

建信中证 1000 指数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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64

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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	65
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	67
§ 9 开放式基金份额变动	67
§ 10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.8 其他重大事件	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金		
基金简称	建信中证 1000 指数增强		
基金主代码	006165		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018 年 11 月 22 日		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,018,998,995.36 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E
下属分级基金的交易代码	006165	006166	013442
报告期末下属分级基金的份额总额	516,788,254.26 份	401,482,194.73 份	100,728,546.37 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 1000 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。</p> <p>本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场

基金、债券型基金、混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	95528
传真	010-66228001	021-63602540
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码	100033	200126
法定代表人	刘军	郑杨

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)		
	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发 起 E
本期已实现 收益	28,753,461.21	17,142,074.67	5,658,671.34
本期利润	60,929,257.70	12,056,766.48	3,158,498.50
加权平均基 金份额本期 利润	0.1115	0.0334	0.0708

本期加权平均净值利润率	6.52%	1.99%	4.19%
本期基金份额净值增长率	9.72%	9.51%	9.52%
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	242,904,566.71	175,758,666.13	44,159,203.64
期末可供分配基金份额利润	0.4700	0.4378	0.4384
期末基金资产净值	887,115,317.51	674,888,168.52	169,386,158.39
期末基金份额净值	1.7166	1.6810	1.6816
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	126.51%	122.41%	-3.64%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信中证 1000 指数增强 A

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

过去一个月	1.60%	1.08%	0.59%	0.99%	1.01%	0.09%
过去三个月	-1.23%	0.89%	-3.77%	0.87%	2.54%	0.02%
过去六个月	9.72%	0.87%	4.87%	0.84%	4.85%	0.03%
过去一年	1.04%	1.11%	-5.27%	1.05%	6.31%	0.06%
过去三年	32.57%	1.34%	4.64%	1.30%	27.93%	0.04%
自基金合同生效起 至今	126.51%	1.39%	35.02%	1.40%	91.49%	-0.01%

建信中证 1000 指数增强 C

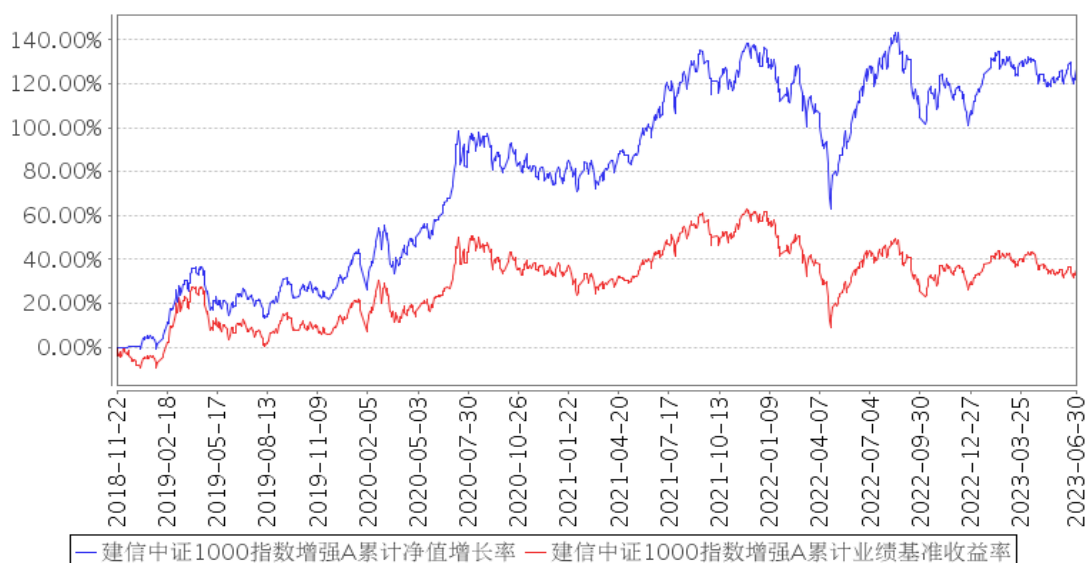
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.57%	1.08%	0.59%	0.99%	0.98%	0.09%
过去三个月	-1.33%	0.89%	-3.77%	0.87%	2.44%	0.02%
过去六个月	9.51%	0.87%	4.87%	0.84%	4.64%	0.03%
过去一年	0.64%	1.11%	-5.27%	1.05%	5.91%	0.06%
过去三年	30.99%	1.34%	4.64%	1.30%	26.35%	0.04%
自基金合同生效起 至今	122.41%	1.39%	35.02%	1.40%	87.39%	-0.01%

建信中证 1000 指数增强发起 E

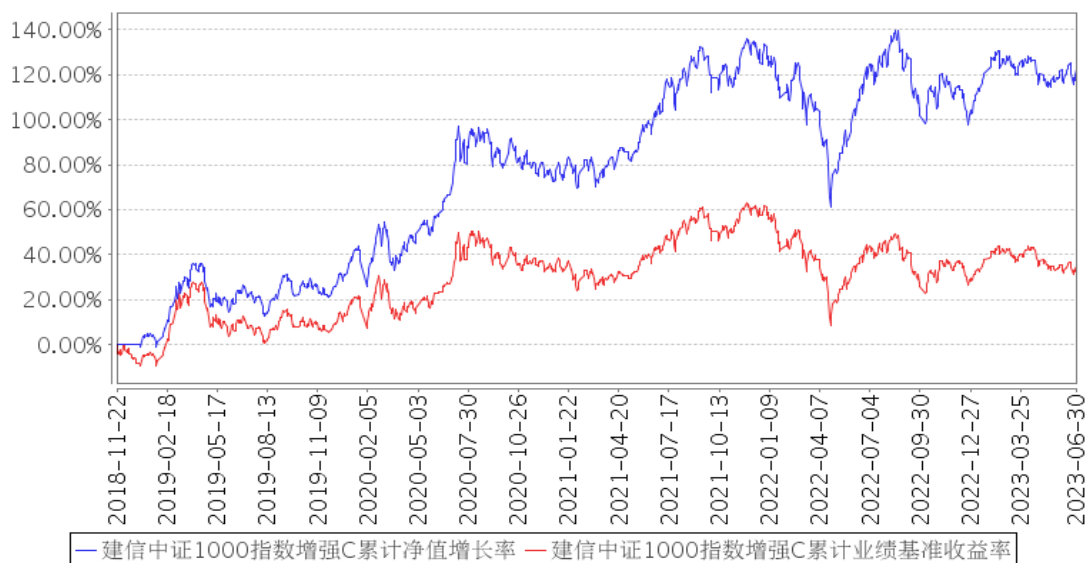
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.58%	1.07%	0.59%	0.99%	0.99%	0.08%
过去三个月	-1.32%	0.89%	-3.77%	0.87%	2.45%	0.02%
过去六个月	9.52%	0.87%	4.87%	0.84%	4.65%	0.03%
过去一年	0.66%	1.11%	-5.27%	1.05%	5.93%	0.06%
自基金合同生效起 至今	-3.64%	1.34%	-15.26%	1.30%	11.62%	0.04%

