

建信精工制造指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 27 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信精工制造指数增强型证券投资基金
基金简称	建信精工制造指数增强
基金主代码	001397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 26 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,794,639.03 份
基金合同存续期	不定期

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，在对中证精工制造指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证精工制造指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	90%×中证精工制造指数收益率+10%×商业银行活期存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	滕菲菲
	电子邮箱	010-66228888
客户服务电话	xinxipilu@ccbfund.cn	4006800000
传真	400-81-95533; 010-66228000	tengfeifei@citicbank.com
注册地址	010-66228001	95558
	010-66228001	010-85230024
	北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	100033	100020
法定代表人	生柳荣	方合英

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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,631,200.33
本期利润	443,270.30
加权平均基金份额本期利润	0.0135
本期加权平均净值利润率	0.85%
本期基金份额净值增长率	1.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	19,489,675.60
期末可供分配基金份额利润	0.5943
期末基金资产净值	52,284,314.63
期末基金份额净值	1.5943
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	59.43%

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

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

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

低于所列数字。

3.2 基金净值表现

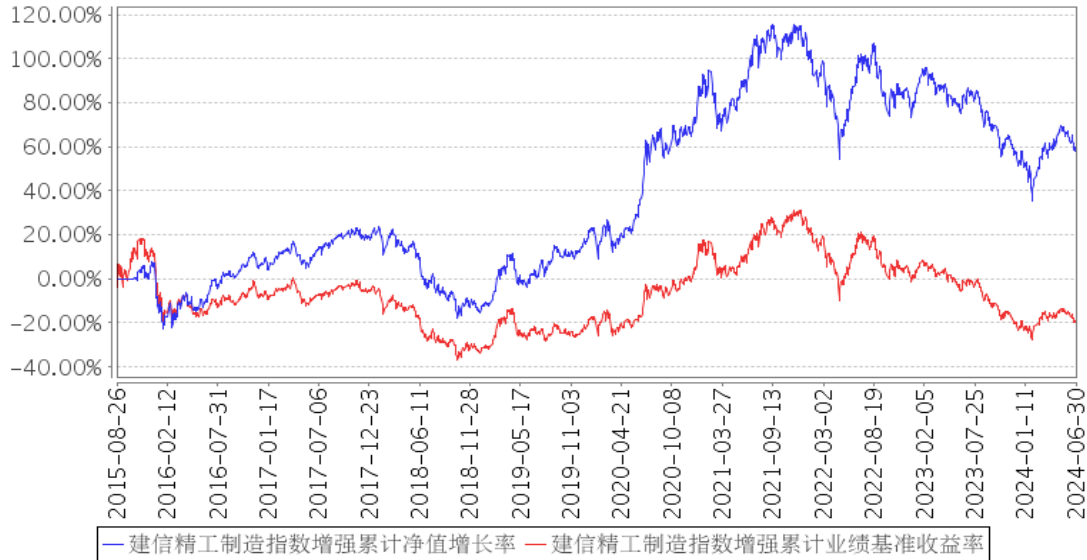
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率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	-3.85%	0.83%	-3.75%	0.81%	-0.10%	0.02%
过去三个月	0.57%	0.93%	-2.27%	1.01%	2.84%	-0.08%
过去六个月	1.06%	1.19%	0.30%	1.20%	0.76%	-0.01%
过去一年	-13.85%	1.05%	-18.50%	1.07%	4.65%	-0.02%
过去三年	-20.90%	1.16%	-30.74%	1.21%	9.84%	-0.05%
自基金合同生效起至今	59.43%	1.25%	-19.14%	1.31%	78.57%	-0.06%

注：本基金业绩比较基准为 $90\% \times \text{中证精工制造指数收益率} + 10\% \times \text{商业银行活期存款利率}$ （税前）。本基金为指数增强型基金，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%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。故在业绩比较基准中给予标的指数收益率 90% 的权重，相应将 10% 作为体现现金或到期日在一年以内的政府债券业绩表现的权重。中证精工制造指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，涵盖工业和通信设备行业，综合反映了这两个行业的上市公司的整体情况。

