材	45,500	934,570.00	0.48
51	000537	广宇发展	79,500	927,765.00	0.47
52	002518	科士达	23,100	924,231.00	0.47
53	603826	坤彩科技	17,900	895,000.00	0.46
54	688234	天岳先进	12,000	887,280.00	0.45

55	603225	新凤鸣	78,500	867,425.00	0.44
56	688390	固德威	5,186	865,335.96	0.44
57	002025	航天电器	13,500	861,300.00	0.44
58	002032	苏泊尔	17,000	850,000.00	0.43
59	603650	彤程新材	25,200	826,560.00	0.42
60	600988	赤峰黄金	61,200	823,752.00	0.42
61	000738	航发控制	33,600	819,840.00	0.42
62	000937	冀中能源	127,200	811,536.00	0.41
63	688072	拓荆科技	1,873	797,841.81	0.41
64	300604	长川科技	16,700	793,083.00	0.40
65	002080	中材科技	37,900	777,708.00	0.40
66	603379	三美股份	32,300	759,373.00	0.39
67	002463	沪电股份	35,100	734,994.00	0.37
68	600079	人福医药	27,200	732,768.00	0.37
69	600399	抚顺特钢	71,400	728,280.00	0.37
70	603596	伯特利	9,000	713,340.00	0.36
71	300058	蓝色光标	72,500	701,075.00	0.36
72	688385	复旦微电	13,800	691,380.00	0.35
73	600764	中国海防	25,300	688,666.00	0.35
74	000997	新大陆	36,400	687,960.00	0.35
75	603688	石英股份	6,000	683,040.00	0.35
76	300251	光线传媒	84,000	679,560.00	0.35
77	002901	大博医疗	21,500	668,220.00	0.34
78	600329	达仁堂	14,800	664,372.00	0.34
79	002568	百润股份	17,400	632,490.00	0.32
80	688099	晶晨股份	7,459	628,942.88	0.32
81	601228	广州港	183,400	592,382.00	0.30
82	600027	华电国际	88,012	588,800.28	0.30
83	300832	新产业	9,800	578,200.00	0.29
84	300383	光环新网	52,900	568,675.00	0.29
85	600909	华安证券	119,300	557,131.00	0.28
86	601666	平煤股份	72,700	548,158.00	0.28
87	000988	华工科技	13,800	524,538.00	0.27
88	601869	长飞光纤	13,700	507,037.00	0.26
89	300850	新强联	13,200	493,416.00	0.25
90	002653	海思科	20,800	490,880.00	0.25
91	688006	杭可科技	15,526	473,077.22	0.24
92	688188	柏楚电子	2,400	452,544.00	0.23
93	600497	驰宏锌锗	89,900	451,298.00	0.23
94	300418	昆仑万维	10,800	435,024.00	0.22
95	002192	融捷股份	6,400	427,712.00	0.22
96	002465	海格通信	40,300	416,702.00	0.21
97	002439	启明星辰	14,000	416,640.00	0.21

98	000975	银泰黄金	35,300	413,010.00	0.21
99	002738	中矿资源	7,980	406,501.20	0.21
100	600566	济川药业	13,400	389,136.00	0.20
101	601106	中国一重	113,500	381,360.00	0.19
102	002156	通富微电	16,600	375,160.00	0.19
103	000960	锡业股份	24,000	373,200.00	0.19
104	600118	中国卫星	12,500	352,625.00	0.18
105	300115	长盈精密	29,400	350,154.00	0.18
106	600315	上海家化	11,700	339,417.00	0.17
107	600707	彩虹股份	69,400	330,344.00	0.17
108	600095	湘财股份	42,200	329,160.00	0.17
109	688029	南微医学	4,000	326,240.00	0.17
110	600415	小商品城	38,200	325,846.00	0.17
111	603885	吉祥航空	20,800	320,944.00	0.16
112	002925	盈趣科技	16,100	312,340.00	0.16
113	688002	睿创微纳	6,800	304,640.00	0.15
114	688248	南网科技	7,400	284,086.00	0.14
115	600435	北方导航	24,300	279,207.00	0.14
116	002131	利欧股份	120,500	277,150.00	0.14
117	000066	中国长城	18,900	261,387.00	0.13
118	603444	吉比特	500	245,555.00	0.12
119	688082	盛美上海	2,200	242,880.00	0.12
120	000778	新兴铸管	59,300	241,944.00	0.12
121	600967	内蒙一机	23,500	237,350.00	0.12
122	300182	捷成股份	35,000	220,850.00	0.11
123	002155	湖南黄金	17,500	213,500.00	0.11
124	300474	景嘉微	2,300	206,977.00	0.11
125	600060	海信视像	8,300	205,425.00	0.10
126	300017	网宿科技	28,800	204,768.00	0.10
127	603868	飞科电器	2,900	182,961.00	0.09
128	688779	长远锂科	15,000	169,050.00	0.09
129	002384	东山精密	6,500	168,350.00	0.09
130	300741	华宝股份	7,500	160,650.00	0.08
131	002966	苏州银行	22,900	149,995.00	0.08
132	002468	申通快递	13,800	149,316.00	0.08
133	603000	人民网	5,000	146,000.00	0.07
134	300001	特锐德	6,600	137,148.00	0.07
135	600705	中航产融	34,700	132,901.00	0.07
136	603638	艾迪精密	5,900	121,068.00	0.06
137	300699	光威复材	3,880	119,698.00	0.06
138	601969	海南矿业	18,000	118,440.00	0.06
139	300212	易华录	3,500	116,305.00	0.06
140	603338	浙江鼎力	2,000	112,020.00	0.06

141	600928	西安银行	31,300	110,176.00	0.06
142	601636	旗滨集团	11,500	99,130.00	0.05
143	600970	中材国际	7,700	98,175.00	0.05
144	603893	瑞芯微	1,100	80,135.00	0.04
145	002745	木林森	8,500	78,200.00	0.04
146	688256	寒武纪	400	75,200.00	0.04
147	300136	信维通信	3,700	74,296.00	0.04
148	300395	菲利华	1,300	63,960.00	0.03
149	603816	顾家家居	600	22,890.00	0.01
150	000739	普洛药业	100	1,774.00	0.00
151	300253	卫宁健康	100	1,082.00	0.00
152	002670	国盛金控	100	878.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603305	旭升集团	74,600	2,079,102.00	1.06
2	600276	恒瑞医药	28,900	1,384,310.00	0.70
3	601319	中国人保	232,900	1,360,136.00	0.69
4	600129	太极集团	22,300	1,326,627.00	0.67
5	300927	江天化学	78,600	1,286,682.00	0.65
6	603580	艾艾精工	86,700	1,233,741.00	0.63
7	603259	药明康德	19,700	1,227,507.00	0.62
8	300015	爱尔眼科	66,062	1,225,450.10	0.62
9	300896	爱美客	2,600	1,156,870.00	0.59
10	601288	农业银行	327,300	1,155,369.00	0.59
11	601003	柳钢股份	285,100	1,151,804.00	0.59
12	688060	云涌科技	19,833	1,092,798.30	0.56
13	002275	桂林三金	59,400	1,069,794.00	0.54
14	601898	中煤能源	113,900	961,316.00	0.49
15	601800	中国交建	87,700	956,807.00	0.49
16	688625	呈和科技	23,717	929,469.23	0.47
17	300633	开立医疗	16,400	893,800.00	0.45
18	688425	铁建重工	185,200	890,812.00	0.45
19	688236	春立医疗	33,667	824,841.50	0.42
20	002637	赞宇科技	78,000	804,180.00	0.41
21	600961	株冶集团	95,700	774,213.00	0.39
22	688510	航亚科技	38,800	771,732.00	0.39
23	688021	奥福环保	28,400	736,128.00	0.37
24	000030	富奥股份	144,000	725,760.00	0.37
25	300515	三德科技	42,500	685,100.00	0.35

26	600085	同仁堂	11,600	667,696.00	0.34
27	600572	康恩贝	94,700	648,695.00	0.33
28	300717	华信新材	36,500	622,325.00	0.32
29	688718	唯赛勃	35,800	619,698.00	0.32
30	000617	中油资本	70,200	507,546.00	0.26
31	603661	恒林股份	14,800	490,768.00	0.25
32	601658	邮储银行	100,000	489,000.00	0.25
33	300428	立中集团	21,200	488,872.00	0.25
34	603032	德新科技	13,400	462,836.00	0.24
35	300884	狄耐克	33,100	438,244.00	0.22
36	603499	翔港科技	44,100	420,714.00	0.21
37	688345	博力威	11,327	420,344.97	0.21
38	300554	三超新材	19,600	408,268.00	0.21
39	600011	华能国际	40,200	372,252.00	0.19
40	688020	方邦股份	7,293	364,431.21	0.19
41	688350	富淼科技	21,200	360,188.00	0.18
42	603093	南华期货	31,600	344,124.00	0.18
43	603236	移远通信	5,900	340,489.00	0.17
44	603192	汇得科技	17,200	328,348.00	0.17
45	603466	风语筑	22,300	309,970.00	0.16
46	688161	威高骨科	6,800	294,508.00	0.15
47	688173	希荻微	12,400	283,712.00	0.14
48	300396	迪瑞医疗	8,100	263,169.00	0.13
49	688569	铁科轨道	6,200	260,834.00	0.13
50	002937	兴瑞科技	10,000	246,000.00	0.13
51	002907	华森制药	16,100	245,042.00	0.12
52	002952	亚世光电	13,500	239,355.00	0.12
53	002772	众兴菌业	21,100	238,430.00	0.12
54	002938	鹏鼎控股	9,800	238,042.00	0.12
55	603997	继峰股份	15,300	218,790.00	0.11
56	603197	保隆科技	3,900	211,575.00	0.11
57	603639	海利尔	11,400	204,288.00	0.10
58	688036	传音控股	1,370	201,390.00	0.10
59	688012	中微公司	1,200	187,740.00	0.10
60	301070	开勒股份	5,000	187,000.00	0.10
61	002988	豪美新材	10,700	182,863.00	0.09
62	300389	艾比森	8,800	179,256.00	0.09
63	601566	九牧王	12,900	155,058.00	0.08
64	301153	中科江南	1,400	104,944.00	0.05
65	300857	协创数据	3,900	102,492.00	0.05
66	000028	国药一致	2,240	97,686.40	0.05
67	688676	金盘科技	3,200	96,928.00	0.05
68	603719	良品铺子	3,700	92,537.00	0.05

