

建信中证 500 指数量化增强型发起式证券 投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、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	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54

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	54
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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	57
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金	
基金简称	建信中证 500 指数量化增强	
基金主代码	016267	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 月 23 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	100,189,166.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
下属分级基金的交易代码	016267	016268
报告期末下属分级基金的份额总额	76,189,143.04 份	24,000,023.07 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以标的指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款税后利率 \times 5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
		fangy_20@bankcomm.com

客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	95559
传真	010-66228001	021-62701216
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	100033	200336
法定代表人	生柳荣	任德奇

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2025年1月1日 - 2025年6月30日)	
	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
本期已实现收益	4,436,802.15	1,422,896.22
本期利润	6,028,414.78	1,959,302.27
加权平均基金份额本期利润	0.0720	0.0677
本期加权平均净值利润率	7.01%	6.65%
本期基金份额净值增长率	7.19%	7.03%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025年6月30日)	
	3,730,956.15	983,728.08
期末可供分配利润	0.0490	0.0410

基金份额利润		
期末基金资产净值	82,536,536.53	25,806,858.54
期末基金份额净值	1.0833	1.0753
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	8.33%	7.53%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信中证 500 指数量化增强发起 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.48%	0.72%	4.09%	0.75%	0.39%	-0.03%
过去三个月	4.44%	1.42%	0.97%	1.43%	3.47%	-0.01%
过去六个月	7.19%	1.25%	3.21%	1.29%	3.98%	-0.04%
过去一年	19.20%	1.54%	18.83%	1.64%	0.37%	-0.10%
自基金合同生效起至今	8.33%	1.25%	2.57%	1.33%	5.76%	-0.08%

建信中证 500 指数量化增强发起 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.46%	0.72%	4.09%	0.75%	0.37%	-0.03%
过去三个月	4.37%	1.42%	0.97%	1.43%	3.40%	-0.01%

过去六个月	7.03%	1.25%	3.21%	1.29%	3.82%	-0.04%
过去一年	18.84%	1.54%	18.83%	1.64%	0.01%	-0.10%
自基金合同生效起至今	7.53%	1.25%	2.57%	1.33%	4.96%	-0.08%

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

建信中证500指数量化增强发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信中证500指数量化增强发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，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9000万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至2025年6月30日，公司管理运作177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1.21余万亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘明辉	本基金的基金经理	2022年12月23日	-	9	刘明辉先生，硕士。2015年7月毕业于北京大学应用统计专业，同年7月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部助理研究员、研究员兼投资经理助理、投资经理、基金经理职务。2021年10月27日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2022年10月17日起任建信恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理；2022年12月23日起任建信中证500指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理。
叶乐天	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2022年12月23日	-	17	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的基金经理；2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金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，该基金于 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；2025 年 3 月 25 日起任建信中证 A 股指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 6 月 3 日起任建信中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
叶乐天	公募基金	10	6,728,728,146.64	2012 年 3 月 21 日

私募资产管理计划	1	10,224,667.77	2025 年 2 月 12 日
其他组合	-	-	-
合计	11	6,738,952,814.41	-

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《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管理控制制度。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 4 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，基准指数为中证 500 指数。投资目标是在跟踪指数的同时，通过一定的投资策略获取超额收益，实现 Beta 收益与 Alpha 收益的叠加。报告期内，产品保持了较低的跟踪误差，获得了一定的超额收益。

在报告期内，管理人通过量化模型构建投资组合并进行风险管理。主要模型为多因子模型。

模型主要包括 Alpha 因子模型和风险模型。Alpha 模型部分，管理人充分利用现有各类数据，基于多种数学模型挖掘股票运行规律，构建出稳健的收益预测因子，以识别出预期收益更高的股票，进而构建出多因子模型。管理人利用风险模型控制组合的风险指标、换手率、行业偏移、市场偏移等，保证组合较低的跟踪误差。

主模型外，管理人还利用深度学习策略、SmartBeta 策略、股指期货策略等卫星策略作为主模型的补充，以提高超额收益，增强超额稳定性。

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 7.19%，波动率 1.25%，业绩比较基准收益率 3.21%，波动率 1.29%。本报告期本基金 C 净值增长率 7.03%，波动率 1.25%，业绩比较基准收益率 3.21%，波动率 1.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年，A 股市场在复杂多变的内外部环境中演绎出独特的运行轨迹，整体走势震荡上行，并呈现出风格轮动、结构分化等多重特征。

红利风格在部分时段依然保持着一定的韧性，银行等高股息红利股稳步攀升，受到险资、社保等追求稳健收益的长线资金青睐，成为市场的“压舱石”。成长风格则在市场情绪以及产业政策的带动下，时而表现突出，时而陷入调整。

上半年市场出现多次显著波动。在某一阶段，受到宏观经济数据不及预期以及行业政策调整等因素影响，市场出现短期快速下跌。但随后在政策利好频出，如 5 月“一揽子货币政策”落地，新增结构性工具重点支持科技、消费等领域；新“国九条”强化分红监管等，以及资金入场的推动下迅速反弹。外部环境方面，中美关税联合声明虽暂缓贸易摩擦升级，但特朗普政策反复及持续的中东地缘冲突构成潜在风险，也加剧了市场的不确定性。不过，总体而言，国内政策积极发力托底经济、引导结构转型，在大盘下探时形成了有力支撑，使得 A 股市场展现出较强的韧性。

上半年中证 500 指数实现了 3.31% 的涨幅，跑赢部分大盘指数，如沪深 300 下跌 0.33%。

对于量化投资策略而言，中证 500 指数具有重要意义。微盘股曾是量化基金重要收益来源之一，今年表现依然强势，但市场对其超额收益延续性的分歧扩大。长期来看，中证 500 指数的波动特性以及成分股的成长潜力，依然为通过量化模型获取超额收益提供了机会。

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、风险管理工作的，熟悉业内法律法规的专家型人员。

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，建信基金管理有限责任公司在建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由建信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6. 4. 7. 1	11,633,061.57	13,136,465.42
结算备付金		1,949,572.48	610,626.03
存出保证金		985,723.20	686,352.00
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	94,567,268.78	112,486,735.28
其中：股票投资		94,567,268.78	112,486,735.28
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		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		62,395.82	20,761.63
递延所得税资产		—	—
其他资产	6. 4. 7. 8	—	—
资产总计		109,198,021.85	126,940,940.36
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		—	—
应付赎回款		649,583.93	297,646.43

