

建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指
数证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国国际金融股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国国际金融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	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57

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	57
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	57
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末上市基金前十名持有人	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	建信 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	建信 MSCI (扩位简称: MSCIA 股 ETF 基金)
基金主代码	512180
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 19 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国国际金融股份有限公司
报告期末基金份额总额	96,048,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，本基金的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际通指数(英文: MSCI China A Inclusion RMB Index)。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	中国国际金融股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinzipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	010-65353060; 010-65351622
传真	010-66228001	010-65059873
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区建外门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区建外门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

邮政编码	100033	100004
法定代表人	刘军	沈如军

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,213,036.50
本期利润	-1,503,976.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0157
本期加权平均净值利润率	-1.11%
本期基金份额净值增长率	-1.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	34,844,116.48
期末可供分配基金份额利润	0.3628
期末基金资产净值	130,892,116.48
期末基金份额净值	1.3628
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	36.28%

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

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

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

3.2 基金净值表现

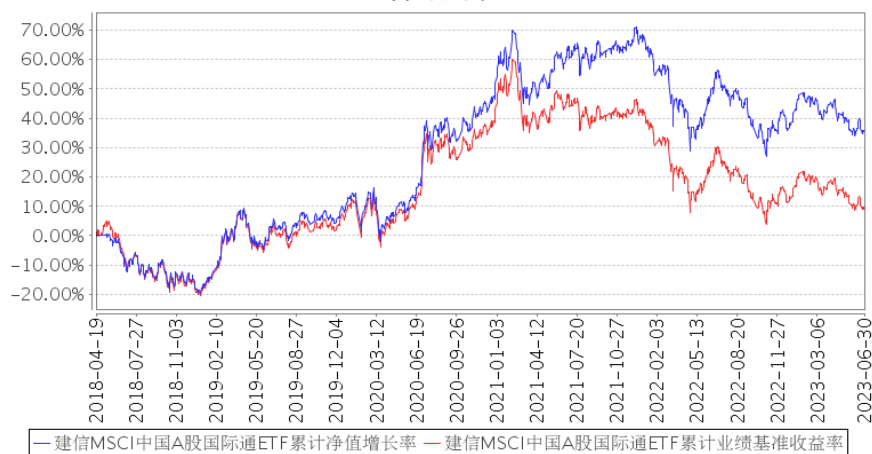
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	1.44%	0.86%	0.43%	0.86%	1.01%	0.00%
过去三个月	-5.00%	0.78%	-6.34%	0.79%	1.34%	-0.01%
过去六个月	-1.25%	0.77%	-2.71%	0.79%	1.46%	-0.02%
过去一年	-12.50%	0.92%	-15.40%	0.95%	2.90%	-0.03%
过去三年	14.67%	1.15%	-4.83%	1.19%	19.50%	-0.04%
自基金合同生效起至今	36.28%	1.22%	9.77%	1.26%	26.51%	-0.04%

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MSCI中国A股国际通ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，由中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司合资设立，注册资本2亿元。

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

新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家，资产管理行业的领跑者”。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁洪昀	数量投资部总经理，本基金的基金经理	2018 年 4 月 19 日	-	20	梁洪昀先生，数量投资部总经理，博士。特许金融分析师（CFA）。曾任大成基金管理有限公司金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005 年 8 月加入建信基金，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总经理。2009 年 11 月 5 日起任建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理；2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2011 年 9 月 8 日至 2016 年 7 月 20 日任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金（ETF）及其联接基金的基金经理；2012 年 3 月 16 日起任建信深证 100 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 3 月 25 日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理，该基金自 2020 年 5 月 7 日转型为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF），梁洪昀继续担任该基金的基金经理；2015 年 7 月 31 日至 2018 年 7 月 31 日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 6 日至 2016 年 10 月 25 日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 6 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 6 月 13 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接

					基金的基金经理；2018 年 2 月 7 日至 2022 年 8 月 8 日任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 4 月 19 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 5 月 16 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数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

本基金在报告期内保持高仓位运行，以满足上市运作要求以及对标的指数的跟踪要求。

在报告期内，基金标的指数的成分股进行了两次例行调整，并有若干次临时调整。管理人根据指数编制公司发布的相应信息，对申赎清单文件及基金投资组合进行了相应的必要操作，比较有效地控制了组合的跟踪误差，也使基金得以平稳运作。

由于四舍五入取整等原因，基金申赎清单中股票的权重结构与标的指数成分股的权重之间存在一定差异，这会给基金组合对标的指数的跟踪造成一些不利影响。管理人对组合结构做了适当调整，以尽力降低这些不利影响，基金的跟踪误差和偏离度在报告期内均保持在合理水平。

在遵守基金合同，确保基金平稳运行的前提下，本基金适量参与了一级市场申购，并适时进行了兑现，力求进一步增厚基金回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率-1.25%，波动率 0.77%，业绩比较基准收益率-2.71%，波动率 0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济的角度来看，尽管面临全球贸易环境的不确定性和国内结构性问题的挑战，但政府的政策导向明确，即推动经济高质量发展，优化经济发展环境，以及积极推动科技创新。这些都为中国经济的稳定增长提供了长期的支撑，特别是提升中国经济的内生增长动力和经济的抗风险能力。

下半年，中国经济有望继续保持增长，但同时我们需要密切关注全球经济环境的变化，以及国内经济结构调整的进展和货币、财政政策的走向。

从资本市场的角度来看，中国资本市场整体稳定，但存在一些波动。监管当局已经采取了一系列措施，包括提高市场透明度，优化上市公司质量，以维护市场稳定。同时，中国资本市场正在进一步开放，这将有助于吸引更多的外资进入，提升市场活力。我们需要密切关注全球资本市场的动态，以及国内资本市场改革的进展。预计科技创新类行业将继续保持良好势头。一些受全球经济环境变化影响的行业，如传统制造业、出口导向型行业等，需要关注外部环境对它们的影响。

本管理人将根据基金合同，继续做好对指数的复制追踪，力争将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

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，中国国际金融股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的重大违规行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

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	3,062,117.78	4,482,966.74
结算备付金		8,779.15	8,022.36
存出保证金		-	14,908.61
交易性金融资产	6.4.7.2	128,129,685.17	131,391,850.84
其中：股票投资		128,129,685.17	131,391,850.84
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		65,419.06	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		131,266,001.16	135,897,748.55
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		-	108,694.80
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		53,842.00	57,279.04
应付托管费		10,768.40	11,455.84
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	309,274.28	417,972.09
负债合计		373,884.68	595,401.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	96,048,000.00	98,048,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	34,844,116.48	37,254,346.78
净资产合计		130,892,116.48	135,302,346.78
负债和净资产总计		131,266,001.16	135,897,748.55

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3628 元，基金份额总额 96,048,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-927,142.06	-13,064,214.21
1. 利息收入		11,739.77	20,309.07
其中：存款利息收入	6.4.7.13	11,739.77	20,309.07
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,770,381.38	2,593,739.30
其中：股票投资收益	6.4.7.14	276,295.01	1,167,557.71

