

建信中证 500 指数增强型证券投资基金 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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63

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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	64
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 500 指数增强型证券投资基金			
基金简称	建信中证 500 指数增强			
基金主代码	000478			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2014 年 1 月 27 日			
基金管理人	建信基金管理有限责任公司			
基金托管人	中信银行股份有限公司			
报告期末基金份 额总额	1,645,089,936.13 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 指数增 强 A	建信中证 500 指数增 强 C	建信中证 500 指 数增强 E	建信中证 500 指数 增强 Y
下属分级基金的交 易代码	000478	005633	021852	022946
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,471,135,293.82 份	172,720,614.84 份	41,398.43 份	1,192,629.04 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，以中证 500 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，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。 在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×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	滕菲菲
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-81-95533; 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区光华路 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(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)			
	建信中证 500 指数 增强 A	建信中证 500 指数 增强 C	建信中证 500 指数 增强 E	建信中证 500 指数 增强 Y
本期已实 现收益	109,312,804.61	15,641,074.31	2,597.15	77,957.18
本期利润	217,190,441.64	26,768,237.11	5,532.32	195,084.60
加权平均 基金份 额 本期利润	0.1429	0.1161	0.1343	0.1994

本期加权 平均净值 利润率	5.50%	4.63%	5.35%	7.64%
本期基金 份额净值 增长率	5.60%	5.34%	5.34%	5.92%
3.1.2 期末数 据和指 标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)			
期末可供 分配利润	2,534,410,195.68	280,458,548.32	67,361.59	2,065,534.40
期末可供 分配基金 份额利润	1.7228	1.6238	1.6272	1.7319
期末基金 资产净值	4,005,545,489.50	453,179,163.16	108,760.02	3,258,163.44
期末基金 份额净值	2.7228	2.6238	2.6272	2.7319
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	172.28%	10.56%	15.73%	3.70%

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 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.57%	0.65%	4.09%	0.75%	0.48%	-0.10%
过去三个月	3.23%	1.39%	0.97%	1.43%	2.26%	-0.04%
过去六个月	5.60%	1.21%	3.21%	1.29%	2.39%	-0.08%
过去一年	14.92%	1.46%	18.83%	1.64%	-3.91%	-0.18%
过去三年	-7.38%	1.17%	-7.61%	1.29%	0.23%	-0.12%
自基金合同生效起至今	172.28%	1.51%	52.03%	1.50%	120.25%	0.01%

建信中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.53%	0.65%	4.09%	0.75%	0.44%	-0.10%
过去三个月	3.10%	1.39%	0.97%	1.43%	2.13%	-0.04%
过去六个月	5.34%	1.21%	3.21%	1.29%	2.13%	-0.08%
过去一年	14.35%	1.46%	18.83%	1.64%	-4.48%	-0.18%
过去三年	-8.76%	1.17%	-7.61%	1.29%	-1.15%	-0.12%
自基金合同生效起至今	10.56%	1.31%	-2.63%	1.34%	13.19%	-0.03%

建信中证 500 指数增强 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.52%	0.65%	4.09%	0.75%	0.43%	-0.10%
过去三个月	3.10%	1.39%	0.97%	1.43%	2.13%	-0.04%
过去六个月	5.34%	1.21%	3.21%	1.29%	2.13%	-0.08%
自基金合同生效起至今	15.73%	1.46%	20.35%	1.65%	-4.62%	-0.19%

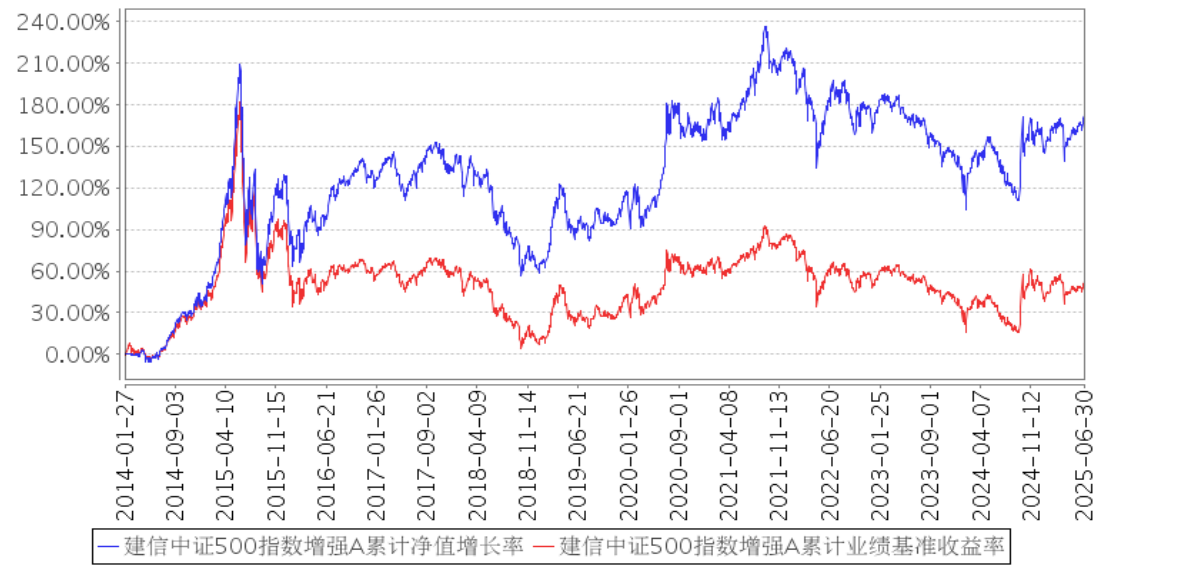
建信中证 500 指数增强 Y

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

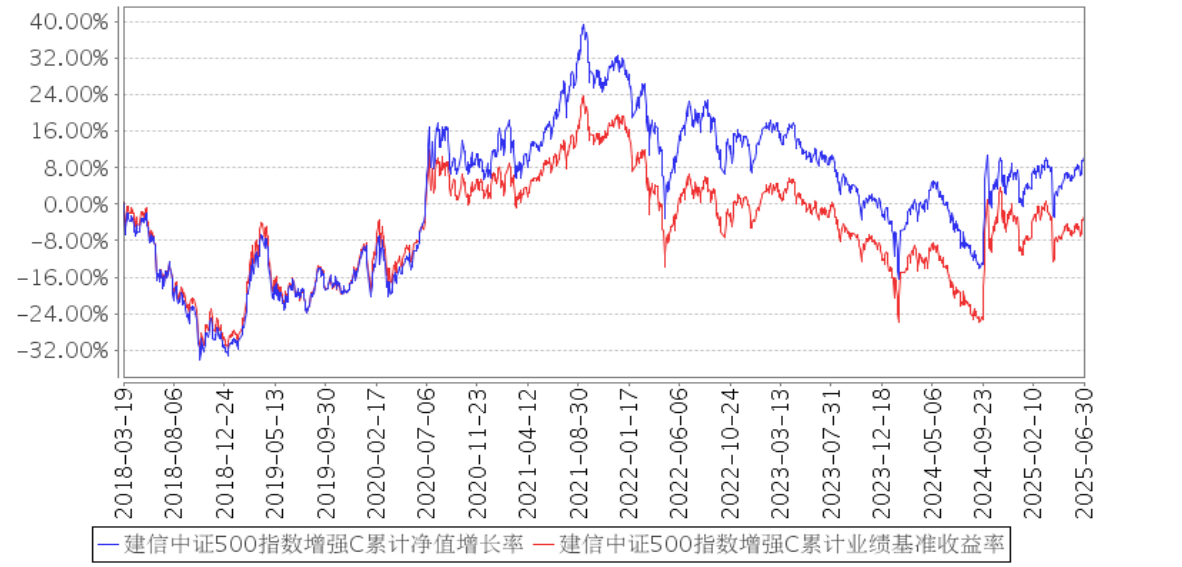
	率①	准差②		④		
过去一个月	4.62%	0.65%	4.09%	0.75%	0.53%	-0.10%
过去三个月	3.39%	1.39%	0.97%	1.43%	2.42%	-0.04%
过去六个月	5.92%	1.21%	3.21%	1.29%	2.71%	-0.08%
自基金合同生效起 至今	3.70%	1.19%	-1.09%	1.28%	4.79%	-0.09%

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

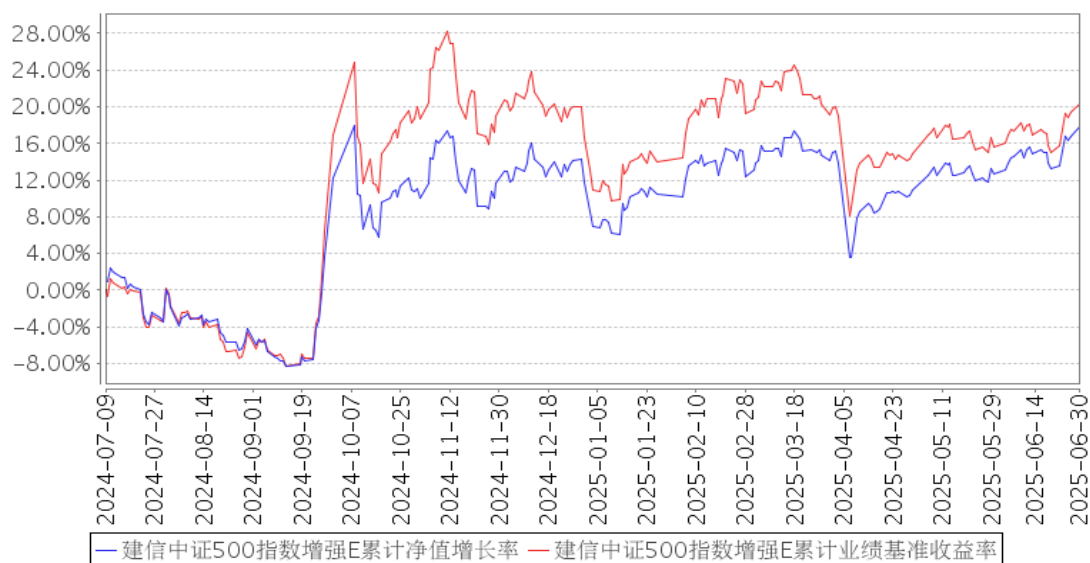
建信中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



