

# 建信中小盘先锋股票型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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。本年度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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>57</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	57
8.3 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 .....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	62
8.6 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 .....	62
8.7 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
8.8 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
8.9 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
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
8.12 投资组合报告附注 .....	63
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>64</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
9.3 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 .....	64
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	65
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>65</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>65</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
11.2 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 .....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
11.4 基金投资策略的改变 .....	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	66
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.8 其他重大事件 .....	69
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>69</b>
12.1 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 .....	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>69</b>
13.1 备查文件目录 .....	69
13.2 存放地点 .....	70
13.3 查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信中小盘先锋股票型证券投资基金	
基金简称	建信中小盘先锋股票	
基金主代码	000729	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 8 月 20 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	682,471,351.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信中小盘先锋股票 A	建信中小盘先锋股票 C
下属分级基金的交易代码	000729	013919
报告期末下属分级基金的份额总额	588,278,231.67 份	94,193,119.62 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。 在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。 此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	85%×中证 500 指数收益率+15%×中债综合全价(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金，混合型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

### 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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	95565
传真	010-66228001	0755-82960794
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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 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	深圳市福田区福田街道福华一 路 111 号
邮政编码	100033	518000
法定代表人	生柳荣	霍达

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网 址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊 普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年		2022 年		2021 年	2021 年 10 月 27 日(基 金合同生效 日)-2021 年 12 月 31 日
	建信中小盘 先锋股票 A	建信中小盘 先锋股票 C	建信中小盘 先锋股票 A	建信中小盘 先锋股票 C	建信中小盘 先锋股票 A	建信中小盘 先锋股票 C
本期已实现 收益	-407,837,6 81.65	-89,024,17 4.50	-232,458,7 73.19	-98,443,67 0.94	117,749,34 2.73	5,625,072. 09
本期利润	-410,740,7 59.05	-77,570,46 8.12	-500,008,5 41.55	-209,918,8 84.25	296,594,03 6.11	9,136,977. 74
加权平均基 金份额本期 利润	-0.5669	-0.4350	-0.6723	-0.6881	1.6788	0.1145
本期加权平 均净值利润 率	-15.76%	-11.89%	-16.66%	-17.05%	47.37%	2.76%
本期基金份 额净值增长 率	-15.29%	-15.63%	-11.43%	-11.80%	67.26%	6.99%
3.1.2 期末 数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

期末可供分配利润	506,695,296.64	78,464,714.07	1,250,366,747.70	394,106,871.04	957,559,858.22	322,317,029.82
期末可供分配基金份额利润	0.8613	0.8330	1.4657	1.4472	1.8073	1.8039
期末基金资产净值	1,865,029,267.52	295,990,197.67	3,192,370,620.53	1,014,159,474.36	2,238,819,376.97	754,329,531.00
期末基金份额净值	3.170	3.142	3.742	3.724	4.225	4.222
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	217.00%	-20.38%	274.20%	-5.63%	322.50%	6.99%

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

建信中小盘先锋股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.56%	0.93%	-3.77%	0.73%	0.21%	0.20%
过去六个月	-12.21%	0.88%	-7.96%	0.73%	-4.25%	0.15%
过去一年	-15.29%	0.90%	-5.96%	0.70%	-9.33%	0.20%
过去三年	25.49%	1.50%	-11.57%	0.92%	37.06%	0.58%
过去五年	193.79%	1.56%	27.99%	1.09%	165.80%	0.47%
自基金合同生效起至今	217.00%	1.64%	24.13%	1.35%	192.87%	0.29%

建信中小盘先锋股票 C

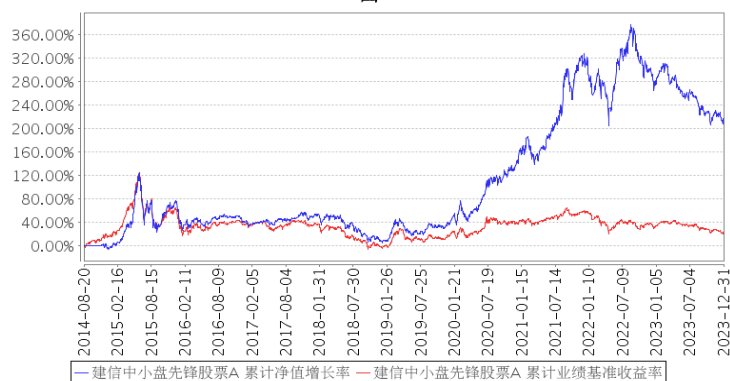
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.65%	0.93%	-3.77%	0.73%	0.12%	0.20%
过去六个月	-12.41%	0.88%	-7.96%	0.73%	-4.45%	0.15%
过去一年	-15.63%	0.90%	-5.96%	0.70%	-9.67%	0.20%
自基金合同生效 起至今	-20.38%	1.35%	-19.14%	0.94%	-1.24%	0.41%

注：本基金投资业绩比较基准为：85%×中证 500 指数收益率+15%×中债综合全价（总值）指数收益率。中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的中小盘股票，综合反映了沪深证券市场内中市值公司的整体情况。因此，基金管理人选择中证 500 指数作为本基金股票部分的比较基准。

