

建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 28 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 2020 年 8 月 26 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 2020 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	9
§ 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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	58
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	59
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 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	2,394,819,943.89 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
下属分级基金的交易代码	000478	005633
报告期末下属分级基金的份额总额	2,288,482,081.46 份	106,337,862.43 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	$95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税前）}$ 。
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	李修滨
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	lixibin@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	北京市东城区朝阳门北大街 9 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	北京市东城区朝阳门北大街 9 号
邮政编码		100033	100010
法定代表人		孙志晨	李庆萍

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(2020 年 1 月 1 日-2020 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
本期已实现收益	502,620,180.18	21,762,391.21
本期利润	786,861,177.35	31,688,844.86
加权平均基金份额本期利润	0.3083	0.2784
本期加权平均净值利润率	14.70%	13.41%

本期基金份额净值增长率	13.79%	13.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	2,523,522,364.32	114,524,913.90
期末可供分配基金份额利润	1.1027	1.0770
期末基金资产净值	5,366,964,183.45	246,432,489.04
期末基金份额净值	2.3452	2.3174
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	134.52%	-2.35%

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	12.16%	0.85%	8.04%	0.84%	4.12%	0.01%
过去三个月	21.13%	1.06%	15.47%	1.08%	5.66%	-0.02%

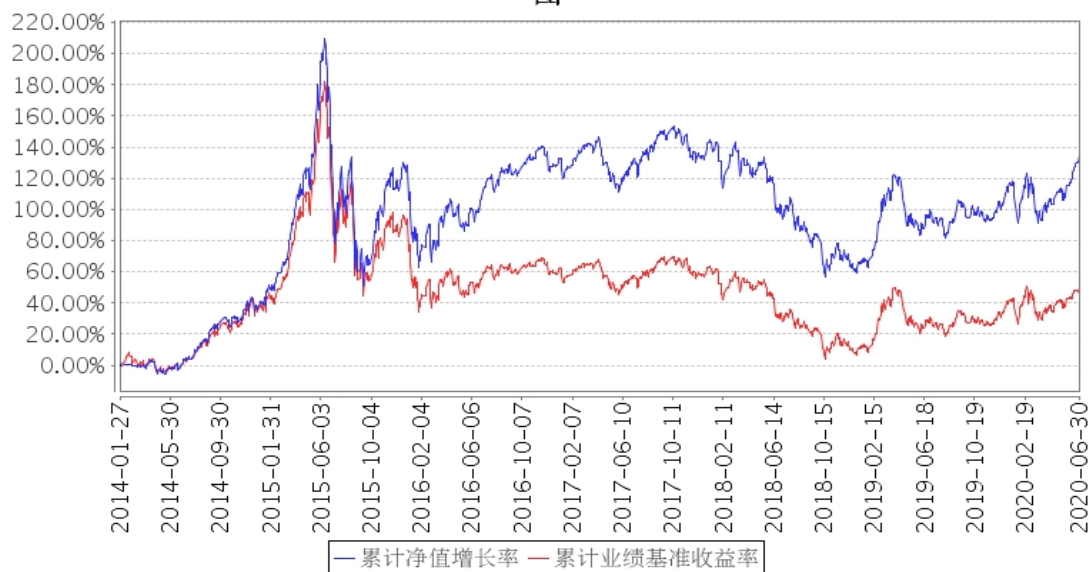
过去六个月	13.79%	1.70%	10.84%	1.70%	2.95%	0.00%
过去一年	20.61%	1.38%	17.63%	1.39%	2.98%	-0.01%
过去三年	2.77%	1.38%	-3.82%	1.39%	6.59%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	134.52%	1.69%	49.89%	1.67%	84.63%	0.02%

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	12.11%	0.85%	8.04%	0.84%	4.07%	0.01%
过去三个月	20.98%	1.06%	15.47%	1.08%	5.51%	-0.02%
过去六个月	13.51%	1.70%	10.84%	1.70%	2.67%	0.00%
过去一年	20.01%	1.38%	17.63%	1.39%	2.38%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	-2.35%	1.47%	-4.01%	1.49%	1.66%	-0.02%

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



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，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、基础设施投资部、网络金融部、人力资源管理部、基金会计部、注册登记部、财务管理部、金融科技部、投资风险管理部、内控合规部和审计部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京、石家庄六个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司以及在香港设立建信资产管理（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”。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信富时 100 指数型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信灵活配置混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双

债增强债券型证券投资基金、建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信短债债券型证券投资基金、建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金（LOF）、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、建信优享稳健养老目标一年持有期

混合型基金中基金（FOF）、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金，建信高股息主题股票型证券投资基金、建信科技创新混合型证券投资基金、建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金共计 126 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 4939.77 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	金融工程及指数投资部副总经理，本基金的基金经理	2014 年 1 月 27 日	-	12 年	叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理，博士。2008 年 5 月至 2011 年 9 月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。2011 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理，2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 4 月 18 日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 22 日起任建信鑫荣回报灵活配置混合

					型证券投资基金的基金经理；2018 年 1 月 10 日起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 日起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。
--	--	--	--	--	--

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证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

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 2 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。本基金自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、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，以尽量避免踩雷风险。报告期内指数波动较大，超额收益的波动也相对放大。

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 13.79%，波动率 1.70%，本报告期本基金 C 净值增长率 13.51%，波动率 1.70%；业绩比较基准收益率 10.84%，波动率 1.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在报告期间，市场波动较大。受海内外的疫情影响，一季度市场波动很大，二季度市场有所反弹，个股之间分化较大，医药行业涨幅领先，机构抱团的现象较为明显，市场整体呈现结构化的行情。为振兴经济，扶持中小企业以及受疫情影响较大的企业，财政政策和货币均较为宽松，流动性的充裕也为市场带来了较好的投资机会。而中美之间的摩擦不断升级也为投资带来很大的不确定性。展望下半年，预计流动性边际收紧，市场受基本面进一步恢复以及流动性收紧的双重影响，仍将维持震荡格局。结构化的行情仍将持续，需继续重点关注个股的基本面情况，精选优质个股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2017]13 号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

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、内控合规部、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。

本公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）；对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣，对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法律法规及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 2020 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 2020 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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	532,956,029.37	327,252,293.65
结算备付金		225,381,045.10	63,861,980.79
存出保证金		67,877,181.79	1,611,079.07
交易性金融资产	6.4.7.2	4,767,102,127.30	5,749,710,938.16
其中：股票投资		4,759,944,928.40	5,748,844,914.78
基金投资		-	-
债券投资		7,157,198.90	866,023.38
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		102,822,640.58	49,595,452.71
应收利息	6.4.7.5	225,205.40	117,699.73
应收股利		-	-
应收申购款		22,109,191.31	8,846,737.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,718,473,420.85	6,200,996,181.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		63,859,030.55	32,744,758.87
应付管理人报酬		4,568,593.32	5,111,307.97

