

# 建信高端装备股票型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：光大证券股份有限公司

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。

基金托管人光大证券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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
7.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
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 .....	59
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
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 .....	60
10.4 基金投资策略的改变 .....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
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
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</b>
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 .....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	64
12.3 查阅方式 .....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信高端装备股票型证券投资基金	
基金简称	建信高端装备股票	
基金主代码	011506	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 4 月 27 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	光大证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,263,345,946.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信高端装备股票 A	建信高端装备股票 C
下属分级基金的交易代码	011506	011507
报告期末下属分级基金的份额总额	714,733,403.40 份	548,612,542.74 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于高端装备主题相关的上市公司，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>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，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。</p> <p>本基金在对高端装备相关行业研究的基础上，从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局多个角度综合评估各个行业的投资价值。本基金坚持“自下而上”的个股选择策略，通过广泛选择投资标的，多维度认可标的价值，重点研究具有竞争力比较优势、未来成长空间大、持续经营能力强的上市公司，同时结合定量分析和多种价值评估方法进行多角度投资价值分析。</p>
业绩比较基准	中证高端装备制造指数收益率×75%+中证全债指数收益率×15%+中证港股通综合指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金的基金资产如投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	建信基金管理有限责任公司	光大证券股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	李庆庆
	联系电话	010-66228888	021-22167432
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	gztg@ebscn.com
客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	021-22167436	
传真	010-66228001	021-22167424	
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	上海市新闻路 1508 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	上海市新闻路 1508 号	
邮政编码	100033	200040	
法定代表人	刘军	刘秋明	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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)	
	建信高端装备股票 A	建信高端装备股票 C
本期已实现收益	-36,416,843.21	-26,968,755.60
本期利润	-2,937,977.65	-13,178,267.10
加权平均基金份 额本期利润	-0.0051	-0.0359
本期加权平均净 值利润率	-0.43%	-3.07%
本期基金份额净 值增长率	2.54%	2.33%

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	78,597,015.20	54,947,899.02
期末可供分配基金份额利润	0.1100	0.1002
期末基金资产净值	840,913,525.87	639,912,991.44
期末基金份额净值	1.1765	1.1664
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	17.65%	16.64%

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

建信高端装备股票 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	2.79%	0.99%	3.51%	0.94%	-0.72%	0.05%
过去三个月	-3.13%	1.12%	-1.55%	0.89%	-1.58%	0.23%
过去六个月	2.54%	1.08%	3.52%	0.86%	-0.98%	0.22%
过去一年	-3.34%	1.38%	-11.99%	1.03%	8.65%	0.35%
自基金合同生效起	17.65%	1.64%	-7.89%	1.22%	25.54%	0.42%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

建信高端装备股票 C

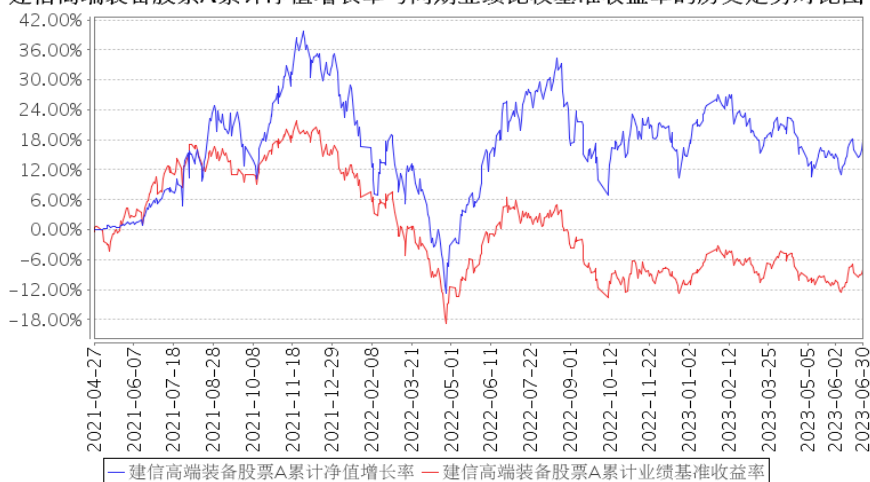
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.76%	0.99%	3.51%	0.94%	-0.75%	0.05%
过去三个月	-3.22%	1.12%	-1.55%	0.89%	-1.67%	0.23%
过去六个月	2.33%	1.08%	3.52%	0.86%	-1.19%	0.22%
过去一年	-3.71%	1.38%	-11.99%	1.03%	8.28%	0.35%
自基金合同生效起至今	16.64%	1.64%	-7.89%	1.22%	24.53%	0.42%

注：本基金合同的业绩比较基准为：中证高端装备制造指数收益率×75%+中证全债指数收益率×15%+中证港股通综合指数收益率×10%。

中证高端装备制造指数是反映 A 股高端装备制造类股票整体表现的指数，涵盖市场中较好的投资标的，因此适合作为本基金投资业绩比较基准。中证全债指数是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数。该指数的样本由上述两个市场的国债、金融债券及企业债券组成。中证港股通综合指数收选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，以反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势。