69	002912	中新赛克	1,900	83,619.00	0.04
70	301395	仁信新材	2,598	69,314.64	0.04
71	301488	豪恩汽电	1,645	65,438.10	0.03
72	688063	派能科技	184	36,478.00	0.02
73	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
74	000534	万泽股份	1,500	25,155.00	0.01
75	601339	百隆东方	3,600	20,160.00	0.01
76	002957	科瑞技术	900	18,243.00	0.01
77	301293	三博脑科	197	14,069.74	0.01
78	603162	海通发展	774	13,196.70	0.01
79	688472	阿特斯	731	12,456.24	0.01
80	301325	曼恩斯特	109	11,766.55	0.01
81	688469	中芯集成	2,174	11,761.34	0.01
82	301320	豪江智能	557	11,485.34	0.01
83	688443	智翔金泰	364	10,734.36	0.01
84	688629	华丰科技	571	10,707.49	0.01
85	688621	阳光诺和	175	10,293.50	0.01
86	688198	佰仁医疗	93	9,868.23	0.01
87	301310	鑫宏业	147	9,618.21	0.00
88	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
89	688682	霍莱沃	100	8,374.00	0.00
90	688582	芯动联科	205	8,339.40	0.00
91	688576	西山科技	69	8,308.29	0.00
92	688190	云路股份	113	8,249.00	0.00
93	688562	航天软件	369	8,232.39	0.00
94	301315	威士顿	158	8,076.96	0.00
95	688217	睿昂基因	200	8,030.00	0.00
96	688377	迪威尔	318	7,965.90	0.00
97	301399	英特科技	153	7,890.21	0.00
98	301360	荣旗科技	84	7,778.40	0.00
99	688484	南芯科技	211	7,745.81	0.00
100	301383	天键股份	215	7,679.80	0.00
101	301141	中科磁业	178	7,598.82	0.00
102	688146	中船特气	199	7,587.87	0.00
103	301387	光大同创	165	7,484.40	0.00
104	301291	明阳电气	238	7,385.14	0.00
105	301307	美利信	229	7,295.94	0.00
106	301295	美硕科技	202	7,286.14	0.00
107	688670	金迪克	152	7,156.16	0.00
108	688543	国科军工	134	7,108.70	0.00
109	301382	蜂助手	216	7,093.44	0.00
110	688352	颀中科技	579	6,988.53	0.00
111	301429	森泰股份	327	6,873.54	0.00

112	688458	美芯晟	74	6,716.24	0.00
113	688593	新相微	460	6,711.40	0.00
114	688273	麦澜德	180	6,661.80	0.00
115	301225	恒勃股份	200	6,652.00	0.00
116	301262	海看股份	245	6,247.50	0.00
117	688523	航天环宇	252	6,010.20	0.00
118	301210	金杨股份	122	5,998.74	0.00
119	688552	航天南湖	239	5,616.50	0.00
120	301355	南王科技	327	5,477.25	0.00
121	301397	溯联股份	136	5,467.20	0.00
122	301428	世纪恒通	178	5,446.80	0.00
123	688581	安杰思	46	5,429.38	0.00
124	688310	迈得医疗	165	5,407.05	0.00
125	301305	朗坤环境	272	5,355.68	0.00
126	688512	慧智微	278	5,326.48	0.00
127	300804	广康生化	160	5,275.20	0.00
128	688433	华曙高科	167	5,260.50	0.00
129	301357	北方长龙	108	5,226.12	0.00
130	301332	德尔玛	380	5,217.40	0.00
131	301376	致欧科技	231	5,199.81	0.00
132	301232	飞沃科技	87	5,082.54	0.00
133	688570	天玛智控	200	5,066.00	0.00
134	001287	中电港	237	4,981.74	0.00
135	688429	时创能源	195	4,978.35	0.00
136	301170	锡南科技	138	4,820.34	0.00
137	688519	南亚新材	200	4,806.00	0.00
138	301203	国泰环保	139	4,781.60	0.00
139	688623	二元科技	52	4,513.08	0.00
140	688631	莱斯信息	145	4,331.15	0.00
141	601061	中信金属	565	4,282.70	0.00
142	301323	新莱福	106	4,172.16	0.00
143	688683	莱尔科技	187	4,160.75	0.00
144	301337	亚华电子	134	4,069.58	0.00
145	688479	友车科技	133	3,922.17	0.00
146	688081	兴图新科	193	3,699.81	0.00
147	001380	华纬科技	112	3,447.36	0.00
148	688028	沃尔德	140	3,136.00	0.00
149	688225	亚信安全	125	2,618.75	0.00
150	601065	江盐集团	207	2,450.88	0.00
151	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
152	601133	柏诚股份	186	2,280.36	0.00
153	688622	禾信仪器	59	2,094.50	0.00
154	688579	山大地纬	121	1,994.08	0.00

155	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
156	688215	瑞晟智能	48	1,893.12	0.00
157	001360	南矿集团	115	1,710.05	0.00
158	603125	常青科技	65	1,594.45	0.00
159	001367	海森药业	39	1,539.72	0.00
160	300376	易事特	100	670.00	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	603259	药明康德	5,494,691.00	41.11
2	603355	莱克电气	5,411,357.00	40.48
3	000987	越秀资本	5,338,372.60	39.94
4	603228	景旺电子	5,209,964.00	38.98
5	300896	爱美客	4,843,230.00	36.23
6	300015	爱尔眼科	4,455,832.00	33.34
7	601336	新华保险	4,414,120.24	33.02
8	002273	水晶光电	4,294,459.00	32.13
9	600079	人福医药	4,214,070.00	31.53
10	600498	烽火通信	4,189,138.00	31.34
11	601231	环旭电子	4,142,848.00	30.99
12	601928	凤凰传媒	4,142,405.00	30.99
13	002262	恩华药业	4,138,062.00	30.96
14	600131	国网信通	4,085,431.00	30.56
15	601598	中国外运	4,082,688.00	30.54
16	002372	伟星新材	4,014,820.60	30.04
17	002563	森马服饰	3,978,884.00	29.77
18	000898	鞍钢股份	3,945,366.30	29.52
19	300308	中际旭创	3,927,970.36	29.39
20	600276	恒瑞医药	3,901,225.00	29.19
21	688273	麦澜德	3,876,077.63	29.00
22	603737	三棵树	3,870,586.00	28.96
23	600160	巨化股份	3,834,719.00	28.69
24	002925	盈趣科技	3,814,633.00	28.54
25	002938	鹏鼎控股	3,698,922.00	27.67
26	600871	石化油服	3,663,836.00	27.41
27	600038	中直股份	3,657,791.00	27.37
28	002739	万达电影	3,633,870.00	27.19

29	601958	金钼股份	3,632,216.00	27.17
30	000423	东阿阿胶	3,576,053.00	26.75
31	000776	广发证券	3,553,961.00	26.59
32	688006	杭可科技	3,485,100.79	26.07
33	000708	中信特钢	3,480,852.00	26.04
34	688510	航亚科技	3,331,935.91	24.93
35	002081	金螳螂	3,318,566.00	24.83
36	601699	潞安环能	3,316,532.00	24.81
37	000739	普洛药业	3,312,879.00	24.79
38	600968	海油发展	3,168,162.00	23.70
39	600008	首创环保	3,160,463.00	23.64
40	600129	太极集团	3,141,266.00	23.50
41	600901	江苏金租	3,105,711.00	23.24
42	002937	兴瑞科技	3,088,067.00	23.10
43	000553	安道麦 A	3,045,498.00	22.78
44	603901	永创智能	2,998,421.00	22.43
45	603056	德邦股份	2,956,213.00	22.12
46	000997	新大陆	2,899,188.00	21.69
47	600271	航天信息	2,892,779.00	21.64
48	601611	中国核建	2,868,877.00	21.46
49	601139	深圳燃气	2,839,302.00	21.24
50	601869	长飞光纤	2,831,279.00	21.18
51	300682	朗新科技	2,827,213.00	21.15
52	002518	科士达	2,813,422.00	21.05
53	002192	融捷股份	2,796,565.00	20.92
54	603898	好莱客	2,787,863.00	20.86
55	002250	联化科技	2,778,980.00	20.79
56	300741	华宝股份	2,770,769.98	20.73
57	002299	圣农发展	2,741,215.00	20.51
58	002128	电投能源	2,709,035.00	20.27
59	002926	华西证券	2,703,434.00	20.23
60	600517	国网英大	2,661,222.00	19.91
61	000683	远兴能源	2,639,202.00	19.75
62	600845	宝信软件	2,615,183.00	19.57
63	603688	石英股份	2,605,535.00	19.49
64	603613	国联股份	2,576,813.00	19.28
65	000048	京基智农	2,566,464.00	19.20
66	002423	中粮资本	2,565,133.00	19.19
67	300633	开立医疗	2,559,413.00	19.15
68	600582	天地科技	2,558,270.00	19.14
69	600167	联美控股	2,545,129.06	19.04
70	688009	中国通号	2,501,475.87	18.71
71	688219	会通股份	2,487,460.29	18.61