应付托管费		913,718.67	1,022,261.58
应付销售服务费		97,292.06	103,750.49
应付交易费用	6.4.7.7	34,477,700.78	30,982,438.08
应交税费		610,242.66	6.31
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	550,170.32	703,494.36
负债合计		105,076,748.36	70,668,017.66
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,394,819,943.89	2,975,779,604.96
未分配利润	6.4.7.10	3,218,576,728.60	3,154,548,558.92
所有者权益合计		5,613,396,672.49	6,130,328,163.88
负债和所有者权益总计		5,718,473,420.85	6,200,996,181.54

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,394,819,943.89 份，其中建信中证 500 指数增强 A 基金份额总额 2,288,482,081.46 份，基金份额净值 2.3452 元；建信中证 500 指数增强 C 基金份额总额 106,337,862.43 份，基金份额净值 2.3174 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		889,698,341.34	931,821,639.70
1. 利息收入		3,377,948.78	3,259,495.58
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,376,410.75	3,221,533.65
债券利息收入		1,538.03	819.78
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	37,142.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		588,604,827.91	656,449,252.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	503,678,409.48	620,488,029.76
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	208,730.92	331,166.89
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			

贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	47,608,862.14	-2,620,129.48
股利收益	6.4.7.16	37,108,825.37	38,250,185.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	294,167,450.82	269,516,306.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,548,113.83	2,596,585.00
减：二、费用		71,148,319.13	71,019,509.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	27,767,381.46	26,984,896.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,553,476.22	5,396,979.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	587,432.52	1,292,044.07
4. 交易费用	6.4.7.19	36,498,152.50	36,188,111.61
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		171,397.41	192,007.37
7. 其他费用	6.4.7.20	570,479.02	965,470.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		818,550,022.21	860,802,130.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		818,550,022.21	860,802,130.27

6.3 所有者权益（基金净值）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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,975,779,604.96	3,154,548,558.92	6,130,328,163.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	818,550,022.21	818,550,022.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-580,959,661.07	-754,521,852.53	-1,335,481,513.60

其中：1. 基金申购款	1,008,986,871.76	1,036,616,482.61	2,045,603,354.37
2. 基金赎回款	-1,589,946,532.83	-1,791,138,335.14	-3,381,084,867.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,394,819,943.89	3,218,576,728.60	5,613,396,672.49
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,402,897,060.52	1,474,542,949.62	3,877,440,010.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	860,802,130.27	860,802,130.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	658,369,989.89	554,335,506.71	1,212,705,496.60
其中：1. 基金申购款	2,031,682,987.63	1,927,968,197.15	3,959,651,184.78
2. 基金赎回款	-1,373,312,997.74	-1,373,632,690.44	-2,746,945,688.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,061,267,050.41	2,889,680,586.60	5,950,947,637.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

吴灵玲

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《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(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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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 2 号《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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

本基金 2020 年半年度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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	532,956,029.37
定期存款	—
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	—
合计	532,956,029.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,253,809,588.34	4,759,944,928.40	506,135,340.06
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,980,956.33	7,157,198.90
	银行间市场	-	-
	合计	4,980,956.33	7,157,198.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,258,790,544.67	4,767,102,127.30	508,311,582.63

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	525, 734, 560. 00	-	-	
其中：股指期货投资	525, 734, 560. 00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	525, 734, 560. 00	-	-	

注：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。于 2020 年 06 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC2007	中证 500 指数 期货 IC2007 合约	472	547,463,360.00	21,728,800.00
总额合计	-	472	547,463,360.00	21,728,800.00

减：可抵销期货暂收款	-	-	-	21,728,800.00
期货投资净额	-	-	-	-

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	130,151.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	92,543.54
应收债券利息	1,528.42
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	981.70
合计	225,205.40

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	34,477,700.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	34,477,700.78

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	140,859.05
应付证券出借违约金	—
应付指数使用费	218,838.18
预提费用	190,473.09
合计	550,170.32

6.4.7.9 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,853,844,142.64	2,853,844,142.64
本期申购	955,817,657.42	955,817,657.42
本期赎回（以“-”号填列）	-1,521,179,718.60	-1,521,179,718.60
-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	2,288,482,081.46	2,288,482,081.46

建信中证 500 指数增强 C

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	121,935,462.32	121,935,462.32
本期申购	53,169,214.34	53,169,214.34
本期赎回（以“-”号填列）	-68,766,814.23	-68,766,814.23
-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	106,337,862.43	106,337,862.43

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。

6.4.7.10 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	2,574,969,604.63	452,578,246.43	3,027,547,851.06

本期利润	502,620,180.18	284,240,997.17	786,861,177.35
本期基金份额交易产生的变动数	-554,067,420.49	-181,859,505.93	-735,926,926.42
其中：基金申购款	956,928,540.23	23,333,696.26	980,262,236.49
基金赎回款	-1,510,995,960.72	-205,193,202.19	-1,716,189,162.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,523,522,364.32	554,959,737.67	3,078,482,101.99
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	107,768,659.67	19,232,048.19	127,000,707.86
本期利润	21,762,391.21	9,926,453.65	31,688,844.86
本期基金份额交易产生的变动数	-15,006,136.98	-3,588,789.13	-18,594,926.11
其中：基金申购款	52,167,121.43	4,187,124.69	56,354,246.12
基金赎回款	-67,173,258.41	-7,775,913.82	-74,949,172.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	114,524,913.90	25,569,712.71	140,094,626.61

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,649,474.67
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	706,604.79
其他	20,331.29
合计	3,376,410.75

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	503,678,409.48

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	503,678,409.48

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	12,597,048,277.99
减：卖出股票成本总额	12,093,369,868.51
买卖股票差价收入	503,678,409.48

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	208,730.92
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	208,730.92

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,079,727.27
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	870,677.34
减：应收利息总额	319.01
买卖债券差价收入	208,730.92

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	47,608,862.14

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	37,108,825.37
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	37,108,825.37

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	272,438,650.82
股票投资	270,262,454.25
债券投资	2,176,196.57
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	21,728,800.00
权证投资	—
期货	21,728,800.00
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	294,167,450.82

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,521,619.29
基金转换费收入	26,494.54
合计	3,548,113.83

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	36,498,152.50
银行间市场交易费用	—
合计	36,498,152.50

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	—
银行划款手续费	7,802.51
指数使用费	444,278.13
银行间账户维护费	9,000.00
合计	570,479.02

6.4.7.21 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
建信基金资产管理有限责任公司（“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
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
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
建信资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