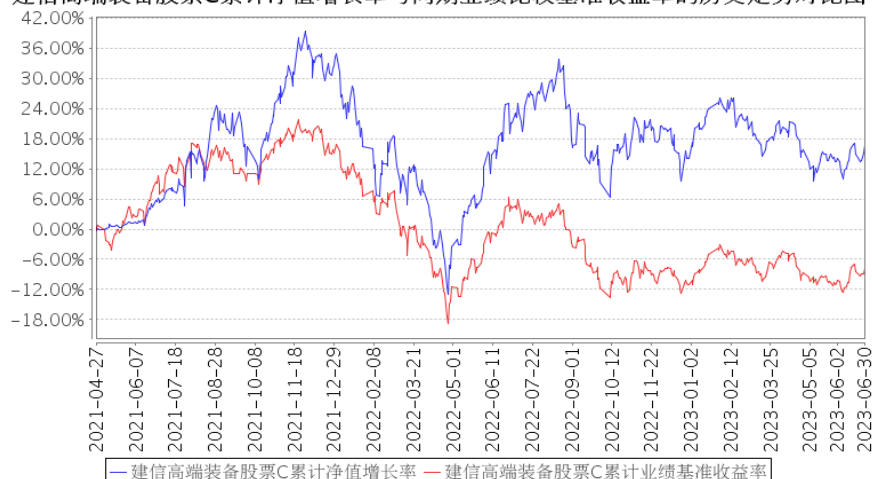
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信高端装备股票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





建信高端装备股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙晟	本基金的基金经理	2021年4月27日	-	11	孙晟先生，硕士。曾任华夏基金管理公司研究员。2013年6月加入建信基金，历任研究员、研究主管、基金经理等职务。2016年3月30日至2018年9月12日任建信健康民生混合型证券投资基金的基金经理；2017年3月8日起任建信中国制造2025股票型证券投资基金的基金经理；2020年7月17日起任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2021年4月27日起任建信高端装备股票型证券投资基金的基金经理；2021年10月20日起任建信内生动力混合型证券投资基金的基金经理；2022年9月27日起任建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。
黄子凌	本基金的基金经理	2021年4月27日	-	7	黄子凌先生，硕士。2015年7月毕业于清华大学机械工程专业，同年7月加入建信基金研究部，历任助理研究员、研究员、高级行业研究员、基金经理。2021年4月27日起任建信高端装备股票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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
孙晟	公募基金	5	2,456,996,216.41	2016年3月30日
	私募资产管理计划	1	43,874,089.05	2021年12月14日
	其他组合	-	-	-
	合计	6	2,500,870,305.46	-

### 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《建信高端装备股票型证券投资基金基金合同》的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场分化较为显著，在经济恢复力度疲弱的背景下，热点及主题特征明显。人工智能作为新兴远期空间广阔板块获得持续追捧，AI+持续扩散但波动加大，制造业中人形机器人、智能驾驶等技术方向也受到较大关注；新能源、半导体、军工等典型成长板块的降价现象及增长预期不明朗等被市场持续担忧。

### 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 2.54%，波动率 1.08%，业绩比较基准收益率 3.52%，波动率

0.86%。本报告期本基金 C 净值增长率 2.33%，波动率 1.08%，业绩比较基准收益率 3.52%，波动率 0.86%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着中央会议对经济各领域积极定调的落地，各项配套政策有望陆续推进，经济恢复疲弱现实有望逐步扭转。映射到制造业投资中，我们认为顺周期机械设备、汽车、半导体等板块有望迎来基本面逐步好转，整体来看，机遇大于风险。

重点板块来看，新能源板块上游供给增加带动产业链价格回落对于需求释放及产业中长期发展较为有利，这其中具备显著竞争优势且赚取合理利润率的环节及个股逐步迎来较好风险收益比的配置时机，同时新技术驱动的降本增效仍然是重要投资线索；半导体板块有望在消费恢复背景下迎来周期触底，同时叠加国产替代进程加快，具备较好的布局价值；对于人工智能板块，我们密切关注应用场景实际落地情况，特别是在智能驾驶及人形机器人等领域的进展变化，在积极评估个股风险收益比的基础上寻求布局时机，力争创造长期稳健回报。

## 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、投资风险管理部和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

规定。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，光大证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在建信高端装备股票型证券投资基金（以下称“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、基金合同和托管协议的规定，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、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：建信高端装备股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	168,375,778.95	62,071,871.97
结算备付金		-	2,897,079.88
存出保证金		658,612.76	464,636.32
交易性金融资产	6.4.7.2	1,346,012,873.93	422,995,182.91
其中：股票投资		1,346,012,873.93	422,995,182.91
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		-	7,569,931.60
应收股利		-	-
应收申购款		1,905,999.37	1,597,710.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,516,953,265.01	497,596,412.94
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,141,973.98	21,126,250.49
应付赎回款		30,621,970.85	496,745.94
应付管理人报酬		1,774,189.33	583,055.74
应付托管费		295,698.20	97,175.96
应付销售服务费		203,706.57	31,807.56
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,089,208.77	1,382,251.40
负债合计		36,126,747.70	23,717,287.09
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,263,345,946.14	413,526,336.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	217,480,571.17	60,352,789.14
净资产合计		1,480,826,517.31	473,879,125.85
负债和净资产总计		1,516,953,265.01	497,596,412.94

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,263,345,946.14 份，其中建信高端装备股票 A 基金份额总额 714,733,403.40 份，基金份额净值人民币 1.1765 元；建信高端装备股票 C 基金份额总额 548,612,542.74 份，基金份额净值人民币 1.1664 元。

## 6.2 利润表

会计主体：建信高端装备股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-5,713,577.43	-38,852,377.80
1. 利息收入		635,541.83	306,188.48
其中：存款利息收入	6.4.7.13	635,541.83	306,188.48
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）		-54,483,458.38	-39,013,353.12
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-59,392,213.47	-40,413,114.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	203,651.12
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	4,908,755.09	1,196,110.35
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	47,269,354.06	-393,268.84
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	864,985.06	248,055.68
<b>减：二、营业总支出</b>		10,402,667.32	2,639,020.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,132,080.36	2,038,484.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,355,346.67	339,747.46
3. 销售服务费		832,216.42	180,261.30
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		-	1.22
8. 其他费用	6.4.7.23	83,023.87	80,525.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-16,116,244.75	-41,491,398.01
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-16,116,244.75	-41,491,398.01
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-16,116,244.75	-41,491,398.01

