

建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF） 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	12
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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	49
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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.4 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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	建信沪深 300 指数 (LOF)
场内简称	沪深 300LOF 建信
基金主代码	165309
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 11 月 5 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	269,044,187.40 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2009 年 11 月 30 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+5\% \times$ 商业银行税后活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，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，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	95588
传真	010-66228001	(010) 66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100033	100140
法定代表人	生柳荣	廖林

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,107,803.36
本期利润	6,024,268.29
加权平均基金份额本期利润	0.0228
本期加权平均净值利润率	1.61%
本期基金份额净值增长率	1.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	109,722,027.65
期末可供分配基金份额利润	0.4078
期末基金资产净值	378,766,215.05
期末基金份额净值	1.4078
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	40.78%

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

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

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

3.2 基金净值表现

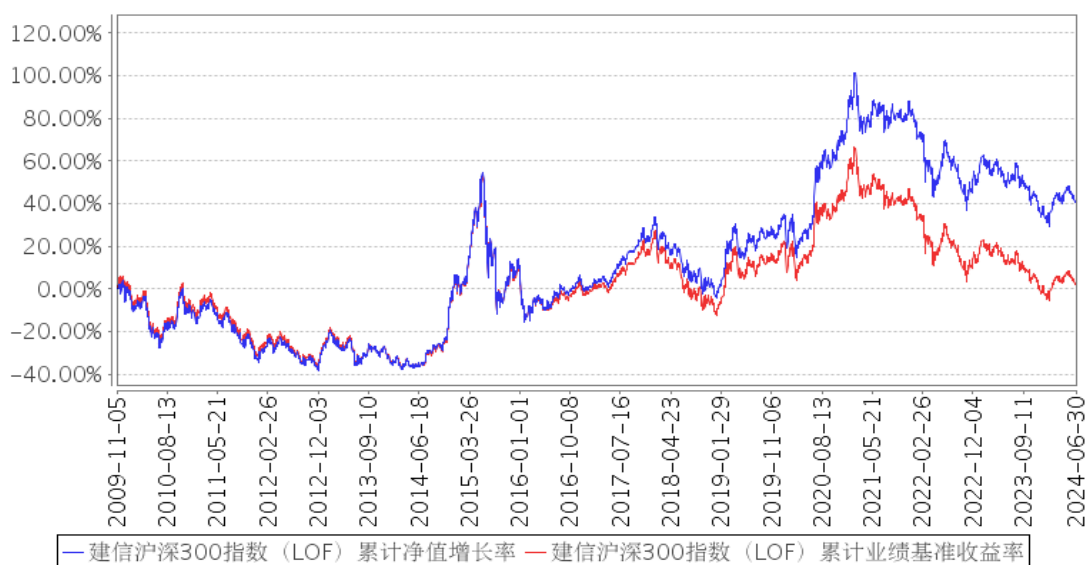
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去一个月	-2.44%	0.45%	-3.14%	0.46%	0.70%	-0.01%
过去三个月	-1.21%	0.71%	-2.03%	0.72%	0.82%	-0.01%
过去六个月	1.47%	0.84%	0.88%	0.85%	0.59%	-0.01%
过去一年	-6.85%	0.81%	-9.38%	0.83%	2.53%	-0.02%
过去三年	-24.62%	0.97%	-32.19%	0.99%	7.57%	-0.02%
自基金合同生效起至今	40.78%	1.31%	2.13%	1.31%	38.65%	0.00%

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

建信沪深300指数 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司拥有公开募集证券投资基金、私募资产管理计划、QDII、保险资金受托等业务资格，总部设在北京，下设北京、上海、广州、成都、深圳、南京、武汉七家分公司，并分别在上海和香

港设立了子公司——建信资本管理有限责任公司、建信资产管理（香港）有限公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家，资产管理行业的领跑者”。