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

建信精工制造指数增强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、中国华电集团产融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、南京、武汉七家分公司，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 8000 万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至 2024 年 6 月 30 日，公司管理运作 166 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 1.12 余万亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘明辉	本基金的基金经理	2021 年 10 月 27 日	-	8	刘明辉先生，硕士。2015 年 7 月毕业于北京大学应用统计专业，同年 7 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部助理研究员、研究员兼投资经理助理、投资经理、基金经理职务。2021 年 10 月 27 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2022 年 10 月 17 日起任建信恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理；2022 年 12 月 23 日起任建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理。
叶乐天	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2015 年 8 月 26 日	-	16	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 日至 2023 年 11 月 17 日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 日至 2024 年 2 月 5 日

					任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年1月10日至2022年8月9日任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年8月24日至2022年11月17日任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年11月22日起任建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2019年11月13日起任建信MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理；2021年9月15日起任建信灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2022年12月23日起任建信中证500指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人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% 的情况有 1 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数增强型基金，基准指数为精工制造指数，其成分股主要由工业和通信业的股票构成。管理人主要采用量化投资的方法对产品进行管理。

在报告期内，管理人充分利用各类数据构建量化模型，挖掘量化因子，基于市场状况及因子表现调整所用的因子种类及权重，不断引入新数据和新因子，构建在量化模型体系中兼顾有效性和稳健性的选股因子，结合风险模型，在保持对标的指数的风格和行业进行跟踪，保持一定相似度的基础上精选个股，同时叠加卫星策略，力争获得更高的超额收益与更低的跟踪误差。

报告期内，微盘股出现数次急跌，对量化组合影响较为明显。管理人坚持风格中性的投资策略，并进一步减少了微盘股在股票池中的比例，避免在微盘端暴露过多，降低投资风险。

在运作期内，管理人利用股指期货对基金仓位调整并利用基差策略进行增强。

报告期内，本基金取得了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 1.06% 波动率 1.19% 业绩比较基准收益率 0.30% 波动率 1.20%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年 A 股市场整体呈现震荡，没有明显的主营行情，也缺少增量资金，整体情绪并不乐观。长期信心仍有待进一步观察政策效果和经济修复程度。未来我们认为市场是一个温和修复的震荡市。

精工制造指数在 1 月和 2 月初下跌明显，修复后呈现弱震荡行情，走势相对平稳。

微盘股在过去相当长的时间内为大量量化产品提供了超额收益，而量化模型是利用过往数据学习而来，或多或少受微盘风格影响。未来微盘股的市场环境发生了较大变化，在投资端、监管端都收到更多的关注。我们认为未来微盘难以如过往一般提供较稳定的超额收益，所以在投资方面尽可能去避免微盘股对我们组合的影响。

精工制造指数作为一个工业类指数，与主流宽基指数相比，今年上半年表现较好。未来我们会针对精工指数设计定制性的策略，关注成分股和行业的底层逻辑，保持模型更新速度。持仓方面保持较低的各类风险敞口，保持和指数类似的风格和行业占比，降低在微盘股方面的风险暴露。在紧跟指数的同时聚焦选股，以期在更加复杂的市场状况中争取获得更高超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、风险与合规管理部、投资风险管理部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

本报告期内，自 2024 年 1 月 17 日至 2024 年 2 月 28 日，本基金基金资产净值存在连续 20 个工作日低于 5000 万元的情形。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》（2014 年 8 月 8 日生效）第四十一条的要求，现将该情况在本次报告中予以披露。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对建信精工制造指数增强型证券投资基金 2024 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司在建信精工制造指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等信息的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信精工制造指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	5,298,933.96	5,793,887.48
结算备付金		961,042.65	1,029,762.12
存出保证金		16,960.62	9,613.56
交易性金融资产	6.4.7.2	46,799,539.22	47,320,297.50
其中：股票投资		46,799,539.22	47,320,297.50
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		-	339,134.25
应收股利		-	-
应收申购款		13,313.78	50,362.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		53,089,790.23	54,543,057.38
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		5,425.55	933,158.80

应付赎回款		165,019.45	44,732.49
应付管理人报酬		43,770.09	39,367.60
应付托管费		8,754.04	7,873.53
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	582,506.47	956,041.09
负债合计		805,475.60	1,981,173.51
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	32,794,639.03	33,318,908.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	19,489,675.60	19,242,975.87
净资产合计		52,284,314.63	52,561,883.87
负债和净资产总计		53,089,790.23	54,543,057.38