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

无。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	27,767,381.46	26,984,896.74
其中：支付销售机构的客户维护费	9,705,069.68	7,892,990.28

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,553,476.22	5,396,979.31

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	合计
-	-	-	-
建信基金	-	348,896.00	348,896.00
-	-	-	-
合计	-	348,896.00	348,896.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	合计
建信基金	-	1,173,908.84	1,173,908.84
合计	-	1,173,908.84	1,173,908.84

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 0.5%。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

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	532,956,029.37	2,649,474.67	550,834,689.90	2,447,026.11

注：本基金的活期存款由基金托管人中信银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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(2020 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	可流通日	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
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股未上市	5.00	6.54	2,546	12,730.00	16,650.84	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新发未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新发未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新发未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新发未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新发未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2021年01月11日	新发未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688085	三友医疗	2020年3月30日	2020年10月9日	新发未上市	20.96	67.62	8,807	184,594.72	595,529.34	-
688096	京源环保	2020年3月31日	2020年10月9日	新发未上市	14.34	21.42	4,485	64,314.90	96,068.70	-
688159	有方科技	2020年1月16日	2020年7月23日	新发未上市	20.35	52.73	3,341	67,989.35	176,170.93	-
688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新发未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新发未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688466	金科环境	2020年4月27日	2020年11月9日	新发未上市	24.61	36.59	4,907	120,761.27	179,547.13	-

688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新发未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688588	凌志软件	2020 年 4 月 28 日	2020 年 11 月 11 日	新发未上市	11.49	33.33	17,277	198,512.73	575,842.41	-
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新发未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

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
601880	大连港	2020 年 6 月 22 日	重大事项	1.72	2020 年 07 月 08 日	1.89	2,209,447	3,828,099.64	3,800,248.84	-
300216	千山药机	2019 年 4 月 26 日	重大事项	3.81	2020 年 08 月 05 日	3.43	787,500	3,589,270.00	3,000,375.00	-
600317	营口港	2020 年 6 月 22 日	重大事项	2.21	2020 年 07 月 08 日	2.43	10	25.15	22.10	-

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、由风险管理委员会、督察长、内控合规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内控合规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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	7,157,198.90	855,882.38
未评级	-	-
合计	7,157,198.90	855,882.38

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等

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。基金管理人会对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	532,956,029.37	-	-	-	532,956,029.37
结算备付金	225,381,045.10	-	-	-	225,381,045.10
存出保证金	67,877,181.79	-	-	-	67,877,181.79
交易性金融资产	-	-	7,157,198.90	4,759,944,928.40	4,767,102,127.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	102,822,640.58	102,822,640.58
应收利息	-	-	-	225,205.40	225,205.40
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	22,109,191.31	22,109,191.31
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	826,214,256.26	-	7,157,198.90	4,885,101,965.69	5,718,473,420.85
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	63,859,030.55	63,859,030.55
应付管理人报酬	-	-	-	4,568,593.32	4,568,593.32
应付托管费	-	-	-	913,718.67	913,718.67
应付销售服务费	-	-	-	97,292.06	97,292.06
应付交易费用	-	-	-	34,477,700.78	34,477,700.78
应交税费	-	-	-	610,242.66	610,242.66
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	550,170.32	550,170.32
负债总计	-	-	-	105,076,748.36	105,076,748.36
利率敏感度缺口	826,214,256.26	-	7,157,198.90	4,780,025,217.33	5,613,396,672.49
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
银行存款	327,252,293.65	-	-	-	327,252,293.65
结算备付金	63,861,980.79	-	-	-	63,861,980.79
存出保证金	1,611,079.07	-	-	-	1,611,079.07
交易性金融资产	-	10,141.00	855,882.38	5,748,844,914.78	5,749,710,938.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	49,595,452.71	49,595,452.71
应收利息	-	-	-	117,699.73	117,699.73
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	8,846,737.43	8,846,737.43
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	392,725,353.51	10,141.00	855,882.38	5,807,404,804.65	6,200,996,181.54
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	32,744,758.87	32,744,758.87
应付管理人报酬	-	-	-	5,111,307.97	5,111,307.97
应付托管费	-	-	-	1,022,261.58	1,022,261.58
应付销售服务费	-	-	-	103,750.49	103,750.49
应付交易费用	-	-	-	30,982,438.08	30,982,438.08
应交税费	-	-	-	6.31	6.31
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	703,494.36	703,494.36
负债总计	-	-	-	70,668,017.66	70,668,017.66
利率敏感度缺口	392,725,353.51	10,141.00	855,882.38	5,736,736,786.99	6,130,328,163.88

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

	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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-	-40.03
	市场利率下降 25 个基点	-	40.29

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	4,759,944,928.40	84.80	5,748,844,914.78	93.78
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	7,157,198.90	0.13	866,023.38	0.01
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	4,767,102,127.30	84.92	5,749,710,938.16	93.79

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	274,645,486.45	290,868,002.71
	业绩比较基准下降 5%	-274,645,486.45	-290,868,002.71

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 4,758,124,513.64 元，属于第二层次的余额为人民币 7,354,455.15 元，属于第三层次的余额为人民币 1,623,158.51 元（于 2019 年 6 月 30 日，属于第一层次的余额为人民币 5,301,332,627.35 元，属于第二层次的余额为人民币 3,067,468.54 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元）。

6.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为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。

6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.2 承诺事项

无。

6.4.14.3 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	4,759,944,928.40	83.24
	其中：股票	4,759,944,928.40	83.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,157,198.90	0.13
	其中：债券	7,157,198.90	0.13
	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	758,337,074.47	13.26
8	其他各项资产	193,034,219.08	3.38
9	合计	5,718,473,420.85	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	118,102,062.09	2.10
C	制造业	2,272,080,070.33	40.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	67,290,104.00	1.20
E	建筑业	123,673,188.43	2.20
F	批发和零售业	162,399,249.51	2.89
G	交通运输、仓储和邮政业	65,447,487.97	1.17
H	住宿和餐饮业	4,809,838.85	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	437,771,545.10	7.80
J	金融业	190,435,736.38	3.39
K	房地产业	96,302,896.71	1.72
L	租赁和商务服务业	77,257,731.43	1.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,719,332.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,351,650.00	0.29
R	文化、体育和娱乐	34,864,504.60	0.62

	业		
S	综合	17,877,063.60	0.32
	合计	3,698,382,461.00	65.88

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	63,007.00	0.00
B	采矿业	14,966,084.00	0.27
C	制造业	686,100,104.66	12.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	92,065.32	0.00
E	建筑业	9,558,189.40	0.17
F	批发和零售业	41,245,569.04	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	68,838,324.79	1.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,710,239.74	2.11
J	金融业	32,536,145.67	0.58
K	房地产业	35,846,122.78	0.64
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,212,239.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	2,570,204.65	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,712,411.35	0.23
R	文化、体育和娱乐业	21,111,760.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	1,061,562,467.40	18.91