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：建信高端装备股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	413,526,336.71	-	60,352,789.14	473,879,125.85
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)	413,526,336.71	-	60,352,789.14	473,879,125.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	849,819,609.43	-	157,127,782.03	1,006,947,391.46
(一)、综合收益总额	-	-	-16,116,244.75	-16,116,244.75
(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)	849,819,609.43	-	173,244,026.78	1,023,063,636.21
其中：1. 基金申购款	1,231,451,879.48	-	243,030,670.46	1,474,482,549.94
2. 基金赎回款	-381,632,270.05	-	-69,786,643.68	-451,418,913.73
(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)	1,263,345,946.14	-	217,480,571.17	1,480,826,517.31
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)	270,196,189.31	-	94,856,672.55	365,052,861.86
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)	270,196,189.31	-	94,856,672.55	365,052,861.86

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-52,676,483.89	-	-48,050,866.37	-100,727,350.26
(一)、综合收益总额	-	-	-41,491,398.01	-41,491,398.01
(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)	-52,676,483.89	-	-6,559,468.36	-59,235,952.25
其中：1. 基金申购款	76,354,538.35	-	9,884,449.68	86,238,988.03
2. 基金赎回款	-129,031,022.24	-	-16,443,918.04	-145,474,940.28
(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)	217,519,705.42	-	46,805,806.18	264,325,511.60

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

建信高端装备股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]266号《关于准予建信高端装备股票型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《建信高端装备股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不

定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 291,777,403.44 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第 61490173\_A28 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信高端装备股票型证券投资基金基金合同》于 2021 年 4 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 291,831,713.31 份基金份额，其中认购资金利息折合 54,309.87 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，基金托管人为光大证券股份有限公司。

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；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。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。本基金不同基金份额类别之间可以互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信高端装备股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通投资标的股票”）、股指期货、股票期权、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具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。本基金为股票型证券投资基金，基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 80-95%，其中投资于本基金界定的“高端装备行业股票”的比例不低于非现金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权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。股指期货、国债期货、股票期权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中证高端装备制造指数收益率×75%+中证全债指数收益率×15%+中证港股通综合指数收益率×10%。

## 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。

#### 6.4.6.5 境外投资

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2023年6月30日
活期存款	89,996,926.19
等于：本金	89,966,874.50
加：应计利息	30,051.69
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	78,378,852.76
等于：本金	78,371,132.94
加：应计利息	7,719.82
减：坏账准备	-
合计	168,375,778.95

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

### 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	1,306,905,761.83	-	1,346,012,873.93	39,107,112.10
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	1,306,905,761.83	-	1,346,012,873.93	39,107,112.10

### 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	130.91
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	962,255.00
其中：交易所市场	962,255.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	126,822.86
合计	1,089,208.77

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

#### 建信高端装备股票 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	334,264,332.44	334,264,332.44
本期申购	473,383,623.88	473,383,623.88
本期赎回（以“-”号填列）	-92,914,552.92	-92,914,552.92
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	714,733,403.40	714,733,403.40

#### 建信高端装备股票 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	79,262,004.27	79,262,004.27
本期申购	758,068,255.60	758,068,255.60
本期赎回（以“-”号填列）	-288,717,717.13	-288,717,717.13
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	548,612,542.74	548,612,542.74

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

## 建信高端装备股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	51,884,085.01	-2,609,238.08	49,274,846.93
本期利润	-36,416,843.21	33,478,865.56	-2,937,977.65
本期基金份额交易产生的变动数	63,129,773.40	16,713,479.79	79,843,253.19
其中：基金申购款	78,197,784.20	19,885,743.60	98,083,527.80
基金赎回款	-15,068,010.80	-3,172,263.81	-18,240,274.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,597,015.20	47,583,107.27	126,180,122.47

## 建信高端装备股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,677,457.53	-599,515.32	11,077,942.21
本期利润	-26,968,755.60	13,790,488.50	-13,178,267.10
本期基金份额交易产生的变动数	70,239,197.09	23,161,576.50	93,400,773.59
其中：基金申购款	113,370,878.45	31,576,264.21	144,947,142.66
基金赎回款	-43,131,681.36	-8,414,687.71	-51,546,369.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	54,947,899.02	36,352,549.68	91,300,448.70

## 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	536,487.64
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	87,249.11
结算备付金利息收入	-
其他	11,805.08
合计	635,541.83

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

## 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	-59,392,213.47
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	-59,392,213.47

#### 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	3,369,021,881.74
减：卖出股票成本总额	3,418,815,210.31
减：交易费用	9,598,884.90
买卖股票差价收入	-59,392,213.47

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,908,755.09
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	4,908,755.09

**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	47,269,354.06
股票投资	47,269,354.06
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	47,269,354.06

#### 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	862,508.82
基金转换费收入	2,476.24
合计	864,985.06

#### 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	-
其他	800.00
证券组合费	401.01
合计	83,023.87

#### 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
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	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

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 (%)
光大证券	692,635,721.65	9.05	359,036,061.98	15.57

#### 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 (%)
光大证券	504,066.06	36.91	962,255.00	100.00
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 (%)
光大证券	258,107.56	15.52	351,019.04	44.06

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 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	8,132,080.36
其中：支付销售机构的客户维护费	1,699,759.60	712,504.27