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.5943 元，基金份额总额 32,794,639.03 份。

6.2 利润表

会计主体：建信精工制造指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		912,889.24	2,248,286.70
1. 利息收入		10,272.38	11,861.47
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,272.38	11,861.47
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,184,828.43	673,013.84
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,777,633.84	363,360.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	1,335.23
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	-97,998.50	-32,522.54
股利收益	6.4.7.19	690,803.91	340,840.33
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,074,470.63	1,548,231.85
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	12,974.66	15,179.54
减：二、营业总支出		469,618.94	441,366.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	257,660.89	246,665.50
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	51,532.21	49,333.14
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	23.35
8. 其他费用	6.4.7.23	160,425.84	145,344.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		443,270.30	1,806,920.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		443,270.30	1,806,920.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		443,270.30	1,806,920.41

6.3 净资产变动表

会计主体：建信精工制造指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	33,318,908.00	-	19,242,975.87	52,561,883.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	33,318,908.00	-	19,242,975.87	52,561,883.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-524,268.97	-	246,699.73	-277,569.24
(一)、综合收益总额	-	-	443,270.30	443,270.30
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-524,268.97	-	-196,570.57	-720,839.54
其中：1. 基金申购款	3,028,673.46	-	1,772,227.75	4,800,901.21
2. 基金赎回款	-3,552,942.43	-	-1,968,798.32	-5,521,740.75
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	32,794,639.03	-	19,489,675.60	52,284,314.63
项目	上年度可比期间			
	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	26,264,734.61	-	20,473,696.86	46,738,431.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	26,264,734.61	-	20,473,696.86	46,738,431.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	729,843.04	-	2,487,922.11	3,217,765.15
(一)、综合收益总额	-	-	1,806,920.41	1,806,920.41
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	729,843.04	-	681,001.70	1,410,844.74
其中：1. 基金申购款	4,537,926.94	-	3,956,217.14	8,494,144.08
2. 基金赎回款	-3,808,083.90	-	-3,275,215.44	-7,083,299.34
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	26,994,577.65	-	22,961,618.97	49,956,196.62

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

建信精工制造指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]285 号《关于准予建信精工制造指数增强型证券投资

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《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 241,071,727.57 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（2015）第 972 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 241,172,123.23 份基金份额，其中认购资金利息折合 100,395.66 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 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，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货以套期保值为目的，股指期货、权证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 $90\% \times$ 中证精工制造指数收益率 $+10\% \times$ 商业银行活期存款利率（税前）。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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‰，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；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,298,933.96
等于：本金	5,298,643.34
加：应计利息	290.62
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	5,298,933.96

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	47,675,587.34	-	46,799,539.22	-876,048.12
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	47,675,587.34	-	46,799,539.22	-876,048.12

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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	416.62
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	432,417.51
其中：交易所市场	432,417.51
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	99,672.34
合计	582,506.47

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,318,908.00	33,318,908.00
本期申购	3,028,673.46	3,028,673.46
本期赎回（以“-”号填列）	-3,552,942.43	-3,552,942.43
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	32,794,639.03	32,794,639.03

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,355,225.49	-10,112,249.62	19,242,975.87
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	29,355,225.49	-10,112,249.62	19,242,975.87
本期利润	-1,631,200.33	2,074,470.63	443,270.30

本期基金份额交易产生的变动数	-467,390.42	270,819.85	-196,570.57
其中：基金申购款	2,424,124.49	-651,896.74	1,772,227.75
基金赎回款	-2,891,514.91	922,716.59	-1,968,798.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,256,634.74	-7,766,959.14	19,489,675.60

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		4,413.12
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		5,737.82
其他		121.44
合计		10,272.38

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-1,777,633.84
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		-1,777,633.84

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		144,324,910.32
减：卖出股票成本总额		145,749,552.78
减：交易费用		352,991.38
买卖股票差价收入		-1,777,633.84

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-97,998.50

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	690,803.91
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	690,803.91

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,074,470.63
股票投资	2,074,470.63
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,074,470.63

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,793.56
基金转换费收入	181.10
合计	12,974.66

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行划款手续费	753.50
指数使用费	100,000.00
合计	160,425.84