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	002019	亿帆医药	5,656,494	129,929,667.18	2.31
2	000090	天健集团	16,468,573	113,797,839.43	2.03
3	000987	越秀金控	9,621,971	112,192,181.86	2.00
4	300418	昆仑万维	4,491,816	112,115,727.36	2.00
5	002028	思源电气	5,075,432	103,843,338.72	1.85
6	002382	蓝帆医疗	3,440,815	103,602,939.65	1.85
7	002653	海思科	3,366,111	89,572,213.71	1.60
8	601865	福莱特	4,660,213	87,612,004.40	1.56
9	603444	吉比特	153,084	84,044,646.84	1.50
10	000930	中粮科技	12,217,151	83,443,141.33	1.49
11	002030	达安基因	2,763,970	75,401,101.60	1.34
12	600521	华海药业	2,209,149	74,956,425.57	1.34
13	000975	银泰黄金	4,613,136	72,333,972.48	1.29
14	002223	鱼跃医疗	1,958,136	71,276,150.40	1.27
15	300285	国瓷材料	2,098,400	70,317,384.00	1.25
16	300274	阳光电源	4,774,403	68,703,659.17	1.22
17	300315	掌趣科技	7,129,087	52,256,207.71	0.93
18	002603	以岭药业	1,633,600	50,951,984.00	0.91
19	603233	大参林	612,960	49,784,611.20	0.89
20	000932	华菱钢铁	12,845,283	48,426,716.91	0.86
21	000488	晨鸣纸业	8,179,069	40,404,600.86	0.72
22	300088	长信科技	3,323,021	37,217,835.20	0.66
23	002390	信邦制药	8,049,944	36,707,744.64	0.65
24	300316	晶盛机电	1,409,712	34,876,274.88	0.62
25	300009	安科生物	1,860,550	33,303,845.00	0.59
26	002640	跨境通	5,051,500	32,784,235.00	0.58
27	002583	海能达	4,315,960	32,758,136.40	0.58
28	600201	生物股份	1,154,952	32,153,863.68	0.57
29	000513	丽珠集团	666,235	31,985,942.35	0.57
30	300058	蓝色光标	4,098,072	31,964,961.60	0.57
31	002174	游族网络	1,222,300	31,877,584.00	0.57
32	600885	宏发股份	776,092	31,136,811.04	0.55
33	002439	启明星辰	738,800	31,081,316.00	0.55
34	000400	许继电气	2,351,883	31,044,855.60	0.55
35	600486	扬农化工	372,851	30,760,207.50	0.55
36	300115	长盈精密	1,341,883	30,662,026.55	0.55
37	002273	水晶光电	1,756,755	30,110,780.70	0.54
38	002920	德赛西威	488,900	29,984,237.00	0.53
39	002127	南极电商	1,349,469	28,568,258.73	0.51
40	300133	华策影视	3,876,100	28,101,725.00	0.50
41	002399	海普瑞	1,114,216	27,899,968.64	0.50
42	002233	塔牌集团	2,302,626	27,700,590.78	0.49

43	002635	安洁科技	1,104,000	27,489,600.00	0.49
44	002925	盈趣科技	472,400	27,370,856.00	0.49
45	000807	云铝股份	6,144,775	26,791,219.00	0.48
46	600845	宝信软件	443,358	26,193,590.64	0.47
47	600901	江苏租赁	4,969,500	25,891,095.00	0.46
48	600058	五矿发展	4,133,814	24,968,236.56	0.44
49	600639	浦东金桥	1,559,811	24,925,779.78	0.44
50	000690	宝新能源	5,244,572	24,754,379.84	0.44
51	002217	合力泰	4,649,600	24,410,400.00	0.43
52	002244	滨江集团	5,679,160	24,250,013.20	0.43
53	600657	信达地产	5,729,000	23,603,480.00	0.42
54	002465	海格通信	1,820,195	23,553,323.30	0.42
55	300459	金科文化	6,404,280	22,094,766.00	0.39
56	601128	常熟银行	2,927,367	21,984,526.17	0.39
57	603317	天味食品	376,730	20,938,653.40	0.37
58	601799	星宇股份	162,900	20,688,300.00	0.37
59	002368	太极股份	472,100	20,626,049.00	0.37
60	300002	神州泰岳	3,308,900	20,482,091.00	0.36
61	603866	桃李面包	395,200	20,111,728.00	0.36
62	000685	中山公用	2,547,194	19,613,393.80	0.35
63	601969	海南矿业	3,862,600	18,849,488.00	0.34
64	600026	中远海能	2,893,180	18,689,942.80	0.33
65	002353	杰瑞股份	600,565	18,617,515.00	0.33
66	002385	大北农	2,039,477	18,579,635.47	0.33
67	000887	中鼎股份	2,350,200	18,449,070.00	0.33
68	600426	华鲁恒升	1,041,557	18,414,727.76	0.33
69	603056	德邦股份	1,336,639	18,084,725.67	0.32
70	002249	大洋电机	4,947,374	17,860,020.14	0.32
71	600811	东方集团	3,948,109	17,450,641.78	0.31
72	603882	金域医学	182,700	16,351,650.00	0.29
73	002387	维信诺	1,117,400	15,956,472.00	0.28
74	002648	卫星石化	963,125	15,670,043.75	0.28
75	300558	贝达药业	111,700	15,635,766.00	0.28
76	002821	凯莱英	63,300	15,381,900.00	0.27
77	002709	天赐材料	443,634	14,990,392.86	0.27
78	000800	一汽解放	1,392,700	14,957,598.00	0.27
79	600298	安琪酵母	294,753	14,584,378.44	0.26
80	300257	开山股份	1,094,483	14,304,892.81	0.25
81	603486	科沃斯	459,100	13,869,411.00	0.25
82	600862	中航高科	819,476	13,865,533.92	0.25
83	600804	鹏博士	1,543,600	13,861,528.00	0.25
84	000600	建投能源	2,625,152	13,362,023.68	0.24