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 1.50%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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 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	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,355,346.67	339,747.46

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

### 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		
	建信高端装备股票 A	建信高端装备股票 C	合计
光大证券	-	7,375.84	7,375.84
建信基金	-	383,707.76	383,707.76
中国建设银行	-	60,949.50	60,949.50
合计	-	452,033.10	452,033.10
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		
	建信高端装备股票 A	建信高端装备股票 C	合计
光大证券	-	10,183.49	10,183.49
建信基金	-	2,936.19	2,936.19
中国建设银行	-	48,968.12	48,968.12
合计	-	62,087.80	62,087.80

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.40%。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固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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

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
601669	中国电建	2023 年 1 月 17 日	6 个月	新发未上市	6.44	5.66	1,552,795	9,999,999.80	8,788,819.70	-

##### 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	168,375,778.95	-	-	-	168,375,778.95
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	658,612.76	-	-	-	658,612.76
交易性金融资产	-	-	-	1,346,012,873.93	1,346,012,873.93
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	-	-	-	1,905,999.37	1,905,999.37
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	169,034,391.71	-	-	1,347,918,873.30	1,516,953,265.01
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	-	-	-	2,141,973.98	2,141,973.98
应付赎回款	-	-	-	30,621,970.85	30,621,970.85
应付管理人报酬	-	-	-	1,774,189.33	1,774,189.33
应付托管费	-	-	-	295,698.20	295,698.20
应付销售服务费	-	-	-	203,706.57	203,706.57
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,089,208.77	1,089,208.77
负债总计	-	-	-	36,126,747.70	36,126,747.70
利率敏感度缺口	169,034,391.71	-	-	1,311,792,125.60	1,480,826,517.31
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	62,071,871.97	-	-	-	62,071,871.97
结算备付金	2,897,079.88	-	-	-	2,897,079.88
存出保证金	464,636.32	-	-	-	464,636.32
交易性金融资产	-	-	-	422,995,182.91	422,995,182.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,569,931.60	7,569,931.60



债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	1,597,710.26	1,597,710.26
其他资产	-	-	-	-
资产总计	65,433,588.17	-	432,162,824.77	497,596,412.94
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	-	-	21,126,250.49	21,126,250.49
应付赎回款	-	-	496,745.94	496,745.94
应付管理人报酬	-	-	583,055.74	583,055.74
应付托管费	-	-	97,175.96	97,175.96
应付销售服务费	-	-	31,807.56	31,807.56
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	1,382,251.40	1,382,251.40
负债总计	-	-	23,717,287.09	23,717,287.09
利率敏感度缺口	65,433,588.17	-	408,445,537.68	473,879,125.85

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			合计
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	46,316,034.09	-	46,316,034.09
资产合计	-	46,316,034.09	-	46,316,034.09
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	46,316,034.09	-	46,316,034.09
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	所有外币相对人民币贬值 5%	-2,315,801.70	-
	所有外币相对人民币升值 5%	2,315,801.70	-

### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产投资比例为基金资产的 80-95%，其中投资于本基金界定的“高端装备行业股票”的比例不低于非现金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除国债期货，股指期货和股票期权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。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	1,346,012,873.93	90.90	422,995,182.91	89.26
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	1,346,012,873.93	90.90	422,995,182.91	89.26

### 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%	85,615,445.29	28,367,829.03
	业绩比较基准下降5%	-85,615,445.29	-28,367,829.03

### 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	1,337,224,054.23	422,975,932.43
第二层次	-	-
第三层次	8,788,819.70	19,250.48

合计	1,346,012,873.93	422,995,182.91
----	------------------	----------------

#### 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	1,346,012,873.93	88.73
	其中：股票	1,346,012,873.93	88.73
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	168,375,778.95	11.10

8	其他各项资产	2,564,612.13	0.17
9	合计	1,516,953,265.01	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 46,316,034.09 元，占期末基金资产净值比例为 3.13%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,269,663,934.06	85.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,788,819.70	0.59
F	批发和零售业	-	-
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	21,244,086.08	1.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1,299,696,839.84	87.77

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
Materials 材料	-	-
Consumer Staples 日常生活消费品	-	-
Consumer Discretionary 非日常消费品	26,783,519.00	1.81

Energy 能源	-	-
Financials 金融	-	-
Health Care 医疗保健	-	-
Industrials 工业	-	-
Real Estate 房地产	-	-
Information Technology 信息技术	19,532,515.09	1.32
Telecommunication Services 通讯服务	-	-
Utilities 公用事业	-	-
合计	46,316,034.09	3.13

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

### 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

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	300750	宁德时代	534,709	122,336,072.11	8.26
2	688981	中芯国际	1,141,049	57,645,795.48	3.89
2	00981	中芯国际	1,038,500	19,532,515.09	1.32
3	688270	臻镭科技	799,909	51,938,091.37	3.51
4	002129	TCL 中环	1,547,375	51,372,850.00	3.47
5	300855	图南股份	1,428,061	50,439,114.52	3.41
6	300274	阳光电源	420,840	49,082,569.20	3.31
7	688072	拓荆科技	115,097	49,027,869.09	3.31
8	600933	爱柯迪	2,083,715	48,529,722.35	3.28
9	601799	星宇股份	385,900	47,697,240.00	3.22
10	301155	海力风电	608,044	46,868,031.52	3.16
11	300969	恒帅股份	503,600	44,392,340.00	3.00
12	002472	双环传动	945,300	34,314,390.00	2.32
13	688503	聚和材料	350,706	34,193,835.00	2.31
14	688362	甬矽电子	934,884	31,122,288.36	2.10
15	601865	福莱特	801,900	30,881,169.00	2.09
16	09868	小鹏汽车-W	581,000	26,783,519.00	1.81
17	603997	继峰股份	1,861,100	26,613,730.00	1.80
18	688012	中微公司	168,195	26,314,107.75	1.78
19	300408	三环集团	885,856	25,999,873.60	1.76
20	001309	德明利	247,600	23,026,800.00	1.55
21	002920	德赛西威	129,500	20,177,395.00	1.36
22	600066	宇通客车	1,302,800	19,203,272.00	1.30
23	688372	伟测科技	124,917	19,131,038.55	1.29