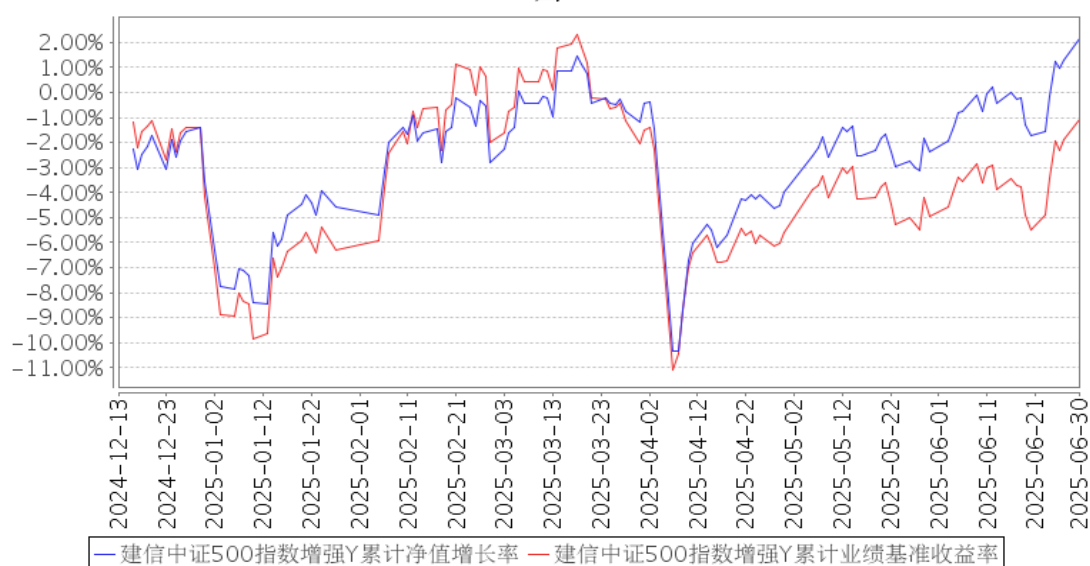
建信中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



建信中证500指数增强Y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		
叶乐天	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2014 年 1 月 27 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合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信中证 500 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 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，管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型进行指数增强和风险管理。本基金从成立以来一直严格控制与标的指数的行业偏离和风格偏离，在个股选择上进行了一定的主动暴露。由于基金规模相对较大，基金管理人采用分散持仓、适当降低换手率、采用算法交易等方式尽量降低交易成本，同时对风险事件进行实时监控，以尽量避免负面事件影响。报告期内市场环境变化较大，市场波动和风格变动都较为明显，但本基金仍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 A 净值增长率 5.60%，波动率 1.21%，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 5.34%，波动率 1.21%，业绩比较基准收益率 3.21%，波动率 1.29%。本报告期本基金 E 净值增长率 5.34%，波动率 1.21%，业绩比较基准收益率 3.21%，波动率 1.29%。本报告期本基金 Y 净值增长率 5.92%，波动率 1.21%，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

在报告期内，指数前期整体呈现震荡走势，在四月初，受到中美贸易摩擦的影响，有一个大幅下跌的过程，但随后随着政策呵护，经济基本面好转，贸易摩擦降低，指数持续震荡上行，整个报告期有显著正收益。在风格方面，以微盘股为代表的小市值股票表现更为优异，显示出投资者情绪和流动性都在好转。

展望 2025 年下半年，科技主题或是一个贯穿全年的一条主线，另外小市值占优的格局预计仍会持续一段时间，但个股的选择仍然比风格选择更为重要。整体来看，结构性行情仍然存在，建议均衡风格配置，优选基本面边际改善的个股。

本基金管理人将持续改进量化模型，积极捕捉市场可能的机会，并控制好交易成本，力争超越基准指数。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，对建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 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中证 500 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内容的真实、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 2025 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：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

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	237,336,806.71	252,913,355.45
结算备付金		437,582,976.34	399,001,293.97
存出保证金		41,846,140.81	45,887,034.43
交易性金融资产	6.4.7.2	3,770,012,425.05	4,095,794,434.07
其中：股票投资		3,770,012,425.05	4,095,794,434.07
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		10,128,689.49	21,387,584.72
应收股利		-	-
应收申购款		652,286.36	1,592,253.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,497,559,324.76	4,816,575,956.41
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		7,177,731.56	1,376,408.29
应付赎回款		13,689,540.22	7,507,769.57
应付管理人报酬		3,600,361.85	4,270,205.16
应付托管费		720,072.35	854,041.02
应付销售服务费		181,908.77	331,488.33
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	10,098,133.89	13,209,319.61
负债合计		35,467,748.64	27,549,231.98
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	1,645,089,936.13	1,867,902,194.77
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,817,001,639.99	2,921,124,529.66
净资产合计		4,462,091,576.12	4,789,026,724.43
负债和净资产总计		4,497,559,324.76	4,816,575,956.41

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,645,089,936.13 份，其中建信中证 500 指数增强 A 基金份额总额 1,471,135,293.82 份，基金份额净值人民币 2.7228 元；建信中证 500 指数增强 C 基金份额总额 172,720,614.84 份，基金份额净值人民币 2.6238 元；建信中证 500 指数增强 E 基金份额总额 41,398.43 份，基金份额净值人民币 2.6272 元；建信中证 500 指数增强 Y 基金份额总额 1,192,629.04 份，基金份额净值人民币 2.7319 元。

6.2 利润表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

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、营业总收入		272,883,128.06	-81,123,485.43
1. 利息收入		3,096,358.99	4,415,106.45
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,096,358.99	4,415,106.45
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）		150,511,288.62	-131,125,715.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	99,559,345.68	-167,040,005.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	7,115,216.14	-39,643,432.87
股利收益	6.4.7.19	43,836,726.80	75,557,722.78
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	119,124,862.42	45,440,047.28
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	150,618.03	147,075.95
减：二、营业总支出		28,723,832.39	33,661,949.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,460,579.93	25,441,704.63
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,492,116.04	5,088,340.91
3. 销售服务费		1,439,179.49	2,608,185.96
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		58,983.52	-
8. 其他费用	6.4.7.23	272,973.41	523,717.97

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		244,159,295.67	-114,785,434.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		244,159,295.67	-114,785,434.90
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		244,159,295.67	-114,785,434.90

6.3 净资产变动表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

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	1,867,902,194.77	-	2,921,124,529.66	4,789,026,724.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,867,902,194.77	-	2,921,124,529.66	4,789,026,724.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-222,812,258.64	-	-104,122,889.67	-326,935,148.31
（一）、综合收益总额	-	-	244,159,295.67	244,159,295.67
（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）	-222,812,258.64	-	-348,282,185.34	-571,094,443.98
其中：1. 基金申购款	69,140,323.73	-	108,449,784.69	177,590,108.42
2. 基金赎回款	-291,952,582.37	-	-456,731,970.03	-748,684,552.40
（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	1,645,089,936.13	-	2,817,001,639.99	4,462,091,576.12
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	2,030,522,283.97	-	2,869,475,497.50	4,899,997,781.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,030,522,283.97	-	2,869,475,497.50	4,899,997,781.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	146,658,851.80	-	75,731,674.93	222,390,526.73
（一）、综合收益总额	-	-	-114,785,434.90	-114,785,434.90
（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）	146,658,851.80	-	190,517,109.83	337,175,961.63
其中：1. 基金申购款	286,240,669.32	-	382,427,537.34	668,668,206.66
2. 基金赎回款	-139,581,817.52	-	-191,910,427.51	-331,492,245.03
（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	2,177,181,135.77	-	2,945,207,172.43	5,122,388,308.20

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

基金管理人负责人

莫红

主管会计工作负责人

丁颖

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[2013]615 号《关于核准建信中证 500 指数增强型证券投资基金募集的批复》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人民币 308,106,805.84 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（2014）第 039 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2014 年 1 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 308,165,342.91 份基金份额，其中认购资金利息折合 58,537.07 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《建信中证 500 指数增强型证券投资基金新增 C 类基金份额及修改基金合同的公告》并报证监会备案，本基金于 2018 年 3 月 16 日起根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同，将本基金基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取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申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。2018 年 3 月 16 日前原有的基金份额在开放申购赎回后，全

部转换为建信中证 500 指数增强 A 类基金份额。

根据《建信中证 500 指数增强型证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2024 年 7 月 9 日起本基金新增 E 类基金份额，从本类别基金资产中计提销售服务费，且在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用。根据更新的《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《建信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金份额包括建信中证 500 指数增强基金之 A 类份额、建信中证 500 指数增强基金之 C 类份额和建信中证 500 指数增强基金之 E 类份额。本基金各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

根据《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》与《关于建信中证 500 指数增强型证券投资基金增加个人养老金基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》并报证监会备案，本基金于 2024 年 12 月 13 日起增加个人养老金基金份额（以下简称“Y 类基金份额”）。本基金 Y 类基金份额对基金管理费和基金托管费实施一定费率优惠。由于基金费用的不同，本基金 A 类、C 类、E 类、Y 类基金份额分别设置代码，并将分别计算基金份额净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 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）占基金资产的比例为不低于 90%，其中投资于中证 500 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%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金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。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。本基金的业绩比较基准为 $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税前）}$ 。