85	603338	浙江鼎力	172,760	13,090,025.20	0.23
86	002124	天邦股份	1,000,100	12,851,285.00	0.23
87	603816	顾家家居	281,300	12,661,313.00	0.23
88	601689	拓普集团	440,123	12,279,431.70	0.22
89	002080	中材科技	784,141	12,154,185.50	0.22
90	000738	航发控制	888,500	12,128,025.00	0.22
91	002444	巨星科技	999,300	11,871,684.00	0.21
92	300166	东方国信	949,000	11,777,090.00	0.21
93	600908	无锡银行	2,287,117	11,229,744.47	0.20
94	600060	海信视像	920,714	11,186,675.10	0.20
95	600216	浙江医药	560,100	10,787,526.00	0.19
96	600348	阳泉煤业	2,538,663	10,713,157.86	0.19
97	300134	大富科技	744,174	10,403,552.52	0.19
98	600350	山东高速	1,675,120	10,285,236.80	0.18
99	002625	光启技术	1,402,900	10,171,025.00	0.18
100	002128	露天煤业	1,303,900	10,105,225.00	0.18
101	000785	居然之家	1,265,101	10,019,599.92	0.18
102	600064	南京高科	986,885	9,592,522.20	0.17
103	002414	高德红外	315,180	9,228,470.40	0.16
104	000009	中国宝安	1,066,660	9,077,276.60	0.16
105	002511	中顺洁柔	404,200	9,013,660.00	0.16
106	002745	木林森	567,200	8,740,552.00	0.16
107	002941	新疆交建	614,700	8,698,005.00	0.15
108	000878	云南铜业	805,704	8,548,519.44	0.15
109	002797	第一创业	1,178,100	8,152,452.00	0.15
110	600875	东方电气	904,801	8,007,488.85	0.14
111	002078	太阳纸业	841,025	8,006,558.00	0.14
112	300070	碧水源	965,600	7,840,672.00	0.14
113	600415	小商品城	1,457,930	7,100,119.10	0.13
114	002818	富森美	529,200	6,509,160.00	0.12
115	600895	张江高科	319,152	6,501,126.24	0.12
116	601811	新华文轩	602,426	6,126,672.42	0.11
117	600282	南钢股份	1,884,821	6,087,971.83	0.11
118	000564	供销大集	1,354,200	6,080,358.00	0.11
119	600751	海航科技	1,907,749	5,971,254.37	0.11
120	600446	金证股份	304,200	5,901,480.00	0.11
121	603883	老百姓	58,919	5,894,256.76	0.11
122	603939	益丰药房	62,680	5,703,880.00	0.10
123	002408	齐翔腾达	896,171	5,565,221.91	0.10
124	600770	综艺股份	1,145,600	5,498,880.00	0.10
125	600549	厦门钨业	447,600	5,299,584.00	0.09
126	002434	万里扬	590,500	5,125,540.00	0.09

127	600466	蓝光发展	933,357	5,030,794.23	0.09
128	300207	欣旺达	259,000	4,895,100.00	0.09
129	000883	湖北能源	1,377,484	4,848,743.68	0.09
130	600291	西水股份	523,000	4,733,150.00	0.08
131	600754	锦江酒店	170,500	4,731,375.00	0.08
132	002815	崇达技术	229,600	4,644,808.00	0.08
133	600008	首创股份	1,538,500	4,630,885.00	0.08
134	603659	璞泰来	41,343	4,259,155.86	0.08
135	002191	劲嘉股份	465,600	4,148,496.00	0.07
136	600125	铁龙物流	714,600	3,987,468.00	0.07
137	603568	伟明环保	167,590	3,888,088.00	0.07
138	601880	大连港	2,209,447	3,800,248.84	0.07
139	600633	浙数文化	388,500	3,799,530.00	0.07
140	600256	广汇能源	1,359,400	3,670,380.00	0.07
141	600017	日照港	1,397,650	3,480,148.50	0.06
142	000636	风华高科	115,000	3,356,850.00	0.06
143	600673	东阳光	477,700	3,300,907.00	0.06
144	600779	水井坊	51,600	3,220,872.00	0.06
145	600022	山东钢铁	2,426,922	3,130,729.38	0.06
146	002183	怡亚通	581,200	3,115,232.00	0.06
147	002221	东华能源	337,800	2,969,262.00	0.05
148	600155	华创阳安	241,266	2,892,779.34	0.05
149	603556	海兴电力	198,829	2,871,090.76	0.05
150	000717	韶钢松山	740,699	2,814,656.20	0.05
151	600717	天津港	608,008	2,687,395.36	0.05
152	601615	明阳智能	194,903	2,426,542.35	0.04
153	000718	苏宁环球	776,434	2,399,181.06	0.04
154	600259	广晟有色	78,400	2,352,000.00	0.04
155	000553	安道麦 A	260,700	2,351,514.00	0.04
156	601200	上海环境	165,881	1,990,572.00	0.04
157	000686	东北证券	234,600	1,982,370.00	0.04
158	300072	三聚环保	446,470	1,910,891.60	0.03
159	600260	凯乐科技	140,600	1,900,912.00	0.03
160	601717	郑煤机	291,000	1,713,990.00	0.03
161	601966	玲珑轮胎	77,709	1,569,721.80	0.03
162	601003	柳钢股份	353,000	1,563,790.00	0.03
163	000848	承德露露	221,443	1,550,101.00	0.03
164	300618	寒锐钴业	24,800	1,538,096.00	0.03
165	600640	号百控股	75,300	1,502,235.00	0.03
166	600507	方大特钢	255,800	1,327,602.00	0.02
167	002064	华峰氨纶	252,900	1,282,203.00	0.02
168	600428	中远海特	408,625	1,258,565.00	0.02

169	600575	淮河能源	574,200	1,200,078.00	0.02
170	002375	亚厦股份	115,200	1,177,344.00	0.02
171	601000	唐山港	447,752	998,486.96	0.02
172	600161	天坛生物	20,400	924,732.00	0.02
173	002507	涪陵榨菜	23,600	849,836.00	0.02
174	601718	际华集团	240,000	796,800.00	0.01
175	600664	哈药股份	245,866	757,267.28	0.01
176	002839	张家港行	130,300	750,528.00	0.01
177	002701	奥瑞金	175,480	735,261.20	0.01
178	002416	爱施德	86,302	619,648.36	0.01
179	002957	科瑞技术	24,100	575,990.00	0.01
180	603885	吉祥航空	62,600	569,660.00	0.01
181	603707	健友股份	8,300	535,931.00	0.01
182	601098	中南传媒	49,972	528,703.76	0.01
183	000750	国海证券	114,820	498,318.80	0.01
184	000528	柳 工	55,000	347,050.00	0.01
185	000581	威孚高科	16,100	332,948.00	0.01
186	600787	中储股份	75,336	330,725.04	0.01
187	002075	沙钢股份	13,518	168,975.00	0.00
188	300271	华宇软件	3,000	84,630.00	0.00
189	603650	彤程新材	3,600	83,772.00	0.00
190	601233	桐昆股份	6,400	81,664.00	0.00
191	601139	深圳燃气	12,412	80,678.00	0.00
192	002831	裕同科技	2,926	80,494.26	0.00
193	002340	格林美	15,800	78,526.00	0.00
194	600258	首旅酒店	5,105	78,463.85	0.00
195	000501	鄂武商 A	5,000	78,400.00	0.00
196	000983	西山煤电	20,757	77,838.75	0.00
197	603225	新凤鸣	7,700	76,846.00	0.00
198	600062	华润双鹤	5,800	76,676.00	0.00
199	600729	重庆百货	2,398	74,865.56	0.00
200	601975	招商南油	31,300	74,807.00	0.00
201	600643	爱建集团	9,194	73,092.30	0.00
202	603000	人民网	3,685	73,073.55	0.00
203	600737	中粮糖业	9,300	72,354.00	0.00
204	002055	山西证券	11,032	72,149.28	0.00
205	600388	龙净环保	7,700	67,760.00	0.00
206	002440	闰土股份	7,300	66,722.00	0.00
207	000830	鲁西化工	8,000	59,680.00	0.00
208	601005	重庆钢铁	39,300	58,557.00	0.00
209	600435	北方导航	7,487	56,601.72	0.00
210	002281	光迅科技	1,700	55,862.00	0.00