应付管理人报酬		88,274.68	108,699.11
应付托管费		8,827.48	10,869.90
应付销售服务费		6,374.33	8,933.68
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	101,566.36	150,007.95
负债合计		854,626.78	576,157.07
净资产：			
实收基金	6. 4. 7. 10	100,189,166.11	125,233,352.46
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	8,154,228.96	1,131,430.83
净资产合计		108,343,395.07	126,364,783.29
负债和净资产总计		109,198,021.85	126,940,940.36

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 100,189,166.11 份，其中建信中证 500 指数量化增强发起 A 基金份额总额 76,189,143.04 份，基金份额净值人民币 1.0833 元；建信中证 500 指数量化增强发起 C 基金份额总额 24,000,023.07 份，基金份额净值人民币 1.0753 元。

6.2 利润表

会计主体：建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业收入		8,739,866.46	-6,570,957.62
1. 利息收入		12,221.29	45,428.95
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	12,221.29	45,428.95
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）		6,598,999.58	-5,398,187.22
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	5,675,470.80	-8,914,137.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	-	-
资产支持证券投资 收益	6. 4. 7. 16	-	-

贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	1, 228. 15	1, 141, 139. 04
股利收益	6. 4. 7. 19	922, 300. 63	2, 374, 811. 64
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, 128, 018. 68	-1, 231, 374. 35
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	626. 91	13, 175. 00
减：二、营业总支出		752, 149. 41	1, 150, 098. 10
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	573, 269. 84	878, 666. 46
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	57, 327. 04	87, 866. 68
3. 销售服务费		43, 952. 82	97, 695. 45
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, 457. 75	4, 117. 24
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	76, 141. 96	81, 752. 27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7, 987, 717. 05	-7, 721, 055. 72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7, 987, 717. 05	-7, 721, 055. 72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7, 987, 717. 05	-7, 721, 055. 72

6.3 净资产变动表

会计主体：建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	125, 233, 352. 46	-	1, 131, 430. 83	126, 364, 783. 29

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	125,233,352.46	-	1,131,430.83	126,364,783.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-25,044,186.35	-	7,022,798.13	-18,021,388.22
(一)、综合收益总额	-	-	7,987,717.05	7,987,717.05
(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)	-25,044,186.35	-	-964,918.92	-26,009,105.27
其中：1.基金申购款	6,816,394.91	-	152,609.96	6,969,004.87
2.基金赎回款	-31,860,581.26	-	-1,117,528.88	-32,978,110.14
(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	100,189,166.11	-	8,154,228.96	108,343,395.07
项目	上年度可比期间 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	214,623,580.44	-	-11,560,662.76	203,062,917.68
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	214,623,580.44	-	-11,560,662.76	203,062,917.68

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-41,465,289.69	-	-4,477,030.55	-45,942,320.24
(一)、综合收益总额	-	-	-7,721,055.72	-7,721,055.72
(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)	-41,465,289.69	-	3,244,025.17	-38,221,264.52
其中：1. 基金申购款	23,156,051.58	-	-1,854,350.06	21,301,701.52
2. 基金赎回款	-64,621,341.27	-	5,098,375.23	-59,522,966.04
(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	173,158,290.75	-	-16,037,693.31	157,120,597.44

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：

谢海玉

莫红

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]1423 号《关于准予建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	4,874,564.58
等于：本金	4,874,508.82
加：应计利息	55.76
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	6,758,496.99
等于：本金	6,758,415.46
加：应计利息	81.53
减：坏账准备	-
合计	11,633,061.57

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 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	93,151,650.81	-	94,567,268.78	1,415,617.97
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	93,151,650.81	-	94,567,268.78	1,415,617.97

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍 生工具	-	-	-	-
货币衍 生工具	-	-	-	-
权益衍 生工具	7,883,360.00	-	-	-
其 中：股指 期货投 资	7,883,360.00	-	-	-
其他衍	-	-	-	-

生工具				
合计	7,883,360.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	7.00	8,214,360.00	331,000.00
合计				331,000.00
减：可抵销期货 暂收款				331,000.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

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 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,383.76
其他应付款	27,182.60
合计	101,566.36

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 500 指数量化增强发起 A

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	91,503,593.41	91,503,593.41
本期申购	2,184,965.74	2,184,965.74
本期赎回(以“-”号填列)	-17,499,416.11	-17,499,416.11
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	76,189,143.04	76,189,143.04

建信中证 500 指数量化增强发起 C

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	33,729,759.05	33,729,759.05

本期申购	4,631,429.17	4,631,429.17
本期赎回(以“-”号填列)	-14,361,165.15	-14,361,165.15
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	24,000,023.07	24,000,023.07

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

建信中证 500 指数量化增强发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-464,642.93	1,439,061.48	974,418.55
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-464,642.93	1,439,061.48	974,418.55
本期利润	4,436,802.15	1,591,612.63	6,028,414.78
本期基金份额交易产生的变动数	-241,203.07	-414,236.77	-655,439.84
其中：基金申购款	35,887.65	14,374.56	50,262.21
基金赎回款	-277,090.72	-428,611.33	-705,702.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,730,956.15	2,616,437.34	6,347,393.49

建信中证 500 指数量化增强发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-376,757.29	533,769.57	157,012.28
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-376,757.29	533,769.57	157,012.28
本期利润	1,422,896.22	536,406.05	1,959,302.27
本期基金份额交易产生的变动数	-62,410.85	-247,068.23	-309,479.08
其中：基金申购款	40,270.20	62,077.55	102,347.75
基金赎回款	-102,681.05	-309,145.78	-411,826.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	983,728.08	823,107.39	1,806,835.47

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	2,474.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,370.64
结算备付金利息收入	6,181.54
其他	195.10
合计	12,221.29

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,675,470.80
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	5,675,470.80

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	354,413,961.61
减：卖出股票成本总额	348,229,724.29
减：交易费用	508,766.52
买卖股票差价收入	5,675,470.80