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、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 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。

6.4.7 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	237,336,806.71
等于：本金	237,286,357.07
加：应计利息	50,449.64
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	237,336,806.71

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		3,624,930,357.84	-	3,770,012,425.05	145,082,067.21
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		3,624,930,357.84	-	3,770,012,425.05	145,082,067.21

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	331,720,160.00	-	-	-
其中：股指期货投资	331,720,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	331,720,160.00	-	-	-

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	180.00	211,226,400.00	7,972,080.00
IM2507	IM2507	105.00	132,077,400.00	3,611,560.00
合计				11,583,640.00
减：可抵销期货 暂收款				11,583,640.00
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

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	11,926.43
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,987,487.91
其中：交易所市场	9,987,487.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,719.55
合计	10,098,133.89

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 500 指数增强 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	1,558,595,884.59	1,558,595,884.59
本期申购	63,138,445.09	63,138,445.09
本期赎回（以“-”号填列）	-150,599,035.86	-150,599,035.86
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	1,471,135,293.82	1,471,135,293.82

建信中证 500 指数增强 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	308,838,212.87	308,838,212.87
本期申购	5,098,609.53	5,098,609.53
本期赎回（以“-”号填列）	-141,216,207.56	-141,216,207.56
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	172,720,614.84	172,720,614.84

建信中证 500 指数增强 E

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	41,074.29	41,074.29
本期申购	1,566.86	1,566.86
本期赎回（以“-”号填列）	-1,242.72	-1,242.72
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	41,398.43	41,398.43

建信中证 500 指数增强 Y

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	427,023.02	427,023.02
本期申购	901,702.25	901,702.25
本期赎回（以“-”号填列）	-136,096.23	-136,096.23
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	1,192,629.04	1,192,629.04

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 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,717,389,325.06	-257,422,719.62	2,459,966,605.44
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,717,389,325.06	-257,422,719.62	2,459,966,605.44
本期利润	109,312,804.61	107,877,637.03	217,190,441.64
本期基金份额交易产生的变动数	-156,373,948.66	13,627,097.26	-142,746,851.40
其中：基金申购款	112,297,260.38	-12,819,564.72	99,477,695.66
基金赎回款	-268,671,209.04	26,446,661.98	-242,224,547.06
本期已分配利润	-	-	-

本期末	2,670,328,181.01	-135,917,985.33	2,534,410,195.68
-----	------------------	-----------------	------------------

建信中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	510,169,523.65	-49,747,334.64	460,422,189.01
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	510,169,523.65	-49,747,334.64	460,422,189.01
本期利润	15,641,074.31	11,127,162.80	26,768,237.11
本期基金份额交易产生的变动数	-229,635,282.13	22,903,404.33	-206,731,877.80
其中：基金申购款	8,608,467.49	-1,057,933.39	7,550,534.10
基金赎回款	-238,243,749.62	23,961,337.72	-214,282,411.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	296,175,315.83	-15,716,767.51	280,458,548.32

建信中证 500 指数增强 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	67,963.28	-6,600.08	61,363.20
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	67,963.28	-6,600.08	61,363.20
本期利润	2,597.15	2,935.17	5,532.32
本期基金份额交易产生的变动数	548.24	-82.17	466.07
其中：基金申购款	2,665.96	-284.82	2,381.14
基金赎回款	-2,117.72	202.65	-1,915.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	71,108.67	-3,747.08	67,361.59

建信中证 500 指数增强 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	744,908.26	-70,536.25	674,372.01
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	744,908.26	-70,536.25	674,372.01
本期利润	77,957.18	117,127.42	195,084.60
本期基金份额交易产生的变动数	1,352,519.24	-156,441.45	1,196,077.79
其中：基金申购款	1,597,277.29	-178,103.50	1,419,173.79
基金赎回款	-244,758.05	21,662.05	-223,096.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,175,384.68	-109,850.28	2,065,534.40

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	1,093,522.65
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	2,000,787.61
其他	2,048.73
合计	3,096,358.99

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	99,559,345.68
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	99,559,345.68

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	6,800,585,496.06
减：卖出股票成本总额	6,694,298,097.51
减：交易费用	6,728,052.87
买卖股票差价收入	99,559,345.68

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	7,115,216.14

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	43,836,726.80

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	43,836,726.80

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	92,952,062.42
股票投资	92,952,062.42
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	26,172,800.00
权证投资	-
期货投资	26,172,800.00
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	119,124,862.42

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	148,120.87
基金转换费收入	2,497.16
合计	150,618.03

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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	6,907.53
指数使用费	162,846.33
银行间账户维护费	9,000.00

合计	272,973.41
----	------------

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 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	22,460,579.93	25,441,704.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,729,800.89	9,328,855.62
应支付基金管理人的净管理费	13,730,779.04	16,112,849.01

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的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额、C 类基金份额、E 类基金份额约定的基金管理费率年费率为 1.00%，Y 类基金份额约定的基金管理费率年费率为 0.50%。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×约定年费率/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	4,492,116.04	5,088,340.91

注：支付基金托管人的托管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。A 类基金份额、C 类基金份额、E 类基金份额约定的基金托管费率年费率为 0.20%，Y 类基金份额约定的基金托管费率年费率为 0.10%。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×约定年费率/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 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C	建信中证 500 指数增强 E	建信中证 500 指数增强 Y	合计
建信基金	-	338,562.79	255.04	-	338,817.83
合计	-	338,562.79	255.04	-	338,817.83
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				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C	建信中证 500 指数增强 E	建信中证 500 指数增强 Y	合计
建信基金	-	830,346.54	-	-	830,346.54

合计	-	830,346.54	-	-	830,346.54
----	---	------------	---	---	------------

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 类基金份额和 E 类基金份额的销售服务费年费率均为 0.50%。销售服务费的计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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
中信银行-活期	237,336,806.71	1,093,522.65	564,722,737.76	1,673,185.04

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
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新发未上市	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新发未上市	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新发未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新发未上市	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新发未上市	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新发未上市	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新发未上市	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新发未上市	29.93	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新发未上市	27.49	45.22	350	9,620.72	15,827.00	-

301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新发未上市	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新发未上市	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新发未上市	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新发未上市	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新发未上市	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新发未上市	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新发未上市	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新发未上市	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
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	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新发未上市	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新发未上市	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海	2025	6 个月	新发	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-

	阳科技	年6月5日		未上市						
603409	汇通控股	2025年2月25日	6个月	新发未上市	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025年1月20日	6个月	新发未上市	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025年1月15日	6个月	新发未上市	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688757	胜利纳米	2025年3月18日	6个月	新发未上市	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025年6月30日	重大事项	38.05	2025年07月11日	39.98	54,100	1,878,684.03	2,058,505.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管

理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临

每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金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	237,336,806.71	-	-	-	237,336,806.71
结算备付金	437,582,976.34	-	-	-	437,582,976.34
存出保证金	41,846,140.81	-	-	-	41,846,140.81
交易性金融资产	-	-	-	3,770,012,425.05	3,770,012,425.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	10,128,689.49	10,128,689.49
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	652,286.36	652,286.36
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	716,765,923.86	-	-	3,780,793,400.90	4,497,559,324.76
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	-	-	-	7,177,731.56	7,177,731.56
应付赎回款	-	-	-	13,689,540.22	13,689,540.22
应付管理人报酬	-	-	-	3,600,361.85	3,600,361.85
应付托管费	-	-	-	720,072.35	720,072.35
应付销售服务费	-	-	-	181,908.77	181,908.77
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	10,098,133.89	10,098,133.89
负债总计	-	-	-	35,467,748.64	35,467,748.64
利率敏感度缺口	716,765,923.86	-	-	3,745,325,652.26	4,462,091,576.12
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	252,913,355.45	-	-	-	252,913,355.45
结算备付金	399,001,293.97	-	-	-	399,001,293.97
存出保证金	45,887,034.43	-	-	-	45,887,034.43

交易性金融资产	-	-	-	4,095,794,434.07	4,095,794,434.07
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	21,387,584.72	21,387,584.72
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,592,253.77	1,592,253.77
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	697,801,683.85	-	-	4,118,774,272.56	4,816,575,956.41
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	-	-	-	1,376,408.29	1,376,408.29
应付赎回款	-	-	-	7,507,769.57	7,507,769.57
应付管理人报酬	-	-	-	4,270,205.16	4,270,205.16
应付托管费	-	-	-	854,041.02	854,041.02
应付销售服务费	-	-	-	331,488.33	331,488.33
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	13,209,319.61	13,209,319.61
负债总计	-	-	-	27,549,231.98	27,549,231.98
利率敏感度缺口	697,801,683.85	-	-	4,091,225,040.58	4,789,026,724.43

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	3,770,012,425.05	84.49	4,095,794,434.07	85.52
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	3,770,012,425.05	84.49	4,095,794,434.07	85.52

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		
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（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%	195,445,098.82	206,324,637.48
	业绩比较基准下降 5%	-195,445,098.82	-206,324,637.48

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的

最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	3,767,652,483.56	4,095,513,984.70
第二层次	2,073,890.54	27,736.50
第三层次	286,050.95	252,712.87
合计	3,770,012,425.05	4,095,794,434.07