211	600528	中铁工业	6,292	55,495.44	0.00
212	600623	华谊集团	10,500	54,180.00	0.00
213	000681	视觉中国	2,901	54,016.62	0.00
214	601928	凤凰传媒	7,851	53,386.80	0.00
215	000547	航天发展	3,892	53,203.64	0.00
216	000012	南玻 A	9,054	45,451.08	0.00
217	600166	福田汽车	5,630	10,134.00	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	300529	健帆生物	721,720	50,159,540.00	0.89
2	601872	招商轮船	6,973,385	40,654,834.55	0.72
3	002049	紫光国微	524,681	38,170,542.75	0.68
4	002959	小熊电器	251,500	30,934,500.00	0.55
5	002437	誉衡药业	9,461,888	30,561,898.24	0.54
6	002727	一心堂	750,890	27,865,527.90	0.50
7	300308	中际旭创	426,300	26,856,900.00	0.48
8	300770	新媒股份	119,792	26,792,678.72	0.48
9	000799	酒鬼酒	300,200	22,968,302.00	0.41
10	002734	利民股份	1,428,420	21,383,447.40	0.38
11	300413	芒果超媒	323,800	21,111,760.00	0.38
12	002460	赣锋锂业	387,900	20,779,803.00	0.37
13	600864	哈投股份	3,395,338	20,405,981.38	0.36
14	300454	深信服	95,400	19,648,584.00	0.35
15	002007	华兰生物	387,362	19,410,709.82	0.35
16	300294	博雅生物	441,100	16,536,839.00	0.29
17	603258	电魂网络	293,800	16,323,528.00	0.29
18	600406	国电南瑞	749,800	15,183,450.00	0.27
19	000661	长春高新	32,898	14,320,499.40	0.26
20	002311	海大集团	286,706	13,644,338.54	0.24
21	002705	新宝股份	365,800	13,344,384.00	0.24
22	600809	山西汾酒	91,100	13,209,500.00	0.24
23	603686	龙马环卫	538,180	13,115,446.60	0.23
24	300037	新宙邦	238,100	13,109,786.00	0.23
25	601012	隆基股份	319,800	13,025,454.00	0.23
26	603238	诺邦股份	307,000	12,955,400.00	0.23
27	000858	五粮液	75,400	12,902,448.00	0.23
28	300170	汉得信息	1,330,900	12,803,258.00	0.23
29	002847	盐津铺子	134,200	12,778,524.00	0.23
30	002208	合肥城建	1,212,606	12,768,741.18	0.23
31	000516	国际医学	3,138,867	12,712,411.35	0.23

32	300373	扬杰科技	376,400	12,616,928.00	0.22
33	601899	紫金矿业	2,829,400	12,449,360.00	0.22
34	002724	海洋王	1,904,500	11,731,720.00	0.21
35	300119	瑞普生物	520,000	11,622,000.00	0.21
36	000915	山大华特	353,600	11,580,400.00	0.21
37	603058	永吉股份	1,207,812	11,401,745.28	0.20
38	002216	三全食品	472,100	11,283,190.00	0.20
39	002568	百润股份	247,900	11,234,828.00	0.20
40	300782	卓胜微	27,580	11,191,136.60	0.20
41	300394	天孚通信	187,000	11,135,850.00	0.20
42	603208	江山欧派	111,200	10,830,880.00	0.19
43	002726	龙大肉食	1,278,494	10,790,489.36	0.19
44	002304	洋河股份	101,500	10,671,710.00	0.19
45	000002	万 科 A	408,200	10,670,348.00	0.19
46	300476	胜宏科技	439,800	10,577,190.00	0.19
47	600761	安徽合力	1,091,711	10,524,094.04	0.19
48	002950	奥美医疗	365,950	10,385,661.00	0.19
49	600004	白云机场	644,900	9,828,276.00	0.18
50	000703	恒逸石化	1,067,540	9,746,640.20	0.17
51	002697	红旗连锁	886,073	9,675,917.16	0.17
52	603611	诺力股份	450,500	9,667,730.00	0.17
53	600496	精工钢构	2,819,742	9,446,135.70	0.17
54	601021	春秋航空	265,800	9,366,792.00	0.17
55	000529	广弘控股	1,263,400	9,298,624.00	0.17
56	300248	新开普	742,800	9,181,008.00	0.16
57	000001	平安银行	712,200	9,116,160.00	0.16
58	000656	金科股份	1,116,100	9,107,376.00	0.16
59	600612	老凤祥	186,700	8,997,073.00	0.16
60	300305	裕兴股份	839,799	8,708,715.63	0.16
61	002912	中新赛克	53,100	8,686,629.00	0.15
62	300188	美亚柏科	436,600	8,657,778.00	0.15
63	603579	荣泰健康	320,700	8,601,174.00	0.15
64	300746	汉嘉设计	732,400	8,591,052.00	0.15
65	603018	中设集团	868,900	8,454,397.00	0.15
66	300214	日科化学	1,031,406	8,395,644.84	0.15
67	600012	皖通高速	1,580,156	8,201,009.64	0.15
68	600745	闻泰科技	48,290	6,082,125.50	0.11
69	002897	意华股份	167,380	5,732,765.00	0.10
70	600584	长电科技	173,048	5,411,210.96	0.10
71	002626	金达威	187,801	4,875,313.96	0.09
72	300041	回天新材	304,600	4,620,782.00	0.08
73	300684	中石科技	121,584	4,218,964.80	0.08
74	000034	神州数码	145,300	3,536,602.00	0.06