公司以持续优秀的管理能力、完善周到的服务，为超过 8000 万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至 2024 年 6 月 30 日，公司管理运作 166 只公开募集证券投资基金以及多个私募资产管理计划，资产管理规模 1.12 余万亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁洪昀	数量投资部总经理，本基金的基金经理	2009 年 11 月 5 日	-	21	梁洪昀先生，数量投资部总经理，博士。特许金融分析师（CFA）。曾任大成基金管理有限公司金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005 年 8 月加入建信基金，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总经理。2009 年 11 月 5 日起任建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)的基金经理；2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 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；2011 年 9 月 8 日至 2016 年 7 月 20 日任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金（ETF）及其联接基金的基金经理；2012 年 3 月 16 日起任建信深证 100 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 3 月 25 日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理，该基金自 2020 年 5 月 7 日转型为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF），梁洪昀继续担任该基金的基金经理；2015 年 7 月 31 日至 2018 年 7 月 31 日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 6 日至 2016 年 10 月 25 日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 6 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 6 月 13 日

					至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理; 2018 年 2 月 7 日至 2022 年 8 月 8 日任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理; 2018 年 4 月 19 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 2018 年 5 月 16 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

在本报告期内, 基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益, 严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人, 保护投资人利益, 避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为, 公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度, 制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块, 一旦出现不同基金同时买卖同一证券时, 系统自动切换至公平交易模块进行操作, 确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合, 严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单

边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次, 原因是投资组合投资策略需要, 未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内, 本基金根据基金合同规定, 采取了对指数的复制策略, 将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。

在报告期内, 标的指数中部分股票限于规定无法投资, 需要用其他股票进行替代, 这是基金跟踪误差的重要来源之一。基金管理人通过量化分析研究, 制定和执行并且不断优化相应的策略, 尽可能地降低这种不利影响。

在报告期内, 标的指数成分股进行了例行调整, 管理人通过适当的调仓策略, 尽量降低了调整过程中投资组合的跟踪误差与偏离度。

在遵守基金合同、确保平稳运作的基础上, 本基金参与了新股申购, 并适时兑现, 力争增厚投资组合的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 1.47% 波动率 0.84% 业绩比较基准收益率 0.88% 波动率 0.85%

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 年下半年中国宏观经济和 A 股市场, 综合考虑国内外的经济政治因素, 可以看到机遇和挑战并存的局面。

中国政府将继续推进全面深化改革, 以应对复杂的国际国内形势。总体上, 宏观政策将继续保持稳中求进的总基调, 推动经济体制改革, 促进社会公平和增进民生福祉。内需将成为经济增长的重要动力, 同时外贸新动能也将加快培育。绿色低碳发展的扎实推进, 脱贫攻坚成果的巩固拓展, 对高技术产业的重点支持、新能源和基础设施的继续建设, 都将对带动整体经济增长起到促进作用。

尽管经济发展中还面临着一些内外部的挑战, 例如房地产市场如何保持平稳发展, 债务压力如何化解, 消费潜力如何得到充分释放等等, 但我们相信, 这些阶段性问题都可以得到妥善的处理。

对 A 股市场而言, 政策的积极支持和经济的稳步增长将为投资者带来信心。特别是在科技创新、绿色发展和消费升级等领域, 政策的持续支持有望引导资本流入, 推动相关板块的表现。在这一过程中, 不排除一些扰动因素可能导致市场的短期波动, 但从长期来看, 随着中国经济结构的优化和市场机制的完善, A 股市场依旧会稳步发展, 并继续表现出活力、充满机遇。

本管理人将根据基金合同，继续以量化分析研究为基础，克服个别成份股无法投资、基金日常申赎、成份股停牌等各种因素造成的不利影响，将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。同时，以研究为基础，在基金合同允许的范围内适当捕捉其他投资机会，力争提升基金收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资

产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体: 建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产:			
货币资金	6.4.7.1	30,048,819.95	28,090,765.51
结算备付金		-	-
存出保证金		7,192.51	7,237.19
交易性金融资产	6.4.7.2	349,574,792.69	329,295,277.16
其中: 股票投资		349,574,792.69	329,295,277.16
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	152,954.50
应收股利		-	-
应收申购款		108,857.08	349,820.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		379,739,662.23	357,896,054.80

负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		173,936.51	116,578.55
应付管理人报酬		234,047.07	223,168.23
应付托管费		46,809.40	44,633.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	518,654.20	871,549.06
负债合计		973,447.18	1,255,929.48
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	269,044,187.40	257,058,909.46
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	109,722,027.65	99,581,215.86
净资产合计		378,766,215.05	356,640,125.32
负债和净资产总计		379,739,662.23	357,896,054.80