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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	1,228.15

6. 4. 7. 19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	922,300.63
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	922,300.63

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,709,258.68
股票投资	1,709,258.68
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	418,760.00
权证投资	—
期货投资	418,760.00
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	2,128,018.68

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	626.78
基金转换费收入	0.13
合计	626.91

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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—

银行划款手续费	1,750.61
证券组合费	2.79
存托服务费	4.80
合计	76,141.96

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	573,269.84	878,666.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	240,117.94	403,869.15
应支付基金管理人的净管理费	333,151.90	474,797.31

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

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 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	57,327.04	87,866.68

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信中证 500 指数量 化增强发起 A	建信中证 500 指数量 化增强发起 C	合计
建信基金	-	585.24	585.24
交通银行	-	58.48	58.48
中国建设银行	-	4,484.44	4,484.44
合计	-	5,128.16	5,128.16

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C	合计
建信基金	-	4.25	4.25
交通银行	-	11.25	11.25
中国建设银行	-	5,777.83	5,777.83
合计	-	5,793.33	5,793.33

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 0.3%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值×约定年费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
基金合同生效日（2022 年 12 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	14,911,051.41	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份	-	-

额		
报告期末持有的基金份额	14,911,051.41	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.57%	-
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
基金合同生效日(2022年12月23日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,889.08	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,889.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.83%	-

注：分级持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
交通银行-活期	4,874,564.58	2,474.01	3,819,865.12	3,727.85

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（2025 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
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新发未上市	12.30	54.45	108	1,328.40	5,880.60	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新发未上市	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新发未上市	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新发未上市	93.50	90.66	18	1,683.00	1,631.88	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新发未上市	8.60	15.61	182	1,565.20	2,841.02	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新发未上市	20.52	37.47	50	1,026.00	1,873.50	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新发未上市	20.60	35.08	54	1,112.40	1,894.32	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新发未上市	11.50	22.39	82	943.00	1,835.98	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新发未上市	19.88	43.81	49	974.12	2,146.69	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新发未上市	24.18	33.32	47	1,136.46	1,566.04	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新发未上市	19.38	83.49	241	4,670.58	20,121.09	-
688545	兴福	2025	6 个月	新发	11.68	26.95	398	4,648.64	10,726.10	-

	电子	年1月 15日		未上 市						
688757	胜科 纳米	2025 年3月 18日	6个月	新发 未上 市	9.08	25.94	520	4,721.60	13,488.80	-
688758	赛分 科技	2025 年1月 2日	6个月	新发 未上 市	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-

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 2025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	11,633,061.57	-	-	-	11,633,061.57
结算备付金	1,949,572.48	-	-	-	1,949,572.48
存出保证金	985,723.20	-	-	-	985,723.20
交易性金融资产	-	-	-	94,567,268.78	94,567,268.78
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	-	-	-	62,395.82	62,395.82
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,568,357.25	-	-	94,629,664.60	109,198,021.85
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	649,583.93	649,583.93
应付管理人报酬	-	-	-	88,274.68	88,274.68
应付托管费			-	8,827.48	8,827.48
应付销售服务费			-	6,374.33	6,374.33
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	101,566.36	101,566.36
负债总计	-	-	-	854,626.78	854,626.78
利率敏感度缺口	14,568,357.25	-	-	93,775,037.82	108,343,395.07
上年度末 2024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	13,136,465.42	-	-	-	13,136,465.42
结算备付金	610,626.03	-	-	-	610,626.03
存出保证金	686,352.00	-	-	-	686,352.00
交易性金融资产	-	-	-	112,486,735.28	112,486,735.28
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	-	-	-	20,761.63	20,761.63
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,433,443.45	-	-	112,507,496.91	126,940,940.36
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	297,646.43	297,646.43
应付管理人报酬	-	-	-	108,699.11	108,699.11
应付托管费	-	-	-	10,869.90	10,869.90

应付销售服务费	-	-	-	8,933.68	8,933.68
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	150,007.95	150,007.95
负债总计	-	-	-	576,157.07	576,157.07
利率敏感度缺口	14,433,443.45	-	-	111,931,339.84	126,364,783.29

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 2025年6月30日		上年度末 2024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	94,567,268.78	87.28	112,486,735.28	89.02
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	94,567,268.78	87.28	112,486,735.28	89.02

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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		
	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）	
分析		本期末（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
业绩比较基准上升5%	5,033,266.44	5,799,240.73	
	业绩比较基准下降5%	-5,033,266.44	-5,799,240.73

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	94,483,828.84	112,292,318.17
第二层次	-	13,173.30
第三层次	83,439.94	181,243.81

合计	94,567,268.78	112,486,735.28
----	---------------	----------------

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	94,567,268.78	86.60
	其中：股票	94,567,268.78	86.60
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	13,582,634.05	12.44
8	其他各项资产	1,048,119.02	0.96
9	合计	109,198,021.85	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	4,298,203.50	3.97
C	制造业	44,960,558.56	41.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,735,736.00	3.45
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	2,540,316.00	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	2,390,280.00	2.21
H	住宿和餐饮业	26,847.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,022,408.14	7.40
J	金融业	7,353,018.00	6.79
K	房地产业	458,280.00	0.42
L	租赁和商务服务业	368,621.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	517,548.46	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	44,660.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	161,874.00	0.15
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	1,359,863.00	1.26
S	综合	—	—
	合计	76,238,213.66	70.37

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	265,844.00	0.25
C	制造业	14,193,277.78	13.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	51,081.00	0.05
G	交通运输、仓储和	303,810.00	0.28

	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	2,516,555.32	2.32
J	金融业	734,945.00	0.68
K	房地产业	65,129.00	0.06
L	租赁和商务服务业	32,681.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	136,740.02	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	28,992.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,329,055.12	16.92