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

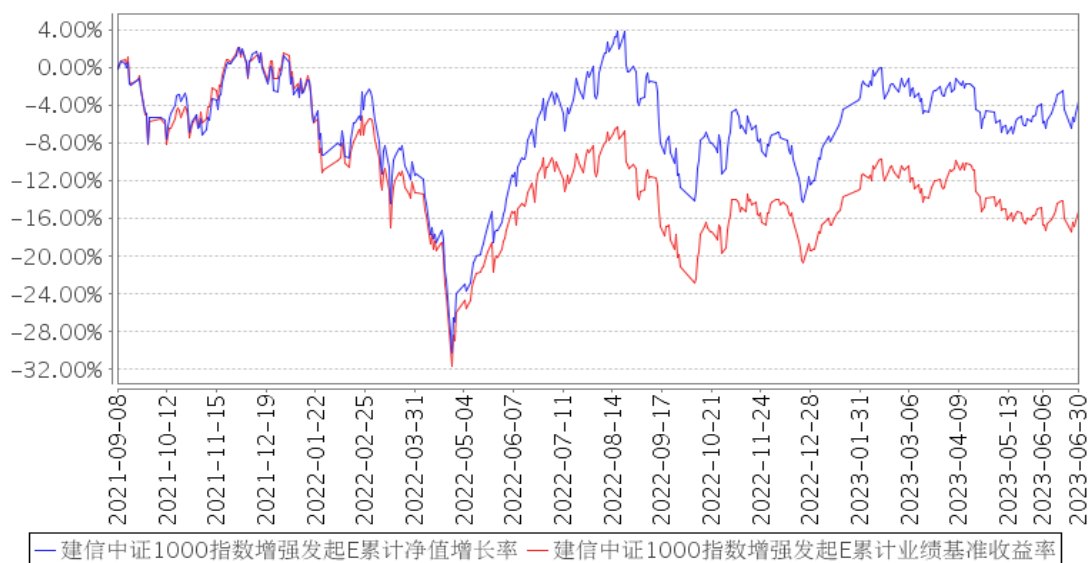
建信中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



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



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司拥有公开募集证券投资基金、私募资产管理计划、QDII、保险资金受托等业务资格，总部设在北京，下设北京、上海、广州、成都、深圳五家分公司，并分别在上海和香港设立了子公司——建信资本管理有限责任公司、建信资产管理（香港）有限公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家，资产管理行业的领跑者”。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶乐天	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2018年11月22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。
赵云煜	数量投资部总经理助理，本基金的基金经理	2018年11月22日	-	10	赵云煜先生，数量投资部总经理助理，硕士。曾任太平资产管理有限公司风险管理分析师。2014年7月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部研究员、基金经理助理、基金经理、总经理助理等职务。2016

					年 6 月 22 日至 2018 年 11 月 7 日任专户投资经理。2018 年 11 月 16 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 9 月 11 日起任建信中证红利潜力指数证券投资基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日起任建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期间，产品基准指数中证 1000 先上涨后弱势震荡，最终获得小幅正收益。本基金投资运作稳健开展，并成功跑赢了基准指数。

本基金为指数增强基金，主要目标是在跟踪基准指数的基础上，力争超越指数本身的收益。本基金主要采用量化模型进行投资和风险管理。投资方面，管理人以建信多因子模型为主的量化选股模型作为依据进行个股选择。风险方面，管理人同样采用量化方法保持组合的风格与行业配置与基准指数基本中性，较好地控制了基金的跟踪误差。此外，本基金积极参与新股申购力争进一步增厚产品收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 9.72%，波动率 0.87%，业绩比较基准收益率 4.87%，波动率 0.84%。本报告期本基金 C 净值增长率 9.51%，波动率 0.87%，业绩比较基准收益率 4.87%，波动率 0.84%。本报告期本基金 E 净值增长率 9.52%，波动率 0.87%，业绩比较基准收益率 4.87%，波动率 0.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年，国内经济处于流动性宽松的复苏过程中。A 股的行情分化主要基于几个概念板块展开，主流宽基指数涨跌互现。细分来看，年初呈现普涨的行情；至一季度末和二季度，围绕 TMT 和“中特估”，相关股票表现各有轮动。风格层面，上半年小盘明显好于大盘；行业层面，TMT 相关的传媒、通信等表现突出，消费类行业整体跑输更多。

我们整体看好经济的持续修复。展望 2023 年下半年，政策端将会是更大的变量，关键领域的政策落地和实施将是影响市场变动的关键因素。盈利方面，经济数据料将在三季度触底，A 股非金融全年的盈利预计将实现小幅的正增长。流动性方面，汇率料将企稳，但仍需关注增量资金对市场的影响。对于股票市场，当前整体的估值情况，尤其是相较债市利率来看较为合适，有着较高的配置价值。本基金将密切跟踪市场动态，持续提升模型的效果，精选个券，谨慎管理组合风险，力争为投资者提供稳健超越业绩基准的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引

和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由建信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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 1000 指数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	226,741,725.29	110,598,041.81
结算备付金		16,294,861.83	10,914,588.17
存出保证金		16,401,305.17	8,934,799.34
交易性金融资产	6.4.7.2	1,480,318,008.21	826,544,958.77
其中：股票投资		1,480,318,008.21	826,544,958.77
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		5,691,727.16	319,462.67
应收股利		-	-
应收申购款		4,512,342.95	1,599,054.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,749,959,970.61	958,910,904.78
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		10,186,746.65	-
应付赎回款		2,248,627.10	2,541,526.53
应付管理人报酬		1,342,868.41	853,996.14
应付托管费		268,573.67	170,799.23
应付销售服务费		249,017.69	86,126.57
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	4,274,492.67	2,970,296.61
负债合计		18,570,326.19	6,622,745.08
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,018,998,995.36	611,543,514.51
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	712,390,649.06	340,744,645.19
净资产合计		1,731,389,644.42	952,288,159.70
负债和净资产总计		1,749,959,970.61	958,910,904.78

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,018,998,995.36 份，其中建信中证 1000 指数增强 A 基金份额总额 516,788,254.26 份，基金份额净值人民币 1.7166 元；建信中证 1000 指数增强 C 基金份额总额 401,482,194.73 份，基金份额净值人民币 1.6810 元；建信中证 1000 指数增强发起 E 基金份额总额 100,728,546.37 份，基金份额净值人民币 1.6816 元。