72	300144	宋城演艺	2,485,563.00	18.60
73	002625	光启技术	2,484,294.00	18.59
74	000869	张裕 A	2,483,357.92	18.58
75	600663	陆家嘴	2,471,732.57	18.49
76	600339	中油工程	2,463,297.00	18.43
77	000960	锡业股份	2,452,750.00	18.35
78	002203	海亮股份	2,441,121.00	18.26
79	002511	中顺洁柔	2,440,349.00	18.26
80	600535	天士力	2,438,695.00	18.24
81	600557	康缘药业	2,390,555.00	17.88
82	600528	中铁工业	2,351,435.00	17.59
83	600563	法拉电子	2,345,469.00	17.55
84	600015	华夏银行	2,338,366.00	17.49
85	600699	均胜电子	2,300,981.00	17.21
86	601288	农业银行	2,277,890.00	17.04
87	000636	风华高科	2,271,671.00	17.00
88	688390	固德威	2,267,494.08	16.96
89	603650	彤程新材	2,238,266.00	16.75
90	002373	千方科技	2,234,939.00	16.72
91	000031	大悦城	2,232,695.00	16.70
92	002065	东华软件	2,227,204.00	16.66
93	000878	云南铜业	2,226,471.00	16.66
94	000630	铜陵有色	2,221,381.00	16.62
95	601003	柳钢股份	2,189,352.51	16.38
96	603305	旭升集团	2,168,300.00	16.22
97	688060	云涌科技	2,118,295.87	15.85
98	002531	天顺风能	2,115,815.00	15.83
99	002600	领益智造	2,108,334.00	15.77
100	600487	亨通光电	2,101,964.00	15.73
101	600655	豫园股份	2,086,904.64	15.61
102	002242	九阳股份	2,044,549.00	15.30
103	301029	怡合达	2,016,046.88	15.08
104	300115	长盈精密	1,999,591.00	14.96
105	688225	亚信安全	1,998,903.92	14.95
106	600026	中远海能	1,990,742.00	14.89
107	603218	日月股份	1,987,965.00	14.87
108	002080	中材科技	1,982,391.00	14.83
109	300168	万达信息	1,939,081.00	14.51
110	300396	迪瑞医疗	1,900,774.00	14.22
111	300146	汤臣倍健	1,881,974.00	14.08
112	603006	黎明股份	1,879,512.00	14.06
113	600373	中文传媒	1,878,485.00	14.05
114	300679	电连技术	1,877,245.00	14.04

115	688621	阳光诺和	1,867,735.12	13.97
116	603444	吉比特	1,843,668.00	13.79
117	00700	腾讯控股	1,837,710.86	13.75
118	603320	迪贝电气	1,821,171.00	13.63
119	300418	昆仑万维	1,817,869.00	13.60
120	002867	周大生	1,815,806.00	13.58
121	002153	石基信息	1,784,462.92	13.35
122	002905	金逸影视	1,775,573.00	13.28
123	300621	维业股份	1,771,800.00	13.26
124	603317	天味食品	1,766,913.00	13.22
125	688208	道通科技	1,740,762.19	13.02
126	688173	希荻微	1,733,347.33	12.97
127	600316	洪都航空	1,711,902.00	12.81
128	600036	招商银行	1,711,566.00	12.81
129	605577	龙版传媒	1,706,664.00	12.77
130	603927	中科软	1,697,176.80	12.70
131	603515	欧普照明	1,667,503.00	12.48
132	600489	中金黄金	1,657,991.00	12.40
133	002389	航天彩虹	1,655,544.00	12.39
134	002880	卫光生物	1,655,410.50	12.38
135	000967	盈峰环境	1,652,865.00	12.37
136	600536	中国软件	1,649,880.00	12.34
137	601991	大唐发电	1,634,731.00	12.23
138	600352	浙江龙盛	1,633,786.00	12.22
139	002463	沪电股份	1,632,404.00	12.21
140	600061	国投资本	1,617,676.00	12.10
141	002439	启明星辰	1,604,847.00	12.01
142	601567	三星医疗	1,594,357.00	11.93
143	688310	迈得医疗	1,591,401.47	11.91
144	300001	特锐德	1,584,929.00	11.86
145	000066	中国长城	1,550,121.00	11.60
146	600399	抚顺特钢	1,529,393.00	11.44
147	002738	中矿资源	1,526,904.00	11.42
148	600637	东方明珠	1,514,453.00	11.33
149	002368	太极股份	1,513,604.00	11.32
150	603580	艾艾精工	1,513,010.00	11.32
151	603786	科博达	1,512,399.00	11.31
152	603933	睿能科技	1,471,329.40	11.01
153	688188	柏楚电子	1,465,806.38	10.97
154	603090	宏盛股份	1,454,449.00	10.88
155	600353	旭光电子	1,436,110.00	10.74
156	600548	深高速	1,430,137.00	10.70
157	688256	寒武纪	1,420,899.41	10.63

158	300181	佐力药业	1,415,341.00	10.59
159	601319	中国人保	1,410,088.00	10.55
160	688517	金冠电气	1,396,782.84	10.45
161	603026	胜华新材	1,391,956.00	10.41
162	688625	呈和科技	1,389,178.18	10.39
163	688198	佰仁医疗	1,379,566.50	10.32
164	600500	中化国际	1,374,461.00	10.28
165	001203	大中矿业	1,365,898.00	10.22
166	601179	中国西电	1,360,691.00	10.18
167	603256	宏和科技	1,351,627.00	10.11
168	603638	艾迪精密	1,347,265.00	10.08
169	002322	理工能科	1,346,716.00	10.08
170	601020	华钰矿业	1,338,044.00	10.01
171	002396	星网锐捷	1,332,106.00	9.97
172	688718	唯赛勃	1,316,967.93	9.85
173	601698	中国卫通	1,306,721.00	9.78
174	002384	东山精密	1,295,645.00	9.69
175	300759	康龙化成	1,289,032.00	9.64
176	603569	长久物流	1,283,692.80	9.60
177	300558	贝达药业	1,280,830.00	9.58
178	601086	国芳集团	1,274,984.00	9.54
179	688118	普元信息	1,272,922.66	9.52
180	300927	江天化学	1,263,618.00	9.45
181	000728	国元证券	1,258,939.00	9.42
182	002890	弘宇股份	1,255,909.00	9.40
183	601992	金隅集团	1,253,831.00	9.38
184	688345	博力威	1,231,443.80	9.21
185	300788	中信出版	1,217,600.00	9.11
186	300711	广哈通信	1,214,063.00	9.08
187	002756	永兴材料	1,211,442.00	9.06
188	601778	晶科科技	1,210,491.00	9.06
189	002152	广电运通	1,204,730.00	9.01
190	603719	良品铺子	1,199,339.00	8.97
191	300474	景嘉微	1,183,032.00	8.85
192	002395	双象股份	1,179,316.00	8.82
193	300554	三超新材	1,177,472.00	8.81
194	601838	成都银行	1,160,186.00	8.68
195	603267	鸿远电子	1,145,660.00	8.57
196	002275	桂林三金	1,139,546.00	8.53
197	000581	威孚高科	1,136,161.00	8.50
198	688021	奥福环保	1,136,098.75	8.50
199	601800	中国交建	1,136,042.00	8.50
200	600967	内蒙一机	1,130,685.00	8.46