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	257,660.89	246,665.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	81,521.40	100,912.90
应支付基金管理人的净管理费	176,139.49	145,752.60

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	51,532.21	49,333.14

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
基金合同生效日（2015年8月26日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	7,399,613.90	-
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	7,399,613.90	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	22.56%	-

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行-活期	5,298,933.96	4,413.12	5,086,237.61	5,424.27

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024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**

无。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

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。基金管理人对于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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,298,933.96	-	-	-	5,298,933.96
结算备付金	961,042.65	-	-	-	961,042.65
存出保证金	16,960.62	-	-	-	16,960.62
交易性金融资产	-	-	-	46,799,539.22	46,799,539.22
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	-	-	-	13,313.78	13,313.78

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,276,937.23	-	-	46,812,853.00	53,089,790.23
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	-	-	-	5,425.55	5,425.55
应付赎回款	-	-	-	165,019.45	165,019.45
应付管理人报酬	-	-	-	43,770.09	43,770.09
应付托管费	-	-	-	8,754.04	8,754.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	582,506.47	582,506.47
负债总计	-	-	-	805,475.60	805,475.60
利率敏感度缺口	6,276,937.23	-	-	46,007,377.40	52,284,314.63
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,793,887.48	-	-	-	5,793,887.48
结算备付金	1,029,762.12	-	-	-	1,029,762.12
存出保证金	9,613.56	-	-	-	9,613.56
交易性金融资产	-	-	-	47,320,297.50	47,320,297.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	339,134.25	339,134.25
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	50,362.47	50,362.47
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,833,263.16	-	-	47,709,794.22	54,543,057.38
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	-	-	-	933,158.80	933,158.80
应付赎回款	-	-	-	44,732.49	44,732.49
应付管理人报酬	-	-	-	39,367.60	39,367.60
应付托管费	-	-	-	7,873.53	7,873.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	956,041.09	956,041.09
负债总计	-	-	1,981,173.51	1,981,173.51
利率敏感度缺口	6,833,263.16	-	45,728,620.71	52,561,883.87

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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	46,799,539.22	89.51	47,320,297.50	90.03
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	46,799,539.22	89.51	47,320,297.50	90.03

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	2,437,264.12	2,408,769.76
业绩比较基准下降5%	-2,437,264.12	-2,408,769.76	

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	46,799,539.22	47,320,297.50

第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	46,799,539.22	47,320,297.50

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	46,799,539.22	88.15
	其中：股票	46,799,539.22	88.15
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	6,259,976.61	11.79
8	其他各项资产	30,274.40	0.06
9	合计	53,089,790.23	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,563,836.98	43.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,699,616.00	7.08
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,167,138.00	11.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,058,304.00	2.02
J	金融业	653,830.00	1.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	112,042.00	0.21
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	34,254,766.98	65.52

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	156,083.00	0.30
C	制造业	9,961,674.94	19.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	889,536.00	1.70
E	建筑业	46,024.00	0.09
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	279,200.40	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	561,237.90	1.07
J	金融业	496,126.00	0.95
K	房地产业	3,251.00	0.01
L	租赁和商务服务业	148,920.00	0.28
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	2,719.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,544,772.24	23.99

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	300750	宁德时代	22,200	3,996,666.00	7.64
2	601668	中国建筑	345,600	1,835,136.00	3.51
3	600018	上港集箱	253,900	1,467,542.00	2.81
4	601567	三星医疗	33,900	1,186,500.00	2.27
5	600406	国电南瑞	42,400	1,058,304.00	2.02
6	000063	中兴通讯	37,600	1,051,672.00	2.01
7	601012	隆基绿能	74,135	1,039,372.70	1.99
8	601989	中国重工	204,100	1,006,213.00	1.92
9	601877	正泰电器	52,400	998,744.00	1.91
10	601390	中国中铁	146,600	955,832.00	1.83
11	601298	青岛港	95,600	913,936.00	1.75
12	300274	阳光电源	14,460	896,953.80	1.72
13	600582	天地科技	121,400	836,446.00	1.60
14	601727	上海电气	225,500	834,350.00	1.60
15	300308	中际旭创	6,040	832,795.20	1.59
16	600233	圆通速递	52,600	823,190.00	1.57
17	000425	徐工机械	102,000	729,300.00	1.39
18	002595	豪迈科技	17,200	656,524.00	1.26
19	600517	国网英大	151,000	653,830.00	1.25
20	601872	招商轮船	76,900	649,805.00	1.24
21	300502	新易盛	6,000	633,300.00	1.21
22	600875	东方电气	31,900	588,555.00	1.13
23	601766	中国中车	74,300	557,993.00	1.07
24	601018	宁波港	149,000	506,600.00	0.97
25	600039	四川路桥	64,000	504,960.00	0.97
26	600066	宇通客车	19,200	495,360.00	0.95
27	601615	明阳智能	46,500	438,960.00	0.84
28	601919	中远海控	27,600	427,524.00	0.82
29	300124	汇川技术	7,300	374,490.00	0.72
30	600885	宏发股份	13,300	368,144.00	0.70
31	600522	中天科技	22,100	350,285.00	0.67
32	601186	中国铁建	38,200	327,374.00	0.63
33	600026	中远海能	20,900	326,249.00	0.62