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.4078 元，基金份额总额 269,044,187.40 份。

6.2 利润表

会计主体：建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,783,367.24	4,362,629.16
1. 利息收入		51,699.30	51,152.07
其中：存款利息收入	6.4.7.13	51,699.30	51,152.07
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		-421,404.87	5,693,075.29
其中: 股票投资收益	6.4.7.14	-4,586,996.88	997,616.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	4,165,592.01	4,695,458.50
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损 失以“-”号填列)	6.4.7.20	8,132,071.65	-1,400,156.09
4. 汇兑收益 (损失以“-” 号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-” 号填列)	6.4.7.21	21,001.16	18,557.89
减: 二、营业总支出		1,759,098.95	2,002,269.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,391,152.65	1,591,694.46
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	278,230.48	318,338.88
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	89,715.82	92,235.73
三、利润总额 (亏损总额 以“-”号填列)		6,024,268.29	2,360,360.09
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-” 号填列)		6,024,268.29	2,360,360.09
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		6,024,268.29	2,360,360.09

6.3 净资产变动表

会计主体: 建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	257,058,909.46	-	99,581,215.86	356,640,125.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	257,058,909.46	-	99,581,215.86	356,640,125.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	11,985,277.94	-	10,140,811.79	22,126,089.73
(一)、综合收益总额	-	-	6,024,268.29	6,024,268.29
(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)	11,985,277.94	-	4,116,543.50	16,101,821.44
其中：1. 基金申购款	29,024,677.58	-	11,110,516.96	40,135,194.54
2. 基金赎回款	-17,039,399.64	-	-6,993,973.46	-24,033,373.10
(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	269,044,187.40	-	109,722,027.65	378,766,215.05
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	276,088,788.03	-	139,143,104.53	415,231,892.56

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	276,088,788.03	-	139,143,104.53	415,231,892.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,854,113.13	-	1,078,197.93	-775,915.20
(一)、综合收益总额	-	-	2,360,360.09	2,360,360.09
(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)	-1,854,113.13	-	-1,282,162.16	-3,136,275.29
其中：1. 基金申购款	18,698,537.07	-	10,258,149.98	28,956,687.05
2. 基金赎回款	-20,552,650.20	-	-11,540,312.14	-32,092,962.34
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	274,234,674.90	-	140,221,302.46	414,455,977.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

张力铮

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (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[2009]882 号《关于核准建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 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《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2009 年 9 月 21 日至 2009 年 10 月 30 日止。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 5,324,471,976.73 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 233 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2009 年 11 月 5 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 5,326,413,369.61 份基金份额, 其中认购资金利息折合 1,941,392.88 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, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 深证上[2009]157 号审核同意, 本基金 59,552,590.00 份基金份额于 2009 年 11 月 30 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%, 投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金对标的指数的跟踪目标: 力争使得日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%, 年化跟踪误差不超过 4%。本基金业绩比较基准为 95%×沪深 300 指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。本基金的标的指数使用费由基金管理人建信基金管理有限责任公司承担, 不计入本基金费用。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

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

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

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	30,048,819.95
等于：本金	30,045,939.27
加：应计利息	2,880.68
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	30,048,819.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	403,632,078.41	-	349,574,792.69	-54,057,285.72
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	403,632,078.41	-	349,574,792.69	-54,057,285.72

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	385.16
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	394,205.92
其中：交易所市场	394,205.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	124,063.12
合计	518,654.20

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	257,058,909.46	257,058,909.46
本期申购	29,024,677.58	29,024,677.58
本期赎回(以“-”号填列)	-17,039,399.64	-17,039,399.64
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	269,044,187.40	269,044,187.40

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	357,945,873.43	-258,364,657.57	99,581,215.86
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	357,945,873.43	-258,364,657.57	99,581,215.86
本期利润	-2,107,803.36	8,132,071.65	6,024,268.29
本期基金份额交易产生的变动数	16,631,257.25	-12,514,713.75	4,116,543.50
其中：基金申购款	40,300,618.47	-29,190,101.51	11,110,516.96
基金赎回款	-23,669,361.22	16,675,387.76	-6,993,973.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	372,469,327.32	-262,747,299.67	109,722,027.65