201	688385	复旦微电	1,121,195.81	8.39
202	002690	美亚光电	1,113,367.00	8.33
203	600435	北方导航	1,111,190.00	8.31
204	603800	道森股份	1,110,803.00	8.31
205	600027	华电国际	1,110,038.12	8.30
206	688227	品高股份	1,108,037.95	8.29
207	601100	恒立液压	1,105,761.00	8.27
208	603711	香飘飘	1,089,572.00	8.15
209	603499	翔港科技	1,082,623.00	8.10
210	603311	金海高科	1,080,754.00	8.09
211	000027	深圳能源	1,072,567.99	8.02
212	000060	中金岭南	1,064,214.00	7.96
213	000937	冀中能源	1,063,566.00	7.96
214	300689	澄天伟业	1,051,291.90	7.87
215	002568	百润股份	1,046,820.00	7.83
216	688622	禾信仪器	1,045,907.98	7.82
217	603378	亚士创能	1,043,456.68	7.81
218	603866	桃李面包	1,041,491.00	7.79
219	601098	中南传媒	1,041,342.00	7.79
220	002430	杭氧股份	1,038,643.00	7.77
221	001979	招商蛇口	1,036,122.00	7.75
222	002653	海思科	1,035,734.00	7.75
223	688215	瑞晟智能	1,033,435.76	7.73
224	688081	兴图新科	1,033,058.57	7.73
225	600885	宏发股份	1,032,527.00	7.72
226	601881	中国银河	1,028,210.00	7.69
227	000603	盛达资源	1,027,121.00	7.68
228	300515	三德科技	1,026,407.00	7.68
229	603556	海兴电力	1,024,127.00	7.66
230	688097	博众精工	1,022,114.99	7.65
231	600066	宇通客车	1,020,672.00	7.64
232	600572	康恩贝	1,015,627.00	7.60
233	002674	兴业科技	1,009,058.00	7.55
234	688655	迅捷兴	1,008,864.60	7.55
235	300251	光线传媒	1,003,355.00	7.51
236	688099	晶晨股份	1,002,974.45	7.50
237	603885	吉祥航空	997,580.00	7.46
238	688579	山大地纬	995,838.22	7.45
239	688101	三达膜	993,947.80	7.44
240	688682	霍莱沃	988,483.68	7.40
241	603596	伯特利	981,886.00	7.35
242	688030	山石网科	981,474.91	7.34
243	300699	光威复材	980,078.00	7.33

244	000959	首钢股份	978,764.00	7.32
245	000537	广宇发展	977,670.00	7.31
246	603225	新凤鸣	976,754.00	7.31
247	603915	国茂股份	975,780.00	7.30
248	000999	华润三九	974,712.00	7.29
249	600909	华安证券	974,525.00	7.29
250	000415	渤海租赁	973,613.00	7.28
251	002416	爱施德	968,769.61	7.25
252	002782	可立克	965,242.00	7.22
253	688072	拓荆科技	964,438.36	7.22
254	002683	广东宏大	963,059.00	7.21
255	000729	燕京啤酒	962,320.00	7.20
256	601898	中煤能源	948,678.00	7.10
257	600376	首开股份	945,530.00	7.07
258	688234	天岳先进	938,826.51	7.02
259	688092	爱科科技	935,987.78	7.00
260	603379	三美股份	934,796.00	6.99
261	600348	华阳股份	926,355.00	6.93
262	300445	康斯特	917,478.00	6.86
263	600415	小商品城	916,363.00	6.86
264	688521	芯原股份	915,298.31	6.85
265	601872	招商轮船	911,603.80	6.82
266	000617	中油资本	910,866.00	6.81
267	300886	华业香料	908,448.00	6.80
268	603826	坤彩科技	907,523.00	6.79
269	300684	中石科技	905,260.00	6.77
270	600566	济川药业	905,059.00	6.77
271	603587	地素时尚	893,563.00	6.69
272	601228	广州港	889,351.00	6.65
273	688425	铁建重工	886,612.07	6.63
274	688236	春立医疗	886,052.84	6.63
275	002142	宁波银行	884,057.00	6.61
276	301180	万祥科技	882,787.00	6.60
277	600315	上海家化	876,208.00	6.56
278	688466	金科环境	872,161.73	6.53
279	002025	航天电器	871,018.00	6.52
280	688066	航天宏图	870,475.11	6.51
281	601137	博威合金	868,336.00	6.50
282	002244	滨江集团	865,802.00	6.48
283	300604	长川科技	855,885.00	6.40
284	000963	华东医药	855,642.00	6.40
285	002415	海康威视	852,612.00	6.38
286	603606	东方电缆	852,139.00	6.38

287	002434	万里扬	849,380.00	6.35
288	000988	华工科技	845,402.00	6.32
289	603928	兴业股份	841,255.00	6.29
290	002032	苏泊尔	840,229.00	6.29
291	600705	中航产融	833,677.00	6.24
292	300058	蓝色光标	832,057.00	6.23
293	300274	阳光电源	828,424.00	6.20
294	000831	中国稀土	827,197.00	6.19
295	002056	横店东磁	826,914.00	6.19
296	603000	人民网	824,333.00	6.17
297	600988	赤峰黄金	821,061.00	6.14
298	002096	易普力	814,036.00	6.09
299	002866	传艺科技	810,919.80	6.07
300	605151	西上海	800,335.00	5.99
301	600588	用友网络	797,851.00	5.97
302	000738	航发控制	797,339.00	5.97
303	300717	华信新材	791,649.00	5.92
304	002637	赞宇科技	787,164.00	5.89
305	603609	禾丰股份	782,152.00	5.85
306	688063	派能科技	774,482.80	5.79
307	603199	九华旅游	772,499.00	5.78
308	600961	株冶集团	771,039.00	5.77
309	600986	浙文互联	766,859.00	5.74
310	601828	美凯龙	762,075.00	5.70
311	688226	威腾电气	752,367.24	5.63
312	603712	七一二	751,635.00	5.62
313	603178	圣龙股份	749,606.00	5.61
314	605218	伟时电子	746,601.00	5.59
315	603879	永悦科技	739,896.50	5.54
316	688395	正弦电气	739,107.02	5.53
317	600197	伊力特	737,369.00	5.52
318	000030	富奥股份	735,845.00	5.51
319	688013	天臣医疗	731,751.17	5.47
320	600764	中国海防	724,593.00	5.42
321	002901	大博医疗	724,389.00	5.42
322	688676	金盘科技	722,463.30	5.41
323	600707	彩虹股份	721,627.00	5.40
324	002500	山西证券	721,478.00	5.40
325	301076	新瀚新材	716,835.00	5.36
326	300881	盛德鑫泰	704,345.00	5.27
327	300750	宁德时代	702,661.00	5.26
328	600329	达仁堂	700,823.00	5.24
329	300760	迈瑞医疗	698,755.00	5.23

330	000062	深圳华强	697,358.05	5.22
331	002444	巨星科技	696,897.00	5.21
332	300212	易华录	696,389.00	5.21
333	603605	珀莱雅	691,932.00	5.18
334	688777	中控技术	676,939.80	5.06
335	300492	华图山鼎	675,162.00	5.05
336	600085	同仁堂	672,888.00	5.03
337	300800	力合科技	666,262.00	4.98
338	603787	新日股份	663,922.00	4.97
339	002044	美年健康	663,717.00	4.97
340	688003	天准科技	659,102.84	4.93
341	002532	天山铝业	656,678.00	4.91
342	688002	睿创微纳	651,640.10	4.88
343	688186	广大特材	641,375.87	4.80
344	600223	福瑞达	638,424.00	4.78
345	000938	紫光股份	636,901.00	4.76
346	300832	新产业	634,735.30	4.75
347	000429	粤高速 A	633,312.00	4.74
348	300850	新强联	633,036.00	4.74
349	300383	光环新网	632,604.00	4.73
350	603055	台华新材	632,590.00	4.73
351	600826	兰生股份	618,410.00	4.63
352	688357	建龙微纳	618,089.98	4.62
353	000629	钒钛股份	608,062.00	4.55
354	600398	海澜之家	607,393.00	4.54
355	603823	百合花	603,370.00	4.51
356	601717	郑煤机	602,558.00	4.51
357	600673	东阳光	602,498.00	4.51
358	603661	恒林股份	602,459.00	4.51
359	688210	统联精密	601,780.48	4.50
360	603099	长白山	598,618.00	4.48
361	002266	浙富控股	593,352.00	4.44
362	600170	上海建工	568,595.00	4.25
363	300980	祥源新材	566,323.00	4.24
364	688036	传音控股	565,705.84	4.23
365	603699	纽威股份	564,489.00	4.22
366	600970	中材国际	562,679.00	4.21
367	603345	安井食品	558,373.00	4.18
368	002912	中新赛克	557,354.00	4.17
369	301239	普瑞眼科	555,895.00	4.16
370	688020	方邦股份	552,194.48	4.13
371	002466	天齐锂业	552,190.00	4.13
372	300257	开山股份	551,812.00	4.13

373	688012	中微公司	550,438.01	4.12
374	002577	雷柏科技	547,496.00	4.10
375	601900	南方传媒	547,098.00	4.09
376	601998	中信银行	546,493.00	4.09
377	601666	平煤股份	540,518.00	4.04
378	601601	中国太保	530,048.00	3.97
379	600809	山西汾酒	524,124.00	3.92
380	002324	普利特	521,543.00	3.90
381	002155	湖南黄金	519,374.53	3.89
382	003031	中瓷电子	514,358.00	3.85
383	600060	海信视像	513,177.00	3.84
384	601658	邮储银行	513,000.00	3.84
385	601066	中信建投	506,080.00	3.79
386	000028	国药一致	501,058.00	3.75
387	300926	博俊科技	500,070.00	3.74
388	300428	立中集团	496,827.00	3.72
389	600369	西南证券	492,880.00	3.69
390	688055	龙腾光电	492,832.60	3.69
391	601225	陕西煤业	485,788.00	3.63
392	002131	利欧股份	483,905.00	3.62
393	002939	长城证券	481,751.00	3.60
394	603032	德新科技	480,485.00	3.59
395	601665	齐鲁银行	479,880.00	3.59
396	000400	许继电气	479,184.00	3.58
397	600941	中国移动	477,300.00	3.57
398	300965	恒宇信通	477,016.00	3.57
399	002916	深南电路	474,700.00	3.55
400	600497	驰宏锌锗	474,199.00	3.55
401	300724	捷佳伟创	472,330.00	3.53
402	300068	南都电源	466,108.00	3.49
403	002558	巨人网络	465,687.00	3.48
404	002156	通富微电	458,354.00	3.43
405	688301	奕瑞科技	453,904.00	3.40
406	000975	银泰黄金	451,718.00	3.38
407	600546	山煤国际	450,273.00	3.37
408	688082	盛美上海	445,922.50	3.34
409	600118	中国卫星	441,363.00	3.30
410	605178	时空科技	440,412.80	3.29
411	002634	棒杰股份	438,198.00	3.28
412	002017	东信和平	438,085.00	3.28
413	600153	建发股份	436,108.00	3.26
414	001207	联科科技	435,268.00	3.26
415	603676	卫信康	433,143.00	3.24