中债综合全价（总值）指数由中央国债登记结算公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成份券种包括除资产支持债券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

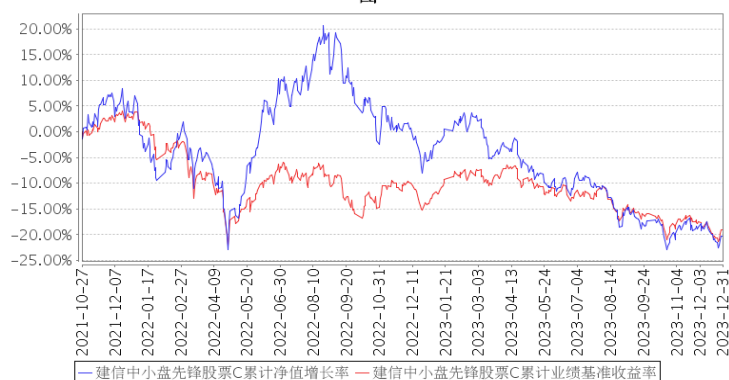
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信中小盘先锋股票A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





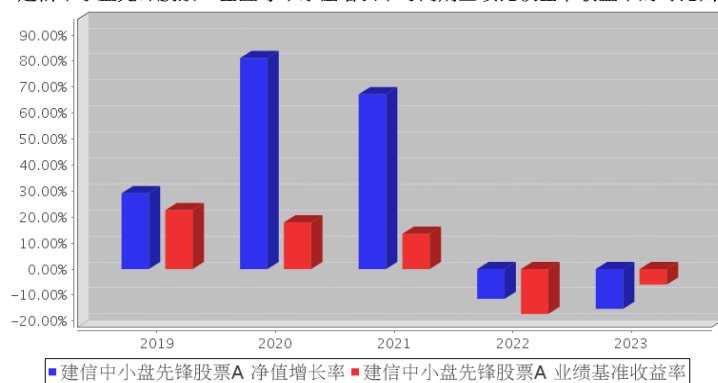
建信中小盘先锋股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



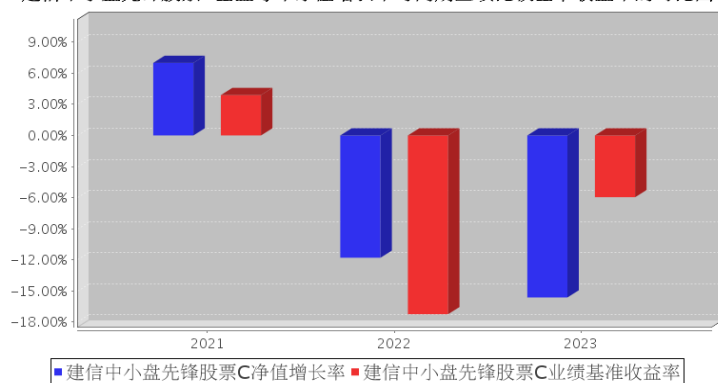
注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信中小盘先锋股票A 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



建信中小盘先锋股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

公司以持续优秀的管理能力、完善周到的服务，为超过 7000 万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至 2023 年 12 月 31 日，公司管理运作 163 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 1.03 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		
周智硕	权益投资部高级基金经理，本基金的基金经理	2020 年 9 月 18 日	-	13	周智硕先生，权益投资部高级基金经理，硕士。曾任南方基金管理有限公司研究部研究员、中国国际金融有限公司研究部高级经理、北京鸿道投资管理有限责任公司研究部权益资深研究员、权益基金经理、七曜投资管理合伙企业投资部权益投资经理、工银瑞信基金管理有限公司养老金投资中心投资经理。2020 年 6 月加入建信基金权益投资部任基金经理。2020 年 9 月 18 日起任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的基金经理；2021 年 9 月 29 日起任建信优化配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 10 月 14 日起任建信智远先锋混合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

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《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 公平交易制度和控制方法

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。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年中国经济总体处于疫后恢复期，GDP 全年增长 5.2%，实现了年初定下的“5%左右”的增速目标，既有基数效应的作用，又与中国经济的韧性和宏观政策有关。从全年经济修复节奏来

看，2023 年中国经济运行呈现“曲折式前进”的特征。一季度开门红、二季度有下行压力、三季度逐步恢复，四季度略有回落。在国内经济复苏不及预期以及海外美债利率大幅上行的双重压力下，权益资产延续了 2022 年的惯性下行趋势，沪深 300 首现年线三连阴，而港股相较于 A 股权重板块则收得更大跌幅。2023 全年来看，沪深 300 指数下跌 11.38%，创业板指数下跌 19.41%，恒生指数下跌 13.82%。