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	51,013.26
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	386.15
其他	299.89
合计	51,699.30

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,586,996.88
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	-4,586,996.88

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	14,701,466.04
减: 卖出股票成本总额	19,236,110.13
减: 交易费用	52,352.79
买卖股票差价收入	-4,586,996.88

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,165,592.01
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	4,165,592.01

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	8,132,071.65
股票投资	8,132,071.65
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	8,132,071.65

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	20,904.21
基金转换费收入	96.95
合计	21,001.16

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,152.70
银行间账户维护费	9,000.00
合计	89,715.82

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,391,152.65	1,591,694.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	411,021.63	439,473.76
应支付基金管理人的净管理费	980,131.02	1,152,220.70

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75%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×0.75%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	278,230.48	318,338.88

注：支付基金托管人的托管费为按前一日基金资产净值 0.15%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×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期	30,048,819.95	51,013.26	27,668,546.53	50,711.51

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新发未上市	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001387	雪祺	2024年1	6个月	新发未上	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-

	电 气	月 4 日		市						
001389	广 合 科 技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新发 未上 市	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇 成 真 空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新发 未上 市	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301536	星 宸 科 技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新发 未上 市	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏 鼎 达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新发 未上 市	39.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏 鑫 科 技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新发 未上 市	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中 仑 新 材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新发 未上 市	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达 利 凯 普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新发 未上 市	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱 迪 特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新发 未上 市	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中 瑞 股 份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	新发 未上 市	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美 新 科 技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新发 未上 市	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301591	肯 特	2024 年 2	6 个月	新发 未上	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-

	股份	月 20 日		市						
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新发未上市	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新发未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新发未上市	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新发未上市	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新发未上市	72.46	68.06	59	4,275.14	4,015.54	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新发未上市	26.00	37.49	205	5,330.00	7,685.45	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新发未上市	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新发未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新发未上市	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新发未上市	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦	2024 年 6 月	6 个月	新发未上市	86.96	174.93	143	12,435.28	25,014.99	-

	数据	月 4 日		市						
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新发未上市	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新发未上市	15.69	18.79	666	10,449.54	12,514.14	-
688717	艾罗能源	2023 年 12 月 26 日	6 个月	新发未上市	55.66	47.02	6,062	337,410.92	285,035.24	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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

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

检查、监督及报告。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的

风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	30,048,819.95	-	-	-	30,048,819.95
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	7,192.51	-	-	-	7,192.51

交易性金融资产	-	-	-	-349,574,792.69	349,574,792.69
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	108,857.08	108,857.08
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	30,056,012.46	-	-	-349,683,649.77	379,739,662.23
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	173,936.51	173,936.51
应付管理人报酬	-	-	-	234,047.07	234,047.07
应付托管费	-	-	-	46,809.40	46,809.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	518,654.20	518,654.20
负债总计	-	-	-	973,447.18	973,447.18
利率敏感度缺口	30,056,012.46	-	-	-348,710,202.59	378,766,215.05
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	28,090,765.51	-	-	-	28,090,765.51
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	7,237.19	-	-	-	7,237.19
交易性金融资产	-	-	-	-329,295,277.16	329,295,277.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	152,954.50	152,954.50
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	349,820.44	349,820.44
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	28,098,002.70	-	-	-329,798,052.10	357,896,054.80
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	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	116,578.55	116,578.55
应付管理人报酬	-	-	223,168.23	223,168.23
应付托管费	-	-	44,633.64	44,633.64
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	871,549.06	871,549.06
负债总计	-	-	1,255,929.48	1,255,929.48
利率敏感度缺口	28,098,002.70	-	-328,542,122.62	356,640,125.32

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	349,574,792.69	92.29	329,295,277.16	92.33

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	349,574,792.69	92.29	329,295,277.16	92.33

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	18,480,976.62	17,450,514.49
	业绩比较基准下降 5%	-18,480,976.62	-17,450,514.49

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定: 第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价; 第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值; 第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	349,050,507.41	327,960,362.23

第二层次	45,611.11	482,015.60
第三层次	478,674.17	852,899.33
合计	349,574,792.69	329,295,277.16