416	002268	电科网安	432,998.00	3.24
417	601997	贵阳银行	432,645.00	3.24
418	300092	科新机电	432,388.00	3.23
419	002050	三花智控	429,110.00	3.21
420	002942	新农股份	428,077.00	3.20
421	605058	澳弘电子	427,386.00	3.20
422	600372	中航电子	426,097.00	3.19
423	688233	神工股份	424,073.68	3.17
424	300511	雪榕生物	423,372.00	3.17
425	600378	昊华科技	421,001.00	3.15
426	603037	凯众股份	420,496.00	3.15
427	603657	春光科技	419,579.00	3.14
428	603706	东方环宇	417,176.00	3.12
429	300884	狄耐克	416,535.00	3.12
430	002068	黑猫股份	414,183.00	3.10
431	001288	运机集团	412,325.00	3.08
432	301227	森鹰窗业	411,491.00	3.08
433	605189	富春染织	411,431.00	3.08
434	605580	恒盛能源	411,366.66	3.08
435	605086	龙高股份	410,774.00	3.07
436	003008	开普检测	408,025.00	3.05
437	002318	久立特材	406,919.00	3.04
438	002465	海格通信	406,863.00	3.04
439	003041	真爱美家	404,778.60	3.03
440	002544	普天科技	402,708.00	3.01
441	603790	雅运股份	401,312.00	3.00
442	300705	九典制药	400,617.00	3.00
443	002066	瑞泰科技	400,412.00	3.00
444	603992	松霖科技	400,118.00	2.99
445	300321	同大股份	399,315.00	2.99
446	300031	宝通科技	399,293.00	2.99
447	601326	秦港股份	399,065.00	2.99
448	688217	睿昂基因	398,590.28	2.98
449	688571	杭华股份	398,129.46	2.98
450	600820	隧道股份	396,433.00	2.97
451	000933	神火股份	395,485.00	2.96
452	300452	山河药辅	393,185.00	2.94
453	600665	天地源	391,324.00	2.93
454	603323	苏农银行	390,595.00	2.92
455	002472	双环传动	390,455.00	2.92
456	600011	华能国际	390,309.00	2.92
457	600089	特变电工	390,203.00	2.92
458	002807	江阴银行	388,342.00	2.91

459	600012	皖通高速	387,988.00	2.90
460	002670	国盛金控	387,751.00	2.90
461	002968	新大正	385,693.00	2.89
462	601106	中国一重	382,861.00	2.86
463	000425	徐工机械	380,097.00	2.84
464	688166	博瑞医药	379,573.90	2.84
465	002963	豪尔赛	379,449.00	2.84
466	688377	迪威尔	378,929.68	2.83
467	601012	隆基绿能	378,537.00	2.83
468	002906	华阳集团	374,607.00	2.80
469	300253	卫宁健康	374,220.00	2.80
470	600917	重庆燃气	373,381.00	2.79
471	688230	芯导科技	368,135.40	2.75
472	688819	天能股份	367,336.34	2.75
473	002254	泰和新材	364,912.00	2.73
474	600703	三安光电	364,700.00	2.73
475	301042	安联锐视	362,802.00	2.71
476	001286	陕西能源	361,603.20	2.71
477	603767	中马传动	360,408.00	2.70
478	603567	珍宝岛	358,996.00	2.69
479	002915	中欣氟材	358,166.60	2.68
480	688029	南微医学	356,273.59	2.67
481	688468	科美诊断	355,702.42	2.66
482	688350	富淼科技	355,291.18	2.66
483	000977	浪潮信息	354,894.00	2.66
484	300360	炬华科技	351,323.00	2.63
485	688590	新致软件	349,249.72	2.61
486	601198	东兴证券	348,699.00	2.61
487	603993	洛阳钼业	347,365.00	2.60
488	603508	思维列控	345,809.00	2.59
489	688616	西力科技	345,094.09	2.58
490	688111	金山办公	344,556.00	2.58
491	603093	南华期货	343,825.00	2.57
492	000032	深桑达 A	343,688.00	2.57
493	002981	朝阳科技	342,442.00	2.56
494	600095	湘财股份	341,825.00	2.56
495	603466	风语筑	340,907.00	2.55
496	002958	青农商行	340,753.00	2.55
497	605005	合兴股份	338,775.00	2.53
498	603236	移远通信	336,845.00	2.52
499	605162	新中港	336,148.00	2.51
500	603880	ST 南卫	335,916.00	2.51
501	605118	力鼎光电	334,427.00	2.50

502	605255	天普股份	333,211.00	2.49
503	002678	珠江钢琴	332,382.00	2.49
504	605588	冠石科技	331,916.00	2.48
505	001211	双枪科技	331,428.00	2.48
506	605028	世茂能源	331,080.00	2.48
507	603958	哈森股份	330,845.00	2.48
508	605169	洪通燃气	330,518.00	2.47
509	603976	正川股份	329,782.00	2.47
510	605488	福莱新材	329,223.35	2.46
511	603238	诺邦股份	329,008.00	2.46
512	603813	原尚股份	328,997.00	2.46
513	603038	华立股份	328,095.00	2.45
514	002955	鸿合科技	327,325.00	2.45
515	605566	福莱蒾特	326,618.00	2.44
516	603353	和顺石油	326,468.00	2.44
517	605318	法狮龙	326,276.00	2.44
518	600927	永安期货	325,920.00	2.44
519	603192	汇得科技	325,498.00	2.44
520	605158	华达新材	325,402.34	2.43
521	688696	极米科技	325,316.76	2.43
522	605179	一鸣食品	324,718.00	2.43
523	003018	金富科技	324,150.00	2.43
524	600350	山东高速	323,774.00	2.42
525	603948	建业股份	323,521.00	2.42
526	000089	深圳机场	323,415.00	2.42
527	605228	神通科技	323,184.00	2.42
528	605155	西大门	322,896.00	2.42
529	000807	云铝股份	320,661.00	2.40
530	600148	长春一东	320,533.00	2.40
531	605099	共创草坪	319,347.00	2.39
532	000534	万泽股份	318,181.00	2.38
533	688260	昀冢科技	316,452.31	2.37
534	605500	森林包装	316,436.00	2.37
535	300866	安克创新	315,545.00	2.36
536	688501	青达环保	313,007.45	2.34
537	300977	深圳瑞捷	311,974.00	2.33
538	688292	浩瀚深度	311,135.04	2.33
539	603983	丸美股份	310,311.00	2.32
540	002885	京泉华	310,127.00	2.32
541	688053	思科瑞	309,790.00	2.32
542	603511	爱慕股份	308,565.00	2.31
543	001308	康冠科技	308,032.00	2.30
544	603893	瑞芯微	307,932.00	2.30

545	603969	银龙股份	307,665.00	2.30
546	603728	鸣志电器	304,992.00	2.28
547	603216	梦天家居	304,938.00	2.28
548	001229	魅视科技	304,144.00	2.28
549	600657	信达地产	302,692.00	2.26
550	688084	晶品特装	302,228.36	2.26
551	000906	浙商中拓	302,211.00	2.26
552	603960	克来机电	300,824.00	2.25
553	688161	威高骨科	299,709.92	2.24
554	603212	赛伍技术	298,512.00	2.23
555	688400	凌云光	294,248.43	2.20
556	600511	国药股份	291,666.00	2.18
557	601969	海南矿业	287,559.00	2.15
558	688670	金迪克	286,441.18	2.14
559	002897	意华股份	280,173.00	2.10
560	002673	西部证券	279,676.00	2.09
561	688088	虹软科技	278,361.65	2.08
562	002988	豪美新材	276,605.00	2.07
563	688981	中芯国际	276,005.63	2.06
564	603685	晨丰科技	275,323.00	2.06
565	000034	神州数码	273,817.00	2.05
566	600028	中国石化	267,882.00	2.00
567	002907	华森制药	267,830.00	2.00

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	601336	新华保险	4,833,586.54	36.16
2	603228	景旺电子	4,710,854.00	35.24
3	300308	中际旭创	4,147,699.00	31.03
4	002262	恩华药业	4,111,036.00	30.76
5	688273	麦澜德	3,881,659.51	29.04
6	002273	水晶光电	3,876,024.00	29.00
7	002938	鹏鼎控股	3,736,588.00	27.96
8	603355	莱克电气	3,666,742.00	27.43
9	002739	万达电影	3,565,386.00	26.67
10	600160	巨化股份	3,562,686.00	26.65
11	603259	药明康德	3,552,245.00	26.58
12	000423	东阿阿胶	3,480,288.00	26.04