6.2 利润表

会计主体：建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：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		87,213,108.07	-26,471,578.48
1. 利息收入		492,656.93	44,438.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	492,656.93	44,438.89
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）		61,561,510.11	-46,547,563.71
其中：股票投资收益	6.4.7.14	53,530,228.33	-47,898,642.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-3,524,648.19	-
股利收益	6.4.7.19	11,555,929.97	1,351,078.79
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	24,590,315.46	19,808,515.80
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	568,625.57	223,030.54
减：二、营业总支出		11,068,585.39	1,795,251.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,930,151.66	1,265,229.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,586,030.32	253,045.92
3. 销售服务费		1,329,463.93	129,215.38
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		7,686.39	-
8. 其他费用	6.4.7.23	215,253.09	147,760.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		76,144,522.68	-28,266,829.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		76,144,522.68	-28,266,829.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		76,144,522.68	-28,266,829.72

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：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)	611,543,514.51	-	340,744,645.19	952,288,159.70
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)	611,543,514.51	-	340,744,645.19	952,288,159.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	407,455,480.85	-	371,646,003.87	779,101,484.72
(一)、综合收益总额	-	-	76,144,522.68	76,144,522.68
(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)	407,455,480.85	-	295,501,481.19	702,956,962.04
其中: 1. 基金申购款	1,067,838,021.18	-	745,430,701.42	1,813,268,722.60
2. 基金赎回款	-660,382,540.33	-	-449,929,220.23	-1,110,311,760.56
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,018,998,995.36	-	712,390,649.06	1,731,389,644.42
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)	139,225,296.27	-	153,980,541.86	293,205,838.13
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	139,225,296.27	-	153,980,541.86	293,205,838.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-10,331,578.84	-	-25,796,099.64	-36,127,678.48
(一)、综合收益总额	-	-	-28,266,829.72	-28,266,829.72
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-10,331,578.84	-	2,470,730.08	-7,860,848.76
其中：1. 基金申购款	88,090,864.09	-	79,354,174.33	167,445,038.42
2. 基金赎回款	-98,422,442.93	-	-76,883,444.25	-175,305,887.18
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	128,893,717.43	-	128,184,442.22	257,078,159.65

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

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1029 号《关于准予建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 99,635,875.53 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2018）第 0686 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 99,645,967.84 份基金份额，其中认购资金利息折合 10,092.31 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、

中期票据、短期融资券等)、货币市场工具(含同业存单)、银行存款、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%,投资于中证 1000 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例不低于 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 \times 95%+银行活期存款税后利率 \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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	226,741,725.29
等于：本金	226,720,402.57
加：应计利息	21,322.72
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	226,741,725.29

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	1,516,748,557.20	-	1,480,318,008.21	-36,430,548.99
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	1,516,748,557.20	-	1,480,318,008.21	-36,430,548.99

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	130,026,640.00	-	-	-
其中：股指期货投资	130,026,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	130,026,640.00	-	-	-

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
IM2307	IM2307	24.00	31,559,040.00	639,800.00
IM2309	IM2309	77.00	100,660,560.00	1,553,160.00
合计				2,192,960.00
减：可抵销期货暂收款				2,192,960.00
净额				-

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	1,525.35
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,078,086.09
其中：交易所市场	4,078,086.09

银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	68,058.37
预提费用	126,822.86
合计	4,274,492.67

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 1000 指数增强 A

项目	本期 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	460,421,067.54	460,421,067.54
本期申购	227,091,539.44	227,091,539.44
本期赎回（以“-”号填列）	-170,724,352.72	-170,724,352.72
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	516,788,254.26	516,788,254.26

建信中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	143,769,023.34	143,769,023.34
本期申购	584,455,702.88	584,455,702.88
本期赎回（以“-”号填列）	-326,742,531.49	-326,742,531.49
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	401,482,194.73	401,482,194.73

建信中证 1000 指数增强发起 E

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	7,353,423.63	7,353,423.63
本期申购	256,290,778.86	256,290,778.86
本期赎回（以“-”号填列）	-162,915,656.12	-162,915,656.12
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	100,728,546.37	100,728,546.37
-----	----------------	----------------

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

建信中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	190,010,785.91	69,874,506.98	259,885,292.89
本期利润	28,753,461.21	32,175,796.49	60,929,257.70
本期基金份额交易产生的变动数	24,140,319.59	25,372,193.07	49,512,512.66
其中：基金申购款	104,488,688.32	63,223,209.49	167,711,897.81
基金赎回款	-80,348,368.73	-37,851,016.42	-118,199,385.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	242,904,566.71	127,422,496.54	370,327,063.25

建信中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	55,326,743.92	21,595,614.71	76,922,358.63
本期利润	17,142,074.67	-5,085,308.19	12,056,766.48
本期基金份额交易产生的变动数	103,289,847.54	81,137,001.14	184,426,848.68
其中：基金申购款	250,421,137.19	152,984,016.25	403,405,153.44
基金赎回款	-147,131,289.65	-71,847,015.11	-218,978,304.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	175,758,666.13	97,647,307.66	273,405,973.79

建信中证 1000 指数增强发起 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,832,722.32	1,104,271.35	3,936,993.67
本期利润	5,658,671.34	-2,500,172.84	3,158,498.50
本期基金份额交易产生的变动数	35,667,809.98	25,894,309.87	61,562,119.85
其中：基金申购款	107,093,304.77	67,220,345.40	174,313,650.17
基金赎回款	-71,425,494.79	-41,326,035.53	-112,751,530.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,159,203.64	24,498,408.38	68,657,612.02

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	348,733.81
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	136,026.63
其他	7,896.49
合计	492,656.93

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	53,530,228.33
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	53,530,228.33

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	4,353,044,746.16
减：卖出股票成本总额	4,287,751,478.15
减：交易费用	11,763,039.68
买卖股票差价收入	53,530,228.33

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	-3,524,648.19

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	11,555,929.97
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,555,929.97

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	20,034,075.46
股票投资	20,034,075.46
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	4,556,240.00
权证投资	-
期货投资	4,556,240.00
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	24,590,315.46

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	566,518.73

基金转换费收入	2,106.84
合计	568,625.57

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	6,547.75
指数使用费	126,882.48
合计	215,253.09

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	7,930,151.66	1,265,229.57
其中：支付销售机构的客户维护费	2,087,192.32	261,400.67

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

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	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托管费	1,586,030.32	253,045.92

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

按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 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 1000 指 数增强 A	建信中证 1000 指 数增强 C	建信中证 1000 指 数增强发起 E	合计
建信基金	-	150,565.11	2,719.96	153,285.07
上海浦东发展银行	-	5,286.38	-	5,286.38
中国建设银行	-	27,495.53	-	27,495.53
合计	-	183,347.02	2,719.96	186,066.98
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	建信中证 1000 指 数增强 A	建信中证 1000 指 数增强 C	建信中证 1000 指 数增强发起 E	合计
建信基金	-	10,476.21	215.93	10,692.14
浦发银行	-	363.67	-	363.67
中国建设银行	-	16,232.55	-	16,232.55
合计	-	27,072.43	215.93	27,288.36