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	349,574,792.69	92.06
	其中：股票	349,574,792.69	92.06
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	30,048,819.95	7.91
8	其他各项资产	116,049.59	0.03

9	合计	379,739,662.23	100.00
---	----	----------------	--------

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,472,760.00	1.18
B	采矿业	21,549,268.85	5.69
C	制造业	184,335,270.78	48.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,602,158.00	4.38
E	建筑业	7,914,714.57	2.09
F	批发和零售业	909,248.40	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	13,258,054.68	3.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,940,509.80	4.21
J	金融业	73,992,978.16	19.54
K	房地产业	3,256,047.33	0.86
L	租赁和商务服务业	2,838,877.14	0.75
M	科学研究和技术服务业	2,800,688.34	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	959,027.28	0.25
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	348,829,603.33	92.10

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	701,224.46	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	162.52	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,383.26	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,419.12	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	745,189.36	0.20

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	600519	贵州茅台	12,545	18,408,407.55	4.86
2	300750	宁德时代	52,560	9,462,376.80	2.50
3	601318	中国平安	214,332	8,864,771.52	2.34
4	600036	招商银行	246,580	8,430,570.20	2.23
5	600900	长江电力	243,700	7,047,804.00	1.86
6	000333	美的集团	97,240	6,271,980.00	1.66
7	601899	紫金矿业	328,092	5,764,576.44	1.52
8	601166	兴业银行	289,701	5,104,531.62	1.35
9	000858	五粮液	38,687	4,953,483.48	1.31
10	002594	比亚迪	18,000	4,504,500.00	1.19
11	601328	交通银行	547,220	4,087,733.40	1.08
12	002475	立讯精密	100,100	3,934,931.00	1.04
13	600030	中信证券	194,398	3,543,875.54	0.94
14	300760	迈瑞医疗	12,100	3,520,011.00	0.93
15	000651	格力电器	89,712	3,518,504.64	0.93

16	600276	恒瑞医药	88,981	3,422,209.26	0.90
17	600887	伊利股份	126,772	3,275,788.48	0.86
18	600309	万华化学	37,518	3,033,705.48	0.80
19	000725	京东方 A	736,119	3,010,726.71	0.79
20	601088	中国神华	65,700	2,915,109.00	0.77
21	601288	农业银行	635,899	2,772,519.64	0.73
22	300059	东方财富	251,501	2,655,850.56	0.70
23	601816	京沪高铁	489,100	2,626,467.00	0.69
24	300308	中际旭创	17,900	2,468,052.00	0.65
25	002714	牧原股份	54,400	2,371,840.00	0.63
26	601857	中国石油	225,800	2,330,256.00	0.62
27	002415	海康威视	74,308	2,296,860.28	0.61
28	601668	中国建筑	414,550	2,201,260.50	0.58
29	600919	江苏银行	292,400	2,172,532.00	0.57
30	601138	工业富联	79,100	2,167,340.00	0.57
31	600690	海尔智家	75,440	2,140,987.20	0.57
32	000568	泸州老窖	14,700	2,109,303.00	0.56
33	300498	温氏股份	106,000	2,100,920.00	0.55
34	600809	山西汾酒	9,689	2,043,216.32	0.54
35	002371	北方华创	6,300	2,015,307.00	0.53
36	601985	中国核电	188,100	2,005,146.00	0.53
37	600406	国电南瑞	79,962	1,995,851.52	0.53
38	601225	陕西煤业	77,283	1,991,582.91	0.53
39	603259	药明康德	50,266	1,969,924.54	0.52
40	601919	中远海控	127,080	1,968,469.20	0.52
41	000001	平安银行	193,279	1,961,781.85	0.52
42	600031	三一重工	118,300	1,951,950.00	0.52
43	601988	中国银行	419,771	1,939,342.02	0.51
44	600941	中国移动	18,000	1,935,000.00	0.51
45	600000	浦发银行	233,900	1,924,997.00	0.51
46	300124	汇川技术	37,297	1,913,336.10	0.51
47	601728	中国电信	309,300	1,902,195.00	0.50
48	601601	中国太保	68,200	1,900,052.00	0.50
49	000792	盐湖股份	108,200	1,888,090.00	0.50
50	600028	中国石化	290,900	1,838,488.00	0.49
51	601766	中国中车	242,326	1,819,868.26	0.48
52	688981	中芯国际	39,300	1,811,730.00	0.48
53	600150	中国船舶	44,500	1,811,595.00	0.48
54	300274	阳光电源	28,940	1,795,148.20	0.47
55	600050	中国联通	380,000	1,786,000.00	0.47
56	000063	中兴通讯	63,500	1,776,095.00	0.47
57	000338	潍柴动力	108,104	1,755,608.96	0.46
58	002352	顺丰控股	48,800	1,741,672.00	0.46