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	7,731.36
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,494,086.37	1,418,450.23
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	-2,717,013.29	-15,718,691.58
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	7,750.08	40,429.00
减：二、营业总支出		576,834.73	622,200.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	336,258.44	392,190.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	67,251.72	78,438.11
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	173,324.57	151,571.59
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-1,503,976.79	-13,686,414.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-1,503,976.79	-13,686,414.26
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-1,503,976.79	-13,686,414.26

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

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)	98,048,000.00	-	37,254,346.78	135,302,346.78
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)	98,048,000.00	-	37,254,346.78	135,302,346.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,000,000.00	-	-2,410,230.30	-4,410,230.30
(一)、综合收益总额	-	-	-1,503,976.79	-1,503,976.79
(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)	-2,000,000.00	-	-906,253.51	-2,906,253.51
其中：1. 基金申购款	10,000,000.00	-	4,309,226.22	14,309,226.22
2. 基金赎回款	-12,000,000.00	-	-5,215,479.73	-17,215,479.73
(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)	96,048,000.00	-	34,844,116.48	130,892,116.48
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	106,048,000.00	-	72,230,798.72	178,278,798.72
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)	106,048,000.00	-	72,230,798.72	178,278,798.72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,000,000.00	-	-17,576,846.63	-25,576,846.63
(一)、综合收益总额	-	-	-13,686,414.26	-13,686,414.26
(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)	-8,000,000.00	-	-3,890,432.37	-11,890,432.37
其中：1. 基金申购款	6,000,000.00	-	3,120,913.07	9,120,913.07
2. 基金赎回款	-14,000,000.00	-	-7,011,345.44	-21,011,345.44
(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)	98,048,000.00	-	54,653,952.09	152,701,952.09

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

张力铮

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]503 号《关于准予建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 2,046,048,000.00 元（含募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2018）第 0258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,046,048,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证自律监管决定书[2018]61 号审核同意，本基金于 2018 年 5 月 21 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。

本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司以本基金为目标 ETF，募集成立了建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“建信 MSCI 联接基金”）。建信 MSCI 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金

融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息

所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	3,062,117.78
等于：本金	3,061,592.94
加：应计利息	524.84
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	3,062,117.78

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		131,652,054.39	-	128,129,685.17	-3,522,369.22
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		131,652,054.39	-	128,129,685.17	-3,522,369.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	101,017.59
其中：交易所市场	101,017.59
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	71,243.01
预提费用	137,013.68
合计	309,274.28

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	98,048,000.00	98,048,000.00
本期申购	10,000,000.00	10,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.00
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	96,048,000.00	96,048,000.00

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	79,781,962.37	-42,527,615.59	37,254,346.78
本期利润	1,213,036.50	-2,717,013.29	-1,503,976.79
本期基金份额交易产生的变动数	-1,628,290.13	722,036.62	-906,253.51
其中：基金申购款	8,171,190.96	-3,861,964.74	4,309,226.22
基金赎回款	-9,799,481.09	4,584,001.36	-5,215,479.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	79,366,708.74	-44,522,592.26	34,844,116.48

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
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	205.14
其他	32.84
合计	11,739.77

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	-15,730.62
股票投资收益——赎回差价收入	292,025.63
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	276,295.01

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	17,420,604.98
减：卖出股票成本总额	17,384,195.20
减：交易费用	52,140.40
买卖股票差价收入	-15,730.62

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	17,215,479.73
减：现金支付赎回款总额	7,666,367.73
减：赎回股票成本总额	9,257,086.37
减：交易费用	-
赎回差价收入	292,025.63

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,494,086.37
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	1,494,086.37

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	-2,717,013.29
股票投资	-2,717,013.29
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,717,013.29

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	-
替代损益	7,750.08
合计	7,750.08

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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	447.47
指数使用费	91,054.24
合计	173,324.57

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金托管人、基金销售机构
建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“建信 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
中金公司	15,537,369.20	45.49	15,585,460.62	49.26

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	14,470.13	45.71	77,347.77	76.57
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	14,514.94	49.57	54,736.19	62.94

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	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	336,258.44	392,190.35
其中：支付销售机构的客户维护费	38,905.80	38,254.15

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	67,251.72	78,438.11

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

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
建信MSCI中国 A股国际通交 易型开放式指 数证券投资基 金发起式联接 基金	47,491,200.00	49.45	47,471,200.00	48.42

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

无。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金因指数投资而持有关联方建设银行（证券代码：601939）的持仓数量为 30,923.00 股，占本基金总净值的比例为 0.15%。持有关联方中金公司（证券代码：601995）的持仓数量为 6,300.00 股，占本基金总净值的比例为 0.17%。（于 2022 年 6 月 30 日，本基金因指数投资而持有关联方建设银行（证券代码：601939）的持仓数量为 33,423.00 股，占本基金总净值的比例为 0.13%。持有关联方中金公司（证券代码：601995）的持仓数量为 4,000.00 股，占本基金总净值的比例为 0.12%。）

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
601061	中	2023	6个月	新发	6.58	7.58	411	2,704.38	3,115.38	-

	信金属	年3月30日		未上市						
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新发未上市	10.36	11.84	143	1,481.48	1,693.12	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新发未上市	11.66	12.26	129	1,504.14	1,581.54	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新发未上市	25.98	24.53	46	1,195.08	1,128.38	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新发未上市	17.80	17.89	141	2,509.80	2,522.49	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新发未上市	15.90	17.09	102	1,621.80	1,743.18	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新发未上市	14.58	16.13	86	1,253.88	1,387.18	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新发未上市	36.15	38.13	140	5,061.00	5,338.20	-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新发未上市	12.10	12.07	398	4,815.80	4,803.86	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新发未上市	19.20	25.53	141	2,707.20	3,599.73	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新发未上市	26.66	31.50	123	3,279.18	3,874.50	-
688443	智	2023	6个月	新发	37.88	29.49	252	9,545.76	7,431.48	-

	翔金泰	年6月13日		未上市						
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新发未上市	75.00	90.76	54	4,050.00	4,901.04	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新发未上市	5.69	5.41	1,463	8,324.47	7,914.83	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新发未上市	33.99	29.49	94	3,195.06	2,772.06	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新发未上市	20.92	19.16	199	4,163.08	3,812.84	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新发未上市	21.86	23.85	186	4,065.96	4,436.10	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新发未上市	43.67	53.05	93	4,061.31	4,933.65	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新发未上市	21.17	23.50	178	3,768.26	4,183.00	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新发未上市	12.68	22.31	276	3,499.68	6,157.56	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新发未上市	30.26	25.33	146	4,417.96	3,698.18	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新发未上市	26.74	40.68	140	3,743.60	5,695.20	-
688603	天承科	2023年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	55.00	55.00	625	34,375.00	34,375.00	-

	技									
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新发未上市	55.00	55.00	70	3,850.00	3,850.00	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新发未上市	125.88	86.79	36	4,531.68	3,124.44	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新发未上市	9.26	18.59	380	3,518.80	7,064.20	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新发未上市	25.28	29.87	101	2,553.28	3,016.87	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制