24	688515	裕太微	105,499	18,109,958.34	1.22
25	601689	拓普集团	223,800	18,060,660.00	1.22
26	002050	三花智控	576,200	17,435,812.00	1.18
27	688226	威腾电气	785,758	17,145,239.56	1.16
28	300718	长盛轴承	735,400	16,362,650.00	1.10
29	002459	晶澳科技	378,300	15,775,110.00	1.07
30	688789	宏华数科	166,994	14,750,580.02	1.00
31	300395	菲利华	295,600	14,543,520.00	0.98
32	688305	科德数控	143,823	14,419,693.98	0.97
33	300161	华中数控	247,000	13,219,440.00	0.89
34	688279	峰岬科技	93,424	12,331,968.00	0.83
35	688458	美芯晟	113,350	10,900,869.50	0.74
36	603662	柯力传感	293,700	10,808,160.00	0.73
37	300567	精测电子	111,900	10,647,285.00	0.72
38	688383	新益昌	75,168	10,464,888.96	0.71
39	002965	祥鑫科技	186,600	10,389,888.00	0.70
40	688049	炬芯科技	279,950	10,302,160.00	0.70
41	003021	兆威机电	104,200	9,141,466.00	0.62
42	688099	晶晨股份	105,694	8,912,118.08	0.60
43	601669	中国电建	1,552,795	8,788,819.70	0.59
44	002475	立讯精密	234,600	7,612,770.00	0.51
45	688112	鼎阳科技	141,778	7,483,042.84	0.51
46	301325	曼恩斯特	65,300	7,476,850.00	0.50
47	605133	嵘泰股份	214,600	7,459,496.00	0.50
48	688320	禾川科技	154,581	7,453,895.82	0.50
49	300769	德方纳米	67,160	7,403,046.80	0.50
50	688150	莱特光电	328,412	7,356,428.80	0.50
51	002338	奥普光电	174,400	7,350,960.00	0.50
52	002997	瑞鹄模具	246,900	7,340,337.00	0.50
53	000625	长安汽车	552,900	7,148,997.00	0.48
54	688408	中信博	83,341	7,028,146.53	0.47
55	688017	绿的谐波	43,050	6,991,320.00	0.47
56	301360	荣旗科技	61,800	6,444,504.00	0.44
57	688160	步科股份	71,146	5,940,691.00	0.40
58	688170	德龙激光	132,537	5,933,681.49	0.40
59	300539	横河精密	344,500	5,102,045.00	0.34
60	873593	鼎智科技	32,938	4,393,929.20	0.30
61	002079	苏州固锔	288,700	4,215,020.00	0.28
62	300782	卓胜微	39,500	3,816,885.00	0.26
63	688181	八亿时空	103,828	2,926,911.32	0.20



## 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	300750	宁德时代	137,557,195.37	29.03
2	00981	中芯国际	21,658,563.78	4.57
3	688981	中芯国际	86,239,501.40	18.20
4	600933	爱柯迪	74,647,059.33	15.75
5	688072	拓荆科技	69,194,514.27	14.60
6	688270	臻镭科技	68,602,901.36	14.48
7	002129	TCL 中环	67,058,144.00	14.15
8	601799	星宇股份	65,853,973.15	13.90
9	300274	阳光电源	62,714,425.90	13.23
10	603305	旭升集团	60,803,584.29	12.83
11	688663	新风光	58,959,032.25	12.44
12	301322	绿通科技	56,360,356.50	11.89
13	300502	新易盛	54,466,582.43	11.49
14	002709	天赐材料	54,007,338.88	11.40
15	300418	昆仑万维	53,206,811.51	11.23
16	688226	威腾电气	50,080,660.80	10.57
17	300855	图南股份	49,651,997.97	10.48
18	688362	甬矽电子	46,775,591.91	9.87
19	600066	宇通客车	42,469,250.65	8.96
20	301155	海力风电	41,926,176.22	8.85
21	300969	恒帅股份	38,811,118.00	8.19
22	300567	精测电子	38,419,842.19	8.11
23	688012	中微公司	36,924,100.16	7.79
24	603997	继峰股份	36,883,998.88	7.78
25	300068	南都电源	36,057,106.90	7.61
26	002777	久远银海	34,583,359.52	7.30
27	300408	三环集团	33,948,315.01	7.16
28	002594	比亚迪	33,017,048.00	6.97
29	688503	聚和材料	31,443,221.63	6.64
30	002472	双环传动	31,196,551.30	6.58
31	300161	华中数控	29,041,183.00	6.13
32	301191	菲菱科思	28,634,066.23	6.04
33	600703	三安光电	28,540,715.13	6.02
34	002916	深南电路	28,336,975.49	5.98