59	601169	北京银行	294,800	1,721,632.00	0.45
60	601012	隆基绿能	120,724	1,692,550.48	0.45
61	603501	韦尔股份	16,915	1,680,843.55	0.44
62	600837	海通证券	192,300	1,646,088.00	0.43
63	000100	TCL 科技	374,000	1,615,680.00	0.43
64	600016	民生银行	423,800	1,606,202.00	0.42
65	002230	科大讯飞	36,800	1,580,560.00	0.42
66	600660	福耀玻璃	31,900	1,528,010.00	0.40
67	002142	宁波银行	65,754	1,450,533.24	0.38
68	601229	上海银行	198,053	1,437,864.78	0.38
69	600089	特变电工	100,650	1,396,015.50	0.37
70	600938	中国海油	41,700	1,376,100.00	0.36
71	601390	中国中铁	204,618	1,334,109.36	0.35
72	000625	长安汽车	98,873	1,327,864.39	0.35
73	688041	海光信息	18,500	1,300,920.00	0.34
74	600104	上汽集团	92,237	1,278,404.82	0.34
75	603986	兆易创新	13,328	1,274,423.36	0.34
76	601688	华泰证券	101,924	1,262,838.36	0.33
77	600048	保利发展	143,100	1,253,556.00	0.33
78	601006	大秦铁路	174,900	1,252,284.00	0.33
79	600436	片仔癀	6,000	1,243,020.00	0.33
80	600905	三峡能源	285,000	1,242,600.00	0.33
81	002027	分众传媒	201,372	1,220,314.32	0.32
82	601211	国泰君安	89,784	1,216,573.20	0.32
83	601888	中国中免	19,418	1,213,430.82	0.32
84	603019	中科曙光	29,180	1,210,970.00	0.32
85	601600	中国铝业	157,900	1,204,777.00	0.32
86	688012	中微公司	8,500	1,200,710.00	0.32
87	603993	洛阳钼业	140,700	1,195,950.00	0.32
88	601818	光大银行	369,742	1,172,082.14	0.31
89	600019	宝钢股份	176,244	1,172,022.60	0.31
90	603288	海天味业	33,257	1,146,368.79	0.30
91	600585	海螺水泥	47,774	1,126,988.66	0.30
92	601658	邮储银行	221,100	1,120,977.00	0.30
93	601989	中国重工	227,100	1,119,603.00	0.30
94	600886	国投电力	59,400	1,083,456.00	0.29
95	601009	南京银行	103,000	1,070,170.00	0.28
96	600795	国电电力	177,600	1,063,824.00	0.28
97	688111	金山办公	4,600	1,046,500.00	0.28
98	688008	澜起科技	18,130	1,036,310.80	0.27
99	601628	中国人寿	33,174	1,030,052.70	0.27
100	600438	通威股份	53,800	1,028,118.00	0.27
101	600999	招商证券	73,900	1,027,949.00	0.27