上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	3,062,117.78	-	-	-	3,062,117.78
结算备付金	8,779.15	-	-	-	8,779.15
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	128,129,685.17	128,129,685.17
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	65,419.06	65,419.06
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,070,896.93	-	-	128,195,104.23	131,266,001.16
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	53,842.00	53,842.00
应付托管费	-	-	-	10,768.40	10,768.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	309,274.28	309,274.28
负债总计	-	-	-	373,884.68	373,884.68

利率敏感度缺口	3,070,896.93	-	-	-127,821,219.55	130,892,116.48
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	4,482,966.74	-	-	-	4,482,966.74
结算备付金	8,022.36	-	-	-	8,022.36
存出保证金	14,908.61	-	-	-	14,908.61
交易性金融资产	-	-	-	-131,391,850.84	131,391,850.84
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,505,897.71	-	-	-131,391,850.84	135,897,748.55
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	-	-	-	108,694.80	108,694.80
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	57,279.04	57,279.04
应付托管费	-	-	-	11,455.84	11,455.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	417,972.09	417,972.09
负债总计	-	-	-	595,401.77	595,401.77
利率敏感度缺口	4,505,897.71	-	-	-130,796,449.07	135,302,346.78

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。

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。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。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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	128,129,685.17	97.89	131,391,850.84	97.11
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	128,129,685.17	97.89	131,391,850.84	97.11

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	6,346,196.36	6,550,328.93
	业绩比较基准下降 5%	-6,346,196.36	-6,550,328.93

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	127,991,531.16	130,765,091.65
第二层次	38,225.00	297,497.50
第三层次	99,929.01	329,261.69
合计	128,129,685.17	131,391,850.84

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	128,129,685.17	97.61
	其中：股票	128,129,685.17	97.61
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	3,070,896.93	2.34
8	其他各项资产	65,419.06	0.05
9	合计	131,266,001.16	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	1,350,489.40	1.03
B	采矿业	5,578,103.27	4.26
C	制造业	71,415,003.07	54.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,872,488.14	3.72
E	建筑业	2,855,816.68	2.18
F	批发和零售业	1,382,059.99	1.06

G	交通运输、仓储和邮政业	4,251,145.34	3.25
H	住宿和餐饮业	191,006.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,280,513.05	4.80
J	金融业	22,369,894.33	17.09
K	房地产业	1,925,448.49	1.47
L	租赁和商务服务业	1,163,118.58	0.89
M	科学研究和技术服务业	851,850.16	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	166,878.50	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	93,530.00	0.07
Q	卫生和社会工作	857,545.45	0.66
R	文化、体育和娱乐业	475,084.20	0.36
S	综合	170,118.00	0.13
	合计	126,250,092.65	96.45

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,089,768.95	0.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,324.72	0.00
F	批发和零售业	3,115.38	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	566,972.93	0.43
J	金融业	80,255.28	0.06
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	101,611.76	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	34,543.50	0.03
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,879,592.52	1.44

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,096	6,926,336.00	5.29
2	300750	宁德时代	14,180	3,244,242.20	2.48
3	600036	招商银行	66,582	2,181,226.32	1.67
4	000858	五粮液	12,507	2,045,769.99	1.56
5	600900	长江电力	76,384	1,685,031.04	1.29
6	601318	中国平安	34,978	1,622,979.20	1.24
7	002594	比亚迪	5,812	1,501,065.24	1.15
8	300760	迈瑞医疗	3,900	1,169,220.00	0.89
9	601166	兴业银行	67,066	1,049,582.90	0.80
10	000568	泸州老窖	4,700	984,979.00	0.75
11	600276	恒瑞医药	20,556	984,632.40	0.75
12	601398	工商银行	202,998	978,450.36	0.75
13	601288	农业银行	274,600	969,338.00	0.74
14	600309	万华化学	10,100	887,184.00	0.68
15	601138	工业富联	32,000	806,400.00	0.62
16	600030	中信证券	39,480	780,914.40	0.60
17	601668	中国建筑	135,312	776,690.88	0.59
18	688111	金山办公	1,600	755,552.00	0.58
19	601899	紫金矿业	66,438	755,400.06	0.58
20	002475	立讯精密	23,032	747,388.40	0.57
21	002714	牧原股份	17,696	745,886.40	0.57
22	601328	交通银行	126,675	734,715.00	0.56
23	300059	东方财富	51,115	725,833.00	0.55
24	600809	山西汾酒	3,921	725,659.47	0.55
25	002352	顺丰控股	15,833	713,909.97	0.55
26	000001	平安银行	62,628	703,312.44	0.54
27	601012	隆基绿能	24,507	702,615.69	0.54

28	603288	海天味业	14,912	698,627.20	0.53
29	601888	中国中免	6,286	694,791.58	0.53
30	600000	浦发银行	94,700	685,628.00	0.52
31	601088	中国神华	21,291	654,698.25	0.50
32	600028	中国石化	102,300	650,628.00	0.50
33	002304	洋河股份	4,888	642,038.80	0.49
34	600406	国电南瑞	25,877	597,758.70	0.46
35	600887	伊利股份	20,688	585,884.16	0.45
36	000063	中兴通讯	12,800	582,912.00	0.45
37	601601	中国太保	22,108	574,365.84	0.44
38	601225	陕西煤业	31,300	569,347.00	0.43
39	300274	阳光电源	4,800	559,824.00	0.43
40	300015	爱尔眼科	30,044	557,316.20	0.43
41	601816	京沪高铁	105,600	555,456.00	0.42
42	600436	片仔癀	1,900	544,084.00	0.42
43	002371	北方华创	1,700	540,005.00	0.41
44	002142	宁波银行	21,312	539,193.60	0.41
45	601857	中国石油	69,600	519,912.00	0.40
46	603259	药明康德	8,276	515,677.56	0.39
47	601766	中国中车	78,500	510,250.00	0.39
48	002230	科大讯飞	7,450	506,302.00	0.39
49	600048	保利发展	38,600	502,958.00	0.38
50	601390	中国中铁	66,300	502,554.00	0.38
51	600438	通威股份	14,526	498,387.06	0.38
52	600905	三峡能源	92,300	495,651.00	0.38
53	000725	京东方 A	121,000	494,890.00	0.38
54	600050	中国联通	102,600	492,480.00	0.38
55	600690	海尔智家	20,328	477,301.44	0.36
56	600150	中国船舶	14,400	473,904.00	0.36
57	601818	光大银行	149,700	459,579.00	0.35
58	601658	邮储银行	93,800	458,682.00	0.35
59	600031	三一重工	27,345	454,747.35	0.35
60	002459	晶澳科技	10,684	445,522.80	0.34
61	601988	中国银行	113,362	443,245.42	0.34
62	000002	万科 A	31,340	439,386.80	0.34
63	002129	TCL 中环	13,000	431,600.00	0.33
64	601985	中国核电	60,900	429,345.00	0.33
65	600016	民生银行	114,424	429,090.00	0.33
66	600019	宝钢股份	71,800	403,516.00	0.31
67	300014	亿纬锂能	6,596	399,058.00	0.30
68	688036	传音控股	2,700	396,900.00	0.30
69	300498	温氏股份	21,120	387,552.00	0.30
70	601919	中远海控	41,080	386,152.00	0.30