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	600862	中航高科	52,600	1,371,808.00	1.27
2	000728	国元证券	163,900	1,293,171.00	1.19
3	601577	长沙银行	127,800	1,270,332.00	1.17
4	000893	亚钾国际	41,200	1,241,768.00	1.15
5	600867	通化东宝	145,700	1,194,740.00	1.10
6	600004	白云机场	129,800	1,181,180.00	1.09
7	603893	瑞芯微	7,600	1,154,136.00	1.07
8	601958	金钼股份	104,500	1,143,230.00	1.06
9	600299	安迪苏	116,300	1,122,295.00	1.04
10	603858	步长制药	69,000	1,120,560.00	1.03
11	600909	华安证券	190,900	1,112,947.00	1.03
12	688387	信科移动	196,200	1,108,530.00	1.02
13	601568	北元集团	262,200	1,088,130.00	1.00
14	300476	胜宏科技	7,900	1,061,602.00	0.98
15	002423	中粮资本	86,400	1,056,672.00	0.98

16	600925	苏能股份	193,800	1,013,574.00	0.94
17	000703	恒逸石化	172,100	1,011,948.00	0.93
18	601158	重庆水务	216,600	1,005,024.00	0.93
19	688582	芯动联科	14,600	981,120.00	0.91
20	688608	恒玄科技	2,800	974,344.00	0.90
21	688002	睿创微纳	11,797	822,486.84	0.76
22	000959	首钢股份	237,000	805,800.00	0.74
23	002595	豪迈科技	13,600	805,392.00	0.74
24	600499	科达制造	78,600	770,280.00	0.71
25	600739	辽宁成大	67,300	740,300.00	0.68
26	600528	中铁工业	98,200	724,716.00	0.67
27	688521	芯原股份	7,200	694,800.00	0.64
28	688213	思特威	6,700	684,874.00	0.63
29	600497	驰宏锌锗	125,700	664,953.00	0.61
30	600885	宏发股份	29,760	663,945.60	0.61
31	002410	广联达	49,000	657,090.00	0.61
32	600956	新天绿能	84,700	653,884.00	0.60
33	601233	桐昆股份	61,400	650,840.00	0.60
34	688819	天能股份	23,200	644,032.00	0.59
35	002624	完美世界	41,600	631,072.00	0.58
36	601918	新集能源	96,900	625,974.00	0.58
37	603868	飞科电器	17,400	624,138.00	0.58
38	600901	江苏金租	102,400	620,544.00	0.57
39	600098	广州发展	97,600	610,000.00	0.56
40	600056	中国医药	57,800	597,652.00	0.55
41	688172	燕东微	30,144	592,631.04	0.55
42	603379	三美股份	12,200	587,064.00	0.54
43	000060	中金岭南	127,900	585,782.00	0.54
44	601139	深圳燃气	89,500	569,220.00	0.53
45	000738	航发控制	27,100	562,325.00	0.52
46	600988	赤峰黄金	22,400	557,312.00	0.51
47	600329	达仁堂	16,200	540,432.00	0.50
48	000050	深天马 A	62,200	529,944.00	0.49
49	688248	南网科技	16,451	517,548.46	0.48
50	601665	齐鲁银行	79,800	504,336.00	0.47
51	002517	恺英网络	26,100	503,991.00	0.47
52	601019	山东出版	51,600	488,652.00	0.45
53	601717	中创智领	29,200	485,304.00	0.45
54	600143	金发科技	45,500	469,105.00	0.43
55	000513	丽珠集团	13,000	468,520.00	0.43
56	688475	萤石网络	14,800	466,496.00	0.43
57	601155	新城控股	33,500	458,280.00	0.42
58	601933	永辉超市	93,300	457,170.00	0.42

59	688220	翱捷科技	5,800	454,140.00	0.42
60	600535	天士力	28,700	449,155.00	0.41
61	688578	艾力斯	4,800	446,592.00	0.41
62	600637	东方明珠	58,300	435,501.00	0.40
63	300627	华测导航	12,380	433,300.00	0.40
64	000429	粤高速 A	32,500	433,225.00	0.40
65	002153	石基信息	50,000	433,000.00	0.40
66	601179	中国西电	69,600	427,344.00	0.39
67	002299	圣农发展	29,900	427,271.00	0.39
68	002532	天山铝业	50,500	419,655.00	0.39
69	688052	纳芯微	2,400	418,776.00	0.39
70	603885	吉祥航空	30,900	416,223.00	0.38
71	300699	光威复材	13,030	412,660.10	0.38
72	605589	圣泉集团	14,500	402,375.00	0.37
73	000729	燕京啤酒	30,900	399,537.00	0.37
74	002195	岩山科技	68,200	383,966.00	0.35
75	300339	润和软件	7,500	381,225.00	0.35
76	601990	南京证券	46,100	372,488.00	0.34
77	688617	惠泰医疗	1,250	371,250.00	0.34
78	600968	海油发展	89,900	366,792.00	0.34
79	600131	国网信通	19,600	346,920.00	0.32
80	000997	新大陆	10,700	346,466.00	0.32
81	603816	顾家家居	13,300	339,416.00	0.31
82	300383	光环新网	23,400	334,620.00	0.31
83	300888	稳健医疗	8,100	332,910.00	0.31
84	300140	节能环保	53,800	331,946.00	0.31
85	002138	顺络电子	11,700	329,004.00	0.30
86	300567	精测电子	5,400	327,294.00	0.30
87	688385	复旦微电	6,600	325,182.00	0.30
88	688235	百济神州	1,382	322,890.48	0.30
89	300763	锦浪科技	5,600	321,384.00	0.30
90	688100	威胜信息	8,600	318,630.00	0.29
91	600704	物产中大	60,400	318,308.00	0.29
92	688568	中科星图	8,814	317,392.14	0.29
93	688278	特宝生物	4,400	317,284.00	0.29
94	600578	京能电力	68,100	305,769.00	0.28
95	600563	法拉电子	2,800	305,452.00	0.28
96	600166	福田汽车	109,100	295,661.00	0.27
97	300857	协创数据	3,400	292,604.00	0.27
98	688065	凯赛生物	6,200	292,020.00	0.27
99	000951	中国重汽	16,200	284,796.00	0.26
100	600363	联创光电	4,800	279,984.00	0.26
101	603826	坤彩科技	13,800	270,066.00	0.25