35	002463	沪电股份	28,228,381.70	5.96
36	001309	德明利	27,801,374.00	5.87
37	600641	万业企业	27,705,467.00	5.85
38	601865	福莱特	26,816,114.75	5.66
39	300499	高澜股份	26,795,331.93	5.65
40	688248	南网科技	26,288,669.48	5.55
41	300769	德方纳米	26,273,982.25	5.54
42	688111	金山办公	26,119,749.33	5.51
43	603348	文灿股份	26,045,913.15	5.50
44	002920	德赛西威	25,980,410.31	5.48
45	300395	菲利华	25,366,300.00	5.35
46	688099	晶晨股份	25,334,135.12	5.35
47	002050	三花智控	25,100,683.00	5.30
48	002156	通富微电	24,944,666.24	5.26
49	300660	江苏雷利	24,820,436.16	5.24
50	688515	裕太微	24,642,124.71	5.20
51	300033	同花顺	24,573,382.66	5.19
52	300443	金雷股份	24,553,980.00	5.18
53	09868	小鹏汽车-W	23,696,799.95	5.00
54	002782	可立克	23,418,271.94	4.94
55	301039	中集车辆	23,020,152.00	4.86
56	688305	科德数控	22,987,345.98	4.85
57	002222	福晶科技	22,907,193.76	4.83
58	003025	思进智能	22,396,059.05	4.73
59	002459	晶澳科技	22,022,400.93	4.65
60	603596	伯特利	21,962,831.00	4.63
61	000066	中国长城	21,852,728.00	4.61
62	688017	绿的谐波	21,733,395.90	4.59
63	002837	英维克	21,251,108.70	4.48
64	603218	日月股份	21,087,112.99	4.45
65	688200	华峰测控	20,734,071.45	4.38
66	603595	东尼电子	20,384,872.00	4.30
67	300007	汉威科技	19,901,251.69	4.20
68	605068	明新旭腾	19,642,681.41	4.15
69	002850	科达利	19,603,050.26	4.14
70	002271	东方雨虹	19,439,974.00	4.10
71	002236	大华股份	19,099,110.00	4.03
72	002833	弘亚数控	19,063,258.76	4.02
73	688521	芯原股份	18,725,427.24	3.95
74	300415	伊之密	18,272,914.00	3.86
75	300308	中际旭创	18,108,095.40	3.82
76	688256	寒武纪	18,050,061.40	3.81
77	688676	金盘科技	17,780,551.88	3.75

78	601689	拓普集团	17,693,311.00	3.73
79	600212	绿能慧充	17,498,975.99	3.69
80	603730	岱美股份	17,431,087.17	3.68
81	002436	兴森科技	16,763,379.97	3.54
82	688045	必易微	16,683,580.18	3.52
83	688326	经纬恒润	16,669,553.16	3.52
84	603556	海兴电力	16,474,588.20	3.48
85	603108	润达医疗	16,437,782.00	3.47
86	688143	长盈通	16,319,888.03	3.44
87	600031	三一重工	16,258,296.00	3.43
88	300129	泰胜风能	16,247,108.31	3.43
89	000810	创维数字	16,160,796.76	3.41
90	688372	伟测科技	16,159,612.72	3.41
91	300474	景嘉微	15,890,742.00	3.35
92	600760	中航沈飞	15,855,363.00	3.35
93	300782	卓胜微	15,851,376.00	3.35
94	603986	兆易创新	15,850,797.00	3.34
95	002487	大金重工	15,697,029.74	3.31
96	300718	长盛轴承	15,579,173.36	3.29
97	603138	海量数据	15,440,770.00	3.26
98	300870	欧陆通	14,954,121.94	3.16
99	688789	宏华数科	14,795,406.07	3.12
100	300394	天孚通信	14,715,630.80	3.11
101	000032	深桑达 A	14,531,329.66	3.07
102	300580	贝斯特	14,525,337.73	3.07
103	300484	蓝海华腾	14,343,691.00	3.03
104	873593	鼎智科技	14,048,217.91	2.96
105	603019	中科曙光	13,938,881.06	2.94
106	688800	瑞可达	13,894,547.51	2.93
107	688239	航宇科技	13,755,266.36	2.90
108	601728	中国电信	13,740,005.00	2.90
109	002897	意华股份	13,727,881.00	2.90
110	300604	长川科技	13,724,957.54	2.90
111	301279	金道科技	13,651,212.84	2.88
112	000581	威孚高科	13,626,340.00	2.88
113	002430	杭氧股份	13,354,134.90	2.82
114	300881	盛德鑫泰	13,289,469.19	2.80
115	000021	深科技	13,277,782.32	2.80
116	688008	澜起科技	13,264,988.13	2.80
117	603186	华正新材	13,050,948.00	2.75
118	002965	祥鑫科技	12,918,829.75	2.73
119	603258	电魂网络	12,915,381.00	2.73
120	00020	商汤-W	12,844,842.71	2.71

121	001311	多利科技	12,839,133.60	2.71
122	688392	骄成超声	12,634,366.14	2.67
123	688408	中信博	12,498,394.39	2.64
124	688498	源杰科技	12,458,837.62	2.63
125	300820	英杰电气	12,307,173.05	2.60
126	688141	杰华特	11,883,306.46	2.51
127	688160	步科股份	11,827,009.77	2.50
128	000680	山推股份	11,817,692.00	2.49
129	603306	华懋科技	11,714,897.00	2.47
130	301260	格力博	11,706,269.83	2.47
131	688279	峰岬科技	11,325,684.96	2.39
132	688383	新益昌	11,315,232.46	2.39
133	603225	新凤鸣	11,288,150.56	2.38
134	603701	德宏股份	11,284,554.44	2.38
135	603888	新华网	11,262,877.00	2.38
136	301325	曼恩斯特	11,235,791.07	2.37
137	300725	药石科技	11,215,017.40	2.37
138	002063	远光软件	11,035,169.00	2.33
139	688049	炬芯科技	11,014,868.89	2.32
140	688368	晶丰明源	10,911,724.72	2.30
141	300188	美亚柏科	10,603,673.00	2.24
142	603806	福斯特	10,546,127.63	2.23
143	600375	汉马科技	10,085,785.28	2.13
144	601669	中国电建	9,999,999.80	2.11
145	688458	美芯晟	9,977,971.04	2.11
146	300438	鹏辉能源	9,749,939.00	2.06
147	603662	柯力传感	9,673,054.80	2.04
148	688122	西部超导	9,636,721.73	2.03