回顾过去，我们在 2020 年提到了经济转型“由高速增长阶段转向高质量发展”、2022 年先后提到了能源安全问题和利润留存、穿越周期等问题，得到的，是“结构性的业绩往往会使得板块性机会有所减少，需要我们进一步研究下沉”的结论，是希望通过“自下而上，寻找产品、服务有竞争力，有供应链管理能力，或者有足够的供给保护或者控制能力”寻找能穿越周期的公司的投资机会。这种机会，是由于不同公司具有不同禀赋导致的。有的是因为他们在疫情三年和疫情复苏后的第一年表现出的卓尔不群的盈利能力；有的是由于行业几近出清，摆脱了负重前行，即将迎来曙光；有的是经济转型、全球产业链变迁带来的行业机会；有的是新技术应用下，在之前布局良久的公司有望受益；还有的是有望转型，具有良好的风险收益比的公司。按照这个思路，本基金继续自下而上，寻找竞争力突出、风险收益比较高的公司这条主线进行投资，重点投资了电子、机械、煤炭、国防军工、电力设备及新能源、房地产、非银、医药和基础化工等行业的企业。

#### 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-15.29%，波动率 0.90%，业绩比较基准收益率-5.96%，波动率 0.70%。本报告期本基金 C 净值增长率-15.63%，波动率 0.90%，业绩比较基准收益率-5.96%，波动率 0.70%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，我们认为经济压力最大阶段已经度过，三大工程发力有助于遏制地产继续快速下行，价格回升带动企业盈利触底回升，名义增速回暖也会带动居民收入进一步修复，地方政府化债亦进入实质攻坚阶段。预计全年 GDP 增速能够实现 5%左右。基本面方面，价格水平回升带动企业盈利修复，是 A 股基本面拐点的重要线索。预计 PPI 将延续修复年中转正，全年中枢-0.7%，GDP 平减指数由去年的-0.54%实现 0.2%左右的小幅正增。中性情形下，2024 年全 A 非金融盈利增速能够修复至 5%左右。估值方面，不论从估值的深度与广度看，当前都处于历史较低水位。从估值深度看，沪深 300PB 一度跌破 1.2 倍，接近历史最低水平；从估值广度看，经过一年多估值去化，申万一级行业中，除了煤炭、公用事业、石油石化等偏高股息行业外，其余行业估值都处于历史 30%分位以下，这也更接近 08 年、12 年、18 年熊市底部的估值特征。正如经济的恢复不能

一蹴而就一样，股市的提振也可能一波三折。尽管我国经济仍处于转型期，国际局势可能依旧日趋复杂，但一批在过去砥砺前行企业有望迎来一段不错的业绩爆发期。本基金将继续发掘优质的中小公司，希冀随着公司长大，通过研究发掘新经济下主导产业中的龙头企业，跟随企业成长，将成为我们获取投资回报的重要手段。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司风险与合规管理部牵头组织继续完善了风险管理制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总裁和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施：

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备定期监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由内控合规部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司年度监察稽核工作计划，实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发违法违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发

的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的原则，秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障持有人的合法权益。

#### 4.7 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 and 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70071792_A14 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信中小盘先锋股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了建信中小盘先锋股票型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的建信中小盘先锋股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了建信中小盘先锋股票型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于建信中小盘先锋股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>建信中小盘先锋股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估建信中小盘先锋股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督建信中小盘先锋股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对建信中小盘先锋股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重</p>



	大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致建信中小盘先锋股票型证券投资基金不能持续经营。	
	(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	贺 耀	王华敏
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2024 年 3 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：建信中小盘先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	192,854,778.87	236,531,688.84
结算备付金		2,318,557.33	4,437,628.53
存出保证金		1,154,899.64	2,860,469.45
交易性金融资产	7.4.7.2	1,965,338,314.14	3,856,713,202.07
其中：股票投资		1,965,338,314.14	3,833,216,028.61
基金投资		-	-
债券投资		-	23,497,173.46
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	126,563,000.00
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		11,180,523.57	54,117,675.45

应收股利		-	-
应收申购款		600,164.11	2,366,776.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		2,173,447,237.66	4,283,590,440.80
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	30,606,525.50
应付赎回款		2,285,654.57	31,597,001.81
应付管理人报酬		2,212,020.89	5,876,842.48
应付托管费		368,670.15	979,473.74
应付销售服务费		103,674.51	418,975.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	100.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	7,457,752.35	7,581,426.23
负债合计		12,427,772.47	77,060,345.91
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.10	682,471,351.29	1,125,433,779.74
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	1,478,548,113.90	3,081,096,315.15
净资产合计		2,161,019,465.19	4,206,530,094.89
负债和净资产总计		2,173,447,237.66	4,283,590,440.80

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 682,471,351.29 份，其中建信中小盘先锋股票 A 基金份额总额 588,278,231.67 份，基金份额净值人民币 3.170 元；建信中小盘先锋股票 C 基金份额总额 94,193,119.62 份，基金份额净值人民币 3.142 元。

## 7.2 利润表

会计主体：建信中小盘先锋股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-431,311,826.92	-631,204,216.71
1. 利息收入		4,736,863.28	6,396,029.95

其中：存款利息收入	7.4.7.13	4,720,271.38	6,396,029.95
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,591.90	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-446,948,583.08	-264,370,605.01
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-492,854,852.98	-337,905,854.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-4,056,410.62	2,475,319.69
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	49,962,680.52	71,059,929.39
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）	7.4.7.20	8,550,628.98	-379,024,981.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	2,349,263.90	5,795,340.02
<b>减：二、营业总支出</b>		56,999,400.25	78,723,209.09
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	46,392,931.08	63,085,341.62
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	7,732,155.21	10,514,223.65
3. 销售服务费		2,646,236.61	4,895,604.93
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		77.35	38.89
8. 其他费用	7.4.7.23	228,000.00	228,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-488,311,227.17	-709,927,425.80
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-488,311,227.17	-709,927,425.80