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	3,770,012,425.05	83.82
	其中：股票	3,770,012,425.05	83.82
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	674,919,783.05	15.01
8	其他各项资产	52,627,116.66	1.17
9	合计	4,497,559,324.76	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	11,563,454.00	0.26
B	采矿业	205,931,041.36	4.62
C	制造业	2,130,053,944.90	47.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	141,582,720.64	3.17
E	建筑业	3,758,430.00	0.08
F	批发和零售业	70,014,198.44	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	46,107,218.75	1.03
H	住宿和餐饮业	4,494,046.50	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	242,430,318.08	5.43
J	金融业	397,104,131.54	8.90
K	房地产业	26,998,895.27	0.61
L	租赁和商务服务业	12,556,667.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	3,649,394.25	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	2,955,202.88	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	965,736.00	0.02
Q	卫生和社会工作	6,788,097.00	0.15
R	文化、体育和娱乐	48,171,744.88	1.08

	业		
S	综合	6,099,935.00	0.14
	合计	3,361,225,176.49	75.33

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,058,515.00	0.09
C	制造业	263,412,084.36	5.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,883,803.08	0.20
E	建筑业	7,090,892.00	0.16
F	批发和零售业	519,752.34	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	12,799,782.00	0.29
H	住宿和餐饮业	103,584.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,339,634.52	2.00
J	金融业	18,012,311.28	0.40
K	房地产业	21,021.00	0.00
L	租赁和商务服务业	248,179.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	3,897,579.98	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	60,770.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	196,000.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	143,340.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	408,787,248.56	9.16

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	300476	胜宏科技	459,800	61,787,924.00	1.38

2	000783	长江证券	8,794,338	60,944,762.34	1.37
3	000729	燕京啤酒	3,776,200	48,826,266.00	1.09
4	600988	赤峰黄金	1,867,900	46,473,352.00	1.04
5	000728	国元证券	5,450,480	43,004,287.20	0.96
6	000893	亚钾国际	1,414,200	42,623,988.00	0.96
7	688578	艾力斯	447,819	41,665,079.76	0.93
8	002056	横店东磁	2,595,000	36,719,250.00	0.82
9	600685	中船防务	1,302,420	35,412,799.80	0.79
10	600060	海信视像	1,536,258	35,364,659.16	0.79
11	688608	恒玄科技	101,621	35,362,075.58	0.79
12	002532	天山铝业	3,972,800	33,013,968.00	0.74
13	601717	中创智领	1,972,700	32,786,274.00	0.73
14	603893	瑞芯微	215,591	32,739,649.26	0.73
15	002595	豪迈科技	546,958	32,390,852.76	0.73
16	600578	京能电力	6,915,200	31,049,248.00	0.70
17	603379	三美股份	623,800	30,017,256.00	0.67
18	002517	恺英网络	1,505,700	29,075,067.00	0.65
19	601555	东吴证券	3,204,353	28,038,088.75	0.63
20	000050	深天马 A	3,249,300	27,684,036.00	0.62
21	601615	明阳智能	2,379,900	27,345,051.00	0.61
22	601665	齐鲁银行	4,278,114	27,037,680.48	0.61
23	600380	健康元	2,422,972	26,725,381.16	0.60
24	000623	吉林敖东	1,569,900	26,609,805.00	0.60
25	603129	春风动力	120,900	26,174,850.00	0.59
26	300373	扬杰科技	499,300	25,913,670.00	0.58
27	600873	梅花生物	2,423,300	25,905,077.00	0.58
28	002299	圣农发展	1,782,200	25,467,638.00	0.57
29	688213	思特威	249,058	25,458,708.76	0.57
30	601168	西部矿业	1,526,618	25,387,657.34	0.57
31	600867	通化东宝	3,072,900	25,197,780.00	0.56
32	601958	金钼股份	2,300,786	25,170,598.84	0.56
33	600143	金发科技	2,414,700	24,895,557.00	0.56
34	601577	长沙银行	2,495,400	24,804,276.00	0.56
35	600901	江苏金租	4,061,628	24,613,465.68	0.55
36	002155	湖南黄金	1,348,360	24,068,226.00	0.54
37	000060	中金岭南	5,198,400	23,808,672.00	0.53
38	600004	白云机场	2,597,400	23,636,340.00	0.53
39	300699	光威复材	739,800	23,429,466.00	0.53
40	300573	兴齐眼药	450,340	23,323,108.60	0.52
41	300251	光线传媒	1,147,944	23,268,824.88	0.52
42	300001	特锐德	968,706	23,219,882.82	0.52
43	300627	华测导航	644,580	22,560,300.00	0.51
44	000987	越秀资本	3,186,098	21,856,632.28	0.49

45	600704	物产中大	4,132,900	21,780,383.00	0.49
46	688582	芯动联科	320,490	21,536,928.00	0.48
47	002078	太阳纸业	1,599,148	21,524,532.08	0.48
48	002624	完美世界	1,414,300	21,454,931.00	0.48
49	688188	柏楚电子	162,825	21,437,539.50	0.48
50	002423	中粮资本	1,745,800	21,351,134.00	0.48
51	600582	天地科技	3,549,409	21,260,959.91	0.48
52	600968	海油发展	5,189,578	21,173,478.24	0.47
53	600535	天士力	1,348,088	21,097,577.20	0.47
54	600299	安迪苏	2,156,500	20,810,225.00	0.47
55	603858	步长制药	1,261,604	20,488,448.96	0.46
56	688387	信科移动	3,609,800	20,395,370.00	0.46
57	000988	华工科技	416,900	19,598,469.00	0.44
58	600563	法拉电子	179,417	19,572,600.53	0.44
59	600329	达仁堂	573,000	19,115,280.00	0.43
60	688568	中科星图	525,202	18,912,524.02	0.42
61	603816	顾家家居	740,500	18,897,560.00	0.42
62	002608	江苏国信	2,576,000	18,882,080.00	0.42
63	000959	首钢股份	5,542,600	18,844,840.00	0.42
64	000513	丽珠集团	521,060	18,779,002.40	0.42
65	601918	新集能源	2,903,500	18,756,610.00	0.42
66	600098	广州发展	2,972,701	18,579,381.25	0.42
67	002673	西部证券	2,299,000	18,116,120.00	0.41
68	002202	金风科技	1,739,900	17,833,975.00	0.40
69	300054	鼎龙股份	603,800	17,316,984.00	0.39
70	600271	航天信息	1,842,500	17,024,700.00	0.38
71	688002	睿创微纳	239,785	16,717,810.20	0.37
72	300017	网宿科技	1,550,600	16,622,432.00	0.37
73	002821	凯莱英	186,310	16,441,857.50	0.37
74	688220	翱捷科技	209,400	16,396,020.00	0.37
75	300724	捷佳伟创	301,864	16,391,215.20	0.37
76	000937	冀中能源	2,799,138	16,095,043.50	0.36
77	600499	科达制造	1,640,600	16,077,880.00	0.36
78	001286	陕西能源	1,831,200	15,931,440.00	0.36
79	688183	生益电子	309,000	15,820,800.00	0.35
80	000423	东阿阿胶	302,200	15,805,060.00	0.35
81	600959	江苏有线	4,543,600	15,629,984.00	0.35
82	000519	中兵红箭	712,300	15,592,247.00	0.35
83	600177	雅戈尔	2,126,500	15,523,450.00	0.35
84	002138	顺络电子	550,803	15,488,580.36	0.35
85	688617	惠泰医疗	51,969	15,434,793.00	0.35
86	601098	中南传媒	1,152,900	15,126,048.00	0.34
87	600909	华安证券	2,536,137	14,785,678.71	0.33

88	688278	特宝生物	203,265	14,657,439.15	0.33
89	600528	中铁工业	1,972,500	14,557,050.00	0.33
90	600885	宏发股份	641,775	14,318,000.25	0.32
91	603596	伯特利	271,300	14,294,797.00	0.32
92	600483	福能股份	1,473,900	14,208,396.00	0.32
93	000559	万向钱潮	1,855,500	14,194,575.00	0.32
94	600312	平高电气	912,171	14,038,311.69	0.31
95	600739	辽宁成大	1,243,800	13,681,800.00	0.31
96	002064	华峰化学	2,062,000	13,629,820.00	0.31
97	688122	西部超导	260,965	13,538,864.20	0.30
98	600166	福田汽车	4,881,000	13,227,510.00	0.30
99	002507	涪陵榨菜	1,026,416	13,127,860.64	0.29
100	000429	粤高速 A	979,400	13,055,402.00	0.29
101	600879	航天电子	1,222,200	12,796,434.00	0.29
102	300207	欣旺达	631,400	12,665,884.00	0.28
103	688017	绿的谐波	101,392	12,662,846.88	0.28
104	300803	指南针	153,975	12,419,623.50	0.28
105	600487	亨通光电	800,600	12,249,180.00	0.27
106	600497	驰宏锌锗	2,307,800	12,208,262.00	0.27
107	002273	水晶光电	608,800	12,157,736.00	0.27
108	688065	凯赛生物	257,800	12,142,380.00	0.27
109	000738	航发控制	571,900	11,866,925.00	0.27
110	603233	大参林	723,204	11,788,225.20	0.26
111	600398	海澜之家	1,677,201	11,673,318.96	0.26
112	600598	北大荒	800,300	11,540,326.00	0.26
113	605589	圣泉集团	410,500	11,391,375.00	0.26
114	600109	国金证券	1,295,900	11,365,043.00	0.25
115	601233	桐昆股份	1,052,500	11,156,500.00	0.25
116	002563	森马服饰	2,117,600	11,138,576.00	0.25
117	688425	铁建重工	2,722,700	11,108,616.00	0.25
118	300285	国瓷材料	627,500	10,887,125.00	0.24
119	600298	安琪酵母	306,500	10,779,605.00	0.24
120	601991	大唐发电	3,388,200	10,740,594.00	0.24
121	601155	新城控股	767,900	10,504,872.00	0.24
122	603979	金诚信	225,830	10,487,545.20	0.24
123	601990	南京证券	1,286,500	10,394,920.00	0.23
124	688469	芯联集成	2,149,200	10,251,684.00	0.23
125	600583	海油工程	1,850,300	10,102,638.00	0.23
126	002773	康弘药业	345,800	10,017,826.00	0.22
127	600998	九州通	1,926,316	9,901,264.24	0.22
128	300496	中科创达	172,800	9,887,616.00	0.22
129	002130	沃尔核材	401,800	9,570,876.00	0.21
130	688521	芯原股份	97,214	9,381,151.00	0.21