71	300308	中际旭创	2,600	383,370.00	0.29
72	002493	荣盛石化	32,675	380,337.00	0.29
73	603501	韦尔股份	3,780	370,591.20	0.28
74	600893	航发动力	8,565	361,956.90	0.28
75	601006	大秦铁路	48,000	356,640.00	0.27
76	600104	上汽集团	25,118	355,922.06	0.27
77	600919	江苏银行	47,653	350,249.55	0.27
78	000625	长安汽车	26,752	345,903.36	0.26
79	300122	智飞生物	7,800	344,760.00	0.26
80	601066	中信建投	14,000	338,800.00	0.26
81	601211	国泰君安	24,200	338,558.00	0.26
82	000166	申万宏源	72,742	336,068.04	0.26
83	002466	天齐锂业	4,800	335,568.00	0.26
84	000792	盐湖股份	17,500	335,475.00	0.26
85	000651	格力电器	9,100	332,241.00	0.25
86	688012	中微公司	2,100	328,545.00	0.25
87	601688	华泰证券	23,700	326,349.00	0.25
88	600346	恒力石化	22,707	325,391.31	0.25
89	001979	招商蛇口	24,963	325,267.89	0.25
90	600999	招商证券	23,968	325,245.76	0.25
91	000596	古井贡酒	1,300	321,594.00	0.25
92	601669	中国电建	55,600	319,144.00	0.24
93	002027	分众传媒	46,600	317,346.00	0.24
94	002460	赣锋锂业	5,182	315,894.72	0.24
95	601169	北京银行	68,192	315,728.96	0.24
96	601628	中国人寿	8,944	312,682.24	0.24
97	300896	爱美客	700	311,465.00	0.24
98	600585	海螺水泥	12,941	307,219.34	0.23
99	000538	云南白药	5,846	306,798.08	0.23
100	603993	洛阳钼业	57,000	303,810.00	0.23
101	600886	国投电力	24,000	303,600.00	0.23
102	688223	晶科能源	21,500	302,290.00	0.23
103	600989	宝丰能源	23,700	298,857.00	0.23
104	688599	天合光能	7,000	298,270.00	0.23
105	300033	同花顺	1,700	297,976.00	0.23
106	300316	晶盛机电	4,200	297,780.00	0.23
107	000938	紫光股份	9,262	294,994.70	0.23
108	600845	宝信软件	5,719	290,582.39	0.22
109	601689	拓普集团	3,600	290,520.00	0.22
110	601360	三六零	23,052	289,072.08	0.22
111	600837	海通证券	31,100	286,742.00	0.22
112	000776	广发证券	19,100	280,961.00	0.21
113	002920	德赛西威	1,800	280,458.00	0.21

114	600089	特变电工	12,544	279,605.76	0.21
115	002812	恩捷股份	2,900	279,415.00	0.21
116	600111	北方稀土	11,650	279,367.00	0.21
117	600703	三安光电	16,100	277,564.00	0.21
118	601100	恒立液压	4,280	275,332.40	0.21
119	600011	华能国际	29,600	274,096.00	0.21
120	600547	山东黄金	11,652	273,588.96	0.21
121	000895	双汇发展	11,171	273,577.79	0.21
122	600570	恒生电子	6,173	273,402.17	0.21
123	000338	潍柴动力	21,900	272,874.00	0.21
124	300124	汇川技术	4,248	272,764.08	0.21
125	601009	南京银行	33,400	267,200.00	0.20
126	601229	上海银行	45,833	263,539.75	0.20
127	600010	宝钢股份	147,100	263,309.00	0.20
128	002049	紫光国微	2,780	259,235.00	0.20
129	000425	徐工机械	38,100	257,937.00	0.20
130	002709	天赐材料	6,180	254,554.20	0.19
131	600085	同仁堂	4,400	253,264.00	0.19
132	002311	海大集团	5,400	252,936.00	0.19
133	002555	三七互娱	7,200	251,136.00	0.19
134	603659	璞泰来	6,531	249,614.82	0.19
135	000963	华东医药	5,701	247,252.37	0.19
136	601336	新华保险	6,708	246,653.16	0.19
137	600188	兖矿能源	8,200	245,344.00	0.19
138	601868	中国能建	104,600	244,764.00	0.19
139	688256	寒武纪	1,300	244,400.00	0.19
140	000100	TCL 科技	60,610	238,803.40	0.18
141	603799	华友钴业	5,153	236,574.23	0.18
142	000301	东方盛虹	20,000	236,400.00	0.18
143	600600	青岛啤酒	2,275	235,758.25	0.18
144	601600	中国铝业	42,600	233,874.00	0.18
145	600958	东方证券	24,100	233,770.00	0.18
146	600660	福耀玻璃	6,500	233,025.00	0.18
147	603986	兆易创新	2,184	232,050.00	0.18
148	600015	华夏银行	42,800	231,548.00	0.18
149	688303	大全能源	5,700	230,565.00	0.18
150	600039	四川路桥	23,380	229,357.80	0.18
151	000977	浪潮信息	4,720	228,920.00	0.17
152	601618	中国中冶	57,600	228,672.00	0.17
153	600588	用友网络	11,121	227,980.50	0.17
154	688396	华润微	4,300	225,363.00	0.17
155	600926	杭州银行	19,140	224,895.00	0.17
156	601995	中金公司	6,300	223,776.00	0.17

157	603806	福斯特	5,978	222,321.82	0.17
158	600795	国电电力	57,500	220,225.00	0.17
159	600029	南方航空	36,265	218,677.95	0.17
160	600221	海航控股	138,200	218,356.00	0.17
161	600674	川投能源	14,400	216,720.00	0.17
162	002236	大华股份	10,777	212,845.75	0.16
163	688008	澜起科技	3,700	212,454.00	0.16
164	601865	福莱特	5,500	211,805.00	0.16
165	603369	今世缘	4,000	211,200.00	0.16
166	600196	复星医药	6,800	210,120.00	0.16
167	600426	华鲁恒升	6,820	208,896.60	0.16
168	601111	中国国航	25,000	206,000.00	0.16
169	300413	芒果超媒	6,000	205,260.00	0.16
170	605117	德业股份	1,360	203,388.00	0.16
171	601607	上海医药	9,000	201,690.00	0.15
172	601633	长城汽车	8,000	201,360.00	0.15
173	601788	光大证券	12,627	200,643.03	0.15
174	600745	闻泰科技	4,000	195,600.00	0.15
175	002241	歌尔股份	11,000	195,250.00	0.15
176	000999	华润三九	3,200	194,112.00	0.15
177	601939	建设银行	30,923	193,577.98	0.15
178	601877	正泰电器	6,888	190,453.20	0.15
179	600741	华域汽车	10,200	188,292.00	0.14
180	300433	蓝思科技	16,000	188,160.00	0.14
181	300999	金龙鱼	4,700	187,953.00	0.14
182	601727	上海电气	40,800	186,456.00	0.14
183	688126	沪硅产业	8,800	183,920.00	0.14
184	601021	春秋航空	3,200	183,904.00	0.14
185	600023	浙能电力	36,000	182,520.00	0.14
186	600176	中国巨石	12,888	182,494.08	0.14
187	002602	世纪华通	24,040	182,463.60	0.14
188	600009	上海机场	4,011	182,179.62	0.14
189	603392	万泰生物	2,728	182,148.56	0.14
190	300408	三环集团	6,200	181,970.00	0.14
191	600732	爱旭股份	5,880	180,810.00	0.14
192	002736	国信证券	20,700	180,711.00	0.14
193	601319	中国人保	30,500	178,120.00	0.14
194	600584	长电科技	5,700	177,669.00	0.14
195	000661	长春高新	1,300	177,190.00	0.14
196	600027	华电国际	26,400	176,616.00	0.13
197	601127	赛力斯	4,800	176,496.00	0.13
198	002050	三花智控	5,800	175,508.00	0.13
199	600115	中国东航	36,800	175,168.00	0.13