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额和 E 类基金份额的销售服务费年费率均为 0.40%。销售服务费的计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数 增强 C	建信中证 1000 指数 增强发起 E
基金合同生效日 (2018 年 11 月 22 日)持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金 份额	13,173,876.83	-	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动 份额	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖 出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金 份额	13,173,876.83	-	-
报告期末持有的基金 份额 占基金总份额比例	2.55%	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数 增强 C	建信中证 1000 指数 增强发起 E
基金合同生效日	-	-	-

(2018 年 11 月 22 日)持有的基金份额			
报告期初持有的基金份额	11,190,038.89	-	-
报告期内申购/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	11,190,038.89	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.78%	-	-

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		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行-活期	226,741,725.29	348,733.81	19,925,576.01	34,980.17

注: 本基金的银行存款由基金托管人保管, 按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新发未上市	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新发未上市	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新发未上市	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新发未上市	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新发未上市	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新发未上市	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新发未上市	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新发未上市	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新发未上市	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-

301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新发未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新发未上市	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新发未上市	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新发未上市	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新发未上市	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新发未上市	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新发未上市	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新发未上市	30.85	23.63	1,886	58,183.10	44,566.18	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新发未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年06月29日	6个月	新发未上市	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新发未上市	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-

301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新发未上市	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新发未上市	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新发未上市	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新发未上市	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新发未上市	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新发未上市	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新发未上市	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新发未上市	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新发未上市	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新发未上市	87.30	53.24	392	34,219.71	20,870.08	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新发未上市	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-

301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新发未上市	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新发未上市	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新发未上市	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新发未上市	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新发未上市	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新发未上市	23.77	42.89	1,195	28,405.15	51,253.55	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新发未上市	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新发未上市	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新发未上市	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新发未上市	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新发未上市	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-

301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新发未上市	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新发未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新发未上市	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新发未上市	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023年5月16日	6个月	新发未上市	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新发未上市	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新发未上市	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新发未上市	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新发未上市	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新发未上市	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新发未上市	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-

601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新发未上市	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新发未上市	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新发未上市	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新发未上市	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新发未上市	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新发未上市	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新发未上市	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新发未上市	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新发未上市	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新发未上市	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新发未上市	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-

688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新发未上市	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新发未上市	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新发未上市	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新发未上市	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新发未上市	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新发未上市	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新发未上市	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新发未上市	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新发未上市	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新发未上市	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新发未上市	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-

688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新发未上市	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新发未上市	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年06月30日	6个月	新发未上市	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新发未上市	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新发未上市	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新发未上市	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	226,741,725.29	-	-	-	226,741,725.29
结算备付金	16,294,861.83	-	-	-	16,294,861.83
存出保证金	16,401,305.17	-	-	-	16,401,305.17
交易性金融资产	-	-	-	1,480,318,008.21	1,480,318,008.21
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	5,691,727.16	5,691,727.16
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,512,342.95	4,512,342.95
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	259,437,892.29	-	-	1,490,522,078.32	1,749,959,970.61
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	-	-	-	10,186,746.65	10,186,746.65
应付赎回款	-	-	-	2,248,627.10	2,248,627.10

应付管理人报酬	-	-	-	1,342,868.41	1,342,868.41
应付托管费	-	-	-	268,573.67	268,573.67
应付销售服务费	-	-	-	249,017.69	249,017.69
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,274,492.67	4,274,492.67
负债总计	-	-	-	18,570,326.19	18,570,326.19
利率敏感度缺口	259,437,892.29	-	-	-1,471,951,752.13	1,731,389,644.42
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	110,598,041.81	-	-	-	110,598,041.81
结算备付金	10,914,588.17	-	-	-	10,914,588.17
存出保证金	8,934,799.34	-	-	-	8,934,799.34
交易性金融资产	-	-	-	826,544,958.77	826,544,958.77
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	319,462.67	319,462.67
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,599,054.02	1,599,054.02
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	130,447,429.32	-	-	828,463,475.46	958,910,904.78
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,541,526.53	2,541,526.53
应付管理人报酬	-	-	-	853,996.14	853,996.14
应付托管费	-	-	-	170,799.23	170,799.23
应付销售服务费	-	-	-	86,126.57	86,126.57
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,970,296.61	2,970,296.61
负债总计	-	-	-	6,622,745.08	6,622,745.08
利率敏感度缺口	130,447,429.32	-	-	821,840,730.38	952,288,159.70

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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。

本基金采用指数增强型投资策略，以中证 1000 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于中证 1000 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	1,480,318,008.21	85.50	826,544,958.77	86.80
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	1,480,318,008.21	85.50	826,544,958.77	86.80
----	------------------	-------	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	89,151,733.04	48,438,763.48
业绩比较基准下降5%	-89,151,733.04	-48,438,763.48	

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	1,478,539,839.58	823,677,923.04
第二层次	366,947.18	385,863.40
第三层次	1,411,221.45	2,481,172.33
合计	1,480,318,008.21	826,544,958.77

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	1,480,318,008.21	84.59
	其中：股票	1,480,318,008.21	84.59
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	243,036,587.12	13.89
8	其他各项资产	26,605,375.28	1.52
9	合计	1,749,959,970.61	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	4,855,956.00	0.28

B	采矿业	49,454,601.17	2.86
C	制造业	738,434,764.85	42.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,230,818.00	1.05
E	建筑业	19,189,760.00	1.11
F	批发和零售业	42,865,481.20	2.48
G	交通运输、仓储和邮政业	22,604,209.00	1.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	181,576,504.16	10.49
J	金融业	30,184,492.00	1.74
K	房地产业	29,108,754.00	1.68
L	租赁和商务服务业	5,516,268.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	25,589,879.75	1.48
N	水利、环境和公共设施管理业	6,147,880.00	0.36
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	40,357,420.00	2.33
S	综合	6,157,531.00	0.36
	合计	1,220,274,319.13	70.48

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	4,876,147.00	0.28
C	制造业	189,323,832.65	10.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,986,989.47	0.29
E	建筑业	10,791,310.80	0.62
F	批发和零售业	69,029.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,708,552.76	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,289,781.77	0.94

J	金融业	2,389,728.00	0.14
K	房地产业	2,684,745.00	0.16
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,485,880.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	25,391,343.00	1.47
S	综合	-	-
	合计	260,043,689.08	15.02