102	000938	紫光股份	45,600	1,019,160.00	0.27
103	000425	徐工机械	141,246	1,009,908.90	0.27
104	600547	山东黄金	35,975	984,995.50	0.26
105	300014	亿纬锂能	24,400	974,048.00	0.26
106	600893	航发动力	26,586	971,718.30	0.26
107	002304	洋河股份	12,000	968,880.00	0.26
108	002179	中航光电	25,358	964,871.90	0.25
109	601669	中国电建	171,600	959,244.00	0.25
110	300015	爱尔眼科	92,929	959,027.28	0.25
111	000002	万 科 A	135,571	939,507.03	0.25
112	002241	歌尔股份	47,650	929,651.50	0.25
113	600926	杭州银行	70,900	925,245.00	0.24
114	000538	云南白药	17,720	906,378.00	0.24
115	600584	长电科技	28,500	903,735.00	0.24
116	600760	中航沈飞	22,000	882,200.00	0.23
117	600111	北方稀土	50,376	866,467.20	0.23
118	600489	中金黄金	57,900	856,920.00	0.23
119	002050	三花智控	44,600	850,968.00	0.22
120	600011	华能国际	87,600	842,712.00	0.22
121	601916	浙商银行	300,400	829,104.00	0.22
122	002252	上海莱士	105,880	827,981.60	0.22
123	600015	华夏银行	126,800	811,520.00	0.21
124	600009	上海机场	24,800	799,800.00	0.21
125	688256	寒武纪	4,000	794,680.00	0.21
126	600958	东方证券	104,100	791,160.00	0.21
127	600426	华鲁恒升	29,600	788,544.00	0.21
128	601186	中国铁建	91,603	785,037.71	0.21
129	002311	海大集团	16,600	781,030.00	0.21
130	300408	三环集团	26,700	779,373.00	0.21
131	000166	申万宏源	179,509	773,683.79	0.20
132	601901	方正证券	98,400	760,632.00	0.20
133	000157	中联重科	98,985	760,204.80	0.20
134	600989	宝丰能源	43,800	759,054.00	0.20
135	000977	浪潮信息	20,500	745,585.00	0.20
136	600674	川投能源	38,800	727,500.00	0.19
137	003816	中国广核	156,700	725,521.00	0.19
138	300433	蓝思科技	39,700	724,525.00	0.19
139	688271	联影医疗	6,600	724,020.00	0.19
140	000776	广发证券	59,000	718,030.00	0.19
141	002049	紫光国微	13,520	711,152.00	0.19
142	002001	新 和 成	36,948	709,401.60	0.19
143	000596	古井贡酒	3,300	696,531.00	0.18
144	601377	兴业证券	137,600	696,256.00	0.18

145	688036	传音控股	8,980	687,329.20	0.18
146	601111	中国国航	92,700	684,126.00	0.18
147	600115	中国东航	170,400	683,304.00	0.18
148	300122	智飞生物	23,850	668,515.50	0.18
149	000768	中航西飞	27,700	665,631.00	0.18
150	002460	赣锋锂业	22,510	644,911.50	0.17
151	001979	招商蛇口	72,170	634,374.30	0.17
152	601800	中国交建	70,900	633,846.00	0.17
153	600010	包钢股份	452,200	633,080.00	0.17
154	600029	南方航空	107,400	632,586.00	0.17
155	601633	长城汽车	24,800	627,440.00	0.17
156	600188	兖矿能源	27,400	622,802.00	0.16
157	002601	龙佰集团	33,300	618,381.00	0.16
158	002466	天齐锂业	20,600	616,146.00	0.16
159	002236	大华股份	39,400	609,124.00	0.16
160	002648	卫星化学	33,520	602,689.60	0.16
161	601117	中国化学	73,000	601,520.00	0.16
162	603799	华友钴业	27,067	598,992.71	0.16
163	000786	北新建材	20,172	598,301.52	0.16
164	000661	长春高新	6,400	587,328.00	0.16
165	600346	恒力石化	42,080	587,016.00	0.15
166	002493	荣盛石化	60,550	584,913.00	0.15
167	000983	山西焦煤	56,500	582,515.00	0.15
168	300782	卓胜微	7,460	579,940.40	0.15
169	603369	今世缘	12,500	577,500.00	0.15
170	601838	成都银行	38,000	577,220.00	0.15
171	600372	中航机载	48,200	576,954.00	0.15
172	600161	天坛生物	23,640	576,816.00	0.15
173	600023	浙能电力	80,100	569,511.00	0.15
174	601788	光大证券	38,900	568,718.00	0.15
175	688223	晶科能源	79,700	565,870.00	0.15
176	000999	华润三九	13,260	564,610.80	0.15
177	600196	复星医药	25,363	561,536.82	0.15
178	000807	云铝股份	41,400	559,314.00	0.15
179	002129	TCL 中环	64,450	557,492.50	0.15
180	002938	鹏鼎控股	13,900	552,664.00	0.15
181	300418	昆仑万维	17,100	551,304.00	0.15
182	600845	宝信软件	17,200	549,196.00	0.14
183	601872	招商轮船	64,900	548,405.00	0.14
184	601868	中国能建	258,400	547,808.00	0.14
185	601360	三六零	71,200	546,816.00	0.14
186	601021	春秋航空	9,700	546,401.00	0.14
187	300661	圣邦股份	6,590	545,520.20	0.14