13	600079	人福医药	3,457,885.00	25.87
14	600131	国网信通	3,427,584.00	25.64
15	000776	广发证券	3,404,750.00	25.47
16	002925	盈趣科技	3,374,697.99	25.25
17	600968	海油发展	3,324,760.00	24.87
18	000987	越秀资本	3,299,271.00	24.68
19	603737	三棵树	3,283,473.00	24.57
20	300896	爱美客	3,188,300.00	23.85
21	002081	金螳螂	3,164,661.00	23.68
22	600008	首创环保	3,142,268.00	23.51
23	000739	普洛药业	3,139,387.00	23.49
24	601699	潞安环能	3,114,296.00	23.30
25	000708	中信特钢	3,088,525.00	23.11
26	601598	中国外运	3,088,046.00	23.10
27	688006	杭可科技	2,900,772.98	21.70
28	601139	深圳燃气	2,900,261.00	21.70
29	300741	华宝股份	2,858,964.00	21.39
30	002372	伟星新材	2,853,361.30	21.35
31	603901	永创智能	2,784,694.00	20.83
32	300682	朗新科技	2,781,455.00	20.81
33	600845	宝信软件	2,771,245.60	20.73
34	002937	兴瑞科技	2,762,209.00	20.67
35	600276	恒瑞医药	2,756,169.00	20.62
36	300015	爱尔眼科	2,749,409.00	20.57
37	600129	太极集团	2,722,415.00	20.37
38	002563	森马服饰	2,686,151.00	20.10
39	600557	康缘药业	2,624,064.81	19.63
40	600015	华夏银行	2,611,239.00	19.54
41	000997	新大陆	2,585,411.00	19.34
42	600871	石化油服	2,573,294.00	19.25
43	603933	睿能科技	2,571,723.68	19.24
44	603898	好莱客	2,536,851.00	18.98
45	002625	光启技术	2,532,075.00	18.94
46	688219	会通股份	2,517,397.33	18.83
47	688510	航亚科技	2,432,432.68	18.20
48	603613	国联股份	2,425,622.00	18.15
49	603056	德邦股份	2,393,856.00	17.91
50	601869	长飞光纤	2,347,896.00	17.57
51	002203	海亮股份	2,340,406.00	17.51
52	002153	石基信息	2,332,257.50	17.45
53	002511	中顺洁柔	2,324,579.00	17.39
54	600901	江苏金租	2,302,073.00	17.22
55	002065	东华软件	2,272,898.00	17.00

56	601958	金钼股份	2,213,004.00	16.56
57	000878	云南铜业	2,203,568.00	16.49
58	600699	均胜电子	2,187,541.00	16.37
59	600487	亨通光电	2,181,707.00	16.32
60	000683	远兴能源	2,167,340.00	16.21
61	000048	京基智农	2,150,026.00	16.09
62	300168	万达信息	2,131,165.00	15.94
63	002250	联化科技	2,126,199.00	15.91
64	000960	锡业股份	2,110,137.00	15.79
65	002905	金逸影视	2,102,920.00	15.73
66	002192	融捷股份	2,095,382.00	15.68
67	600655	豫园股份	2,089,991.48	15.64
68	603688	石英股份	2,086,944.00	15.61
69	601231	环旭电子	2,071,538.98	15.50
70	688225	亚信安全	2,042,433.78	15.28
71	600498	烽火通信	1,991,987.00	14.90
72	300144	宋城演艺	1,987,639.48	14.87
73	603927	中科软	1,976,011.80	14.78
74	002880	卫光生物	1,972,146.80	14.75
75	00700	腾讯控股	1,958,079.31	14.65
76	300115	长盈精密	1,921,844.00	14.38
77	000630	铜陵有色	1,896,695.00	14.19
78	600026	中远海能	1,886,623.00	14.11
79	603006	黎明股份	1,881,060.00	14.07
80	002242	九阳股份	1,880,344.16	14.07
81	000636	风华高科	1,873,632.00	14.02
82	300621	维业股份	1,819,330.00	13.61
83	601928	凤凰传媒	1,816,486.00	13.59
84	002518	科士达	1,798,251.00	13.45
85	300633	开立医疗	1,797,024.00	13.44
86	603320	迪贝电气	1,786,321.00	13.36
87	605577	龙版传媒	1,764,427.72	13.20
88	688621	阳光诺和	1,721,114.35	12.88
89	000553	安道麦 A	1,716,306.00	12.84
90	603515	欧普照明	1,706,838.93	12.77
91	600061	国投资本	1,700,354.00	12.72
92	300679	电连技术	1,668,322.00	12.48
93	601567	三星医疗	1,665,820.00	12.46
94	300146	汤臣倍健	1,660,721.00	12.42
95	688517	金冠电气	1,649,474.09	12.34
96	002389	航天彩虹	1,610,757.00	12.05
97	600036	招商银行	1,609,212.00	12.04
98	603317	天味食品	1,602,181.80	11.99

99	300396	迪瑞医疗	1,580,801.00	11.83
100	600316	洪都航空	1,568,610.00	11.74
101	688310	迈得医疗	1,548,838.42	11.59
102	600353	旭光电子	1,544,099.00	11.55
103	688173	希荻微	1,542,869.60	11.54
104	603444	吉比特	1,533,907.00	11.48
105	300788	中信出版	1,524,895.00	11.41
106	600548	深高速	1,518,548.00	11.36
107	300001	特锐德	1,509,569.00	11.29
108	601086	国芳集团	1,495,235.00	11.19
109	603256	宏和科技	1,492,908.00	11.17
110	688118	普元信息	1,485,433.58	11.11
111	603650	彤程新材	1,480,865.00	11.08
112	688256	寒武纪	1,476,305.64	11.04
113	601698	中国卫通	1,448,257.00	10.84
114	600352	浙江龙盛	1,431,224.00	10.71
115	600536	中国软件	1,420,980.00	10.63
116	002423	中粮资本	1,368,792.00	10.24
117	000898	鞍钢股份	1,367,724.00	10.23
118	300181	佐力药业	1,342,228.00	10.04
119	600637	东方明珠	1,339,527.00	10.02
120	688198	佰仁医疗	1,338,176.60	10.01
121	300418	昆仑万维	1,337,179.00	10.00
122	603638	艾迪精密	1,308,782.00	9.79
123	001203	大中矿业	1,297,522.00	9.71
124	600500	中化国际	1,296,570.81	9.70
125	000728	国元证券	1,296,054.00	9.70
126	603026	胜华新材	1,272,444.00	9.52
127	601992	金隅集团	1,270,671.00	9.51
128	002890	弘宇股份	1,269,462.20	9.50
129	002384	东山精密	1,263,693.00	9.45
130	603090	宏盛股份	1,250,653.00	9.36
131	002395	双象股份	1,246,383.00	9.32
132	002299	圣农发展	1,240,145.00	9.28
133	601881	中国银河	1,224,447.00	9.16
134	300711	广哈通信	1,222,019.00	9.14
135	000066	中国长城	1,219,337.00	9.12
136	601020	华钰矿业	1,216,394.00	9.10
137	603711	香飘飘	1,215,886.00	9.10
138	002396	星网锐捷	1,207,240.00	9.03
139	300759	康龙化成	1,173,945.00	8.78
140	603569	长久物流	1,161,699.00	8.69
141	688030	山石网科	1,161,559.97	8.69

142	601778	晶科科技	1,157,597.00	8.66
143	002439	启明星辰	1,151,038.00	8.61
144	000581	威孚高科	1,150,066.00	8.60
145	002080	中材科技	1,149,388.00	8.60
146	688215	瑞晟智能	1,140,577.87	8.53
147	603556	海兴电力	1,132,965.00	8.48
148	002322	理工能科	1,132,336.00	8.47
149	688682	霍莱沃	1,120,121.77	8.38
150	600066	宇通客车	1,116,905.00	8.36
151	000027	深圳能源	1,114,701.60	8.34
152	601098	中南传媒	1,112,821.00	8.33
153	601838	成都银行	1,112,479.00	8.32
154	002756	永兴材料	1,109,297.00	8.30
155	300689	澄天伟业	1,102,802.00	8.25
156	001979	招商蛇口	1,096,448.00	8.20
157	000603	盛达资源	1,092,353.00	8.17
158	300474	景嘉微	1,083,739.00	8.11
159	601100	恒立液压	1,078,487.00	8.07
160	688579	山大地纬	1,072,688.21	8.03
161	688188	柏楚电子	1,071,432.18	8.02
162	000060	中金岭南	1,055,149.00	7.89
163	000959	首钢股份	1,052,465.00	7.87
164	603267	鸿远电子	1,035,415.00	7.75
165	688227	品高股份	1,032,343.04	7.72
166	002430	杭氧股份	1,032,057.00	7.72
167	603719	良品铺子	1,017,168.00	7.61
168	002674	兴业科技	1,013,402.00	7.58
169	688622	禾信仪器	1,005,784.59	7.52
170	688081	兴图新科	1,000,080.50	7.48
171	688655	迅捷兴	998,483.66	7.47
172	002738	中矿资源	992,841.00	7.43
173	603915	国茂股份	992,520.00	7.43
174	603311	金海高科	987,839.00	7.39
175	000729	燕京啤酒	986,709.00	7.38
176	300684	中石科技	983,888.00	7.36
177	600885	宏发股份	982,181.00	7.35
178	603800	道森股份	981,413.00	7.34
179	603866	桃李面包	979,967.80	7.33
180	688101	三达膜	978,532.99	7.32
181	688390	固德威	973,739.58	7.28
182	688521	芯原股份	972,412.45	7.28
183	601288	农业银行	959,649.00	7.18
184	002416	爱施德	956,074.00	7.15