131	603605	珀莱雅	112,500	9,313,875.00	0.21
132	600008	首创环保	3,071,200	9,275,024.00	0.21
133	600295	鄂尔多斯	1,018,776	8,873,538.96	0.20
134	601399	国机重装	2,906,400	8,719,200.00	0.20
135	002414	高德红外	847,230	8,684,107.50	0.19
136	002410	广联达	638,700	8,564,967.00	0.19
137	300888	稳健医疗	207,980	8,547,978.00	0.19
138	600862	中航高科	319,812	8,340,696.96	0.19
139	601456	国联民生	794,200	8,219,970.00	0.18
140	600096	云天化	368,800	8,102,536.00	0.18
141	000537	中绿电	967,100	8,084,956.00	0.18
142	600378	昊华科技	298,300	8,074,981.00	0.18
143	002841	视源股份	232,900	8,058,340.00	0.18
144	600153	建发股份	776,600	8,053,342.00	0.18
145	300454	深信服	84,700	7,977,046.00	0.18
146	603529	爱玛科技	228,681	7,866,626.40	0.18
147	002353	杰瑞股份	209,400	7,329,000.00	0.16
148	000009	中国宝安	819,500	7,277,160.00	0.16
149	688702	盛科通信	117,886	7,200,476.88	0.16
150	300857	协创数据	83,100	7,151,586.00	0.16
151	002939	长城证券	847,700	7,103,726.00	0.16
152	002080	中材科技	355,200	6,926,400.00	0.16
153	002185	华天科技	683,000	6,898,300.00	0.15
154	300677	英科医疗	289,000	6,843,520.00	0.15
155	000733	振华科技	136,100	6,811,805.00	0.15
156	002153	石基信息	785,475	6,802,213.50	0.15
157	301267	华夏眼科	354,100	6,788,097.00	0.15
158	600498	烽火通信	321,600	6,763,248.00	0.15
159	600062	华润双鹤	360,333	6,723,813.78	0.15
160	601108	财通证券	841,530	6,656,502.30	0.15
161	600352	浙江龙盛	644,944	6,552,631.04	0.15
162	000825	太钢不锈	1,798,000	6,454,820.00	0.14
163	688819	天能股份	231,809	6,435,017.84	0.14
164	000027	深圳能源	995,700	6,352,566.00	0.14
165	000960	锡业股份	413,800	6,331,140.00	0.14
166	300595	欧普康视	408,600	6,239,322.00	0.14
167	600663	陆家嘴	700,632	6,207,599.52	0.14
168	600699	均胜电子	355,200	6,194,688.00	0.14
169	600673	东阳光	524,500	6,099,935.00	0.14
170	688249	晶合集成	299,959	6,080,168.93	0.14
171	002244	滨江集团	613,365	5,980,308.75	0.13
172	002683	广东宏大	175,200	5,946,288.00	0.13
173	688099	晶晨股份	82,725	5,874,302.25	0.13

174	003022	联泓新科	370,000	5,857,100.00	0.13
175	000750	国海证券	1,419,300	5,847,516.00	0.13
176	002670	国盛金控	381,700	5,744,585.00	0.13
177	600884	杉杉股份	600,700	5,682,622.00	0.13
178	002318	久立特材	239,900	5,611,261.00	0.13
179	002025	航天电器	107,200	5,511,152.00	0.12
180	000598	兴蓉环境	751,359	5,417,298.39	0.12
181	601928	凤凰传媒	462,700	5,168,359.00	0.12
182	300140	节能环境	821,300	5,067,421.00	0.11
183	300604	长川科技	112,300	5,043,393.00	0.11
184	688052	纳芯微	28,500	4,972,965.00	0.11
185	688361	中科飞测	58,495	4,924,694.05	0.11
186	002340	格林美	772,400	4,904,740.00	0.11
187	601568	北元集团	1,180,600	4,899,490.00	0.11
188	000898	鞍钢股份	2,109,300	4,893,576.00	0.11
189	002958	青农商行	1,351,600	4,879,276.00	0.11
190	002500	山西证券	825,200	4,819,168.00	0.11
191	002281	光迅科技	97,600	4,813,632.00	0.11
192	601216	君正集团	851,300	4,699,176.00	0.11
193	603565	中谷物流	482,725	4,610,023.75	0.10
194	000703	恒逸石化	782,300	4,599,924.00	0.10
195	601019	山东出版	482,400	4,568,328.00	0.10
196	300395	菲利华	88,800	4,537,680.00	0.10
197	000021	深科技	241,000	4,516,340.00	0.10
198	000785	居然智家	1,476,500	4,503,325.00	0.10
199	600258	首旅酒店	318,050	4,494,046.50	0.10
200	600839	四川长虹	458,200	4,453,704.00	0.10
201	688475	萤石网络	140,700	4,434,864.00	0.10
202	300919	中伟股份	134,700	4,428,936.00	0.10
203	300558	贝达药业	76,300	4,421,585.00	0.10
204	601231	环旭电子	297,000	4,345,110.00	0.10
205	600132	重庆啤酒	75,500	4,160,050.00	0.09
206	601162	天风证券	841,700	4,149,581.00	0.09
207	600895	张江高科	161,200	4,142,840.00	0.09
208	600435	北方导航	263,500	4,107,965.00	0.09
209	002152	广电运通	302,400	4,064,256.00	0.09
210	000039	中集集团	516,566	4,060,208.76	0.09
211	688778	厦钨新能	72,232	4,039,213.44	0.09
212	600637	东方明珠	539,811	4,032,388.17	0.09
213	688297	中无人机	74,260	3,965,484.00	0.09
214	601933	永辉超市	800,100	3,920,490.00	0.09
215	002461	珠江啤酒	341,700	3,857,793.00	0.09
216	002926	华西证券	430,800	3,851,352.00	0.09

217	600316	洪都航空	101,900	3,841,630.00	0.09
218	600038	中直股份	97,700	3,791,737.00	0.08
219	300037	新宙邦	107,700	3,791,040.00	0.08
220	002444	巨星科技	146,820	3,745,378.20	0.08
221	300339	润和软件	73,500	3,736,005.00	0.08
222	601212	白银有色	1,146,000	3,586,980.00	0.08
223	300748	金力永磁	148,200	3,533,088.00	0.08
224	003031	中瓷电子	65,980	3,510,795.80	0.08
225	603160	汇顶科技	48,700	3,459,161.00	0.08
226	002120	韵达股份	512,300	3,432,410.00	0.08
227	600820	隧道股份	561,900	3,427,590.00	0.08
228	603298	杭叉集团	163,200	3,419,040.00	0.08
229	601965	中国汽研	191,475	3,398,681.25	0.08
230	000034	神州数码	89,700	3,376,308.00	0.08
231	002065	东华软件	351,500	3,374,400.00	0.08
232	300458	全志科技	84,430	3,351,026.70	0.08
233	002223	鱼跃医疗	94,100	3,349,960.00	0.08
234	603087	甘李药业	60,500	3,314,190.00	0.07
235	603650	彤程新材	102,300	3,288,945.00	0.07
236	000887	中鼎股份	184,556	3,246,340.04	0.07
237	000563	陕国投 A	899,700	3,211,929.00	0.07
238	301358	湖南裕能	101,000	3,150,190.00	0.07
239	601099	太平洋	798,600	3,138,498.00	0.07
240	600816	建元信托	1,047,500	3,090,125.00	0.07
241	600141	兴发集团	144,600	2,968,638.00	0.07
242	603939	益丰药房	121,000	2,960,870.00	0.07
243	002266	浙富控股	957,400	2,948,792.00	0.07
244	001696	宗申动力	129,100	2,898,295.00	0.06
245	300024	机器人	166,300	2,857,034.00	0.06
246	300450	先导智能	113,900	2,830,415.00	0.06
247	600118	中国卫星	98,800	2,822,716.00	0.06
248	688172	燕东微	143,500	2,821,210.00	0.06
249	688772	珠海冠宇	197,122	2,816,873.38	0.06
250	603658	安图生物	74,960	2,811,000.00	0.06
251	603659	璞泰来	147,900	2,777,562.00	0.06
252	600801	华新水泥	228,500	2,705,440.00	0.06
253	601128	常熟银行	363,590	2,679,658.30	0.06
254	605358	立昂微	114,900	2,677,170.00	0.06
255	002430	杭氧股份	137,100	2,662,482.00	0.06
256	000066	中国长城	178,700	2,644,760.00	0.06
257	300346	南大光电	83,056	2,627,891.84	0.06
258	002966	苏州银行	296,700	2,605,026.00	0.06
259	601139	深圳燃气	407,700	2,592,972.00	0.06