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-488,311,227.17	-709,927,425.80

### 7.3 净资产变动表

会计主体：建信中小盘先锋股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	1,125,433,779. 74	-	3,081,096,315. 15	4,206,530,094.8 9
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,125,433,779. 74	-	3,081,096,315. 15	4,206,530,094.8 9
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-442,962,428.4 5	-	-1,602,548,201 .25	-2,045,510,629. 70
(一)、综合收益总额	-	-	-488,311,227.1 7	-488,311,227.17
(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)	-442,962,428.4 5	-	-1,114,236,974 .08	-1,557,199,402. 53
其中：1. 基金申购款	424,319,618.41	-	1,178,877,162. 96	1,603,196,781.3 7
2. 基金赎回款	-867,282,046.8 6	-	-2,293,114,137 .04	-3,160,396,183. 90
(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	682,471,351.29	-	1,478,548,113.90	2,161,019,465.19
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	708,518,982.98	-	2,284,629,924.99	2,993,148,907.97
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	708,518,982.98	-	2,284,629,924.99	2,993,148,907.97
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	416,914,796.76	-	796,466,390.16	1,213,381,186.92
(一)、综合收益总额	-	-	-709,927,425.80	-709,927,425.80
(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)	416,914,796.76	-	1,506,393,815.96	1,923,308,612.72
其中：1. 基金申购款	1,152,238,217.76	-	3,682,403,496.07	4,834,641,713.83
2. 基金赎回款	-735,323,421.00	-	-2,176,009,680.11	-2,911,333,101.11
(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	1,125,433,779.74	-	3,081,096,315.15	4,206,530,094.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

张力铮

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

建信中小盘先锋股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]495号《关于核准建信中小盘先锋股票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《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 759,552,595.20 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 464 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 8 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 759,776,341.92 份基金份额，其中认购资金利息折合 223,746.72 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，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《建信中小盘先锋股票型证券投资基金增加 C 类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 2021 年 10 月 27 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。2021 年 10 月 27 日前原有的基金份额全部转换为建信中小盘先锋股票 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括 A 股股票（包含中小板、创业板、存托凭证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、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：股票资产占基金资产的 80%-95%，债券等固定收益类资产合计市值占基金资产净值的 0-20%，权证投资合计市值占基金资产净值的 0-3%，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。本基金将不低于 80% 的非现金基金资产投资于具有较高成长性的中小盘股票。本基金的业绩比较基准为  $85\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 15\% \times \text{中债综合全价（总值）指数收益率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2024 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 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〉》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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### （2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以



单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算

的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（4）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（5）公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（6）其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现

平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 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。

##### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》

的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	192,854,778.87	236,531,688.84
等于：本金	192,742,514.54	236,401,036.92
加：应计利息	112,264.33	130,651.92
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	192,854,778.87	236,531,688.84

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	2,128,433,944.41	-	1,965,338,314.14	-163,095,630.27	
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	2,128,433,944.41	-	1,965,338,314.14	-163,095,630.27	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	4,008,801,966.38	-	3,833,216,028.61	-175,585,937.77	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	19,548,904.78	8,590.16	23,497,173.46	3,939,678.52
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	19,548,904.78	8,590.16	23,497,173.46	3,939,678.52
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,028,350,871.16	8,590.16	3,856,713,202.07	-171,646,259.25	

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	126,563,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	126,563,000.00	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。



## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,043.33	30,901.13
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	7,241,209.02	7,336,025.10
其中：交易所市场	7,241,209.02	7,336,025.10
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	214,500.00	214,500.00
合计	7,457,752.35	7,581,426.23

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 建信中小盘先锋股票 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	853,104,074.42	853,104,074.42
本期申购	303,853,397.70	303,853,397.70
本期赎回（以“-”号填列）	-568,679,240.45	-568,679,240.45
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	588,278,231.67	588,278,231.67

## 建信中小盘先锋股票 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	272,329,705.32	272,329,705.32
本期申购	120,466,220.71	120,466,220.71

本期赎回（以“-”号填列）	-298,602,806.41	-298,602,806.41
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	94,193,119.62	94,193,119.62

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。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 建信中小盘先锋股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,250,366,747.70	1,088,899,798.41	2,339,266,546.11
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,250,366,747.70	1,088,899,798.41	2,339,266,546.11
本期利润	-407,837,681.65	-2,903,077.40	-410,740,759.05
本期基金份额交易产生的变动数	-335,833,769.41	-315,940,981.80	-651,774,751.21
其中：基金申购款	416,459,346.59	422,893,935.11	839,353,281.70
基金赎回款	-752,293,116.00	-738,834,916.91	-1,491,128,032.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	506,695,296.64	770,055,739.21	1,276,751,035.85