185	300445	康斯特	948,605.00	7.10
186	000999	华润三九	944,118.00	7.06
187	688097	博众精工	937,222.74	7.01
188	301180	万祥科技	935,599.00	7.00
189	688092	爱科科技	925,650.01	6.93
190	002683	广东宏大	922,617.00	6.90
191	688060	云涌科技	914,813.11	6.84
192	600038	中直股份	913,005.00	6.83
193	600435	北方导航	911,982.00	6.82
194	600376	首开股份	909,081.00	6.80
195	688066	航天宏图	906,385.85	6.78
196	600967	内蒙一机	902,676.00	6.75
197	603378	亚士创能	892,143.00	6.67
198	002463	沪电股份	889,768.00	6.66
199	605151	西上海	882,887.00	6.61
200	000415	渤海租赁	881,813.00	6.60
201	300886	华业香料	873,264.00	6.53
202	603928	兴业股份	864,919.00	6.47
203	601003	柳钢股份	855,136.00	6.40
204	002690	美亚光电	854,498.85	6.39
205	603606	东方电缆	851,585.00	6.37
206	600399	抚顺特钢	851,098.00	6.37
207	603587	地素时尚	845,874.99	6.33
208	002782	可立克	843,688.00	6.31
209	600348	华阳股份	839,441.00	6.28
210	300699	光威复材	834,469.00	6.24
211	688466	金科环境	832,317.15	6.23
212	002434	万里扬	828,210.00	6.20
213	600563	法拉电子	827,792.00	6.19
214	002142	宁波银行	826,087.00	6.18
215	601137	博威合金	825,535.00	6.18
216	603199	九华旅游	820,600.00	6.14
217	002415	海康威视	819,662.00	6.13
218	603609	禾丰股份	816,476.00	6.11
219	002244	滨江集团	813,407.00	6.09
220	000831	中国稀土	810,749.00	6.07
221	000963	华东医药	805,499.00	6.03
222	688345	博力威	803,862.04	6.01
223	300554	三超新材	800,798.00	5.99
224	601872	招商轮船	792,342.00	5.93
225	300274	阳光电源	791,850.00	5.92
226	600398	海澜之家	791,151.00	5.92
227	603879	永悦科技	788,680.00	5.90

228	603605	珀莱雅	785,888.00	5.88
229	000062	深圳华强	779,681.75	5.83
230	600986	浙文互联	775,081.00	5.80
231	002096	易普力	771,638.00	5.77
232	603499	翔港科技	758,891.00	5.68
233	600197	伊力特	758,410.00	5.67
234	688395	正弦电气	750,895.41	5.62
235	605218	伟时电子	743,864.00	5.57
236	688013	天臣医疗	741,189.38	5.55
237	603178	圣龙股份	739,576.00	5.53
238	002056	横店东磁	739,181.00	5.53
239	002368	太极股份	737,598.00	5.52
240	600705	中航产融	737,496.00	5.52
241	601828	美凯龙	737,216.00	5.52
242	002500	山西证券	733,983.90	5.49
243	002866	传艺科技	723,508.00	5.41
244	002444	巨星科技	723,468.00	5.41
245	300492	华图山鼎	711,400.00	5.32
246	300800	力合科技	709,505.00	5.31
247	300760	迈瑞医疗	698,302.00	5.22
248	300212	易华录	697,717.00	5.22
249	600170	上海建工	697,423.00	5.22
250	600826	兰生股份	691,475.00	5.17
251	603699	纽威股份	686,700.00	5.14
252	603712	七一二	684,843.00	5.12
253	600588	用友网络	676,688.00	5.06
254	603787	新日股份	673,956.00	5.04
255	000938	紫光股份	667,062.00	4.99
256	301076	新瀚新材	664,021.63	4.97
257	688063	派能科技	660,964.20	4.94
258	688777	中控技术	660,402.62	4.94
259	688003	天准科技	657,769.90	4.92
260	603055	台华新材	651,118.00	4.87
261	601998	中信银行	648,937.00	4.85
262	603000	人民网	648,823.00	4.85
263	688226	威腾电气	647,696.92	4.85
264	300750	宁德时代	644,470.00	4.82
265	002044	美年健康	637,515.00	4.77
266	688186	广大特材	637,179.00	4.77
267	300881	盛德鑫泰	634,880.00	4.75
268	600673	东阳光	633,771.00	4.74
269	603885	吉祥航空	629,831.00	4.71
270	603786	科博达	628,799.00	4.70

271	600415	小商品城	621,695.00	4.65
272	688357	建龙微纳	614,432.35	4.60
273	300257	开山股份	613,514.00	4.59
274	688210	统联精密	604,390.20	4.52
275	603345	安井食品	602,099.00	4.50
276	000429	粤高速 A	600,979.00	4.50
277	603099	长白山	599,927.00	4.49
278	000031	大悦城	599,460.00	4.48
279	600223	福瑞达	598,625.00	4.48
280	601717	郑煤机	595,077.00	4.45
281	603823	百合花	592,585.00	4.43
282	002266	浙富控股	589,877.00	4.41
283	688718	唯赛勃	581,477.86	4.35
284	001286	陕西能源	576,227.00	4.31
285	000967	盈峰环境	569,234.00	4.26
286	300980	祥源新材	566,222.00	4.24
287	301239	普瑞眼科	566,030.00	4.23
288	601900	南方传媒	559,821.00	4.19
289	688676	金盘科技	550,688.78	4.12
290	002532	天山铝业	545,631.00	4.08
291	600315	上海家化	544,799.00	4.08
292	002558	巨人网络	542,962.00	4.06
293	002466	天齐锂业	540,237.00	4.04
294	002577	雷柏科技	536,871.00	4.02
295	688208	道通科技	535,184.64	4.00
296	003031	中瓷电子	533,534.00	3.99
297	601601	中国太保	530,516.00	3.97
298	000629	钒钛股份	529,500.00	3.96
299	301029	怡合达	522,741.00	3.91
300	600566	济川药业	519,456.00	3.89
301	002268	电科网安	505,514.00	3.78
302	688055	龙腾光电	503,748.44	3.77
303	002916	深南电路	501,705.00	3.75
304	601066	中信建投	498,454.00	3.73
305	300724	捷佳伟创	495,703.00	3.71
306	300926	博俊科技	495,386.00	3.71
307	600027	华电国际	495,043.00	3.70
308	300965	恒宇信通	492,770.00	3.69
309	600970	中材国际	490,032.00	3.67
310	600809	山西汾酒	487,203.00	3.64
311	601225	陕西煤业	484,927.00	3.63
312	002653	海思科	480,534.00	3.60
313	600941	中国移动	477,473.00	3.57

314	000400	许继电气	477,074.00	3.57
315	601665	齐鲁银行	474,137.00	3.55
316	002017	东信和平	473,122.00	3.54
317	002568	百润股份	472,932.00	3.54
318	605178	时空科技	470,334.00	3.52
319	002912	中新赛克	468,831.00	3.51
320	603676	卫信康	468,108.00	3.50
321	002939	长城证券	466,097.00	3.49
322	300068	南都电源	464,142.00	3.47
323	600546	山煤国际	462,913.00	3.46
324	600369	西南证券	461,301.00	3.45
325	600917	重庆燃气	457,721.00	3.42
326	000617	中油资本	454,883.00	3.40
327	300031	宝通科技	454,113.00	3.40
328	002324	普利特	452,944.00	3.39
329	600528	中铁工业	452,419.00	3.38
330	002942	新农股份	447,511.00	3.35
331	600372	中航电子	443,098.00	3.32
332	300511	雪榕生物	438,795.00	3.28
333	301227	森鹰窗业	434,632.00	3.25
334	688301	奕瑞科技	433,526.00	3.24
335	600820	隧道股份	430,959.00	3.22
336	601997	贵阳银行	430,686.00	3.22
337	688036	传音控股	429,106.08	3.21
338	603657	春光科技	425,077.00	3.18
339	688099	晶晨股份	424,157.72	3.17
340	300253	卫宁健康	422,437.00	3.16
341	605058	澳弘电子	422,200.00	3.16
342	301042	安联锐视	420,917.00	3.15
343	603037	凯众股份	419,167.00	3.14
344	300717	华信新材	419,058.00	3.14
345	001207	联科科技	416,804.00	3.12
346	601326	秦港股份	414,923.00	3.10
347	300092	科新机电	413,375.00	3.09
348	603790	雅运股份	412,858.00	3.09
349	001288	运机集团	411,735.00	3.08
350	603992	松霖科技	409,451.00	3.06
351	600153	建发股份	407,509.00	3.05
352	002068	黑猫股份	407,495.00	3.05
353	003041	真爱美家	407,002.00	3.04
354	688292	浩瀚深度	406,082.00	3.04
355	600707	彩虹股份	405,533.00	3.03
356	605580	恒盛能源	402,866.24	3.01