200	603260	合盛硅业	2,500	175,050.00	0.13
201	600522	中天科技	11,000	175,010.00	0.13
202	601901	方正证券	26,600	173,964.00	0.13
203	601377	兴业证券	27,900	170,748.00	0.13
204	000876	新希望	14,600	170,528.00	0.13
205	601825	沪农商行	31,100	169,495.00	0.13
206	600875	东方电气	9,001	167,868.65	0.13
207	000983	山西焦煤	18,360	167,076.00	0.13
208	300782	卓胜微	1,716	165,817.08	0.13
209	601238	广汽集团	15,900	165,678.00	0.13
210	601117	中国化学	19,700	163,116.00	0.12
211	002252	上海莱士	21,700	162,967.00	0.12
212	000733	振华科技	1,700	162,945.00	0.12
213	002648	卫星化学	10,838	162,136.48	0.12
214	600233	圆通速递	11,100	161,616.00	0.12
215	601881	中国银河	13,900	161,379.00	0.12
216	600489	中金黄金	15,600	161,148.00	0.12
217	601699	潞安环能	9,700	158,304.00	0.12
218	600803	新奥股份	8,300	157,534.00	0.12
219	002074	国轩高科	5,700	157,434.00	0.12
220	300418	昆仑万维	3,900	157,092.00	0.12
221	002600	领益智造	22,700	156,857.00	0.12
222	002180	纳思达	4,558	156,111.50	0.12
223	600918	中泰证券	22,500	155,475.00	0.12
224	603833	欧派家居	1,616	154,812.80	0.12
225	688777	中控技术	2,465	154,752.70	0.12
226	000157	中联重科	22,890	154,507.50	0.12
227	002841	视源股份	2,300	153,732.00	0.12
228	002001	新和成	9,968	153,507.20	0.12
229	601872	招商轮船	26,200	151,698.00	0.12
230	600415	小商品城	17,700	150,981.00	0.12
231	002938	鹏鼎控股	6,200	150,598.00	0.12
232	600515	海南机场	36,900	149,814.00	0.11
233	601838	成都银行	12,100	147,741.00	0.11
234	300832	新产业	2,500	147,500.00	0.11
235	600132	重庆啤酒	1,600	147,456.00	0.11
236	600061	国投资本	20,700	147,384.00	0.11
237	300454	深信服	1,300	147,225.00	0.11
238	300751	迈为股份	864	146,344.32	0.11
239	600332	白云山	4,567	145,595.96	0.11
240	600256	广汇能源	21,200	145,432.00	0.11
241	300496	中科创达	1,500	144,525.00	0.11
242	600161	天坛生物	5,300	143,895.00	0.11

243	000066	中国长城	10,400	143,832.00	0.11
244	600079	人福医药	5,300	142,782.00	0.11
245	688363	华熙生物	1,600	142,656.00	0.11
246	000807	云铝股份	11,200	142,576.00	0.11
247	002384	东山精密	5,500	142,450.00	0.11
248	300628	亿联网络	4,040	141,682.80	0.11
249	600026	中远海能	11,200	141,568.00	0.11
250	300223	北京君正	1,600	141,296.00	0.11
251	603198	迎驾贡酒	2,200	140,360.00	0.11
252	603486	科沃斯	1,800	139,986.00	0.11
253	002422	科伦药业	4,700	139,496.00	0.11
254	600460	士兰微	4,600	139,242.00	0.11
255	002603	以岭药业	5,420	139,239.80	0.11
256	300003	乐普医疗	6,100	137,921.00	0.11
257	300142	沃森生物	5,200	137,540.00	0.11
258	603688	石英股份	1,200	136,608.00	0.10
259	600702	舍得酒业	1,100	136,345.00	0.10
260	300763	锦浪科技	1,300	135,330.00	0.10
261	000786	北新建材	5,500	134,805.00	0.10
262	688009	中国通号	23,200	134,560.00	0.10
263	603899	晨光股份	3,000	133,920.00	0.10
264	002007	华兰生物	5,920	132,667.20	0.10
265	603345	安井食品	900	132,120.00	0.10
266	300146	汤臣倍健	5,500	131,890.00	0.10
267	600536	中国软件	2,760	129,388.80	0.10
268	603290	斯达半导	600	129,120.00	0.10
269	002463	沪电股份	6,080	127,315.20	0.10
270	600362	江西铜业	6,700	127,166.00	0.10
271	002601	龙佰集团	7,700	127,050.00	0.10
272	002821	凯莱英	1,060	124,931.60	0.10
273	002568	百润股份	3,436	124,898.60	0.10
274	688122	西部超导	2,240	124,835.20	0.10
275	300957	贝泰妮	1,400	124,432.00	0.10
276	002916	深南电路	1,640	123,606.80	0.09
277	300724	捷佳伟创	1,100	123,585.00	0.09
278	601878	浙商证券	12,500	123,500.00	0.09
279	300037	新宙邦	2,380	123,498.20	0.09
280	601615	明阳智能	7,300	123,224.00	0.09
281	600754	锦江酒店	2,900	122,786.00	0.09
282	300661	圣邦股份	1,495	122,784.35	0.09
283	300759	康龙化成	3,200	122,496.00	0.09
284	000988	华工科技	3,200	121,632.00	0.09
285	603444	吉比特	247	121,304.17	0.09