##### 建信中小盘先锋股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	394,106,871.04	347,722,898.00	741,829,769.04
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	394,106,871.04	347,722,898.00	741,829,769.04
本期利润	-89,024,174.50	11,453,706.38	-77,570,468.12
本期基金份额交易产生的变动数	-226,617,982.47	-235,844,240.40	-462,462,222.87
其中：基金申购款	169,710,579.84	169,813,301.42	339,523,881.26
基金赎回款	-396,328,562.31	-405,657,541.82	-801,986,104.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,464,714.07	123,332,363.98	201,797,078.05

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	4,622,387.33	6,214,120.03
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	53,252.07	122,151.43
其他	44,631.98	59,758.49
合计	4,720,271.38	6,396,029.95

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-492,854,852.98	-337,905,854.09
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	-492,854,852.98	-337,905,854.09

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	6,469,165,784.08	7,938,513,631.22
减：卖出股票成本总额	6,946,846,398.65	8,252,988,635.98
减：交易费用	15,174,238.41	23,430,849.33
买卖股票差价收入	-492,854,852.98	-337,905,854.09

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 7.4.7.15 债券投资收益

## 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利息收入	21,490.94	10,786.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,077,901.56	2,464,533.34
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	-4,056,410.62	2,475,319.69

## 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	113,010,312.54	9,125,861.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	116,877,606.89	6,657,958.12
减：应计利息总额	204,546.71	3,318.28
减：交易费用	6,060.50	52.22
买卖债券差价收入	-4,077,901.56	2,464,533.34

## 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	49,962,680.52	71,059,929.39
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	49,962,680.52	71,059,929.39

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	8,550,628.98	-379,024,981.67
股票投资	12,490,307.50	-380,746,497.58
债券投资	-3,939,678.52	1,721,515.91
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	8,550,628.98	-379,024,981.67

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,236,628.59	5,662,248.47
基金转换费收入	112,635.31	133,091.55
合计	2,349,263.90	5,795,340.02

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行间账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	228,000.00	228,000.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	46,392,931.08	63,085,341.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	11,636,044.20	12,781,220.46
应支付基金管理人的净管理费	34,756,886.88	50,304,121.16

注：于 2023 年 8 月 14 日前，支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

根据基金管理人于 2023 年 8 月 14 日发布的《建信基金管理有限责任公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 8 月 14 日起，本基金管理人报酬调整为按前一日基金资产净值 1.20% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,732,155.21	10,514,223.65

注：于 2023 年 8 月 14 日前，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

根据基金管理人于 2023 年 8 月 14 日发布的《建信基金管理有限责任公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 8 月 14 日起，本基金托管费调整为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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信中小盘先锋股票	建信中小盘先锋股票	合计
	A	C	
建信基金	-	997,036.30	997,036.30
合计	-	997,036.30	997,036.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信中小盘先锋股票	建信中小盘先锋股票	合计



	A	C	
建信基金	-	1,857,471.58	1,857,471.58
合计	-	1,857,471.58	1,857,471.58

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

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

## 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新发未上市	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
301172	君逸数码	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新发未上市	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新发未上市	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威尔高	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新发未上市	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新发未上市	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-

				市						
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新发未上市	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	6个月	新发未上市	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新发未上市	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新发未上市	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新发未上市	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新发未上市	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新发未上市	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月	新发未上市	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301469	恒达新	2023年8月10日	6个月	新发未	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-

	材	日		上市						
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新发未上市	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新发未上市	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新发未上市	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新发未上市	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新发未上市	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新发未上市	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301509	金凯生科	2023年7月26日	6个月	新发未上市	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新发未上市	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福	2023年8	6个月	新发	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-

	科技	月8日		未上市						
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新发未上市	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新发未上市	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新发未上市	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新发未上市	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新发未上市	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新发未上市	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新发未上市	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新发未上市	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301533	威	2023	6个	新	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-

	马农机	年8月7日	月	发未上市						
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新发未上市	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新发未上市	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新发未上市	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新发未上市	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新发未上市	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新发未上市	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新发未上市	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603275	众辰科技	2023年08月16日	6个月	新发未上市	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-

603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月	新发未上市	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
688347	华虹公司	2023年7月27日	6个月	新发未上市	52.00	42.06	57,825	3,006,900.00	2,432,119.50	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新发未上市	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新发未上市	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新发未上市	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新发未上市	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688573	信宇人	2023年8月9日	6个月	新发未上市	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新发未上市	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新发未上市	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-

				市						
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新发未上市	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新发未上市	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新发未上市	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新发未上市	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688638	誉辰智能	2023年7月4日	6个月	新发未上市	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新发未上市	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新发未上市	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新发未上市	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新发未	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-



		日		上市						
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新发未上市	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新发未上市	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 7.4.13.2.4 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	15,205,146.84
AAA 以下	-	8,292,026.62
未评级	-	-
合计	-	23,497,173.46