357	002066	瑞泰科技	402,815.00	3.01
358	002634	棒杰股份	402,529.00	3.01
359	603706	东方环宇	402,083.00	3.01
360	600089	特变电工	400,806.00	3.00
361	688233	神工股份	400,649.71	3.00
362	300705	九典制药	398,465.00	2.98
363	688385	复旦微电	396,518.04	2.97
364	002050	三花智控	396,229.00	2.96
365	000028	国药一致	395,549.00	2.96
366	605189	富春染织	395,427.00	2.96
367	002318	久立特材	394,861.00	2.95
368	002963	豪尔赛	394,598.00	2.95
369	003008	开普检测	394,538.00	2.95
370	002544	普天科技	393,600.00	2.94
371	600909	华安证券	393,035.00	2.94
372	688166	博瑞医药	392,692.21	2.94
373	002670	国盛金控	392,264.00	2.93
374	000933	神火股份	391,990.00	2.93
375	688021	奥福环保	391,793.65	2.93
376	688230	芯导科技	391,284.00	2.93
377	688571	杭华股份	391,213.45	2.93
378	300452	山河药辅	390,532.60	2.92
379	000425	徐工机械	390,197.00	2.92
380	603767	中马传动	389,632.00	2.92
381	603323	苏农银行	388,827.00	2.91
382	300515	三德科技	386,776.00	2.89
383	688590	新致软件	386,703.67	2.89
384	000988	华工科技	385,794.00	2.89
385	002807	江阴银行	384,511.00	2.88
386	600012	皖通高速	382,076.00	2.86
387	688377	迪威尔	377,352.15	2.82
388	002955	鸿合科技	377,242.00	2.82
389	300321	同大股份	377,199.00	2.82
390	688468	科美诊断	372,976.30	2.79
391	600378	昊华科技	372,145.00	2.78
392	000977	浪潮信息	372,061.00	2.78
393	688217	睿昂基因	371,127.54	2.78
394	603567	珍宝岛	366,910.00	2.75
395	688625	呈和科技	365,203.50	2.73
396	002906	华阳集团	363,939.00	2.72
397	002254	泰和新材	363,708.00	2.72
398	002968	新大正	361,037.00	2.70
399	300866	安克创新	359,951.00	2.69

400	605086	龙高股份	359,373.00	2.69
401	688819	天能股份	357,782.78	2.68
402	603580	艾艾精工	357,447.00	2.67
403	601198	东兴证券	347,797.00	2.60
404	605588	冠石科技	345,400.00	2.58
405	605118	力鼎光电	342,730.00	2.56
406	601012	隆基绿能	342,209.00	2.56
407	002472	双环传动	342,053.00	2.56
408	002915	中欣氟材	341,736.00	2.56
409	300360	炬华科技	341,157.00	2.55
410	603728	鸣志电器	340,667.00	2.55
411	002958	青农商行	338,327.00	2.53
412	688670	金迪克	337,876.91	2.53
413	603993	洛阳钼业	335,127.00	2.51
414	688111	金山办公	334,182.00	2.50
415	688228	开普云	334,081.61	2.50
416	600703	三安光电	334,062.00	2.50
417	600665	天地源	333,873.00	2.50
418	600350	山东高速	332,764.00	2.49
419	002981	朝阳科技	332,433.00	2.49
420	688616	西力科技	332,044.68	2.48
421	688696	极米科技	331,872.00	2.48
422	688260	昀冢科技	331,089.97	2.48
423	688012	中微公司	330,783.41	2.47
424	002678	珠江钢琴	328,174.00	2.46
425	300977	深圳瑞捷	326,971.00	2.45
426	002867	周大生	325,915.00	2.44
427	605179	一鸣食品	322,460.00	2.41
428	605162	新中港	322,087.00	2.41
429	001308	康冠科技	321,738.00	2.41
430	600657	信达地产	321,308.00	2.40
431	000807	云铝股份	321,237.00	2.40
432	600895	张江高科	319,206.00	2.39
433	605028	世茂能源	319,054.00	2.39
434	001211	双枪科技	318,282.05	2.38
435	600060	海信视像	318,236.00	2.38
436	605169	洪通燃气	317,702.56	2.38
437	601163	三角轮胎	317,636.00	2.38
438	603353	和顺石油	317,582.00	2.38
439	605005	合兴股份	317,245.00	2.37
440	600572	康恩贝	316,028.00	2.36
441	600927	永安期货	315,226.00	2.36
442	688084	晶品特装	315,149.06	2.36

443	688400	凌云光	314,153.87	2.35
444	603508	思维列控	313,806.00	2.35
445	000089	深圳机场	313,062.00	2.34
446	000032	深桑达 A	312,820.00	2.34
447	605228	神通科技	312,627.00	2.34
448	688501	青达环保	311,780.88	2.33
449	603038	华立股份	311,524.00	2.33
450	605155	西大门	311,394.00	2.33
451	603813	原尚股份	309,650.00	2.32
452	605255	天普股份	307,689.00	2.30
453	605500	森林包装	307,348.00	2.30
454	001229	魅视科技	307,001.00	2.30
455	603948	建业股份	303,658.00	2.27
456	603238	诺邦股份	303,552.00	2.27
457	605158	华达新材	303,370.00	2.27
458	600148	长春一东	303,054.00	2.27
459	002885	京泉华	303,030.00	2.27
460	603976	正川股份	302,876.00	2.27
461	003018	金富科技	302,621.00	2.26
462	605318	法狮龙	301,027.00	2.25
463	605488	福莱新材	300,970.90	2.25
464	605099	共创草坪	300,857.00	2.25
465	603511	爱慕股份	300,461.00	2.25
466	605566	福莱茵特	299,889.00	2.24
467	603958	哈森股份	299,814.00	2.24
468	603969	银龙股份	298,552.46	2.23
469	688088	虹软科技	298,284.98	2.23
470	300251	光线传媒	296,928.00	2.22
471	000534	万泽股份	295,872.00	2.21
472	603983	丸美股份	292,827.00	2.19
473	603216	梦天家居	292,460.00	2.19
474	601999	出版传媒	290,232.00	2.17
475	603218	日月股份	287,591.00	2.15
476	603880	ST 南卫	286,402.00	2.14
477	600028	中国石化	285,361.00	2.13
478	688053	思科瑞	282,295.52	2.11
479	000034	神州数码	282,041.00	2.11
480	688002	睿创微纳	281,803.27	2.11
481	000906	浙商中拓	279,048.00	2.09
482	603685	晨丰科技	278,477.00	2.08
483	002673	西部证券	278,049.00	2.08
484	601228	广州港	277,744.00	2.08
485	002371	北方华创	274,714.00	2.06

486	001210	金房能源	272,303.00	2.04
487	301099	雅创电子	270,936.00	2.03
488	000869	张裕 A	270,720.00	2.03
489	600511	国药股份	269,965.00	2.02

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	718,940,848.10
卖出股票收入（成交）总额	546,634,302.56

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	1,539,256.89
2	应收清算款	351,162.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,165,545.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,055,964.80

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 指数量化增强发起 A	3,279	43,915.70	10,460,635.54	7.26	133,538,947.53	92.74
建信中证 500 指数量化增强发起 C	2,930	15,318.82	259,767.39	0.58	44,624,361.92	99.42
合计	6,209	30,420.96	10,720,402.93	5.68	178,163,309.45	94.32

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 指数量化增强发起 A	9,004.33	0.01
	建信中证 500 指数量化增强发起 C	1,851.17	0.00
	合计	10,855.50	0.01

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

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

有本基金。

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	10,001,889.08	5.30	10,001,889.08	5.30	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	10,001,889.08	5.30	10,001,889.08	5.30	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
基金合同生效日 (2022 年 12 月 23 日) 基金份额总额	12,099,599.84	1,238,351.04
本报告期期初基金份额总额	12,099,599.84	1,238,351.04
本报告期基金总申购份额	215,030,283.51	126,181,990.05
减：本报告期基金总赎回份额	83,130,300.28	82,536,211.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	143,999,583.07	44,884,129.31

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

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	3	435,528,927.43	34.54	392,708.33	36.07	-
华创证券	1	229,998,826.60	18.24	214,200.87	19.68	-
开源证券	1	211,255,501.62	16.75	154,491.63	14.19	-
光大证券	1	106,635,203.10	8.46	98,255.29	9.03	-
华泰证券	5	90,425,985.54	7.17	73,528.30	6.75	-
中泰证券	3	70,803,232.31	5.61	65,229.23	5.99	-
东北证券	1	60,571,999.56	4.80	43,689.53	4.01	-
国泰君安	2	27,272,968.98	2.16	19,945.12	1.83	-
太平洋证券	1	25,840,354.00	2.05	24,065.94	2.21	-
高华证券	1	2,711,243.57	0.21	2,524.62	0.23	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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

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

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

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

（4）佣金费率合理。

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

3、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

中泰证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
高华证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
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	关于新增腾安基金销售（深圳）有限公司为建信现代服务业股票型证券投资基金等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 06 月 29 日
2	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
3	关于新增泰信财富基金销售有限公司为建信弘利灵活配置混合型证券投资	指定报刊和/或公司网站	2023 年 01 月 11 日

	基金等代销机构的公告		
4	建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 01 月 03 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 01 月 01 日-2023 年 02 月 08 日	10,001,889.08	-	-	10,001,889.08	5.30

注：本基金本报告期末不存在单一投资者份额占比达到或超过 20% 的情况。

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 指数量化增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 500 指数量化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

2023 年 8 月 30 日