34	601865	福莱特	15,300	307,530.00	0.59
35	002625	光启技术	17,200	298,420.00	0.57
36	600760	中航沈飞	6,700	268,670.00	0.51
37	688819	天能股份	11,200	267,232.00	0.51
38	002850	科达利	3,400	259,692.00	0.50
39	001965	招商公路	21,400	253,804.00	0.49
40	300394	天孚通信	2,820	249,344.40	0.48
41	601598	中国外运	42,500	239,275.00	0.46
42	300628	亿联网络	6,100	224,297.00	0.43
43	002028	思源电气	3,200	214,080.00	0.41
44	600031	三一重工	12,000	198,000.00	0.38
45	601228	广州港	64,900	197,945.00	0.38
46	000800	一汽解放	24,200	189,486.00	0.36
47	603659	璞泰来	13,300	187,929.00	0.36
48	002056	横店东磁	15,000	187,050.00	0.36
49	603606	东方电缆	3,400	165,954.00	0.32
50	600372	中航机载	12,900	154,413.00	0.30
51	000786	北新建材	4,900	145,334.00	0.28
52	002465	海格通信	13,000	134,680.00	0.26
53	000738	航发控制	6,700	134,469.00	0.26
54	002444	巨星科技	5,400	133,380.00	0.26
55	601156	东航物流	5,900	120,065.00	0.23
56	300751	迈为股份	1,000	119,480.00	0.23
57	600415	小商品城	15,100	112,042.00	0.21
58	603565	中谷物流	10,900	95,266.00	0.18
59	600482	中国动力	4,800	93,504.00	0.18
60	002340	格林美	13,700	87,269.00	0.17
61	603338	浙江鼎力	1,300	78,546.00	0.15
62	002179	中航光电	2,000	76,100.00	0.15
63	002352	顺丰控股	2,100	74,949.00	0.14
64	688375	国博电子	1,000	70,640.00	0.14
65	688032	禾迈股份	596	68,408.88	0.13
66	603806	福斯特	4,620	67,914.00	0.13
67	600038	中直股份	1,400	57,554.00	0.11
68	601669	中国电建	10,200	57,018.00	0.11
69	000400	许继电气	1,400	48,174.00	0.09
70	600089	特变电工	3,400	47,158.00	0.09
71	603298	杭叉集团	2,300	45,172.00	0.09
72	001872	招商港口	2,200	42,350.00	0.08
73	600487	亨通光电	2,600	41,002.00	0.08
74	002129	TCL 中环	4,100	35,465.00	0.07
75	002531	天顺风能	3,900	34,866.00	0.07
76	002120	韵达股份	3,700	28,638.00	0.05

77	600970	中材国际	1,600	19,296.00	0.04
----	--------	------	-------	-----------	------