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	600583	海油工程	3,800,100	22,230,585.00	1.28
2	688173	希荻微	789,444	18,062,478.72	1.04
3	601801	皖新传媒	1,820,100	17,090,739.00	0.99
4	000048	京基智农	841,400	16,424,128.00	0.95
5	600675	中华企业	5,351,900	15,788,105.00	0.91
6	300821	东岳硅材	1,611,300	15,694,062.00	0.91
7	300767	震安科技	564,900	14,325,864.00	0.83
8	002158	汉钟精机	551,127	13,756,129.92	0.79
9	002636	金安国纪	1,476,300	13,626,249.00	0.79
10	000885	城发环境	1,008,600	13,424,466.00	0.78
11	600578	京能电力	3,376,900	13,203,679.00	0.76
12	300768	迪普科技	795,900	13,188,063.00	0.76
13	688148	芳源股份	1,070,518	13,060,319.60	0.75
14	600850	电科数字	551,150	13,001,628.50	0.75
15	688389	普门科技	552,709	12,983,134.41	0.75
16	002990	盛视科技	352,600	12,975,680.00	0.75
17	600933	爱柯迪	550,200	12,814,158.00	0.74
18	000030	富奥股份	2,525,260	12,727,310.40	0.74

19	600400	红豆股份	3,828,400	12,557,152.00	0.73
20	603093	南华期货	1,144,000	12,458,160.00	0.72
21	601908	京运通	2,046,500	12,381,325.00	0.72
22	600761	安徽合力	619,900	12,354,607.00	0.71
23	000950	重药控股	1,818,700	12,239,851.00	0.71
24	300502	新易盛	176,020	11,964,079.40	0.69
25	601965	中国汽研	574,200	11,857,230.00	0.68
26	000688	国城矿业	765,401	11,611,133.17	0.67
27	000627	天茂集团	3,866,400	11,599,200.00	0.67
28	601567	三星医疗	911,334	11,510,148.42	0.66
29	002664	信质集团	793,200	11,168,256.00	0.65
30	003006	百亚股份	639,100	11,043,648.00	0.64
31	601126	四方股份	724,557	11,006,020.83	0.64
32	002946	新乳业	760,300	10,910,305.00	0.63
33	600869	远东股份	1,961,000	10,824,720.00	0.63
34	300765	新诺威	833,487	10,743,647.43	0.62
35	603609	禾丰股份	1,123,500	10,223,850.00	0.59
36	603098	森特股份	479,700	9,833,850.00	0.57
37	002782	可立克	609,600	9,320,784.00	0.54
38	000517	荣安地产	3,047,700	9,295,485.00	0.54
39	603060	国检集团	844,125	8,829,547.50	0.51
40	601019	山东出版	955,300	8,760,101.00	0.51
41	600420	国药现代	763,400	8,618,786.00	0.50
42	600572	康恩贝	1,232,000	8,439,200.00	0.49
43	300687	赛意信息	297,400	8,261,772.00	0.48
44	603877	太平鸟	324,800	8,210,944.00	0.47
45	603229	奥翔药业	379,200	7,955,616.00	0.46
46	002215	诺普信	1,040,500	7,814,155.00	0.45
47	603055	台华新材	699,928	7,776,200.08	0.45
48	000555	神州信息	629,300	7,740,390.00	0.45
49	603466	风语筑	555,500	7,721,450.00	0.45
50	600688	上海石化	2,468,600	7,677,346.00	0.44
51	603100	川仪股份	196,700	7,643,762.00	0.44
52	603916	苏博特	570,020	7,547,064.80	0.44
53	603636	南威软件	513,000	7,525,710.00	0.43
54	603032	德新科技	217,400	7,508,996.00	0.43
55	603567	珍宝岛	500,000	7,480,000.00	0.43
56	688128	中国电研	292,159	7,450,054.50	0.43
57	300451	创业慧康	870,400	7,293,952.00	0.42
58	301039	中集车辆	550,600	7,284,438.00	0.42
59	000813	德展健康	2,444,400	7,186,536.00	0.42
60	002262	恩华药业	225,700	6,958,331.00	0.40
61	603601	再升科技	1,618,200	6,909,714.00	0.40

62	300133	华策影视	957,000	6,785,130.00	0.39
63	688676	金盘科技	222,734	6,746,612.86	0.39
64	002645	华宏科技	545,294	6,685,304.44	0.39
65	688233	神工股份	208,847	6,595,388.26	0.38
66	601882	海天精工	197,000	6,560,100.00	0.38
67	603305	旭升集团	234,100	6,524,367.00	0.38
68	603719	良品铺子	260,100	6,505,101.00	0.38
69	688318	财富趋势	63,987	6,396,780.39	0.37
70	603730	岱美股份	404,516	6,391,352.80	0.37
71	600557	康缘药业	230,343	6,325,218.78	0.37
72	000028	国药一致	144,820	6,315,600.20	0.36
73	603989	艾华集团	296,400	6,242,184.00	0.36
74	000923	河钢资源	459,100	6,197,850.00	0.36
75	600770	综艺股份	1,093,700	6,157,531.00	0.36
76	002961	瑞达期货	425,200	6,127,132.00	0.35
77	688100	威胜信息	205,200	6,117,012.00	0.35
78	000951	中国重汽	362,300	6,104,755.00	0.35
79	002724	海洋王	703,300	6,104,644.00	0.35
80	002913	奥士康	159,700	6,097,346.00	0.35
81	300002	神州泰岳	435,400	6,095,600.00	0.35
82	002088	鲁阳节能	330,500	6,094,420.00	0.35
83	603997	继峰股份	419,000	5,991,700.00	0.35
84	002320	海峡股份	986,500	5,958,460.00	0.34
85	301087	可孚医疗	120,200	5,925,860.00	0.34
86	000860	顺鑫农业	169,100	5,696,979.00	0.33
87	301180	万祥科技	322,700	5,656,931.00	0.33
88	301089	拓新药业	90,900	5,630,346.00	0.33
89	002484	江海股份	263,000	5,599,270.00	0.32
90	002351	漫步者	270,700	5,598,076.00	0.32
91	002461	珠江啤酒	626,800	5,522,108.00	0.32
92	000058	深赛格	892,600	5,516,268.00	0.32
93	002011	盾安环境	396,000	5,476,680.00	0.32
94	688088	虹软科技	127,788	5,462,937.00	0.32
95	300183	东软载波	325,700	5,377,307.00	0.31
96	300226	上海钢联	165,540	5,363,496.00	0.31
97	000761	本钢板材	1,333,600	5,334,400.00	0.31
98	603025	大豪科技	427,523	5,284,184.28	0.31
99	000921	海信家电	196,000	5,282,200.00	0.31
100	000935	四川双马	312,900	5,269,236.00	0.30
101	002063	远光软件	603,400	5,237,512.00	0.30
102	000603	盛达资源	430,300	5,202,327.00	0.30
103	300755	华致酒行	231,300	5,197,311.00	0.30
104	300428	立中集团	221,900	5,117,014.00	0.30