286	603939	益丰药房	3,256	120,472.00	0.09
287	600160	巨化股份	8,700	119,886.00	0.09
288	002738	中矿资源	2,340	119,199.60	0.09
289	688301	奕瑞科技	420	118,620.60	0.09
290	600018	上港集团	22,500	118,125.00	0.09
291	002202	金风科技	11,093	117,807.66	0.09
292	600487	亨通光电	8,000	117,280.00	0.09
293	688390	固德威	700	116,802.00	0.09
294	002028	思源电气	2,500	116,800.00	0.09
295	000069	华侨城 A	26,507	116,630.80	0.09
296	002558	巨人网络	6,500	116,545.00	0.09
297	601958	金钼股份	10,400	115,960.00	0.09
298	002223	鱼跃医疗	3,200	115,168.00	0.09
299	000408	藏格矿业	5,100	115,107.00	0.09
300	688521	芯原股份	1,600	115,072.00	0.09
301	002340	格林美	16,600	114,706.00	0.09
302	600219	南山铝业	37,800	114,156.00	0.09
303	688561	奇安信	2,200	113,982.00	0.09
304	603737	三棵树	1,736	113,569.12	0.09
305	000729	燕京啤酒	9,100	113,477.00	0.09
306	603882	金域医学	1,500	113,250.00	0.09
307	000423	东阿阿胶	2,117	113,153.65	0.09
308	601058	赛轮轮胎	9,900	112,761.00	0.09
309	601555	东吴证券	16,177	112,268.38	0.09
310	002294	信立泰	3,588	111,909.72	0.09
311	601216	君正集团	27,200	111,520.00	0.09
312	601799	星宇股份	900	111,240.00	0.08
313	002080	中材科技	5,400	110,808.00	0.08
314	002156	通富微电	4,900	110,740.00	0.08
315	600884	杉杉股份	7,300	110,522.00	0.08
316	600642	申能股份	15,800	110,442.00	0.08
317	002430	杭氧股份	3,200	109,952.00	0.08
318	002064	华峰化学	16,000	109,760.00	0.08
319	688099	晶晨股份	1,300	109,616.00	0.08
320	603885	吉祥航空	7,100	109,553.00	0.08
321	002409	雅克科技	1,500	109,320.00	0.08
322	600705	中航产融	28,500	109,155.00	0.08
323	600004	白云机场	7,600	108,984.00	0.08
324	000629	钒钛股份	27,800	108,698.00	0.08
325	601108	财通证券	15,000	108,600.00	0.08
326	300919	中伟股份	1,800	108,450.00	0.08
327	600970	中材国际	8,500	108,375.00	0.08
328	603606	东方电缆	2,200	107,866.00	0.08

329	002756	永兴材料	1,720	107,689.20	0.08
330	002625	光启技术	7,000	106,820.00	0.08
331	601966	玲珑轮胎	4,800	106,656.00	0.08
332	600183	生益科技	7,500	106,500.00	0.08
333	002414	高德红外	13,699	106,441.23	0.08
334	002624	完美世界	6,300	106,407.00	0.08
335	000932	华菱钢铁	22,300	106,371.00	0.08
336	600153	建发股份	9,711	105,947.01	0.08
337	688032	禾迈股份	298	105,834.70	0.08
338	002850	科达利	800	105,800.00	0.08
339	002939	长城证券	13,000	105,690.00	0.08
340	000723	美锦能源	14,000	105,560.00	0.08
341	600383	金地集团	14,600	105,266.00	0.08
342	601155	新城控股	7,300	105,193.00	0.08
343	300144	宋城演艺	8,483	105,189.20	0.08
344	002372	伟星新材	5,100	104,754.00	0.08
345	000975	银泰黄金	8,940	104,598.00	0.08
346	600109	国金证券	12,000	104,040.00	0.08
347	600606	绿地控股	37,800	103,950.00	0.08
348	601233	桐昆股份	7,800	103,350.00	0.08
349	000783	长江证券	17,800	103,240.00	0.08
350	603596	伯特利	1,300	103,038.00	0.08
351	300487	蓝晓科技	1,650	102,993.00	0.08
352	603233	大参林	3,667	102,712.67	0.08
353	603816	顾家家居	2,690	102,623.50	0.08
354	000738	航发控制	4,200	102,480.00	0.08
355	002153	石基信息	7,311	102,354.00	0.08
356	601077	渝农商行	28,500	102,315.00	0.08
357	000032	深桑达 A	3,100	101,990.00	0.08
358	600157	永泰能源	71,700	101,814.00	0.08
359	600298	安琪酵母	2,800	101,388.00	0.08
360	603156	养元饮品	4,100	101,270.00	0.08
361	000027	深圳能源	15,360	101,222.40	0.08
362	601577	长沙银行	13,000	100,880.00	0.08
363	600096	云天化	5,900	100,713.00	0.08
364	688180	君实生物	2,600	100,204.00	0.08
365	000009	中国宝安	8,300	100,181.00	0.08
366	000021	深科技	5,000	99,950.00	0.08
367	688063	派能科技	500	99,125.00	0.08
368	603658	安图生物	1,900	98,287.00	0.08
369	000630	铜陵有色	34,000	98,260.00	0.08
370	600352	浙江龙盛	10,500	98,175.00	0.08
371	600021	上海电力	9,100	98,007.00	0.07

372	688220	翱捷科技	1,300	98,007.00	0.07
373	300207	欣旺达	6,000	97,920.00	0.07
374	601990	南京证券	11,900	97,342.00	0.07
375	603185	弘元绿能	1,300	96,915.00	0.07
376	600763	通策医疗	1,000	96,860.00	0.07
377	688187	时代电气	2,300	96,278.00	0.07
378	002078	太阳纸业	9,000	96,210.00	0.07
379	688169	石头科技	300	96,204.00	0.07
380	600563	法拉电子	700	96,110.00	0.07
381	601696	中银证券	9,000	95,940.00	0.07
382	603568	伟明环保	5,450	95,429.50	0.07
383	300390	天华新能	2,660	95,228.00	0.07
384	002128	电投能源	7,200	95,184.00	0.07
385	300604	长川科技	2,000	94,980.00	0.07
386	000933	神火股份	7,300	94,900.00	0.07
387	300118	东方日升	3,700	94,831.00	0.07
388	300769	德方纳米	860	94,797.80	0.07
389	002185	华天科技	10,300	94,760.00	0.07
390	000831	中国稀土	3,200	94,720.00	0.07
391	002056	横店东磁	5,200	94,692.00	0.07
392	601880	辽港股份	60,700	94,692.00	0.07
393	600779	水井坊	1,600	94,384.00	0.07
394	688516	奥特维	500	94,200.00	0.07
395	600998	九州通	9,073	94,177.74	0.07
396	600378	昊华科技	2,500	94,100.00	0.07
397	603338	浙江鼎力	1,680	94,096.80	0.07
398	600177	雅戈尔	14,900	94,019.00	0.07
399	603589	口子窖	1,900	93,765.00	0.07
400	002152	广电运通	8,000	93,760.00	0.07
401	002607	中公教育	19,900	93,530.00	0.07
402	600511	国药股份	2,400	93,240.00	0.07
403	600848	上海临港	7,760	92,732.00	0.07
404	600546	山煤国际	6,400	92,608.00	0.07
405	600348	华阳股份	11,700	92,547.00	0.07
406	002240	盛新锂能	2,900	92,423.00	0.07
407	600985	淮北矿业	8,000	92,160.00	0.07
408	600872	中炬高新	2,500	91,975.00	0.07
409	601933	永辉超市	29,300	91,709.00	0.07
410	000728	国元证券	14,040	91,540.80	0.07
411	002673	西部证券	14,414	91,528.90	0.07
412	300601	康泰生物	3,569	90,616.91	0.07
413	688188	柏楚电子	480	90,508.80	0.07
414	000799	酒鬼酒	1,000	90,150.00	0.07