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	603305	旭升集团	77,345,385.48	16.32
2	300418	昆仑万维	59,233,998.09	12.50
3	300750	宁德时代	55,636,258.40	11.74
4	300502	新易盛	53,753,161.75	11.34
5	002709	天赐材料	50,688,684.52	10.70
6	688663	新风光	49,313,161.16	10.41
7	301322	绿通科技	46,874,206.85	9.89

8	688226	威腾电气	37,775,026.99	7.97
9	300068	南都电源	34,949,530.00	7.38
10	002594	比亚迪	34,792,268.42	7.34
11	688256	寒武纪	34,510,304.23	7.28
12	002777	久远银海	33,488,345.08	7.07
13	600066	宇通客车	33,297,820.00	7.03
14	300274	阳光电源	32,636,474.69	6.89
15	688326	经纬恒润	32,041,334.50	6.76
16	301191	菲菱科思	30,410,028.05	6.42
17	688200	华峰测控	28,025,063.92	5.91
18	300033	同花顺	27,865,791.62	5.88
19	300567	精测电子	27,694,563.20	5.84
20	688099	晶晨股份	27,059,514.79	5.71
21	002782	可立克	26,675,533.54	5.63
22	600641	万业企业	26,635,226.16	5.62
23	688072	拓荆科技	26,481,702.14	5.59
24	600933	爱柯迪	26,425,403.00	5.58
25	301039	中集车辆	26,363,466.00	5.56
26	600703	三安光电	26,325,461.00	5.56
27	688111	金山办公	25,728,117.28	5.43
28	002837	英维克	25,046,557.54	5.29
29	002463	沪电股份	24,971,849.90	5.27
30	003025	思进智能	24,336,061.94	5.14
31	300408	三环集团	23,560,764.00	4.97
32	300660	江苏雷利	23,157,067.28	4.89
33	688248	南网科技	22,967,629.66	4.85
34	002916	深南电路	22,853,950.27	4.82
35	300499	高澜股份	22,841,285.00	4.82
36	300161	华中数控	22,836,072.00	4.82
37	002156	通富微电	22,629,757.82	4.78
38	603596	伯特利	22,601,315.00	4.77
39	002222	福晶科技	22,361,612.94	4.72
40	688143	长盈通	22,065,740.06	4.66
41	603348	文灿股份	21,913,679.00	4.62
42	002236	大华股份	21,867,067.00	4.61
43	000066	中国长城	21,211,434.29	4.48
44	688045	必易微	20,941,091.58	4.42
45	003031	中瓷电子	20,919,602.64	4.41
46	002833	弘亚数控	20,187,129.60	4.26
47	300443	金雷股份	19,968,500.24	4.21
48	002271	东方雨虹	19,525,613.00	4.12
49	688239	航宇科技	18,759,027.79	3.96
50	688800	瑞可达	18,744,185.03	3.96

51	300007	汉威科技	18,510,417.00	3.91
52	603218	日月股份	18,477,664.63	3.90
53	300308	中际旭创	18,376,950.97	3.88
54	300769	德方纳米	18,367,694.34	3.88
55	600031	三一重工	18,074,545.54	3.81
56	688120	华海清科	17,946,408.12	3.79
57	603986	兆易创新	17,820,433.08	3.76
58	300855	图南股份	17,808,164.00	3.76
59	601728	中国电信	17,393,920.00	3.67
60	605068	明新旭腾	17,388,943.91	3.67
61	603730	岱美股份	17,239,853.42	3.64
62	688981	中芯国际	17,198,569.77	3.63
63	600212	绿能慧充	16,910,861.02	3.57
64	002920	德赛西威	16,906,070.06	3.57
65	002850	科达利	16,894,878.20	3.57
66	300474	景嘉微	16,877,480.03	3.56
67	000810	创维数字	16,733,676.00	3.53
68	300129	泰胜风能	16,654,068.00	3.51
69	300415	伊之密	16,602,959.00	3.50
70	688521	芯原股份	16,601,083.12	3.50
71	603108	润达医疗	16,522,936.00	3.49
72	688270	臻镭科技	16,360,608.36	3.45
73	002487	大金重工	16,291,666.00	3.44
74	000032	深桑达 A	16,229,957.00	3.42
75	688017	绿的谐波	16,217,743.09	3.42
76	688362	甬矽电子	16,155,861.79	3.41
77	002436	兴森科技	16,039,241.00	3.38
78	300870	欧陆通	15,842,216.36	3.34
79	300817	双飞股份	15,759,350.40	3.33
80	603556	海兴电力	15,730,837.70	3.32
81	688008	澜起科技	15,605,622.66	3.29
82	688676	金盘科技	15,418,528.64	3.25
83	873593	鼎智科技	15,232,401.41	3.21
84	601799	星宇股份	15,209,838.30	3.21
85	000733	振华科技	15,140,160.12	3.19
86	688798	艾为电子	15,087,974.49	3.18
87	603138	海量数据	14,925,669.08	3.15
88	601633	长城汽车	14,873,822.00	3.14
89	603595	东尼电子	14,749,374.00	3.11
90	300580	贝斯特	14,684,561.15	3.10
91	300438	鹏辉能源	14,636,778.45	3.09
92	600760	中航沈飞	14,469,271.36	3.05
93	300820	英杰电气	14,422,725.75	3.04