105	002605	姚记科技	108,000	5,014,440.00	0.29
106	300394	天孚通信	46,800	4,999,644.00	0.29
107	600986	浙文互联	764,800	4,894,720.00	0.28
108	600100	同方股份	586,700	4,764,004.00	0.28
109	601028	玉龙股份	442,800	4,760,100.00	0.27
110	601137	博威合金	305,100	4,747,356.00	0.27
111	688575	亚辉龙	256,200	4,726,890.00	0.27
112	002517	恺英网络	297,910	4,689,103.40	0.27
113	688368	晶丰明源	36,512	4,644,691.52	0.27
114	300634	彩讯股份	175,100	4,622,640.00	0.27
115	002549	凯美特气	401,400	4,616,100.00	0.27
116	300773	拉卡拉	262,300	4,574,512.00	0.26
117	002335	科华数据	127,100	4,569,245.00	0.26
118	002324	普利特	310,600	4,432,262.00	0.26
119	300685	艾德生物	178,380	4,327,498.80	0.25
120	300031	宝通科技	172,400	4,261,728.00	0.25
121	002859	洁美科技	152,300	4,218,710.00	0.24
122	300158	振东制药	730,600	4,186,338.00	0.24
123	603298	杭叉集团	176,920	4,166,466.00	0.24
124	000756	新华制药	189,700	4,093,726.00	0.24
125	600246	万通发展	703,700	4,025,164.00	0.23
126	300723	一品红	137,250	4,021,425.00	0.23
127	600984	建设机械	885,500	4,002,460.00	0.23
128	300900	广联航空	138,900	4,001,709.00	0.23
129	300134	大富科技	389,000	3,987,250.00	0.23
130	603983	丸美股份	122,400	3,959,640.00	0.23
131	000917	电广传媒	526,600	3,849,446.00	0.22
132	300762	上海瀚讯	323,500	3,807,595.00	0.22
133	002017	东信和平	286,500	3,756,015.00	0.22
134	603915	国茂股份	175,500	3,717,090.00	0.21
135	603595	东尼电子	81,700	3,498,394.00	0.20
136	600612	老凤祥	49,700	3,473,036.00	0.20
137	603013	亚普股份	219,900	3,448,032.00	0.20
138	300638	广和通	151,900	3,445,092.00	0.20
139	002534	西子洁能	202,280	3,398,304.00	0.20
140	300101	振芯科技	174,800	3,389,372.00	0.20
141	688127	蓝特光学	189,834	3,346,773.42	0.19
142	600483	福能股份	282,500	3,262,875.00	0.19
143	002020	京新药业	253,100	3,244,742.00	0.19
144	002895	川恒股份	164,100	3,232,770.00	0.19
145	000851	高鸿股份	593,800	3,230,272.00	0.19
146	688315	诺禾致源	119,675	3,177,371.25	0.18
147	002777	久远银海	87,200	3,092,984.00	0.18

148	300271	华宇软件	273,100	3,025,948.00	0.17
149	603733	仙鹤股份	144,700	3,016,995.00	0.17
150	300130	新国都	105,800	2,997,314.00	0.17
151	002234	民和股份	162,800	2,964,588.00	0.17
152	600248	陕建股份	615,700	2,936,889.00	0.17
153	603530	神马电力	184,700	2,872,085.00	0.17
154	688037	芯源微	16,664	2,848,710.80	0.16
155	603505	金石资源	118,000	2,755,300.00	0.16
156	603179	新泉股份	61,700	2,708,013.00	0.16
157	000032	深桑达 A	81,700	2,687,930.00	0.16
158	300203	聚光科技	128,400	2,602,668.00	0.15
159	002737	葵花药业	106,400	2,589,776.00	0.15
160	688508	芯朋微	43,937	2,547,906.63	0.15
161	603368	柳药集团	102,600	2,535,246.00	0.15
162	603728	鸣志电器	31,000	2,489,300.00	0.14
163	688278	特宝生物	55,905	2,454,788.55	0.14
164	300459	汤姆猫	377,700	2,451,273.00	0.14
165	300229	拓尔思	93,800	2,435,986.00	0.14
166	603985	恒润股份	112,900	2,367,513.00	0.14
167	600531	豫光金铅	374,600	2,359,980.00	0.14
168	603801	志邦家居	70,800	2,337,816.00	0.14
169	600211	西藏药业	38,700	2,298,780.00	0.13
170	300894	火星人	87,100	2,224,534.00	0.13
171	002174	游族网络	131,300	2,205,840.00	0.13
172	002051	中工国际	183,700	2,191,541.00	0.13
173	000550	江铃汽车	156,300	2,163,192.00	0.12
174	301015	百洋医药	75,000	2,082,000.00	0.12
175	601369	陕鼓动力	227,200	2,069,792.00	0.12
176	002428	云南锗业	165,000	2,006,400.00	0.12
177	600320	振华重工	525,700	1,960,861.00	0.11
178	605008	长鸿高科	136,995	1,953,548.70	0.11
179	300366	创意信息	156,200	1,930,632.00	0.11
180	688425	铁建重工	395,200	1,900,912.00	0.11
181	000735	罗牛山	289,200	1,891,368.00	0.11
182	603871	嘉友国际	118,300	1,858,493.00	0.11
183	600446	金证股份	124,700	1,813,138.00	0.10
184	603043	广州酒家	63,100	1,783,206.00	0.10
185	300382	斯莱克	134,607	1,775,466.33	0.10
186	603053	成都燃气	175,200	1,764,264.00	0.10
187	002651	利君股份	226,800	1,762,236.00	0.10
188	002498	汉缆股份	435,100	1,744,751.00	0.10
189	002906	华阳集团	50,800	1,736,852.00	0.10
190	002967	广电计量	85,900	1,725,731.00	0.10