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	600562	国睿科技	40,200	549,132.00	1.05
2	603556	海兴电力	10,900	510,447.00	0.98
3	600098	广州发展	69,900	447,360.00	0.86
4	000598	兴蓉环境	58,800	442,176.00	0.85
5	301056	森赫股份	55,900	428,753.00	0.82
6	600967	内蒙一机	59,400	427,680.00	0.82
7	603699	纽威股份	24,600	421,152.00	0.81
8	601633	长城汽车	15,900	402,270.00	0.77
9	688662	富信科技	15,800	385,520.00	0.74
10	601238	广汽集团	49,200	380,808.00	0.73
11	002249	大洋电机	77,400	366,102.00	0.70
12	603786	科博达	5,500	352,825.00	0.67
13	600184	光电股份	38,600	328,486.00	0.63
14	688676	金盘科技	5,800	302,470.00	0.58
15	002580	圣阳股份	44,500	273,675.00	0.52
16	002410	广联达	25,400	243,332.00	0.47
17	601838	成都银行	15,600	236,964.00	0.45
18	603050	科林电气	8,840	214,458.40	0.41
19	688519	南亚新材	7,992	204,355.44	0.39
20	002736	国信证券	21,700	188,573.00	0.36
21	002706	良信股份	27,100	185,906.00	0.36
22	688475	萤石网络	4,900	167,139.00	0.32
23	688313	仕佳光子	17,400	165,648.00	0.32
24	603871	嘉友国际	9,360	165,578.40	0.32
25	000625	长安汽车	12,300	165,189.00	0.32
26	603025	大豪科技	11,500	158,930.00	0.30
27	000913	钱江摩托	9,600	151,296.00	0.29
28	600057	厦门象屿	21,900	148,920.00	0.28
29	002064	华峰化学	20,600	147,702.00	0.28
30	002664	信质集团	11,900	141,610.00	0.27
31	601898	中煤能源	11,300	141,024.00	0.27
32	688226	威腾电气	7,922	138,476.56	0.26
33	688586	江航装备	14,800	137,640.00	0.26
34	300081	恒信东方	30,600	135,252.00	0.26
35	301138	华研精机	5,500	131,395.00	0.25
36	688311	盟升电子	6,400	131,136.00	0.25

37	300408	三环集团	4,400	128,436.00	0.25
38	300765	新诺威	5,000	126,150.00	0.24
39	300415	伊之密	5,900	122,602.00	0.23
40	300286	安科瑞	5,300	114,692.00	0.22
41	688503	聚和材料	4,028	113,186.80	0.22
42	000550	江铃汽车	5,100	110,721.00	0.21
43	605066	天正电气	17,375	96,778.75	0.19
44	600161	天坛生物	3,960	96,624.00	0.18
45	000725	京东方 A	22,500	92,025.00	0.18
46	603713	密尔克卫	1,700	90,984.00	0.17
47	603178	圣龙股份	4,200	90,006.00	0.17
48	688609	九联科技	8,800	77,616.00	0.15
49	000922	佳电股份	5,800	69,194.00	0.13
50	301321	翰博高新	6,000	69,060.00	0.13
51	301260	格力博	5,000	68,100.00	0.13
52	605333	沪光股份	2,400	66,840.00	0.13
53	600894	广日股份	5,700	65,550.00	0.13
54	603766	隆鑫通用	9,000	61,020.00	0.12
55	002749	国光股份	3,600	54,144.00	0.10
56	600588	用友网络	5,300	53,000.00	0.10
57	000408	藏格矿业	2,200	52,954.00	0.10
58	002765	蓝黛科技	11,000	51,700.00	0.10
59	300418	昆仑万维	1,600	51,584.00	0.10
60	688128	中国电研	2,800	48,188.00	0.09
61	300993	玉马遮阳	5,300	47,382.00	0.09
62	603516	淳中科技	1,500	47,355.00	0.09
63	600183	生益科技	2,200	46,332.00	0.09
64	000498	山东路桥	8,800	46,024.00	0.09
65	688036	传音控股	600	45,924.00	0.09
66	688111	金山办公	200	45,500.00	0.09
67	600761	安徽合力	2,100	45,444.00	0.09
68	603278	大业股份	7,100	44,091.00	0.08
69	601319	中国人保	8,200	42,230.00	0.08
70	301012	扬电科技	1,700	42,092.00	0.08
71	300155	安居宝	11,800	41,182.00	0.08
72	688070	纵横股份	1,400	39,564.00	0.08
73	688100	威胜信息	1,000	38,150.00	0.07
74	002976	瑞玛精密	1,500	36,000.00	0.07
75	300857	协创数据	600	34,200.00	0.07
76	000561	烽火电子	5,300	33,973.00	0.06
77	603768	常青股份	2,700	30,618.00	0.06
78	603949	雪龙集团	2,100	23,646.00	0.05
79	002123	梦网科技	3,300	23,199.00	0.04