102	601001	晋控煤业	22,100	270,062.00	0.25
103	600298	安琪酵母	7,600	267,292.00	0.25
104	688188	柏楚电子	2,000	263,320.00	0.24
105	688295	中复神鹰	12,600	262,080.00	0.24
106	300017	网宿科技	24,400	261,568.00	0.24
107	301498	乖宝宠物	2,300	251,551.00	0.23
108	002353	杰瑞股份	7,000	245,000.00	0.23
109	688122	西部超导	4,600	238,648.00	0.22
110	002261	拓维信息	7,700	238,315.00	0.22
111	603129	春风动力	1,100	238,150.00	0.22
112	601928	凤凰传媒	21,100	235,687.00	0.22
113	601921	浙版传媒	29,200	235,352.00	0.22
114	300496	中科创达	4,100	234,602.00	0.22
115	601456	国联民生	22,500	232,875.00	0.21
116	600352	浙江龙盛	22,900	232,664.00	0.21
117	600398	海澜之家	32,300	224,808.00	0.21
118	000623	吉林敖东	13,200	223,740.00	0.21
119	603596	伯特利	4,200	221,298.00	0.20
120	688072	拓荆科技	1,400	215,194.00	0.20
121	600109	国金证券	24,400	213,988.00	0.20
122	300458	全志科技	5,300	210,357.00	0.19
123	300765	新诺威	4,000	206,760.00	0.19
124	688114	华大智造	3,171	205,575.93	0.19
125	688183	生益电子	4,000	204,800.00	0.19
126	600839	四川长虹	20,800	202,176.00	0.19
127	000537	中绿电	22,900	191,444.00	0.18
128	688249	晶合集成	9,400	190,538.00	0.18
129	605358	立昂微	7,900	184,070.00	0.17
130	600486	扬农化工	3,100	179,800.00	0.17
131	002739	万达电影	15,000	171,450.00	0.16
132	600995	南网储能	17,500	171,150.00	0.16
133	001213	中铁特货	42,000	170,520.00	0.16
134	688099	晶晨股份	2,400	170,424.00	0.16
135	002056	横店东磁	11,900	168,385.00	0.16
136	002607	中公教育	52,900	161,874.00	0.15
137	002262	恩华药业	7,600	157,928.00	0.15
138	600511	国药股份	5,400	157,464.00	0.15
139	300058	蓝色光标	23,200	152,192.00	0.14
140	002155	湖南黄金	8,210	146,548.50	0.14
141	002065	东华软件	15,100	144,960.00	0.13
142	000785	居然智家	47,400	144,570.00	0.13
143	688469	芯联集成	27,600	131,652.00	0.12
144	603298	杭叉集团	6,100	127,795.00	0.12

145	003031	中瓷电子	2,300	122,383.00	0.11
146	300251	光线传媒	6,000	121,620.00	0.11
147	600380	健康元	11,000	121,330.00	0.11
148	002025	航天电器	2,300	118,243.00	0.11
149	000783	长江证券	17,000	117,810.00	0.11
150	600316	洪都航空	3,100	116,870.00	0.11
151	600517	国网英大	22,800	116,280.00	0.11
152	000958	电投产融	16,200	110,808.00	0.10
153	000062	深圳华强	4,100	110,126.00	0.10
154	688027	国盾量子	400	110,004.00	0.10
155	688281	华秦科技	1,800	108,918.00	0.10
156	000898	鞍钢股份	44,900	104,168.00	0.10
157	300454	深信服	1,100	103,598.00	0.10
158	603529	爱玛科技	3,000	103,200.00	0.10
159	688361	中科飞测	1,200	101,028.00	0.09
160	001389	广合科技	1,700	99,909.00	0.09
161	603156	养元饮品	4,700	99,452.00	0.09
162	002202	金风科技	9,100	93,275.00	0.09
163	000559	万向钱潮	12,100	92,565.00	0.09
164	300604	长川科技	1,800	80,838.00	0.07
165	600977	中国电影	7,500	80,400.00	0.07
166	603233	大参林	4,300	70,090.00	0.06
167	603658	安图生物	1,800	67,500.00	0.06
168	002851	麦格米特	1,300	65,182.00	0.06
169	300748	金力永磁	2,600	61,984.00	0.06
170	600906	财达证券	8,800	60,016.00	0.06
171	002461	珠江啤酒	5,300	59,837.00	0.06
172	600873	梅花生物	5,500	58,795.00	0.05
173	601000	唐山港	14,200	57,652.00	0.05
174	600685	中船防务	2,100	57,099.00	0.05
175	002120	韵达股份	8,500	56,950.00	0.05
176	600038	中直股份	1,400	54,334.00	0.05
177	002281	光迅科技	1,100	54,252.00	0.05
178	002080	中材科技	2,700	52,650.00	0.05
179	002294	信立泰	1,100	52,063.00	0.05
180	000988	华工科技	1,100	51,711.00	0.05
181	601168	西部矿业	3,100	51,553.00	0.05
182	002568	百润股份	2,000	51,220.00	0.05
183	002444	巨星科技	2,000	51,020.00	0.05
184	600312	平高电气	3,300	50,787.00	0.05
185	000960	锡业股份	3,300	50,490.00	0.05
186	688772	珠海冠宇	3,518	50,272.22	0.05
187	000733	振华科技	1,000	50,050.00	0.05