415	002044	美年健康	12,675	90,119.25	0.07
416	002532	天山铝业	15,000	89,850.00	0.07
417	002120	韵达股份	9,380	89,672.80	0.07
418	002405	四维图新	7,700	89,166.00	0.07
419	002385	大北农	13,400	88,440.00	0.07
420	601991	大唐发电	26,700	88,377.00	0.07
421	002531	天顺风能	5,800	88,334.00	0.07
422	601231	环旭电子	5,900	88,264.00	0.07
423	002244	滨江集团	10,000	88,200.00	0.07
424	600521	华海药业	4,790	88,183.90	0.07
425	300595	欧普康视	2,910	87,852.90	0.07
426	002739	万达电影	7,000	87,780.00	0.07
427	600549	厦门钨业	4,600	87,538.00	0.07
428	600486	扬农化工	1,000	87,420.00	0.07
429	688536	思瑞浦	400	87,200.00	0.07
430	600566	济川药业	3,000	87,120.00	0.07
431	600655	豫园股份	12,600	86,436.00	0.07
432	000987	越秀资本	13,488	85,648.80	0.07
433	000591	太阳能	12,600	85,428.00	0.07
434	688728	格科微	5,400	85,428.00	0.07
435	688385	复旦微电	1,700	85,170.00	0.07
436	002032	苏泊尔	1,700	85,000.00	0.06
437	603613	国联股份	2,298	84,865.14	0.06
438	600873	梅花生物	9,500	84,835.00	0.06
439	000683	远兴能源	11,700	84,123.00	0.06
440	600481	双良节能	6,000	83,880.00	0.06
441	000800	一汽解放	10,000	83,700.00	0.06
442	600583	海油工程	14,300	83,655.00	0.06
443	300395	菲利华	1,700	83,640.00	0.06
444	601198	东兴证券	10,400	83,408.00	0.06
445	600704	物产中大	16,800	82,992.00	0.06
446	002353	杰瑞股份	3,300	82,929.00	0.06
447	000960	锡业股份	5,300	82,415.00	0.06
448	300699	光威复材	2,648	81,690.80	0.06
449	301236	软通动力	3,000	81,630.00	0.06
450	000519	中兵红箭	4,500	81,405.00	0.06
451	688005	容百科技	1,500	81,030.00	0.06
452	601168	西部矿业	7,700	80,927.00	0.06
453	605358	立昂微	2,200	80,806.00	0.06
454	300073	当升科技	1,600	80,528.00	0.06
455	603893	瑞芯微	1,100	80,135.00	0.06
456	600141	兴发集团	3,600	79,992.00	0.06
457	000703	恒逸石化	11,780	79,868.40	0.06

458	603456	九洲药业	2,900	79,402.00	0.06
459	600380	健康元	6,200	78,802.00	0.06
460	601866	中远海发	31,900	78,793.00	0.06
461	002508	老板电器	3,095	78,272.55	0.06
462	600369	西南证券	21,400	78,110.00	0.06
463	300676	华大基因	1,300	77,987.00	0.06
464	000513	丽珠集团	2,000	77,820.00	0.06
465	002797	第一创业	13,600	77,792.00	0.06
466	600699	均胜电子	4,400	77,616.00	0.06
467	300347	泰格医药	1,200	77,448.00	0.06
468	002966	苏州银行	11,800	77,290.00	0.06
469	600170	上海建工	28,700	77,203.00	0.06
470	300251	光线传媒	9,500	76,855.00	0.06
471	601016	节能风电	20,910	76,739.70	0.06
472	002299	圣农发展	4,000	76,600.00	0.06
473	002465	海格通信	7,404	76,557.36	0.06
474	600516	方大炭素	12,290	76,198.00	0.06
475	002518	科士达	1,900	76,019.00	0.06
476	600598	北大荒	5,700	75,981.00	0.06
477	600038	中直股份	1,900	75,658.00	0.06
478	603712	七一二	2,500	75,525.00	0.06
479	000709	河钢股份	33,300	75,258.00	0.06
480	002268	电科网安	2,700	75,249.00	0.06
481	601636	旗滨集团	8,700	74,994.00	0.06
482	603517	绝味食品	2,000	74,300.00	0.06
483	603529	爱玛科技	2,300	74,106.00	0.06
484	603858	步长制药	3,595	74,021.05	0.06
485	002145	中核钛白	12,520	73,742.80	0.06
486	600688	上海石化	23,654	73,563.94	0.06
487	600559	老白干酒	3,000	73,530.00	0.06
488	600392	盛和资源	5,700	73,359.00	0.06
489	002831	裕同科技	3,000	73,170.00	0.06
490	000937	冀中能源	11,400	72,732.00	0.06
491	002065	东华软件	10,300	72,718.00	0.06
492	600988	赤峰黄金	5,400	72,684.00	0.06
493	000050	深天马 A	7,901	72,531.18	0.06
494	300438	鹏辉能源	1,500	72,060.00	0.06
495	000825	太钢不锈	18,500	71,595.00	0.05
496	600499	科达制造	6,300	71,568.00	0.05
497	002266	浙富控股	17,300	71,449.00	0.05
498	300568	星源材质	4,145	71,252.55	0.05
499	603707	健友股份	5,238	70,713.00	0.05
500	002926	华西证券	8,500	70,635.00	0.05

501	601456	国联证券	7,743	70,461.30	0.05
502	600673	东阳光	9,700	69,937.00	0.05
503	688779	长远锂科	6,200	69,874.00	0.05
504	300212	易华录	2,100	69,783.00	0.05
505	002407	多氟多	3,500	69,510.00	0.05
506	603077	和邦生物	28,500	69,255.00	0.05
507	000155	川能动力	4,800	69,120.00	0.05
508	002507	涪陵榨菜	3,770	69,028.70	0.05
509	300373	扬杰科技	1,700	68,969.00	0.05
510	000893	亚钾国际	3,000	68,820.00	0.05
511	600258	首旅酒店	3,600	68,220.00	0.05
512	000739	普洛药业	3,800	67,412.00	0.05
513	002497	雅化集团	3,700	65,786.00	0.05
514	002176	江特电机	5,500	65,560.00	0.05
515	000830	鲁西化工	6,200	65,472.00	0.05
516	002487	大金重工	2,100	64,764.00	0.05
517	002791	坚朗五金	1,000	64,710.00	0.05
518	000998	隆平高科	4,200	64,470.00	0.05
519	002500	山西证券	11,540	64,393.20	0.05
520	000401	冀东水泥	8,600	63,382.00	0.05
521	002541	鸿路钢构	2,200	63,382.00	0.05
522	600056	中国医药	4,840	62,823.20	0.05
523	688002	睿创微纳	1,400	62,720.00	0.05
524	603218	日月股份	3,300	62,667.00	0.05
525	300558	贝达药业	1,300	62,439.00	0.05
526	002138	顺络电子	2,600	62,166.00	0.05
527	300529	健帆生物	2,570	59,572.60	0.05
528	601992	金隅集团	26,900	58,642.00	0.04
529	002408	齐翔腾达	9,200	58,604.00	0.04
530	603127	昭衍新药	1,424	58,241.60	0.04
531	300357	我武生物	1,700	57,171.00	0.04
532	601666	平煤股份	7,500	56,550.00	0.04
533	600885	宏发股份	1,720	54,782.00	0.04
534	600801	华新水泥	4,400	54,340.00	0.04
535	002092	中泰化学	8,400	54,180.00	0.04
536	002192	融捷股份	800	53,464.00	0.04
537	300363	博腾股份	1,800	53,262.00	0.04
538	600338	西藏珠峰	2,900	52,954.00	0.04
539	603866	桃李面包	5,128	51,895.36	0.04
540	002030	达安基因	4,552	45,383.44	0.03