260	000932	华菱钢铁	577,800	2,542,320.00	0.06
261	002294	信立泰	52,400	2,480,092.00	0.06
262	600511	国药股份	84,800	2,472,768.00	0.06
263	600536	中国软件	52,800	2,469,456.00	0.06
264	600517	国网英大	465,500	2,374,050.00	0.05
265	600079	人福医药	112,300	2,356,054.00	0.05
266	600282	南钢股份	559,900	2,351,580.00	0.05
267	600906	财达证券	338,700	2,309,934.00	0.05
268	002472	双环传动	68,500	2,294,065.00	0.05
269	600348	华阳股份	339,864	2,263,494.24	0.05
270	000933	神火股份	130,600	2,173,184.00	0.05
271	688100	威胜信息	50,900	1,885,845.00	0.04
272	000636	风华高科	116,900	1,606,206.00	0.04
273	600765	中航重机	91,700	1,547,896.00	0.03
274	600131	国网信通	80,100	1,417,770.00	0.03
275	603225	新凤鸣	121,500	1,293,975.00	0.03
276	688295	中复神鹰	55,400	1,152,320.00	0.03
277	688027	国盾量子	3,800	1,045,038.00	0.02
278	000683	博源化工	218,000	1,044,220.00	0.02
279	002607	中公教育	315,600	965,736.00	0.02
280	300002	神州泰岳	78,100	921,580.00	0.02
281	600363	联创光电	14,700	857,451.00	0.02
282	603156	养元饮品	38,600	816,776.00	0.02
283	600126	杭钢股份	88,500	796,500.00	0.02
284	601179	中国西电	125,700	771,798.00	0.02
285	601156	东航物流	56,700	742,203.00	0.02
286	002984	森麒麟	35,300	661,875.00	0.01
287	000830	鲁西化工	40,100	413,030.00	0.01
288	601611	中国核建	36,000	330,840.00	0.01
289	600688	上海石化	115,300	328,605.00	0.01
290	301165	锐捷网络	4,820	296,237.20	0.01
291	688072	拓荆科技	1,920	295,123.20	0.01
292	000883	湖北能源	60,800	274,208.00	0.01
293	600369	西南证券	60,100	261,435.00	0.01
294	002008	大族激光	10,100	246,137.00	0.01
295	601598	中国外运	47,400	233,682.00	0.01
296	601000	唐山港	56,300	228,578.00	0.01
297	003035	南网能源	49,200	225,828.00	0.01
298	002568	百润股份	8,600	220,246.00	0.00
299	603228	景旺电子	5,204	217,735.36	0.00
300	603486	科沃斯	3,700	215,451.00	0.00
301	688385	复旦微电	4,300	211,861.00	0.00
302	000400	许继电气	9,700	211,169.00	0.00

303	300623	捷捷微电	7,000	208,600.00	0.00
304	002429	兆驰股份	47,300	207,174.00	0.00
305	688777	中控技术	4,500	202,095.00	0.00
306	600720	中交设计	24,300	187,839.00	0.00
307	688114	华大智造	2,700	175,041.00	0.00
308	603290	斯达半导	2,041	165,872.07	0.00
309	300567	精测电子	2,700	163,647.00	0.00
310	002797	第一创业	21,600	152,928.00	0.00
311	600208	衢州发展	47,500	140,600.00	0.00
312	601880	辽港股份	88,700	133,050.00	0.00
313	600655	豫园股份	23,800	132,090.00	0.00
314	000591	太阳能	28,300	124,237.00	0.00
315	603737	三棵树	3,077	113,387.45	0.00
316	600566	济川药业	3,782	99,580.06	0.00
317	301536	星辰科技	1,609	97,022.70	0.00
318	300474	景嘉微	1,300	94,900.00	0.00
319	600580	卧龙电驱	4,680	92,523.60	0.00
320	603786	科博达	1,600	88,656.00	0.00
321	688563	航材股份	1,501	85,001.63	0.00
322	600021	上海电力	8,000	70,320.00	0.00
323	688281	华秦科技	1,100	66,561.00	0.00
324	002436	兴森科技	4,600	60,904.00	0.00
325	300003	乐普医疗	4,300	59,254.00	0.00
326	603707	健友股份	4,900	54,635.00	0.00
327	002432	九安医疗	1,300	47,359.00	0.00
328	300144	宋城演艺	4,700	40,185.00	0.00
329	601228	广州港	11,000	35,530.00	0.00
330	600562	国睿科技	1,100	34,639.00	0.00
331	603338	浙江鼎力	635	30,099.00	0.00
332	600872	中炬高新	1,400	26,600.00	0.00
333	300676	华大基因	500	24,885.00	0.00
334	601118	海南橡胶	4,900	23,128.00	0.00
335	600848	上海临港	2,500	22,675.00	0.00
336	603568	伟明环保	336	6,410.88	0.00
337	601001	晋控煤业	500	6,110.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603444	吉比特	69,100	20,864,745.00	0.47
2	603699	纽威股份	584,700	18,225,099.00	0.41
3	002487	大金重工	458,900	15,097,810.00	0.34
4	002625	光启技术	376,016	15,033,119.68	0.34
5	301119	正强股份	399,900	14,140,464.00	0.32

6	688636	智明达	412,760	13,947,160.40	0.31
7	600350	山东高速	1,141,100	12,164,126.00	0.27
8	002407	多氟多	891,680	10,869,579.20	0.24
9	603040	新坐标	264,200	10,612,914.00	0.24
10	000401	冀东水泥	2,261,727	9,906,364.26	0.22
11	300006	莱美药业	2,607,200	9,777,000.00	0.22
12	688286	敏芯股份	135,126	9,552,056.94	0.21
13	688168	安博通	133,485	9,460,081.95	0.21
14	688288	鸿泉物联	318,371	9,235,942.71	0.21
15	688536	思瑞浦	64,146	8,898,333.12	0.20
16	688256	寒武纪	14,600	8,781,900.00	0.20
17	605090	九丰能源	338,980	8,749,073.80	0.20
18	601319	中国人保	972,000	8,466,120.00	0.19
19	688208	道通科技	231,700	7,090,020.00	0.16
20	603955	大千生态	205,900	6,391,136.00	0.14
21	000001	平安银行	520,000	6,276,400.00	0.14
22	688685	迈信林	107,799	6,020,574.15	0.13
23	688668	鼎通科技	96,340	6,017,396.40	0.13
24	601702	华峰铝业	370,400	5,885,656.00	0.13
25	688258	卓易信息	116,117	5,623,546.31	0.13
26	688369	致远互联	205,876	5,433,067.64	0.12
27	688229	博睿数据	105,733	5,387,096.35	0.12
28	300241	瑞丰光电	914,769	5,214,183.30	0.12
29	300879	大叶股份	127,200	4,996,416.00	0.11
30	688025	杰普特	64,400	4,604,600.00	0.10
31	002032	苏泊尔	86,400	4,526,496.00	0.10
32	301270	汉仪股份	94,300	4,494,338.00	0.10
33	688329	艾隆科技	219,300	4,219,332.00	0.09
34	688088	虹软科技	84,888	4,095,846.00	0.09
35	300502	新易盛	31,220	3,965,564.40	0.09
36	688588	凌志软件	271,600	3,957,212.00	0.09
37	600660	福耀玻璃	68,900	3,927,989.00	0.09
38	688266	泽璟制药	34,100	3,666,091.00	0.08
39	300984	金沃股份	61,800	3,538,050.00	0.08
40	688058	宝兰德	118,516	3,397,853.72	0.08
41	301160	翔楼新材	39,600	3,171,168.00	0.07
42	300570	太辰光	32,800	3,161,264.00	0.07
43	603267	鸿远电子	62,700	3,151,929.00	0.07
44	688591	泰凌微	62,100	2,974,590.00	0.07
45	002736	国信证券	248,714	2,865,185.28	0.06
46	603259	药明康德	40,900	2,844,595.00	0.06
47	603236	移远通信	31,400	2,694,120.00	0.06
48	688071	华依科技	68,800	2,507,760.00	0.06

49	603766	隆鑫通用	195,900	2,499,684.00	0.06
50	300583	赛托生物	136,000	2,344,640.00	0.05
51	600259	广晟有色	41,100	2,183,232.00	0.05
52	603115	海星股份	149,300	2,154,399.00	0.05
53	300363	博腾股份	124,900	2,133,292.00	0.05
54	002734	利民股份	115,400	2,111,820.00	0.05
55	000156	华数传媒	265,700	2,109,658.00	0.05
56	688313	仕佳光子	54,100	2,058,505.00	0.05
57	688095	福昕软件	29,463	2,000,832.33	0.04
58	605080	浙江自然	64,500	1,793,100.00	0.04
59	301000	肇民科技	36,700	1,748,388.00	0.04
60	300489	光智科技	36,600	1,616,256.00	0.04
61	605086	龙高股份	58,000	1,543,960.00	0.03
62	688118	普元信息	67,601	1,510,882.35	0.03
63	000551	创元科技	103,700	1,332,545.00	0.03
64	688227	品高股份	26,300	826,872.00	0.02
65	688586	江航装备	72,400	814,500.00	0.02
66	688651	盛邦安全	21,039	718,061.07	0.02
67	301045	天禄科技	27,500	629,750.00	0.01
68	300320	海达股份	48,500	482,090.00	0.01
69	688195	腾景科技	10,000	450,000.00	0.01
70	688655	迅捷兴	20,600	436,514.00	0.01
71	002706	良信股份	47,200	420,552.00	0.01
72	600416	湘电股份	29,300	393,792.00	0.01
73	688252	天德钰	15,300	373,014.00	0.01
74	002853	皮阿诺	27,000	370,170.00	0.01
75	002916	深南电路	3,380	364,397.80	0.01
76	002170	芭田股份	34,800	356,700.00	0.01
77	688709	成都华微	10,448	342,067.52	0.01
78	688013	天臣医疗	11,696	341,874.08	0.01
79	688056	莱伯泰科	9,681	323,151.78	0.01
80	002160	常铝股份	72,600	313,632.00	0.01
81	688322	奥比中光	5,312	313,461.12	0.01
82	002225	濮耐股份	63,300	313,335.00	0.01
83	301283	聚胶股份	8,500	302,175.00	0.01
84	688026	洁特生物	17,900	293,560.00	0.01
85	002068	黑猫股份	28,700	293,027.00	0.01
86	688080	映翰通	5,736	291,905.04	0.01
87	301187	欧圣电气	10,360	285,936.00	0.01
88	688768	容知日新	6,306	279,923.34	0.01
89	002830	名雕股份	18,300	278,892.00	0.01
90	002063	远光软件	46,100	274,295.00	0.01
91	688558	国盛智科	10,831	273,374.44	0.01