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。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 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。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	192,854,778.87	-	-	-	192,854,778.87
结算备付金	2,318,557.33	-	-	-	2,318,557.33
存出保证金	1,154,899.64	-	-	-	1,154,899.64
交易性金融资产	-	-	-	1,965,338,314.14	1,965,338,314.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	11,180,523.57	11,180,523.57
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	600,164.11	600,164.11
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	196,328,235.84	-	-	1,977,119,001.82	2,173,447,237.66
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,285,654.57	2,285,654.57
应付管理人报酬	-	-	-	2,212,020.89	2,212,020.89
应付托管费	-	-	-	368,670.15	368,670.15
应付销售服务费	-	-	-	103,674.51	103,674.51
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	7,457,752.35	7,457,752.35
负债总计	-	-	-	12,427,772.47	12,427,772.47
利率敏感度缺口	196,328,235.84	-	-	-1,964,691,229.35	2,161,019,465.19
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	236,531,688.84	-	-	-	236,531,688.84
结算备付金	4,437,628.53	-	-	-	4,437,628.53
存出保证金	2,860,469.45	-	-	-	2,860,469.45
交易性金融资产	-	-	23,497,173.46	3,833,216,028.61	3,856,713,202.07
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	126,563,000.00	-	-	-	126,563,000.00
应收清算款	-	-	-	54,117,675.45	54,117,675.45

债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,366,776.46	2,366,776.46
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	370,392,786.82	-	23,497,173.46	3,889,700,480.52	4,283,590,440.80
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	-	-	-	30,606,525.50	30,606,525.50
应付赎回款	-	-	-	31,597,001.81	31,597,001.81
应付管理人报酬	-	-	-	5,876,842.48	5,876,842.48
应付托管费	-	-	-	979,473.74	979,473.74
应付销售服务费	-	-	-	418,975.28	418,975.28
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	100.87	100.87
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	7,581,426.23	7,581,426.23
负债总计	-	-	-	77,060,345.91	77,060,345.91
利率敏感度缺口	370,392,786.82	-	23,497,173.46	3,812,640,134.61	4,206,530,094.89

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,965,338,314.14	90.94	3,833,216,028.61	91.13
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	23,497,173.46	0.56
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,965,338,314.14	90.94	3,856,713,202.07	91.69

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	115,879,662.36	249,009,595.73
	业绩比较基准下降 5%	-115,879,662.36	-249,009,595.73

## 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

## 7.4.14 公允价值

## 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,961,929,938.17	3,805,852,709.29
第二层次	-	-
第三层次	3,408,375.97	50,860,492.78
合计	1,965,338,314.14	3,856,713,202.07

##### 7.4.14.2.2 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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	50,860,492.78	50,860,492.78
当期购买	-	3,909,887.58	3,909,887.58
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	50,860,492.78	50,860,492.78
当期利得或损失总额	-	-501,511.61	-501,511.61
其中：计入损益的利得或损失	-	-501,511.61	-501,511.61
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	3,408,375.97	3,408,375.97
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-501,511.61	-501,511.61
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,488,319.74	1,488,319.74
当期购买	-	66,307,935.99	66,307,935.99
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,488,319.74	1,488,319.74
当期利得或损失总额	-	-15,447,443.21	-15,447,443.21
其中：计入损益的利得或损失	-	-15,447,443.21	-15,447,443.21
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	50,860,492.78	50,860,492.78
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-15,447,443.21	-15,447,443.21

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期股票投资	3,408,375.97	平均价格 亚式期权模型	预期波动率	0.1462-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期股票投资	50,860,492.78	平均价格 亚式期权模型	预期波动率	0.2063-2.4756	负相关



**7.4.14.3 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。

**7.4.14.4 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。

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

## 7.4.15.1 承诺事项

无。

## 7.4.15.2 其他事项

无。

## 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

**§ 8 投资组合报告****8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,965,338,314.14	90.42
	其中：股票	1,965,338,314.14	90.42
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	195,173,336.20	8.98
8	其他各项资产	12,935,587.32	0.60
9	合计	2,173,447,237.66	100.00

**8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合****8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	37,247,658.25	1.72
B	采矿业	223,177,587.90	10.33
C	制造业	1,106,289,694.20	51.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	144,930,511.44	6.71
F	批发和零售业	21,667,766.42	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	20,998,848.00	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	150,071,486.31	6.94
J	金融业	117,765,844.04	5.45
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	66,662,346.12	3.08
N	水利、环境和公共设施管理业	25,179,333.46	1.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	51,347,238.00	2.38
	合计	1,965,338,314.14	90.94

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600133	东湖高新	13,456,872	144,930,511.44	6.71
2	600188	兖矿能源	5,670,780	112,338,151.80	5.20
3	601901	方正证券	13,320,734	107,365,116.04	4.97
4	688349	三一重能	3,379,440	96,719,572.80	4.48
5	600845	宝信软件	1,877,614	91,627,563.20	4.24
6	003031	中瓷电子	981,403	86,589,186.69	4.01
7	688522	纳睿雷达	1,278,700	70,955,063.00	3.28
8	300750	宁德时代	428,800	70,005,888.00	3.24
9	603773	沃格光电	2,011,840	68,141,020.80	3.15
10	601965	中国汽研	3,020,661	66,635,781.66	3.08
11	300751	迈为股份	419,029	54,268,445.79	2.51
12	601231	环旭电子	3,533,000	53,383,630.00	2.47