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	688212	澳华内镜	2,692	182,786.80	0.14
2	688045	必易微	1,891	107,787.00	0.08
3	688372	伟测科技	697	106,745.55	0.08
4	688207	格灵深瞳	4,166	103,733.40	0.08
5	688496	清越科技	5,200	103,376.00	0.08
6	688787	海天瑞声	1,144	101,129.60	0.08
7	688262	国芯科技	2,079	84,594.51	0.06
8	601059	信达证券	5,628	80,255.28	0.06
9	688772	珠海冠宇	3,657	73,688.55	0.06
10	301136	招标股份	5,246	71,975.12	0.05
11	688722	同益中	3,687	68,356.98	0.05
12	688234	天岳先进	918	67,876.92	0.05
13	688206	概伦电子	2,200	61,688.00	0.05
14	300285	国瓷材料	2,200	60,280.00	0.05
15	688152	麒麟信安	621	57,305.88	0.04
16	688049	炬芯科技	1,376	50,636.80	0.04
17	688132	邦彦技术	1,776	48,271.68	0.04
18	688426	康为世纪	1,488	44,937.60	0.03
19	688209	英集芯	2,729	44,537.28	0.03
20	688767	博拓生物	1,462	41,608.52	0.03
21	688296	和达科技	2,173	38,788.05	0.03
22	688603	天承科技	695	38,225.00	0.03
23	688203	海正生材	2,674	36,847.72	0.03
24	688455	科捷智能	2,151	31,469.13	0.02
25	688265	南模生物	792	29,636.64	0.02
26	688565	力源科技	3,450	29,221.50	0.02
27	688469	中芯集成	1,463	7,914.83	0.01
28	688443	智翔金泰	252	7,431.48	0.01
29	688629	华丰科技	380	7,064.20	0.01
30	688562	航天软件	276	6,157.56	0.00
31	688582	芯动联科	140	5,695.20	0.00
32	688146	中船特气	140	5,338.20	0.00
33	300958	建工修复	300	5,322.00	0.00
34	688543	国科军工	93	4,933.65	0.00
35	688458	美芯晟	54	4,901.04	0.00
36	688352	颀中科技	398	4,803.86	0.00
37	688523	航天环宇	186	4,436.10	0.00
38	688552	航天南湖	178	4,183.00	0.00
39	300992	泰福泵业	200	4,024.00	0.00
40	688433	华曙高科	123	3,874.50	0.00
41	688512	慧智微	199	3,812.84	0.00
42	688570	天玛智控	146	3,698.18	0.00
43	688429	时创能源	141	3,599.73	0.00

44	600760	中航沈飞	71	3,195.00	0.00
45	688623	双元科技	36	3,124.44	0.00
46	601061	中信金属	411	3,115.38	0.00
47	688631	莱斯信息	101	3,016.87	0.00
48	688479	友车科技	94	2,772.06	0.00
49	603135	中重科技	141	2,522.49	0.00
50	603137	恒尚节能	102	1,743.18	0.00
51	601065	江盐集团	143	1,693.12	0.00
52	601133	柏诚股份	129	1,581.54	0.00
53	603172	万丰股份	86	1,387.18	0.00
54	002271	东方雨虹	50	1,363.00	0.00
55	603125	常青科技	46	1,128.38	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	601816	京沪高铁	592,788.00	0.44
2	300750	宁德时代	387,733.00	0.29
3	300760	迈瑞医疗	365,947.00	0.27
4	000858	五粮液	344,426.00	0.25
5	600703	三安光电	314,458.00	0.23
6	688256	寒武纪	301,285.94	0.22
7	600886	国投电力	299,031.00	0.22
8	002352	顺丰控股	290,555.00	0.21
9	688223	晶科能源	262,690.18	0.19
10	688303	大全能源	242,952.97	0.18
11	600221	海航控股	233,558.00	0.17
12	300418	昆仑万维	219,473.00	0.16
13	688126	沪硅产业	193,763.29	0.14
14	002714	牧原股份	192,977.00	0.14
15	600023	浙能电力	184,905.00	0.14
16	600519	贵州茅台	182,960.00	0.14
17	601901	方正证券	180,614.00	0.13
18	600489	中金黄金	174,304.00	0.13
19	601021	春秋航空	173,451.00	0.13
20	603688	石英股份	162,974.00	0.12

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	300750	宁德时代	650,132.00	0.48
2	000858	五粮液	480,329.00	0.36
3	300760	迈瑞医疗	464,413.00	0.34
4	300124	汇川技术	371,908.50	0.27
5	002352	顺丰控股	351,815.00	0.26
6	600519	贵州茅台	335,867.00	0.25
7	002594	比亚迪	260,011.00	0.19
8	002714	牧原股份	245,396.00	0.18
9	600036	招商银行	208,318.00	0.15
10	000568	泸州老窖	207,415.00	0.15
11	002459	晶澳科技	183,315.00	0.14
12	300059	东方财富	164,937.00	0.12
13	688506	百利天恒	161,799.60	0.12
14	601916	浙商银行	155,727.00	0.12
15	000001	平安银行	153,585.00	0.11
16	002013	中航机电	147,554.00	0.11
17	300274	阳光电源	144,008.00	0.11
18	002475	立讯精密	139,359.00	0.10
19	002230	科大讯飞	138,411.00	0.10
20	300015	爱尔眼科	128,203.00	0.09

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	18,116,254.19
卖出股票收入（成交）总额	17,420,604.98

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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	-
2	应收清算款	65,419.06
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,419.06

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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,560	61,569.23	52,742,200.00	54.91	43,305,800.00	45.09

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	47,491,200.00	49.45

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	方正证券股份有限公司	2,607,700.00	2.71
2	中信证券股份有限公司	2,413,700.00	2.51
3	刘海涛	1,500,000.00	1.56
4	王锦华	1,000,000.00	1.04
4	张建军	1,000,000.00	1.04
6	李林晖	630,000.00	0.66
7	高为	580,000.00	0.60
8	孟志成	565,200.00	0.59
9	翟兆娟	500,000.00	0.52

10	任泽红	445,000.00	0.46
11	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	47,491,200.00	49.45

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年4月19日） 基金份额总额	2,046,048,000.00
本报告期期初基金份额总额	98,048,000.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	96,048,000.00

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，不涉及基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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 (%)	
中金公司	4	15,537,369.20	45.49	14,470.13	45.71	-
中信证券	1	15,323,589.80	44.87	14,117.45	44.60	-
天风证券	1	3,292,294.01	9.64	3,066.25	9.69	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

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

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

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

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

(4) 佣金费率合理。

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于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

§ 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(%)

建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2023 年 01 月 01 日-2023 年 06 月 30 日	47,471,200.00	24,020,000.00	24,000,000.00	47,491,200.00	49.45
--	---	-----------------------------------	---------------	---------------	---------------	---------------	-------

注：本基金本报告期申购、赎回份额中包含了买入、卖出份额。

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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数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