191	000737	北方铜业	305,600	1,647,184.00	0.10
192	603938	三孚股份	81,500	1,612,885.00	0.09
193	002746	仙坛股份	199,600	1,572,848.00	0.09
194	688518	联赢激光	56,000	1,560,160.00	0.09
195	000065	北方国际	102,500	1,539,550.00	0.09
196	002573	清新环境	278,000	1,531,780.00	0.09
197	300206	理邦仪器	98,200	1,480,856.00	0.09
198	600403	大有能源	354,600	1,457,406.00	0.08
199	600750	江中药业	66,200	1,451,766.00	0.08
200	600966	博汇纸业	241,800	1,431,456.00	0.08
201	601212	白银有色	519,200	1,412,224.00	0.08
202	601975	招商南油	476,500	1,362,790.00	0.08
203	603363	傲农生物	141,400	1,296,638.00	0.07
204	603171	税友股份	32,100	1,283,358.00	0.07
205	300188	美亚柏科	58,900	1,224,531.00	0.07
206	603301	振德医疗	39,800	1,178,876.00	0.07
207	000682	东方电子	106,000	1,030,320.00	0.06
208	688499	利元亨	15,800	1,003,616.00	0.06
209	300232	洲明科技	99,800	912,172.00	0.05
210	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	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	300515	三德科技	737,200	11,883,664.00	0.69
2	688021	奥福环保	416,369	10,792,284.48	0.62
3	601800	中国交建	988,000	10,779,080.00	0.62
4	603289	泰瑞机器	943,100	10,581,582.00	0.61
5	688081	兴图新科	551,206	10,566,619.02	0.61
6	601928	凤凰传媒	881,300	10,046,820.00	0.58
7	688560	明冠新材	276,800	7,692,272.00	0.44
8	603378	亚士创能	755,200	6,879,872.00	0.40
9	688519	南亚新材	280,516	6,740,799.48	0.39
10	300884	狄耐克	502,110	6,647,936.40	0.38
11	600373	中文传媒	479,600	6,388,272.00	0.37
12	688395	正弦电气	218,831	5,818,716.29	0.34
13	601231	环旭电子	386,500	5,782,040.00	0.33
14	000719	中原传媒	490,700	5,741,190.00	0.33
15	300554	三超新材	249,700	5,201,251.00	0.30
16	688718	唯赛勃	287,281	4,972,834.11	0.29
17	603309	维力医疗	320,500	4,958,135.00	0.29
18	603689	皖天然气	564,600	4,951,542.00	0.29
19	688510	航亚科技	248,796	4,948,552.44	0.29
20	603556	海兴电力	170,200	4,295,848.00	0.25

21	002275	桂林三金	236,700	4,262,967.00	0.25
22	688078	龙软科技	77,140	3,976,567.00	0.23
23	688588	凌志软件	254,531	3,957,957.05	0.23
24	688596	正帆科技	90,470	3,917,351.00	0.23
25	603507	振江股份	103,600	3,756,536.00	0.22
26	002937	兴瑞科技	150,300	3,697,380.00	0.21
27	603676	卫信康	266,300	3,680,266.00	0.21
28	688036	传音控股	21,800	3,204,600.00	0.19
29	688655	迅捷兴	190,000	3,123,600.00	0.18
30	688618	三旺通信	45,953	3,111,937.16	0.18
31	002907	华森制药	203,200	3,092,704.00	0.18
32	600339	中油工程	718,100	2,922,667.00	0.17
33	688020	方邦股份	57,578	2,877,172.66	0.17
34	603960	克来机电	153,920	2,870,608.00	0.17
35	688579	山大地纬	170,200	2,804,896.00	0.16
36	600665	天地源	662,900	2,684,745.00	0.16
37	300396	迪瑞医疗	82,300	2,673,927.00	0.15
38	600301	华锡有色	147,100	2,640,445.00	0.15
39	688569	铁科轨道	60,293	2,536,526.51	0.15
40	601319	中国人保	409,200	2,389,728.00	0.14
41	002678	珠江钢琴	414,000	2,372,220.00	0.14
42	688236	春立医疗	95,600	2,342,200.00	0.14
43	301076	新瀚新材	118,710	2,329,090.20	0.13
44	688013	天臣医疗	94,760	2,246,759.60	0.13
45	300689	澄天伟业	93,100	2,175,747.00	0.13
46	300788	中信出版	60,900	2,022,489.00	0.12
47	002518	科士达	49,600	1,984,496.00	0.11
48	601958	金钼股份	175,200	1,953,480.00	0.11
49	002463	沪电股份	89,100	1,865,754.00	0.11
50	688310	迈得医疗	56,639	1,856,060.03	0.11
51	300045	华力创通	158,900	1,843,240.00	0.11
52	600548	深高速	190,262	1,708,552.76	0.10
53	688255	凯尔达	50,400	1,706,544.00	0.10
54	688292	浩瀚深度	52,831	1,516,249.70	0.09
55	605167	利柏特	153,500	1,485,880.00	0.09
56	002885	京泉华	66,700	1,456,728.00	0.08
57	603701	德宏股份	100,600	1,427,514.00	0.08
58	601566	九牧王	115,700	1,390,714.00	0.08
59	002755	奥赛康	157,200	1,381,788.00	0.08
60	688210	统联精密	70,502	1,376,199.04	0.08
61	603508	思维列控	78,600	1,340,130.00	0.08
62	688227	品高股份	53,227	1,321,626.41	0.08
63	688225	亚信安全	62,739	1,314,382.05	0.08

64	688685	迈信林	61,200	1,294,992.00	0.07
65	688060	云涌科技	23,200	1,278,320.00	0.07
66	688072	拓荆科技	3,000	1,277,910.00	0.07
67	688358	祥生医疗	24,600	1,254,600.00	0.07
68	301182	凯旺科技	52,200	1,199,034.00	0.07
69	601595	上海电影	42,200	1,192,572.00	0.07
70	301310	鑫宏业	4,089	280,239.27	0.02
71	603587	地素时尚	11,000	161,040.00	0.01
72	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
73	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.01
74	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.01
75	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.01
76	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
77	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
78	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
79	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
80	301358	湖南裕能	1,195	51,253.55	0.00
81	301260	格力博	1,886	44,566.18	0.00
82	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
83	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
84	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
85	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
86	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
87	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
88	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
89	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
90	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
91	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
92	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
93	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
94	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
95	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
96	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
97	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
98	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
99	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
100	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
101	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
102	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
103	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
104	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
105	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
106	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00

107	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
108	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
109	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
110	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
111	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
112	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
113	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
114	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
115	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
116	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
117	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
118	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
119	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
120	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
121	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
122	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
123	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
124	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
125	601133	柏诚股份	779	9,855.29	0.00
126	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
127	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
128	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
129	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
130	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
131	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
132	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
133	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
134	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
135	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
136	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
137	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
138	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
139	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
140	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
141	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
142	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
143	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
144	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
145	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
146	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
147	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	603093	南华期货	35,453,930.23	3.72
2	002946	新乳业	31,705,676.76	3.33
3	300768	迪普科技	31,179,201.78	3.27
4	300377	赢时胜	29,630,526.00	3.11
5	603960	克来机电	28,238,023.58	2.97
6	600578	京能电力	27,878,107.00	2.93
7	601567	三星医疗	27,535,812.36	2.89
8	300382	斯莱克	26,791,107.59	2.81
9	002517	恺英网络	26,502,008.25	2.78
10	002913	奥士康	24,403,552.00	2.56
11	688173	希荻微	23,922,682.53	2.51
12	600583	海油工程	23,322,814.00	2.45
13	002461	珠江啤酒	23,189,440.77	2.44
14	603609	禾丰股份	22,836,638.28	2.40
15	601069	西部黄金	22,832,126.00	2.40
16	002937	兴瑞科技	22,430,506.00	2.36
17	688318	财富趋势	22,420,046.43	2.35
18	300679	电连技术	22,291,158.78	2.34
19	002518	科士达	22,278,524.12	2.34
20	000688	国城矿业	21,754,931.78	2.28
21	688148	芳源股份	20,774,229.06	2.18
22	300579	数字认证	20,583,003.13	2.16
23	300767	震安科技	20,562,516.75	2.16
24	300133	华策影视	20,434,172.00	2.15
25	002389	航天彩虹	20,280,990.00	2.13
26	603567	珍宝岛	20,218,527.02	2.12
27	000603	盛达资源	19,897,764.26	2.09
28	002123	梦网科技	19,733,663.24	2.07
29	600675	中华企业	19,694,677.00	2.07
30	000048	京基智农	19,592,769.10	2.06
31	601137	博威合金	19,559,348.00	2.05
32	603636	南威软件	19,489,915.00	2.05
33	300821	东岳硅材	19,467,769.00	2.04
34	603032	德新科技	19,434,402.63	2.04
35	603298	杭叉集团	19,417,131.98	2.04
36	300634	彩讯股份	19,340,680.00	2.03
37	603212	赛伍技术	19,145,615.50	2.01