92	688112	鼎阳科技	7,372	272,542.84	0.01
93	688545	兴福电子	9,940	270,387.88	0.01
94	688276	百克生物	12,806	268,926.00	0.01
95	002020	京新药业	20,600	268,830.00	0.01
96	601127	赛力斯	1,900	255,208.00	0.01
97	603583	捷昌驱动	6,884	251,403.68	0.01
98	603929	亚翔集成	7,100	249,210.00	0.01
99	300551	古鳌科技	22,900	246,404.00	0.01
100	688597	煜邦电力	31,360	245,548.80	0.01
101	002779	中坚科技	3,220	242,369.40	0.01
102	603995	甬金股份	13,500	238,680.00	0.01
103	688652	京仪装备	4,157	238,279.24	0.01
104	688580	伟思医疗	5,118	237,935.82	0.01
105	688510	航亚科技	9,739	235,489.02	0.01
106	002988	豪美新材	6,100	231,800.00	0.01
107	603799	华友钴业	6,200	229,524.00	0.01
108	603937	丽岛新材	23,200	226,896.00	0.01
109	301197	工大科雅	9,800	225,400.00	0.01
110	603006	联明股份	18,400	224,112.00	0.01
111	001211	双枪科技	9,800	223,538.00	0.01
112	688101	三达膜	15,545	216,697.30	0.00
113	300823	建科智能	14,420	214,713.80	0.00
114	688053	思科瑞	6,904	213,540.72	0.00
115	603678	火炬电子	5,500	209,165.00	0.00
116	603348	文灿股份	10,000	208,800.00	0.00
117	301080	百普赛斯	2,900	207,437.00	0.00
118	301525	儒竞科技	2,660	205,431.80	0.00
119	002826	易明医药	10,100	196,445.00	0.00
120	301239	普瑞眼科	5,000	196,000.00	0.00
121	688311	盟升电子	4,500	193,725.00	0.00
122	603657	春光科技	5,800	193,720.00	0.00
123	688310	迈得医疗	12,846	189,350.04	0.00
124	600026	中远海能	18,200	188,006.00	0.00
125	000408	藏格矿业	4,300	183,481.00	0.00
126	002648	卫星化学	10,500	181,965.00	0.00
127	301571	国科天成	3,499	181,563.11	0.00
128	301550	斯菱股份	2,030	181,258.70	0.00
129	300662	科锐国际	6,100	181,231.00	0.00
130	605133	嵘泰股份	4,100	180,728.00	0.00
131	600199	金种子酒	16,400	177,120.00	0.00
132	301016	雷尔伟	10,080	175,492.80	0.00
133	688108	赛诺医疗	15,600	175,032.00	0.00
134	001208	华菱线缆	16,300	173,595.00	0.00

135	001267	汇绿生态	18,300	171,654.00	0.00
136	301362	民爆光电	4,191	171,034.71	0.00
137	300329	海伦钢琴	22,500	170,550.00	0.00
138	688338	赛科希德	6,716	169,108.88	0.00
139	002895	川恒股份	7,400	166,944.00	0.00
140	301395	仁信新材	12,200	164,578.00	0.00
141	601020	华钰矿业	9,100	164,528.00	0.00
142	002948	青岛银行	32,600	162,348.00	0.00
143	688092	爱科科技	7,280	162,344.00	0.00
144	301413	安培龙	2,123	162,303.35	0.00
145	002533	金杯电工	16,500	160,710.00	0.00
146	603113	金能科技	23,100	160,083.00	0.00
147	002906	华阳集团	4,900	159,299.00	0.00
148	300384	三联虹普	9,000	158,310.00	0.00
149	603297	永新光学	1,800	157,230.00	0.00
150	688159	有方科技	2,184	156,527.28	0.00
151	002313	日海智能	15,100	156,436.00	0.00
152	300810	中科海讯	3,400	155,754.00	0.00
153	605599	菜百股份	9,500	155,325.00	0.00
154	688129	东来技术	5,633	153,217.60	0.00
155	301479	弘景光电	1,815	151,344.34	0.00
156	688757	胜科纳米	5,357	150,145.30	0.00
157	688390	固德威	3,387	147,165.15	0.00
158	688050	爱博医疗	2,129	146,581.65	0.00
159	600156	华升股份	19,700	144,401.00	0.00
160	002373	千方科技	15,400	143,220.00	0.00
161	688255	凯尔达	4,220	142,171.80	0.00
162	301177	迪阿股份	4,800	142,080.00	0.00
163	002976	瑞玛精密	5,400	140,400.00	0.00
164	688533	上声电子	5,197	139,955.21	0.00
165	001872	招商港口	6,900	137,034.00	0.00
166	002971	和远气体	5,850	136,480.50	0.00
167	688125	安达智能	3,691	135,459.70	0.00
168	001331	胜通能源	13,776	134,729.28	0.00
169	000089	深圳机场	18,900	130,410.00	0.00
170	600827	百联股份	14,231	130,071.34	0.00
171	002331	皖通科技	16,100	129,605.00	0.00
172	002128	电投能源	6,400	126,592.00	0.00
173	601518	吉林高速	44,700	122,478.00	0.00
174	605333	沪光股份	4,400	120,780.00	0.00
175	603282	亚光股份	6,700	114,101.00	0.00
176	301222	浙江恒威	3,900	113,529.00	0.00
177	688121	卓然股份	9,221	111,389.68	0.00

178	688105	诺唯赞	4,916	111,249.08	0.00
179	001227	兰州银行	44,400	111,000.00	0.00
180	688610	埃科光电	2,747	108,946.02	0.00
181	300168	万达信息	14,000	107,380.00	0.00
182	301566	达利凯普	5,755	106,755.25	0.00
183	002969	嘉美包装	30,200	106,002.00	0.00
184	600550	保变电气	12,300	105,780.00	0.00
185	002557	洽洽食品	4,866	105,202.92	0.00
186	601137	博威合金	5,900	104,961.00	0.00
187	003020	立方制药	4,680	104,457.60	0.00
188	603367	辰欣药业	7,400	103,748.00	0.00
189	000428	华天酒店	31,200	103,584.00	0.00
190	688509	正元地信	23,800	102,102.00	0.00
191	001260	坤泰股份	5,400	101,682.00	0.00
192	688070	纵横股份	2,100	101,430.00	0.00
193	300523	辰安科技	4,400	101,420.00	0.00
194	301499	维科精密	3,709	101,070.25	0.00
195	301516	中远通	6,033	100,751.10	0.00
196	301456	盘古智能	4,061	99,332.06	0.00
197	688800	瑞可达	2,016	99,187.20	0.00
198	688073	毕得医药	1,700	98,634.00	0.00
199	000818	航锦科技	4,300	96,750.00	0.00
200	605566	福莱蒾特	4,600	95,910.00	0.00
201	688716	中研股份	2,668	94,980.80	0.00
202	301052	果麦文化	2,300	93,840.00	0.00
203	002979	雷赛智能	2,100	92,988.00	0.00
204	301015	百洋医药	4,600	92,276.00	0.00
205	688157	松井股份	2,300	91,724.00	0.00
206	301107	瑜欣电子	3,080	91,630.00	0.00
207	000815	美利云	7,000	90,300.00	0.00
208	000617	中油资本	12,300	89,790.00	0.00
209	002730	电光科技	5,300	89,623.00	0.00
210	601126	四方股份	5,500	89,485.00	0.00
211	001366	播恩集团	7,200	87,912.00	0.00
212	300931	通用电梯	11,500	87,745.00	0.00
213	600980	北矿科技	3,600	87,552.00	0.00
214	688336	三生国健	1,600	86,784.00	0.00
215	688443	智翔金泰	3,033	84,135.42	0.00
216	301591	肯特股份	2,184	83,974.80	0.00
217	300248	新开普	5,400	80,946.00	0.00
218	688653	康希通信	6,478	79,355.50	0.00
219	600268	国电南自	10,080	78,825.60	0.00
220	301199	迈赫股份	3,080	78,601.60	0.00