75	600658	电子城	539,200	3,219,024.00	0.06
76	300216	千山退	787,500	3,000,375.00	0.05
77	601222	林洋能源	519,400	2,835,924.00	0.05
78	601878	浙商证券	261,500	2,591,465.00	0.05
79	600547	山东黄金	67,200	2,460,864.00	0.04
80	002159	三特索道	220,442	2,327,867.52	0.04
81	002214	大立科技	42,251	1,190,633.18	0.02
82	300565	科信技术	61,800	812,670.00	0.01
83	688085	三友医疗	8,807	595,529.34	0.01
84	688588	凌志软件	17,277	575,842.41	0.01
85	600009	上海机场	7,800	562,146.00	0.01
86	002588	史丹利	100,400	423,688.00	0.01
87	300701	森霸传感	12,000	417,960.00	0.01
88	002812	恩捷股份	5,500	361,900.00	0.01
89	688466	金科环境	4,907	179,547.13	0.00
90	688159	有方科技	3,341	176,170.93	0.00
91	300750	宁德时代	1,000	174,360.00	0.00
92	603360	百傲化学	8,262	160,530.66	0.00
93	002280	*ST 联络	97,516	140,423.04	0.00
94	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
95	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
96	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
97	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
98	300768	迪普科技	2,100	97,209.00	0.00
99	688096	京源环保	4,485	96,068.70	0.00
100	300494	盛天网络	4,000	95,400.00	0.00
101	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00
102	601326	秦港股份	37,525	94,187.75	0.00
103	600958	东方证券	9,705	92,100.45	0.00
104	300384	三联虹普	5,200	90,896.00	0.00
105	300749	顶固集创	6,480	90,396.00	0.00
106	002001	新 和 成	3,100	90,210.00	0.00
107	002577	雷柏科技	6,671	89,724.95	0.00
108	601066	中信建投	2,200	86,636.00	0.00
109	000166	申万宏源	16,800	84,840.00	0.00
110	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
111	603013	亚普股份	5,200	83,824.00	0.00
112	300277	海联讯	5,700	82,479.00	0.00
113	002942	新农股份	2,800	81,816.00	0.00
114	000560	我爱我家	25,198	80,633.60	0.00
115	601100	恒立液压	1,000	80,200.00	0.00
116	300435	中泰股份	8,100	79,299.00	0.00
117	002358	森源电气	15,500	77,345.00	0.00

118	601688	华泰证券	4,100	77,080.00	0.00
119	300748	金力永磁	2,300	76,774.00	0.00
120	603429	集友股份	2,408	76,646.64	0.00
121	603696	安记食品	5,303	76,469.26	0.00
122	300635	中达安	2,600	75,894.00	0.00
123	000523	广州浪奇	13,600	74,936.00	0.00
124	002600	领益智造	7,000	74,410.00	0.00
125	300598	诚迈科技	390	73,866.00	0.00
126	300573	兴齐眼药	500	72,500.00	0.00
127	002008	大族激光	2,000	71,900.00	0.00
128	300559	佳发教育	3,300	70,026.00	0.00
129	002366	台海核电	16,500	69,795.00	0.00
130	002410	广联达	1,000	69,700.00	0.00
131	002095	生意宝	3,400	68,680.00	0.00
132	000049	德赛电池	1,400	68,614.00	0.00
133	600611	大众交通	18,224	68,522.24	0.00
134	603289	泰瑞机器	6,900	68,172.00	0.00
135	603966	法兰泰克	6,900	68,172.00	0.00
136	300693	盛弘股份	3,400	68,068.00	0.00
137	002243	通产丽星	4,708	67,795.20	0.00
138	600183	生益科技	2,310	67,613.70	0.00
139	603318	派思股份	8,600	65,360.00	0.00
140	300154	瑞凌股份	12,400	64,232.00	0.00
141	601236	红塔证券	3,300	64,020.00	0.00
142	300319	麦捷科技	5,700	63,327.00	0.00
143	002573	清新环境	11,500	62,790.00	0.00
144	002660	茂硕电源	7,200	62,496.00	0.00
145	601919	中远海控	17,900	62,113.00	0.00
146	603035	常熟汽饰	5,400	61,668.00	0.00
147	300719	安达维尔	5,250	60,585.00	0.00
148	300487	蓝晓科技	1,834	60,301.92	0.00
149	688300	联瑞新材	864	59,425.92	0.00
150	300751	迈为股份	200	59,392.00	0.00
151	000963	华东医药	2,300	58,190.00	0.00
152	300537	广信材料	3,100	58,187.00	0.00
153	002299	圣农发展	2,003	58,087.00	0.00
154	603316	诚邦股份	6,950	57,198.50	0.00
155	300414	中光防雷	5,048	56,941.44	0.00
156	000705	浙江震元	7,846	55,941.98	0.00
157	601898	中煤能源	14,700	55,860.00	0.00
158	002765	蓝黛传动	12,700	55,626.00	0.00
159	600939	重庆建工	15,280	54,855.20	0.00
160	300779	惠城环保	2,900	54,549.00	0.00

161	300462	华铭智能	2,400	54,432.00	0.00
162	300610	晨化股份	4,420	54,366.00	0.00
163	300538	同益股份	1,900	53,390.00	0.00
164	603533	掌阅科技	1,400	53,382.00	0.00
165	002401	中远海科	3,300	52,569.00	0.00
166	002634	棒杰股份	8,800	51,656.00	0.00
167	002743	富煌钢构	8,100	51,354.00	0.00
168	300737	科顺股份	2,588	51,061.24	0.00
169	600169	太原重工	26,700	50,997.00	0.00
170	000708	中信特钢	2,870	49,048.30	0.00
171	300129	泰胜风能	13,100	48,077.00	0.00
172	300457	赢合科技	1,350	43,038.00	0.00
173	603026	石大胜华	1,600	42,704.00	0.00
174	300085	银之杰	2,600	41,652.00	0.00
175	603197	保隆科技	1,300	38,454.00	0.00
176	300709	精研科技	390	37,498.50	0.00
177	300563	神宇股份	1,100	36,003.00	0.00
178	603596	伯特利	1,000	35,200.00	0.00
179	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
180	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
181	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
182	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
183	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
184	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
185	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
186	300159	新研股份	1,876	7,335.16	0.00
187	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
188	300363	博腾股份	200	6,912.00	0.00
189	002714	牧原股份	60	4,920.00	0.00
190	603005	晶方科技	60	4,719.60	0.00
191	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
192	300715	凯伦股份	90	3,355.20	0.00
193	300059	东方财富	60	1,212.00	0.00
194	002384	东山精密	26	778.70	0.00
195	000099	中信海直	61	421.51	0.00
196	600346	恒力石化	20	280.00	0.00
197	600317	营口港	10	22.10	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	002019	亿帆医药	140,530,038.18	2.29