13	600186	莲花健康	8,806,000	53,276,300.00	2.47
14	000009	中国宝安	4,373,700	51,347,238.00	2.38
15	300586	美联新材	6,248,786	50,552,678.74	2.34
16	300285	国瓷材料	2,067,800	47,807,536.00	2.21
17	300896	爱美客	158,000	46,504,140.00	2.15
18	600256	广汇能源	6,249,315	44,620,109.10	2.06
19	002444	巨星科技	1,949,400	43,900,488.00	2.03
20	300474	景嘉微	594,600	42,044,166.00	1.95
21	600703	三安光电	2,985,800	41,353,330.00	1.91
22	002123	梦网科技	3,337,500	37,213,125.00	1.72
23	002353	杰瑞股份	1,235,200	34,721,472.00	1.61
24	688352	颀中科技	2,045,773	31,525,361.93	1.46
25	600975	新五丰	2,736,085	28,592,088.25	1.32
26	688480	赛恩斯	650,062	25,170,400.64	1.16
27	300833	浩洋股份	270,444	24,367,004.40	1.13
28	688543	国科军工	422,968	23,643,911.20	1.09
29	601001	晋控煤业	1,764,400	21,755,052.00	1.01
30	301017	漱玉平民	1,059,614	21,647,914.02	1.00
31	688169	石头科技	75,991	21,501,653.45	0.99
32	601225	陕西煤业	1,019,000	21,286,910.00	0.99
33	600986	浙文互联	3,882,415	21,197,985.90	0.98
34	000828	东莞控股	1,955,200	20,998,848.00	0.97
35	688281	华秦科技	145,691	19,764,441.06	0.91
36	600420	国药现代	1,862,000	18,228,980.00	0.84
37	600761	安徽合力	892,600	16,254,246.00	0.75
38	603298	杭叉集团	648,300	16,129,704.00	0.75
39	300151	昌红科技	740,000	13,601,200.00	0.63
40	601699	潞安环能	541,100	11,855,501.00	0.55
41	688456	有研粉材	406,973	11,464,429.41	0.53
42	601666	平煤股份	979,400	11,321,864.00	0.52
43	300832	新产业	143,200	11,198,240.00	0.52
44	601108	财通证券	1,340,300	10,400,728.00	0.48
45	300065	海兰信	937,972	9,539,175.24	0.44
46	603477	巨星农牧	231,000	8,655,570.00	0.40
47	603658	安图生物	116,800	6,658,768.00	0.31
48	002149	西部材料	401,900	6,317,868.00	0.29
49	688301	奕瑞科技	18,268	5,941,849.68	0.27
50	688122	西部超导	100,991	5,375,750.93	0.25
51	688347	华虹公司	57,825	2,432,119.50	0.11
52	600438	通威股份	49,300	1,233,979.00	0.06
53	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
54	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
55	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00

56	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
57	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
58	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
59	301291	明阳电气	1,206	34,202.16	0.00
60	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
61	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
62	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
63	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
64	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
65	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
66	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
67	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
68	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
69	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
70	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
71	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
72	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
73	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
74	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
75	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
76	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
77	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
78	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
79	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
80	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
81	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
82	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
83	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
84	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
85	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
86	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
87	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
88	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
89	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
90	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
91	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
92	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
93	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
94	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
95	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
96	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
97	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
98	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00

99	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
100	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
101	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
102	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
103	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
104	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
105	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
106	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
107	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
108	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
109	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
110	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
111	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
112	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
113	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	600703	三安光电	219,570,670.91	5.22
2	600133	东湖高新	154,516,727.68	3.67
3	002532	天山铝业	136,475,409.18	3.24
4	300896	爱美客	125,111,201.00	2.97
5	688012	中微公司	123,218,300.43	2.93
6	601901	方正证券	116,707,280.22	2.77
7	300750	宁德时代	111,736,259.67	2.66
8	600570	恒生电子	110,997,570.68	2.64
9	002371	北方华创	109,080,025.68	2.59
10	600188	兖矿能源	108,651,968.52	2.58
11	600845	宝信软件	95,218,257.92	2.26
12	000423	东阿阿胶	94,033,163.82	2.24
13	300034	钢研高纳	90,064,092.89	2.14
14	600938	中国海油	89,208,599.94	2.12
15	688522	纳睿雷达	88,878,093.69	2.11
16	600186	莲花健康	85,958,272.56	2.04
17	600011	华能国际	84,813,766.72	2.02
18	601600	中国铝业	83,734,182.47	1.99
19	300068	南都电源	81,304,441.16	1.93
20	002705	新宝股份	75,766,649.09	1.80

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。

## 8.4.2 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	600188	兖矿能源	316,513,610.25	7.52
2	300068	南都电源	254,738,992.75	6.06
3	601965	中国汽研	165,127,410.21	3.93
4	600703	三安光电	149,676,247.55	3.56
5	300750	宁德时代	149,161,933.60	3.55
6	600546	山煤国际	141,640,386.84	3.37
7	600256	广汇能源	118,935,709.66	2.83
8	002129	TCL 中环	118,876,782.94	2.83
9	601699	潞安环能	109,932,246.93	2.61
10	601100	恒立液压	109,866,666.99	2.61
11	603338	浙江鼎力	108,318,307.49	2.58
12	688012	中微公司	108,206,384.88	2.57
13	600233	圆通速递	105,625,944.76	2.51
14	002532	天山铝业	104,338,672.98	2.48
15	000423	东阿阿胶	101,942,880.67	2.42
16	002371	北方华创	101,890,005.51	2.42
17	002897	意华股份	101,439,220.34	2.41
18	600549	厦门钨业	98,360,679.49	2.34
19	600938	中国海油	97,082,940.13	2.31
20	003031	中瓷电子	96,815,104.12	2.30
21	600795	国电电力	96,451,082.71	2.29
22	600011	华能国际	89,925,101.00	2.14
23	600570	恒生电子	88,350,191.84	2.10