188	688017	绿的谐波	400	49,956.00	0.05
189	600132	重庆啤酒	900	49,590.00	0.05
190	002185	华天科技	4,900	49,490.00	0.05
191	603087	甘李药业	900	49,302.00	0.05
192	600699	均胜电子	2,800	48,832.00	0.05
193	300803	指南针	600	48,396.00	0.04
194	000598	兴蓉环境	6,700	48,307.00	0.04
195	002414	高德红外	4,700	48,175.00	0.04
196	300207	欣旺达	2,400	48,144.00	0.04
197	600998	九州通	9,300	47,802.00	0.04
198	002939	长城证券	5,700	47,766.00	0.04
199	300573	兴齐眼药	920	47,646.80	0.04
200	002683	广东宏大	1,400	47,516.00	0.04
201	002958	青农商行	13,000	46,930.00	0.04
202	601598	中国外运	9,500	46,835.00	0.04
203	600062	华润双鹤	2,500	46,650.00	0.04
204	601555	东吴证券	5,300	46,375.00	0.04
205	600498	烽火通信	2,200	46,266.00	0.04
206	000039	中集集团	5,800	45,588.00	0.04
207	002841	视源股份	1,300	44,980.00	0.04
208	002266	浙富控股	14,500	44,660.00	0.04
209	600487	亨通光电	2,900	44,370.00	0.04
210	002821	凯莱英	500	44,125.00	0.04
211	000987	越秀资本	6,400	43,904.00	0.04
212	000921	海信家电	1,700	43,690.00	0.04
213	600282	南钢股份	10,400	43,680.00	0.04
214	600153	建发股份	4,200	43,554.00	0.04
215	300724	捷佳伟创	800	43,440.00	0.04
216	688425	铁建重工	10,600	43,248.00	0.04
217	600126	杭钢股份	4,800	43,200.00	0.04
218	600583	海油工程	7,900	43,134.00	0.04
219	600582	天地科技	7,200	43,128.00	0.04
220	601997	贵阳银行	6,900	43,056.00	0.04
221	300054	鼎龙股份	1,500	43,020.00	0.04
222	300595	欧普康视	2,800	42,756.00	0.04
223	300037	新宙邦	1,200	42,240.00	0.04
224	002507	涪陵榨菜	3,300	42,207.00	0.04
225	002318	久立特材	1,800	42,102.00	0.04
226	000034	神州数码	1,100	41,404.00	0.04
227	601991	大唐发电	13,000	41,210.00	0.04
228	603225	新凤鸣	3,800	40,470.00	0.04
229	300677	英科医疗	1,700	40,256.00	0.04
230	600096	云天化	1,800	39,546.00	0.04

231	600060	海信视像	1,700	39,134.00	0.04
232	601108	财通证券	4,800	37,968.00	0.04
233	688777	中控技术	800	35,928.00	0.03
234	603650	彤程新材	1,100	35,365.00	0.03
235	600390	五矿资本	6,000	34,980.00	0.03
236	600118	中国卫星	1,200	34,284.00	0.03
237	001696	宗申动力	1,500	33,675.00	0.03
238	688778	厦钨新能	600	33,552.00	0.03
239	002430	杭氧股份	1,700	33,014.00	0.03
240	000932	华菱钢铁	7,400	32,560.00	0.03
241	603979	金诚信	700	32,508.00	0.03
242	002926	华西证券	3,600	32,184.00	0.03
243	688297	中无人机	600	32,040.00	0.03
244	603659	璞泰来	1,700	31,926.00	0.03
245	000423	东阿阿胶	600	31,380.00	0.03
246	301358	湖南裕能	1,000	31,190.00	0.03
247	300395	菲利华	600	30,660.00	0.03
248	300757	罗博特科	200	29,994.00	0.03
249	601615	明阳智能	2,600	29,874.00	0.03
250	300450	先导智能	1,200	29,820.00	0.03
251	689009	九号公司	500	29,585.00	0.03
252	300024	机器人	1,700	29,206.00	0.03
253	600483	福能股份	3,000	28,920.00	0.03
254	601106	中国一重	10,200	28,560.00	0.03
255	000415	渤海租赁	8,500	28,305.00	0.03
256	600361	创新新材	7,000	27,930.00	0.03
257	603565	中谷物流	2,900	27,695.00	0.03
258	300558	贝达药业	469	27,178.55	0.03
259	600258	首旅酒店	1,900	26,847.00	0.02
260	600373	中文传媒	2,600	26,702.00	0.02
261	600801	华新水泥	2,000	23,680.00	0.02
262	603899	晨光股份	800	23,192.00	0.02

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	603699	纽威股份	20,400	635,868.00	0.59
2	688636	智明达	15,688	530,097.52	0.49
3	600883	博闻科技	58,300	457,655.00	0.42
4	000686	东北证券	59,400	453,222.00	0.42
5	002394	联发股份	49,500	407,385.00	0.38
6	601702	华峰铝业	24,600	390,894.00	0.36
7	688458	美芯晟	7,200	339,552.00	0.31
8	301119	正强股份	9,500	335,920.00	0.31

9	002625	光启技术	8,200	327,836.00	0.30
10	001336	楚环科技	15,200	323,304.00	0.30
11	002847	盐津铺子	4,000	321,600.00	0.30
12	301276	嘉曼服饰	17,300	314,687.00	0.29
13	600350	山东高速	28,500	303,810.00	0.28
14	603040	新坐标	7,200	289,224.00	0.27
15	000404	长虹华意	40,700	288,970.00	0.27
16	600596	新安股份	34,200	277,020.00	0.26
17	603558	健盛集团	29,900	272,389.00	0.25
18	001339	智微智能	5,600	270,648.00	0.25
19	301503	智迪科技	7,100	270,155.00	0.25
20	001283	豪鹏科技	4,900	266,805.00	0.25
21	301278	快可电子	8,000	266,640.00	0.25
22	688071	华依科技	7,000	255,150.00	0.24
23	688358	祥生医疗	8,600	254,990.00	0.24
24	688657	浩辰软件	6,000	254,820.00	0.24
25	300750	宁德时代	1,000	252,220.00	0.23
26	001332	锡装股份	6,800	243,712.00	0.22
27	688256	寒武纪	400	240,600.00	0.22
28	301157	华塑科技	5,100	240,414.00	0.22
29	603270	金帝股份	9,300	238,917.00	0.22
30	603766	隆鑫通用	18,600	237,336.00	0.22
31	301232	飞沃科技	7,700	236,621.00	0.22
32	300445	康斯特	13,800	235,290.00	0.22
33	688602	康鹏科技	27,800	232,964.00	0.22
34	301528	多浦乐	4,300	231,426.00	0.21
35	002396	星网锐捷	10,300	231,235.00	0.21
36	605086	龙高股份	8,500	226,270.00	0.21
37	688018	乐鑫科技	1,520	222,072.00	0.20
38	300006	莱美药业	58,200	218,250.00	0.20
39	688229	博睿数据	4,200	213,990.00	0.20
40	002881	美格智能	4,200	194,880.00	0.18
41	688118	普元信息	8,200	183,270.00	0.17
42	002891	中宠股份	2,900	179,423.00	0.17
43	688136	科兴制药	4,600	175,812.00	0.16
44	688682	霍莱沃	5,600	175,280.00	0.16
45	688168	安博通	2,400	170,088.00	0.16
46	688058	宝兰德	5,800	166,286.00	0.15
47	300879	大叶股份	4,200	164,976.00	0.15
48	605080	浙江自然	5,500	152,900.00	0.14
49	688266	泽璟制药	1,400	150,514.00	0.14
50	603115	海星股份	9,900	142,857.00	0.13
51	300329	海伦钢琴	18,300	138,714.00	0.13