2	300274	阳光电源	135,529,936.82	2.21
3	000090	天健集团	130,896,511.01	2.14
4	300010	立思辰	118,462,115.69	1.93
5	300315	掌趣科技	113,269,996.31	1.85
6	600584	长电科技	111,884,433.70	1.83
7	000930	中粮科技	107,585,428.42	1.75
8	300418	昆仑万维	105,877,210.73	1.73
9	000987	越秀金控	102,685,095.40	1.68
10	002028	思源电气	96,687,854.25	1.58
11	000547	航天发展	94,880,831.52	1.55
12	002505	大康农业	87,735,793.00	1.43
13	601108	财通证券	87,290,238.00	1.42
14	002223	鱼跃医疗	80,013,833.25	1.31
15	300058	蓝色光标	78,211,146.97	1.28
16	002653	海思科	78,024,560.31	1.27
17	600521	华海药业	77,778,345.50	1.27
18	002249	大洋电机	76,841,221.58	1.25
19	000975	银泰黄金	75,769,366.21	1.24
20	000400	许继电气	74,566,582.45	1.22

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	600584	长电科技	138,690,763.80	2.26
2	002505	大康农业	125,281,540.26	2.04
3	000547	航天发展	118,317,006.00	1.93
4	002714	牧原股份	111,151,841.50	1.81
5	300010	立思辰	105,804,948.00	1.73
6	600143	金发科技	94,108,319.58	1.54
7	300058	蓝色光标	93,982,419.04	1.53
8	601108	财通证券	90,640,643.45	1.48
9	300014	亿纬锂能	89,885,227.25	1.47
10	000025	特力A	85,973,931.93	1.40
11	300274	阳光电源	84,989,461.50	1.39
12	300315	掌趣科技	81,487,880.73	1.33
13	300253	卫宁健康	76,430,580.53	1.25
14	002385	大北农	71,536,033.85	1.17
15	002384	东山精密	69,082,530.66	1.13
16	300257	开山股份	68,989,488.00	1.13
17	601966	玲珑轮胎	68,096,908.40	1.11
18	002624	完美世界	68,049,686.10	1.11

19	002129	中环股份	65,129,246.74	1.06
20	300001	特锐德	65,064,299.06	1.06

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	10,834,207,427.88
卖出股票收入（成交）总额	12,597,048,277.99

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,157,198.90	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,157,198.90	0.13

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113035	福莱转债	49,810	7,157,198.90	0.13

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代 码	名 称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2007	IC2007	472	547,463,360.00	21,728,800.00	-
公允价值变动总额合计(元)					21,728,800.00
股指期货投资本期收益(元)					47,608,862.14
股指期货投资本期公允价值变动(元)					21,728,800.00

7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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	67,877,181.79
2	应收证券清算款	102,822,640.58
3	应收股利	-
4	应收利息	225,205.40

5	应收申购款	22,109,191.31
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	193,034,219.08

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	364,527	6,277.95	309,058,658.49	13.50	1,979,423,422.97	86.50
建信中证 500 指 数增强 C	22,610	4,703.13	66,778,837.61	62.80	39,559,024.82	37.20
合计	387,137	6,185.98	375,837,496.10	15.69	2,018,982,447.79	84.31

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	1,491,992.46	0.07
	建信中证 500 指数增强 C	45,656.35	0.04
	合计	1,537,648.81	0.06

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	—
	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	—
	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
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	2,853,844,142.64	121,935,462.32
本报告期基金总申购份额	955,817,657.42	53,169,214.34
减：本报告期基金总赎回份额	1,521,179,718.60	68,766,814.23
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期期末基金份	2,288,482,081.46	106,337,862.43

额总额		
-----	--	--

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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人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

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	
方正证券	3	7,774,658,574.53	33.20%	7,240,556.79	33.44%	-
长江证券	3	2,625,878,996.28	11.21%	2,436,553.05	11.25%	-
申万宏源	2	1,833,305,030.24	7.83%	1,670,698.62	7.72%	-
国泰君安 证券	1	1,689,729,930.62	7.22%	1,539,856.49	7.11%	-
中泰证券	1	1,401,899,593.82	5.99%	1,305,591.15	6.03%	-
宏信证券	1	1,113,618,396.22	4.76%	1,037,117.71	4.79%	-
中金公司	2	1,077,899,519.92	4.60%	1,003,849.52	4.64%	-
安信证券	2	1,015,633,265.93	4.34%	925,547.40	4.28%	-
天风证券	1	937,397,879.15	4.00%	854,219.52	3.95%	-
民生证券	1	809,142,808.21	3.46%	753,556.00	3.48%	-
中信建投	1	529,697,119.30	2.26%	482,724.30	2.23%	-
中金财富 证券	1	502,586,751.48	2.15%	457,999.60	2.12%	-
广发证券	2	405,978,634.66	1.73%	378,089.03	1.75%	-
国都证券	1	370,789,735.13	1.58%	337,901.06	1.56%	-
东北证券	1	369,522,373.25	1.58%	344,137.35	1.59%	-
中信证券	4	253,976,675.35	1.08%	231,455.86	1.07%	-
光大证券	2	215,200,642.97	0.92%	196,112.75	0.91%	-
招商证券	1	185,542,983.70	0.79%	169,085.04	0.78%	-
东方财富 证券	2	178,386,831.57	0.76%	166,131.14	0.77%	-
东方证券	2	126,990,181.94	0.54%	118,266.57	0.55%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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

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

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

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

（4）佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内新增中泰证券 1 个交易单元，未剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期权证

		成交总额的 比例		回购 成交总额的 比例		证 成交总额的 比例
方正证券	325,305.56	5.36%				
长江证券						
申万宏源						
国泰君安 证券						
中泰证券						
宏信证券	516,710.08	8.52%				
中金公司	4,700.00	0.08%				
安信证券						
天风证券	231,790.20	3.82%				
民生证券						
中信建投						
中金财富 证券						
广发证券						
国都证券						
东北证券						
中信证券						
光大证券						
招商证券						
东方财富 证券	4,986,783.35	82.22%				
东方证券						
渤海证券						
东兴证券						
高华证券						
广州证券						
国金证券						
国盛证券						
国信证券						
海通证券						
宏源证券						
华创证券						
华融证券						
上海证券						

太平洋证券						
信达证券						
兴业证券						
中航证券						
中银国际						

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	建信基金管理有限责任公司关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-10
2	建信基金管理有限责任公司关于新增阳光人寿为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-05
3	建信基金管理有限责任公司关于增加大连网金基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-30
4	建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加渤海银行基金申购、定投费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-26
5	建信基金管理有限责任公司关于增加华瑞保险销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-08
6	关于新增方正证券为旗下部分开放式基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-03-10

§ 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

2020 年 8 月 28 日