80	605228	神通科技	2,700	23,166.00	0.04
81	605088	冠盛股份	1,100	22,924.00	0.04
82	603569	长久物流	3,300	22,638.00	0.04
83	300719	安达维尔	1,100	18,645.00	0.04
84	002779	中坚科技	600	17,004.00	0.03
85	603529	爱玛科技	600	16,398.00	0.03
86	603928	兴业股份	1,300	10,179.00	0.02
87	000599	青岛双星	2,400	8,472.00	0.02
88	002584	西陇科学	1,400	7,868.00	0.02
89	300853	申昊科技	500	7,270.00	0.01
90	601881	中国银河	600	6,516.00	0.01
91	601968	宝钢包装	1,300	6,084.00	0.01
92	000728	国元证券	1,000	6,060.00	0.01
93	600690	海尔智家	200	5,676.00	0.01
94	605377	华旺科技	420	5,565.00	0.01
95	688668	鼎通科技	140	5,500.60	0.01
96	688391	钜泉科技	170	4,958.90	0.01
97	300337	银邦股份	600	4,860.00	0.01
98	600268	国电南自	840	4,796.40	0.01
99	002156	通富微电	200	4,478.00	0.01
100	601088	中国神华	100	4,437.00	0.01
101	603855	华荣股份	200	4,422.00	0.01
102	688173	希荻微	400	4,412.00	0.01
103	603816	顾家家居	130	4,197.70	0.01
104	600746	江苏索普	700	4,123.00	0.01
105	688200	华峰测控	44	4,037.00	0.01
106	000852	石化机械	700	3,752.00	0.01
107	300447	全信股份	300	3,714.00	0.01
108	000776	广发证券	300	3,651.00	0.01
109	603912	佳力图	588	3,528.00	0.01
110	002293	罗莱生活	400	3,232.00	0.01
111	603882	金域医学	100	2,719.00	0.01
112	600887	伊利股份	100	2,584.00	0.00
113	601225	陕西煤业	100	2,577.00	0.00
114	300088	长信科技	500	2,350.00	0.00
115	600188	兖矿能源	100	2,273.00	0.00
116	002402	和而泰	200	2,142.00	0.00
117	600028	中国石化	300	1,896.00	0.00
118	601699	潞安环能	100	1,813.00	0.00
119	002790	瑞尔特	200	1,806.00	0.00
120	601166	兴业银行	100	1,762.00	0.00
121	688639	华恒生物	23	1,756.97	0.00
122	601169	北京银行	300	1,752.00	0.00

123	002132	恒星科技	800	1,696.00	0.00
124	600173	卧龙地产	400	1,496.00	0.00
125	601328	交通银行	200	1,494.00	0.00
126	688400	凌云光	86	1,434.48	0.00
127	601988	中国银行	300	1,386.00	0.00
128	000708	中信特钢	100	1,357.00	0.00
129	600019	宝钢股份	200	1,330.00	0.00
130	600015	华夏银行	200	1,280.00	0.00
131	601818	光大银行	400	1,268.00	0.00
132	600016	民生银行	300	1,137.00	0.00
133	600688	上海石化	400	1,044.00	0.00
134	601009	南京银行	100	1,039.00	0.00
135	601857	中国石油	100	1,032.00	0.00
136	000983	山西焦煤	100	1,031.00	0.00
137	601658	邮储银行	200	1,014.00	0.00
138	688101	三达膜	88	1,001.44	0.00
139	688287	观典防务	190	999.40	0.00
140	001979	招商蛇口	100	879.00	0.00
141	600048	保利发展	100	876.00	0.00
142	000877	天山股份	100	540.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600406	国电南瑞	2,175,638.00	4.14
2	601012	隆基绿能	1,856,700.00	3.53
3	601567	三星医疗	1,661,938.00	3.16
4	601668	中国建筑	1,614,062.00	3.07
5	601877	正泰电器	1,572,736.00	2.99
6	600018	上港集箱	1,513,712.00	2.88
7	300750	宁德时代	1,429,504.26	2.72
8	600562	国睿科技	1,336,846.00	2.54
9	000425	徐工机械	1,269,975.00	2.42
10	601766	中国中车	1,211,526.00	2.30
11	601727	上海电气	1,198,520.00	2.28
12	300124	汇川技术	1,146,785.00	2.18
13	605222	起帆电缆	1,119,759.00	2.13
14	601633	长城汽车	1,084,303.00	2.06