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。

## 8.4.3 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	5,066,478,376.68
卖出股票收入（成交）总额	6,469,165,784.08

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。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

## 8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策  
无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策  
无。

8.11.2 本期国债期货投资评价  
无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	1,154,899.64
2	应收清算款	11,180,523.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	600,164.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,935,587.32

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
无。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 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 (%)
建信中小盘先锋股票 A	67,531	8,711.23	318,284,729.41	54.10	269,993,502.26	45.90
建信中小盘先锋股票 C	46,743	2,015.13	39,641,900.27	42.09	54,551,219.35	57.91
合计	114,274	5,972.24	357,926,629.68	52.45	324,544,721.61	47.55

## 9.2 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	建信中小盘先锋股票 A	2,033,599.57	0.35
	建信中小盘先锋股票 C	112,741.68	0.12
	合计	2,146,341.25	0.31

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）。

## 9.3 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、	建信中小盘先锋股票 A	10~50



基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信中小盘先锋股票 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	建信中小盘先锋股票 A	-
	建信中小盘先锋股票 C	-
	合计	-

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中小盘先锋股票 A	建信中小盘先锋股票 C
基金合同生效日 (2014年8月20日) 基金份额总额	759,776,341.92	-
本报告期期初基金份额总额	853,104,074.42	272,329,705.32
本报告期基金总申购份额	303,853,397.70	120,466,220.71
减：本报告期基金总赎回份额	568,679,240.45	298,602,806.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	588,278,231.67	94,193,119.62

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。

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 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。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2023 年 1 月 19 日发布公告，自 2023 年 1 月 17 日起吴灵玲女士不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起刘军先生不再担任建信基金管理有限责任公司董事长，暂由总裁张军红先生

生代为履行董事长职务；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 3 月 18 日发布公告，自 2023 年 3 月 17 日起聘任张力铮先生担任建信基金管理有限责任公司副总裁，张威威先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁、首席信息官；基金管理人于 2023 年 9 月 28 日发布公告，自 2023 年 9 月 26 日起聘任生柳荣先生担任建信基金管理有限责任公司董事长，张军红先生不再代为履行董事长职务；基金管理人于 2023 年 12 月 9 日发布公告，自 2023 年 12 月 7 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司财务负责人。上述事项均已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案。

2023 年 7 月 23 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部副总经理职务，另有任用。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金财产、基金管理业务的诉讼事项。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 11.5 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。本年度审计费用为人民币 90000 元。该会计师事务所自 2019 年起为本公司旗下所有公募基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	建信基金管理有限责任公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 7 月 14 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	公司个别业务内部控制机制和风险管理不完善。
管理人采取整改措施	截止本报告期末，公司已按照法律法规

施的情况（如提出整改意见）	和监管要求及时完成整改工作，并将整改报告报送至监管机构。
其他	无

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 (%)	
方正证券	1	2,826,261,305.67	24.68	2,083,843.36	24.09	-
天风证券	1	2,352,072,063.43	20.54	1,703,264.66	19.69	-
信达证券	2	1,644,766,474.92	14.36	1,191,161.30	13.77	-
首创证券	2	1,571,730,048.63	13.72	1,143,830.70	13.22	-
西南证券	1	1,329,517,148.90	11.61	1,238,179.70	14.31	-
西部证券	1	619,423,492.19	5.41	446,791.35	5.16	-
华泰证券	1	499,579,335.12	4.36	360,351.79	4.17	-
财通证券	1	340,344,396.64	2.97	250,469.89	2.90	-
海通证券	2	181,815,347.76	1.59	167,507.04	1.94	-
华金证券	1	87,237,557.54	0.76	65,071.45	0.75	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

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财通证券、华金证券各 1 个交易单元，无剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 11.7.2 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(%)
方正证券	66,949,606.54	44.15	-	-	-	-
天风证券	24,363,929.18	16.07	-	-	-	-
信达证券	60,322,198.02	39.78	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	关于新增深圳前海微众银行股份有限公司为建信创新中国混合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	2023 年 9 月 26 日
2	关于新增银泰证券有限责任公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 7 月 26 日
3	关于新增中信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	2023 年 3 月 15 日
4	关于新增兴业证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 3 月 9 日
5	关于新增兴业银行银银平台为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 3 月 6 日
6	关于增加上海陆享基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 3 月 1 日
7	关于增加博时财富基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 2 月 24 日
8	关于新增山西证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 2 月 22 日
9	关于更新建信基金旗下公募基金产品适当性风险等级评定结果的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 2 月 15 日
10	关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 2 月 7 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信中小盘先锋股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金托管协议》；

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

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2024 年 3 月 28 日