94	688311	盟升电子	14,392,037.60	3.04
95	688305	科德数控	14,311,775.31	3.02
96	300394	天孚通信	14,150,199.11	2.99
97	301279	金道科技	13,983,696.00	2.95
98	688121	卓然股份	13,936,147.29	2.94
99	603019	中科曙光	13,842,113.29	2.92
100	001311	多利科技	13,559,493.01	2.86
101	002897	意华股份	13,403,227.00	2.83
102	002049	紫光国微	13,352,203.40	2.82
103	688498	源杰科技	13,180,181.78	2.78
104	300484	蓝海华腾	13,045,908.00	2.75
105	688392	骄成超声	12,982,955.35	2.74
106	603186	华正新材	12,954,193.00	2.73
107	300604	长川科技	12,866,661.00	2.72
108	000581	威孚高科	12,733,122.06	2.69
109	688141	杰华特	12,427,803.21	2.62
110	603888	新华网	12,228,030.61	2.58
111	002430	杭氧股份	12,190,975.00	2.57
112	300881	盛德鑫泰	12,117,077.64	2.56
113	002129	TCL 中环	12,065,425.00	2.55
114	000680	山推股份	11,829,844.00	2.50
115	688372	伟测科技	11,700,421.82	2.47
116	603258	电魂网络	11,655,753.00	2.46
117	688349	三一重能	11,605,051.86	2.45
118	688697	纽威数控	11,594,595.35	2.45
119	688560	明冠新材	11,550,970.64	2.44
120	00020	商汤-W	11,548,988.09	2.44
121	688711	宏微科技	11,476,396.72	2.42
122	000951	中国重汽	11,374,203.49	2.40
123	300188	美亚柏科	11,218,493.00	2.37
124	301260	格力博	11,186,786.98	2.36
125	000021	深科技	11,117,381.00	2.35
126	603225	新凤鸣	11,110,514.00	2.34
127	688378	奥来德	10,832,723.39	2.29
128	600562	国睿科技	10,654,945.05	2.25
129	603701	德宏股份	10,606,490.00	2.24
130	603306	华懋科技	10,343,221.00	2.18
131	603806	福斯特	10,331,419.49	2.18
132	300725	药石科技	10,160,888.10	2.14
133	601226	华电重工	10,008,894.00	2.11
134	688368	晶丰明源	9,821,746.29	2.07
135	600375	汉马科技	9,820,983.00	2.07
136	300782	卓胜微	9,730,609.80	2.05

137	300491	通合科技	9,670,678.00	2.04
-----	--------	------	--------------	------

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	4,294,563,547.27
卖出股票收入（成交）总额	3,369,021,881.74

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	658,612.76
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,905,999.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,564,612.13
---	----	--------------

#### 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

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 (%)
建信高端 装备股票 A	7,716	92,630.04	476,634,315.59	66.69	238,099,087.81	33.31
建信高端 装备股票 C	20,369	26,933.70	360,670,356.56	65.74	187,942,186.18	34.26
合计	28,085	44,982.94	837,304,672.15	66.28	426,041,273.99	33.72

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	建信高端装备股票 A	3,266,149.97	0.46
	建信高端装备股票 C	205,320.07	0.04
	合计	3,471,470.04	0.27

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	建信高端装备股票 A	50~100
	建信高端装备股票 C	-
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	建信高端装备股票 A	10~50
	建信高端装备股票 C	-
	合计	10~50

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信高端装备股票 A	建信高端装备股票 C
基金合同生效日 (2021年4月27日) 基金份额总额	236,061,832.98	55,769,880.33
本报告期期初基金份额总额	334,264,332.44	79,262,004.27
本报告期基金总申购份额	473,383,623.88	758,068,255.60
减：本报告期基金总赎回份额	92,914,552.92	288,717,717.13
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	714,733,403.40	548,612,542.74

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

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2023 年 1 月 19 日发布公告，自 2023 年 1 月 17 日起吴灵玲女士不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起刘军先生不再担任建信基金管理有限责任公司董事长，暂由总裁张军红先生代为履行董事长职务；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 3 月 18 日发布公告，自 2023 年 3 月 17 日起聘任张力铮先生担任建信基金管理有限责任公司副总裁，张威威先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁、首席信息官。上述事项均已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所

处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

## 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 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 (%)	
兴业证券	3	3,730,668,033.16	48.74	2,670,956.93	48.32	-
长江证券	2	1,931,096,786.39	25.23	1,412,217.26	25.55	-
德邦证券	2	1,191,776,638.63	15.57	861,446.20	15.59	-
光大证券	2	692,635,721.65	9.05	504,066.06	9.12	-
东北证券	3	107,408,249.38	1.40	78,549.05	1.42	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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

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

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

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

（4）佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内新增兴业证券 3 个交易单元，长江证券 2 个交易单元，东北证券 3 个交易单元。

## 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(%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

## 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新增中国人寿为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 06 月 05 日
2	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
3	关于建信高端装备股票型证券投资基金证券交易模式转换完成的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 03 月 11 日
4	关于建信高端装备股票型证券投资基金证券交易模式转换有关事项的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 03 月 08 日
5	关于新增兴业银行银银平台为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 03 月 06 日
6	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

7	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
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	关于新增海通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 21 日
10	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	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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信高端装备股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信高端装备股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信高端装备股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信高端装备股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

## 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

## 12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2023 年 8 月 30 日