52	300489	光智科技	3,100	136,896.00	0.13
53	688258	卓易信息	2,800	135,604.00	0.13
54	688685	迈信林	2,400	134,040.00	0.12
55	688579	山大地纬	11,600	129,804.00	0.12
56	603416	信捷电气	2,200	123,354.00	0.11
57	000553	安道麦 A	17,000	122,740.00	0.11
58	301316	慧博云通	2,800	120,624.00	0.11
59	300984	金沃股份	2,100	120,225.00	0.11
60	300241	瑞丰光电	21,000	119,700.00	0.11
61	688182	灿勤科技	4,200	115,752.00	0.11
62	688588	凌志软件	7,800	113,646.00	0.10
63	688081	兴图新科	5,400	112,374.00	0.10
64	603039	泛微网络	2,000	111,400.00	0.10
65	003041	真爱美家	3,900	107,679.00	0.10
66	603969	银龙股份	14,400	105,552.00	0.10
67	688209	英集芯	5,600	103,432.00	0.10
68	603612	索通发展	5,600	102,928.00	0.10
69	688629	华丰科技	1,600	91,520.00	0.08
70	300871	回盛生物	4,100	85,690.00	0.08
71	300033	同花顺	300	81,903.00	0.08
72	301080	百普赛斯	1,000	71,530.00	0.07
73	300779	惠城环保	400	71,396.00	0.07
74	688008	澜起科技	800	65,600.00	0.06
75	600592	龙溪股份	2,600	62,790.00	0.06
76	603444	吉比特	200	60,390.00	0.06
77	603799	华友钴业	1,600	59,232.00	0.05
78	300363	博腾股份	3,400	58,072.00	0.05
79	688369	致远互联	2,200	58,058.00	0.05
80	688502	茂莱光学	200	57,532.00	0.05
81	603009	北特科技	1,200	50,040.00	0.05
82	601319	中国人保	5,700	49,647.00	0.05
83	002487	大金重工	1,400	46,060.00	0.04
84	688141	杰华特	1,400	45,612.00	0.04
85	688395	正弦电气	2,000	45,360.00	0.04
86	600889	南京化纤	2,900	44,515.00	0.04
87	300009	安科生物	5,300	44,361.00	0.04
88	603259	药明康德	600	41,730.00	0.04
89	603822	嘉澳环保	800	41,704.00	0.04
90	002364	中恒电气	2,700	41,418.00	0.04
91	300502	新易盛	320	40,646.40	0.04
92	002001	新和成	1,900	40,413.00	0.04
93	603993	洛阳钼业	4,700	39,574.00	0.04
94	688591	泰凌微	800	38,320.00	0.04

95	301076	新瀚新材	1,100	38,258.00	0.04
96	300113	顺网科技	1,900	37,544.00	0.03
97	600482	中国动力	1,600	36,912.00	0.03
98	002315	焦点科技	800	36,552.00	0.03
99	603855	华荣股份	1,600	35,408.00	0.03
100	002597	金禾实业	1,500	35,325.00	0.03
101	603267	鸿远电子	700	35,189.00	0.03
102	601336	新华保险	600	35,100.00	0.03
103	603236	移远通信	400	34,320.00	0.03
104	600866	星湖科技	4,900	33,859.00	0.03
105	002690	美亚光电	2,000	33,740.00	0.03
106	000560	我爱我家	11,100	32,967.00	0.03
107	002170	芭田股份	3,200	32,800.00	0.03
108	300662	科锐国际	1,100	32,681.00	0.03
109	601126	四方股份	2,000	32,540.00	0.03
110	001914	招商积余	2,600	32,162.00	0.03
111	000776	广发证券	1,900	31,939.00	0.03
112	688800	瑞可达	600	29,520.00	0.03
113	002895	川恒股份	1,300	29,328.00	0.03
114	603199	九华旅游	800	28,992.00	0.03
115	688088	虹软科技	600	28,950.00	0.03
116	300570	太辰光	300	28,914.00	0.03
117	603456	九洲药业	1,900	28,899.00	0.03
118	688025	杰普特	400	28,600.00	0.03
119	600926	杭州银行	1,700	28,594.00	0.03
120	688286	敏芯股份	400	28,276.00	0.03
121	600216	浙江医药	1,900	28,101.00	0.03
122	601138	工业富联	1,300	27,794.00	0.03
123	002876	三利谱	1,100	27,709.00	0.03
124	688488	艾迪药业	2,000	27,700.00	0.03
125	002736	国信证券	2,400	27,648.00	0.03
126	300035	中科电气	1,600	27,008.00	0.02
127	002948	青岛银行	5,400	26,892.00	0.02
128	301078	孩子王	2,000	26,140.00	0.02
129	688668	鼎通科技	400	24,984.00	0.02
130	300475	香农芯创	700	24,941.00	0.02
131	688411	海博思创	241	20,121.09	0.02
132	688757	胜科纳米	520	13,488.80	0.01
133	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
134	688545	兴福电子	398	10,726.10	0.01
135	688710	益诺思	233	8,117.72	0.01
136	002339	积成电子	900	7,128.00	0.01
137	300768	迪普科技	400	6,860.00	0.01