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	601069	西部黄金	34,602,848.23	3.63
2	002913	奥士康	33,839,723.94	3.55
3	300634	彩讯股份	29,340,591.00	3.08
4	300377	赢时胜	28,844,029.98	3.03
5	603920	世运电路	28,081,300.00	2.95
6	002517	恺英网络	27,844,824.80	2.92
7	300761	立华股份	27,722,920.55	2.91
8	600578	京能电力	26,899,080.00	2.82
9	603093	南华期货	26,290,004.25	2.76
10	300579	数字认证	26,245,174.62	2.76
11	603960	克来机电	24,967,743.63	2.62
12	002461	珠江啤酒	24,890,846.00	2.61
13	000567	海德股份	24,809,427.69	2.61
14	300134	大富科技	24,746,784.00	2.60
15	002518	科士达	24,742,550.42	2.60
16	002946	新乳业	23,694,246.95	2.49
17	002534	西子洁能	22,886,328.22	2.40
18	300765	新诺威	22,665,598.76	2.38
19	300679	电连技术	22,540,204.84	2.37
20	002937	兴瑞科技	22,389,642.04	2.35
21	601886	江河集团	22,299,116.32	2.34
22	002123	梦网科技	21,649,980.00	2.27
23	601231	环旭电子	21,409,247.00	2.25
24	300382	斯莱克	21,367,378.25	2.24
25	600481	双良节能	20,996,887.00	2.20
26	688158	优刻得	20,916,499.47	2.20
27	603298	杭叉集团	20,726,578.58	2.18
28	688788	科思科技	20,693,147.11	2.17
29	601567	三星医疗	20,426,711.00	2.15
30	000761	本钢板材	20,291,369.04	2.13
31	300036	超图软件	20,179,130.00	2.12
32	002463	沪电股份	20,123,424.31	2.11
33	603728	鸣志电器	20,004,825.80	2.10
34	603013	亚普股份	19,615,614.68	2.06
35	600776	东方通信	19,119,924.24	2.01

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	4,921,490,452.13
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	4,353,044,746.16
--------------	------------------

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

本基金以套期保值为前提进行股指期货的投资。报告期间，本基金主要通过买入期货的方式，力争使用股指期货有效调节产品的风险暴露，同时降低频繁交易股票带来的成本。具体交易时，本基金综合分析不同合约的标的指数、期限、基差和流动性的情况进行配置。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响较小，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	16,401,305.17
2	应收清算款	5,691,727.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,512,342.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,605,375.28

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
建信中证 1000 指数增强 A	25,530	20,242.39	365,074,483.94	70.64	151,713,770.32	29.36
建信中证 1000 指数增强 C	27,274	14,720.33	311,684,078.18	77.63	89,798,116.55	22.37
建信中证 1000 指数增强发起 E	1,536	65,578.48	93,516,227.26	92.84	7,212,319.11	7.16
合计	54,340	18,752.28	770,274,789.38	75.59	248,724,205.98	24.41

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信中证 1000 指数增强 A	200,330.64	0.04
	建信中证 1000 指数增强 C	5,705.31	0.00
	建信中证 1000 指数增强发起 E	46.14	0.00
	合计	206,082.09	0.02

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

开放式基金	建信中证 1000 指数增强 C	0~10
	建信中证 1000 指数增强发起 E	-
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	13,173,876.83	1.29	13,173,876.83	1.29	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	61,916.76	0.01	-	-	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	13,235,793.59	1.30	13,173,876.83	1.29	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E
基金合同生效日（2018 年 11 月 22 日）基金份额总额	50,945,615.13	48,700,352.71	-
本报告期期初基金份额总额	460,421,067.54	143,769,023.34	7,353,423.63
本报告期基金总申购份额	227,091,539.44	584,455,702.88	256,290,778.86
减：本报告期基金总赎回份额	170,724,352.72	326,742,531.49	162,915,656.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	516,788,254.26	401,482,194.73	100,728,546.37

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

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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 (%)	
中信建投	1	3,812,021,205.44	41.17	2,787,757.39	41.74	-
长江证券	1	2,609,052,920.56	28.18	2,403,712.37	35.99	-
天风证券	1	1,147,735,754.51	12.40	368,781.37	5.52	-
招商证券	1	1,009,145,668.12	10.90	727,875.09	10.90	-
华安证券	1	355,149,534.66	3.84	153,179.30	2.29	-
西部证券	1	210,400,337.41	2.27	153,867.27	2.30	-
太平洋证券	1	115,963,044.26	1.25	83,642.91	1.25	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

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

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

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

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

（4）佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内增加太平洋证券 1 个交易单元，无剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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 (%)
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	建信基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金申购金额起点（包括转换转入、定投）及赎回份额下限（包括转换转出）的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 06 月 08 日
2	关于调整旗下部分基金申购金额起点（包括转换转入、定投）及赎回份额下限（包括转换转出）的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 05 月 29 日
3	关于新增华西证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 05 月 29 日
4	关于调整旗下部分基金申购金额起点（包括转换转入、定投）及赎回份额下限（包括转换转出）的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 05 月 25 日
5	关于新增安信证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 04 月 11 日
6	关于新增兴业证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 03 月 09 日
7	关于增加上海陆享基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 03 月 01 日
8	关于新增深圳前海微众银行股份有限公司为建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金等代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 24 日

9	关于增加博时财富基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 24 日
10	关于新增湘财证券为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 22 日
11	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
12	关于调整旗下部分基金申购（包括转换转入、定投）及赎回（包括转换转出）金额起点的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 11 日
13	关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 07 日
14	关于新增东兴证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 01 日

§ 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 16 日, 2023 年 02 月 21 日-2023 年 06 月 30 日	209,947,427.31	148,220,974.94	-	358,168,402.25	35.15
产品特有风险							
<p>本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2023 年 8 月 30 日