15	601872	招商轮船	1,048,717.00	2.00
16	600066	宇通客车	1,028,227.00	1.96
17	600875	东方电气	1,026,264.00	1.95
18	301056	森赫股份	1,013,771.00	1.93
19	601919	中远海控	972,361.00	1.85
20	600233	圆通速递	961,009.00	1.83

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	601018	宁波港	1,450,391.00	2.76
2	601012	隆基绿能	1,346,628.00	2.56
3	000338	潍柴动力	1,293,782.00	2.46
4	300750	宁德时代	1,279,402.00	2.43
5	601800	中国交建	1,253,260.00	2.38
6	600150	中国船舶	1,253,233.00	2.38
7	601816	京沪高铁	1,245,899.00	2.37
8	601567	三星医疗	1,222,214.00	2.33
9	601766	中国中车	1,185,070.00	2.25
10	600029	南方航空	1,173,851.00	2.23
11	601633	长城汽车	1,137,775.00	2.16
12	600406	国电南瑞	1,132,131.00	2.15
13	605222	起帆电缆	1,099,816.00	2.09
14	603112	华翔股份	1,073,899.00	2.04
15	600312	平高电气	1,060,633.00	2.02
16	300124	汇川技术	1,056,266.00	2.01
17	601616	广电电气	1,037,807.00	1.97
18	300423	昇辉科技	1,007,696.00	1.92
19	600377	宁沪高速	940,797.00	1.79
20	688191	智洋创新	930,238.31	1.77

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	143,154,323.87
卖出股票收入（成交）总额	144,324,910.32

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不

包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，中国船舶重工股份有限公司（601989）于 2023 年 7 月 12 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《立案告知书》（证监立案字 0142023015 号），因公司涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会决定对公司立案。2023 年 12 月 29 日，中国船舶重工股份有限公司收到中国证监会北京监管局下发的《行政处罚决定书》（2023）15 号，因中国船舶重工股份有限公司 2018 年、2019 年、2020 年年度报告存在错报，上述行为违反了 2005 年《证券法》第六十三条及《证券法》第七十八条第二款的规定，构成 2005 年《证券法》第一百九十三条第一款、《证券法》第一百九十七条第二款所述的违法行为，故对中国船舶重工股份有限公司给予警告，并处以 150 万元的罚款。

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	16,960.62
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,313.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	30,274.40
---	----	-----------

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

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 (%)
13,943	2,352.05	7,399,675.66	22.56	25,394,963.37	77.44

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	5,741.49	0.02

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	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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年8月26日） 基金份额总额	241,172,123.23
本报告期期初基金份额总额	33,318,908.00
本报告期基金总申购份额	3,028,673.46
减：本报告期基金总赎回份额	3,552,942.43
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	32,794,639.03

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 2024 年 3 月 30 日发布公告，自 2024 年 3 月 28 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司首席信息官。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未发生重大人事变动。

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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	建信基金管理有限责任公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 1 月 18 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	信息披露不及时
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
民生证券	1	75,162,879.84	26.15	67,910.41	25.88	-
中金公司	2	62,925,022.20	21.89	59,110.26	22.53	-

中信建投	1	62,692,026.93	21.81	58,674.13	22.36	-
兴业证券	2	34,198,402.42	11.90	27,423.91	10.45	-
国泰君安 证券	1	28,596,528.66	9.95	26,763.59	10.20	-
方正证券	3	13,601,498.24	4.73	12,865.75	4.90	-
东北证券	2	10,302,875.90	3.58	9,642.23	3.67	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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

(1) 财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作

高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为；

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

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

(4) 佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内新增东北证券 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(%)
民生证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

东方证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
中信华 南	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国新证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增申万宏源证券有限公司等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	2024 年 3 月 14 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	2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日	7,399,613.90	-	-	7,399,613.90	22.56

产品特有风险

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。

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精工制造指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信精工制造指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信精工制造指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；

- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2024 年 8 月 29 日