138	603395	红四方	200	6,746.00	0.01
139	301617	博苑股份	163	6,691.15	0.01
140	301586	佳力奇	115	6,555.00	0.01
141	301585	蓝宇股份	191	6,551.30	0.01
142	688314	康拓医疗	199	6,145.12	0.01
143	603072	天和磁材	108	5,880.60	0.01
144	688109	品茗科技	164	5,105.32	0.00
145	603205	健尔康	128	4,944.64	0.00
146	603194	中力股份	101	4,584.39	0.00
147	301220	亚香股份	100	4,490.00	0.00
148	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
149	603210	泰鸿万立	182	2,841.02	0.00
150	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
151	603400	华之杰	49	2,146.69	0.00
152	603271	永杰新材	54	1,894.32	0.00
153	603257	中国瑞林	50	1,873.50	0.00
154	603382	海阳科技	82	1,835.98	0.00
155	603202	天有为	18	1,631.88	0.00
156	603310	巍华新材	83	1,588.62	0.00
157	603409	汇通控股	47	1,566.04	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	603893	瑞芯微	2,855,089.00	2.26
2	603129	春风动力	2,371,716.00	1.88
3	600499	科达制造	1,986,044.00	1.57
4	002625	光启技术	1,927,140.00	1.53
5	600988	赤峰黄金	1,817,263.00	1.44
6	688608	恒玄科技	1,764,741.08	1.40
7	601702	华峰铝业	1,662,219.00	1.32
8	601918	新集能源	1,550,258.00	1.23
9	601019	山东出版	1,548,348.00	1.23
10	600704	物产中大	1,547,594.00	1.22
11	000997	新大陆	1,473,344.00	1.17
12	688213	思特威	1,457,028.71	1.15
13	002461	珠江啤酒	1,448,981.95	1.15
14	601577	长沙银行	1,443,455.00	1.14
15	000825	太钢不锈	1,375,590.00	1.09
16	603658	安图生物	1,356,888.40	1.07
17	002532	天山铝业	1,354,324.00	1.07
18	600885	宏发股份	1,353,517.00	1.07

19	688100	威胜信息	1,344,732.56	1.06
20	300476	胜宏科技	1,337,539.00	1.06

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交量），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	600704	物产中大	3,159,086.00	2.50
2	600352	浙江龙盛	3,067,355.00	2.43
3	002625	光启技术	3,036,375.00	2.40
4	603129	春风动力	2,472,451.00	1.96
5	000039	中集集团	2,216,550.00	1.75
6	000997	新大陆	2,155,582.00	1.71
7	600418	江淮汽车	2,146,257.00	1.70
8	600153	建发股份	2,094,814.00	1.66
9	600316	洪都航空	2,083,990.00	1.65
10	300476	胜宏科技	2,072,556.00	1.64
11	002532	天山铝业	1,994,790.00	1.58
12	603893	瑞芯微	1,875,065.00	1.48
13	000088	盐田港	1,839,784.00	1.46
14	600927	永安期货	1,796,238.00	1.42
15	300529	健帆生物	1,783,044.00	1.41
16	601155	新城控股	1,769,400.00	1.40
17	000728	国元证券	1,768,742.00	1.40
18	600536	中国软件	1,623,654.00	1.28
19	002500	山西证券	1,623,517.00	1.28
20	000878	云南铜业	1,607,978.00	1.27

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交量），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	328,600,999.11
卖出股票收入（成交）总额	354,413,961.61

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。本基金利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位交易频率，降低交易成本，提高资金使用效率，降低跟踪误差，同时利用基差进行增强，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策
无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	985,723.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	62,395.82
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,048,119.02

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
建信中证 500 指数量化增强发起 A	1,602	47,558.77	15,399,162.99	20.21	60,789,980.05	79.79
建信中证 500 指数量化增强发起 C	1,801	13,325.94	14,080.46	0.06	23,985,942.61	99.94
合计	3,403	29,441.42	15,413,243.45	15.38	84,775,922.66	84.62

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)

基金管理人所有从业人员持有本基金	建信中证 500 指数量化增强发起 A	128,521.41	0.17
	建信中证 500 指数量化增强发起 C	-	-
	合计	128,521.41	0.13

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信中证 500 指数量化增强发起 A	-
	建信中证 500 指数量化增强发起 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	建信中证 500 指数量化增强发起 A	10~50
	建信中证 500 指数量化增强发起 C	-
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	14,911,051.41	14.88	10,001,889.08	9.98	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	119,512.58	0.12	-	-	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	15,030,563.99	15.00	10,001,889.08	9.98	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
基金合同生效日 (2022 年 12 月 23 日) 基金份额总额	12,099,599.84	1,238,351.04
本报告期期初基金份 额总额	91,503,593.41	33,729,759.05
本报告期基金总申购 份额	2,184,965.74	4,631,429.17
减：本报告期基金总 赎回份额	17,499,416.11	14,361,165.15
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	76,189,143.04	24,000,023.07

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 2025 年 1 月 25 日发布公告，自 2025 年 1 月 24 日起聘任张铮先生担任建信基金管理有限责任公司副总裁。上述事项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

本报告期内无其他涉及本基金管理业务、基金财产、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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
国信证券	3	682,738,805. 16	100.00	287,189.45	100.00	-

注：1、公司选择证券公司的标准

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 10 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，研究业务线最近两年未因发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；
- (6) 能及时为公司提供高质量的研究服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走势分析、个股分析报告及其他专门报告。

2、证券公司服务评价程序

- (1) 证券公司服务的评价包括定期的证券公司评价打分以及对证券公司投研支持服务的定额激励。
- (2) 公司对证券公司实行“核心名单”管理。在所有公司合作机构中筛选部分机构进入“核心名单”。公司的评价打分仅针对进入“核心名单”的机构，“核心名单”定期调整、动态优化。
- (3) 定期的证券公司评价打分：根据证券公司服务记录，投研人员定期在投研系统平台对核心名单的证券公司服务进行评价打分。
- (4) 证券公司服务的定额激励：根据证券公司服务记录，投研各部门可提出定额激励作为对证券公司投研支持服务的补充激励。证券公司投研支持服务的范围包括但不限于：重点推荐、

定向路演邀请、投研课题委托、产业链调研、数据模型及支持等服务内容。

(5) 证券公司服务评价、交易佣金分配建议等证券公司服务的定期考核评价结果，由研究部进行汇总，提交公司投资决策委员会授权的投研部门总经理联席会议审议。

3、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。

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(%)
国信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增邮储银行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	2025年5月24日
2	关于新增民生银行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	2025年5月20日
3	关于新增国泰君安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	2025年3月26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中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金托管协议》；

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

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2025 年 8 月 29 日