221	002240	盛新锂能	6,000	77,280.00	0.00
222	301552	科力装备	1,992	77,209.92	0.00
223	600066	宇通客车	3,075	76,444.50	0.00
224	688323	瑞华泰	5,200	75,452.00	0.00
225	603014	威高血净	2,045	74,061.80	0.00
226	600346	恒力石化	5,100	72,726.00	0.00
227	301636	泽润新能	1,273	70,469.68	0.00
228	301587	中瑞股份	3,056	68,698.88	0.00
229	300283	温州宏丰	10,300	68,186.00	0.00
230	000819	岳阳兴长	4,300	67,295.00	0.00
231	300688	创业黑马	2,100	66,948.00	0.00
232	300847	中船汉光	3,700	65,897.00	0.00
233	688357	建龙微纳	2,200	63,338.00	0.00
234	002549	凯美特气	5,900	60,770.00	0.00
235	601500	通用股份	12,580	57,993.80	0.00
236	000895	双汇发展	2,300	56,143.00	0.00
237	301502	华阳智能	1,375	55,838.75	0.00
238	300812	易天股份	2,400	55,464.00	0.00
239	688695	中创股份	1,856	55,123.20	0.00
240	002774	快意电梯	6,200	54,498.00	0.00
241	600183	生益科技	1,800	54,270.00	0.00
242	603056	德邦股份	3,400	54,128.00	0.00
243	300633	开立医疗	1,800	53,496.00	0.00
244	600668	尖峰集团	3,600	50,940.00	0.00
245	301180	万祥科技	3,400	50,082.00	0.00
246	003041	真爱美家	1,800	49,698.00	0.00
247	301291	明阳电气	1,206	49,626.90	0.00
248	301025	读客文化	4,500	49,500.00	0.00
249	688205	德科立	780	48,898.20	0.00
250	688368	晶丰明源	556	48,833.48	0.00
251	301588	美新科技	2,568	47,662.08	0.00
252	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
253	688605	先锋精科	744	46,611.60	0.00
254	603776	永安行	2,200	44,330.00	0.00
255	605319	无锡振华	1,200	40,992.00	0.00
256	603272	联翔股份	2,400	40,896.00	0.00
257	000603	盛达资源	2,700	40,203.00	0.00
258	688348	昱能科技	935	40,176.95	0.00
259	688171	纬德信息	1,300	39,988.00	0.00
260	688596	正帆科技	1,089	36,938.88	0.00
261	688750	金天钛业	1,685	36,193.80	0.00
262	600967	内蒙一机	1,800	34,830.00	0.00
263	300932	三友联众	2,660	30,457.00	0.00

264	300702	天宇股份	1,300	30,238.00	0.00
265	301622	英思特	306	26,695.44	0.00
266	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
267	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
268	688550	瑞联新材	500	21,505.00	0.00
269	600958	东方证券	2,200	21,296.00	0.00
270	600649	城投控股	4,900	21,021.00	0.00
271	301606	绿联科技	396	20,366.28	0.00
272	000776	广发证券	1,200	20,172.00	0.00
273	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
274	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
275	002250	联化科技	1,400	15,400.00	0.00
276	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
277	002931	锋龙股份	900	14,355.00	0.00
278	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
279	301617	博苑股份	329	13,505.45	0.00
280	603194	中力股份	291	13,208.49	0.00
281	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
282	301603	乔锋智能	233	11,768.83	0.00
283	688710	益诺思	332	11,566.88	0.00
284	688393	安必平	400	11,496.00	0.00
285	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
286	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
287	301585	蓝宇股份	273	9,363.90	0.00
288	603216	梦天家居	700	8,862.00	0.00
289	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
290	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
291	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
292	603395	红四方	200	6,746.00	0.00
293	301320	豪江智能	300	5,760.00	0.00
294	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
295	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
296	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
297	603350	安乃达	106	3,713.18	0.00
298	001965	招商公路	300	3,600.00	0.00
299	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
300	002084	海鸥住工	900	3,195.00	0.00
301	603285	键邦股份	129	3,044.40	0.00
302	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
303	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
304	603317	天味食品	153	1,701.36	0.00
305	603507	振江股份	60	1,504.80	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	688608	恒玄科技	70,694,511.05	1.48
2	300476	胜宏科技	65,896,701.00	1.38
3	600988	赤峰黄金	57,114,931.00	1.19
4	603129	春风动力	52,297,716.00	1.09
5	603893	瑞芯微	50,478,507.00	1.05
6	300803	指南针	46,207,099.80	0.96
7	000783	长江证券	43,710,635.00	0.91
8	000893	亚钾国际	41,404,113.84	0.86
9	002821	凯莱英	41,097,207.51	0.86
10	688180	君实生物	40,355,893.44	0.84
11	601319	中国人保	39,892,975.00	0.83
12	300251	光线传媒	37,936,406.00	0.79
13	002625	光启技术	37,829,532.00	0.79
14	688005	容百科技	37,313,688.65	0.78
15	600060	海信视像	36,799,656.38	0.77
16	002532	天山铝业	36,616,838.00	0.76
17	688361	中科飞测	35,590,652.22	0.74
18	601216	君正集团	34,700,963.00	0.72
19	300054	鼎龙股份	34,582,531.00	0.72
20	600316	洪都航空	33,820,500.00	0.71

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	300476	胜宏科技	79,557,667.67	1.66
2	002625	光启技术	70,756,263.38	1.48
3	603893	瑞芯微	67,865,047.40	1.42
4	688521	芯原股份	65,469,028.65	1.37
5	600418	江淮汽车	63,684,305.58	1.33
6	000997	新大陆	59,598,111.25	1.24
7	002128	电投能源	59,463,222.49	1.24
8	002273	水晶光电	58,147,358.00	1.21
9	300054	鼎龙股份	56,598,648.80	1.18
10	002558	巨人网络	54,956,988.64	1.15
11	600316	洪都航空	53,020,942.73	1.11
12	002414	高德红外	50,327,864.28	1.05

13	300002	神州泰岳	45,233,930.00	0.94
14	002850	科达利	44,757,340.28	0.93
15	603529	爱玛科技	44,186,451.12	0.92
16	601777	千里科技	43,199,782.00	0.90
17	688180	君实生物	43,043,141.36	0.90
18	000423	东阿阿胶	42,670,910.10	0.89
19	300972	万辰集团	42,646,722.80	0.89
20	300803	指南针	41,675,409.97	0.87

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	6,275,564,026.07
卖出股票收入（成交）总额	6,800,585,496.06

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	41,846,140.81
2	应收清算款	10,128,689.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	652,286.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,627,116.66

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 增强 A	313,934	4,686.13	104,473,336.39	7.10	1,366,661,957.43	92.90
建信中证 500 指数 增强 C	18,711	9,230.97	131,143,595.56	75.93	41,577,019.28	24.07
建信中证 500 指数 增强 E	8	5,174.80	0.00	0.00	41,398.43	100.00
建信中证 500 指数 增强 Y	571	2,088.67	0.00	0.00	1,192,629.04	100.00
合计	333,224	4,936.89	235,616,931.95	14.32	1,409,473,004.18	85.68

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 指数增强 A	371,773.38	0.03
	建信中证 500 指数增强 C	1,665.09	0.00
	建信中证 500 指数增强 E	88.10	0.21
	建信中证 500 指数增强 Y	36,691.90	3.08
	合计	410,218.47	0.02

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	建信中证 500 指数增强 A	0~10
	建信中证 500 指数增强 C	—
	建信中证 500 指数增强 E	—

	建信中证 500 指数增强 Y	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	建信中证 500 指数增强 A	—
	建信中证 500 指数增强 C	—
	建信中证 500 指数增强 E	—
	建信中证 500 指数增强 Y	—
	合计	—

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 500 指数 增强 A	建信中证 500 指数 增强 C	建信中证 500 指数 增强 E	建信中证 500 指数 增强 Y
基金合同 生效日 (2014 年 1 月 27 日) 基金份额 总额	308,165,342.91	—	—	—
本报告期 期初基金 份额总额	1,558,595,884.59	308,838,212.87	41,074.29	427,023.02
本报告期 基金总申 购份额	63,138,445.09	5,098,609.53	1,566.86	901,702.25
减：本报告 期基金总 赎回份额	150,599,035.86	141,216,207.56	1,242.72	136,096.23
本报告期 基金拆分 变动份额	—	—	—	—
本报告期 期末基金 份额总额	1,471,135,293.82	172,720,614.84	41,398.43	1,192,629.04

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 (%)	
浙商证券	1	2,712,619,709.22	20.75	531,418.31	21.35	-
广发证券	2	2,405,270,381.08	18.40	450,714.04	18.11	-
长江证券	2	2,161,396,387.06	16.53	404,393.35	16.25	-
中金公司	2	1,672,070,166.16	12.79	310,835.39	12.49	-
方正证券	1	1,275,948,648.80	9.76	249,966.71	10.04	-

民生证券	1	918,184,800.70	7.02	179,875.94	7.23	-
中信建投	1	640,894,271.21	4.90	119,138.65	4.79	-
兴业证券	2	527,474,531.37	4.03	98,046.38	3.94	-
中信证券	2	417,681,858.08	3.19	77,644.73	3.12	-
信达证券	1	343,460,195.27	2.63	67,286.31	2.70	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

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、本基金本报告期内新增浙商证券一个交易单元，剔除方正证券和国投证券各一个交易单元。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 (%)
浙商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	关于新增国元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 6 月 26 日
2	关于新增中信证券股份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	2025 年 6 月 25 日
3	关于新增上海天天基金销售有限公司为建信周盈安心理债债券型证券投资基金等基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 6 月 25 日
4	关于新增上海华夏财富投资管理有限公司为建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 6 月 5 日
5	关于新增中银国际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 6 月 3 日
6	关于新增浦发银行为公司旗下建信中证 500 指数增强型证券投资基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 5 月 29 日
7	关于新增国金证券股份有限公司为建信旗下养老产品 Y 份额销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 5 月 29 日
8	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
9	关于新增华西证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 4 月 18 日
10	关于新增光大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 4 月 2 日
11	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
12	关于新增腾安基金销售（深圳）有限公司为建信中证 500 指数增强型证券投资基金等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 3 月 24 日
13	关于建信基金管理有限责任公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 3 月 19 日
14	关于新增平安银行为建信中证 500 指数增强型证券投资基金 Y 类份额代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 3 月 4 日

15	关于新增中信建投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 1 月 24 日
16	关于新增东方证券股份有限公司为建信中证 500 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 1 月 21 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 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 500 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

2025 年 8 月 29 日