188	600233	圆通速递	34,300	536,795.00	0.14
189	600570	恒生电子	30,208	533,473.28	0.14
190	600219	南山铝业	139,900	533,019.00	0.14
191	600176	中国巨石	47,848	528,720.40	0.14
192	600085	同仁堂	13,700	523,477.00	0.14
193	300896	爱美客	3,040	523,184.00	0.14
194	002180	纳思达	19,700	520,474.00	0.14
195	601995	中金公司	17,500	518,175.00	0.14
196	605499	东鹏饮料	2,400	517,800.00	0.14
197	600600	青岛啤酒	7,100	516,667.00	0.14
198	600741	华域汽车	31,413	514,544.94	0.14
199	300347	泰格医药	10,308	500,968.80	0.13
200	002736	国信证券	57,400	498,806.00	0.13
201	601689	拓普集团	9,300	498,573.00	0.13
202	601336	新华保险	16,600	498,498.00	0.13
203	601100	恒立液压	10,700	498,406.00	0.13
204	601066	中信建投	25,900	498,316.00	0.13
205	603392	万泰生物	7,538	496,603.44	0.13
206	600183	生益科技	23,500	494,910.00	0.13
207	002271	东方雨虹	40,100	494,834.00	0.13
208	000895	双汇发展	20,729	492,728.33	0.13
209	600362	江西铜业	20,699	490,152.32	0.13
210	600745	闻泰科技	17,300	488,725.00	0.13
211	000963	华东医药	17,440	485,006.40	0.13
212	001965	招商公路	40,800	483,888.00	0.13
213	002920	德赛西威	5,500	478,995.00	0.13
214	600027	华电国际	67,800	470,532.00	0.12
215	601881	中国银河	43,300	470,238.00	0.12
216	601898	中煤能源	36,500	455,520.00	0.12
217	688126	沪硅产业	32,800	452,968.00	0.12
218	300033	同花顺	4,300	445,910.00	0.12
219	002459	晶澳科技	39,528	442,713.60	0.12
220	601618	中国中冶	142,200	440,820.00	0.12
221	600026	中远海能	27,700	432,397.00	0.11
222	601699	潞安环能	23,800	431,494.00	0.11
223	600515	海南机场	136,500	428,610.00	0.11
224	002916	深南电路	4,040	427,310.80	0.11
225	300832	新产业	6,300	424,872.00	0.11
226	601607	上海医药	22,200	424,242.00	0.11
227	000301	东方盛虹	52,700	420,019.00	0.11
228	000876	新希望	45,300	414,042.00	0.11
229	601878	浙商证券	38,600	413,792.00	0.11
230	600039	四川路桥	52,100	411,069.00	0.11

231	600332	白云山	14,000	410,620.00	0.11
232	601998	中信银行	61,200	410,040.00	0.11
233	600588	用友网络	40,900	409,000.00	0.11
234	601877	正泰电器	21,450	408,837.00	0.11
235	002074	国轩高科	21,300	407,895.00	0.11
236	600875	东方电气	22,100	407,745.00	0.11
237	600415	小商品城	54,600	405,132.00	0.11
238	002555	三七互娱	30,900	403,245.00	0.11
239	002709	天赐材料	22,900	402,124.00	0.11
240	688396	华润微	10,500	393,120.00	0.10
241	600025	华能水电	35,900	387,002.00	0.10
242	600803	新奥股份	18,500	384,800.00	0.10
243	000408	藏格矿业	15,700	377,899.00	0.10
244	300316	晶盛机电	13,000	373,490.00	0.10
245	300223	北京君正	6,700	371,448.00	0.10
246	300628	亿联网络	10,100	371,377.00	0.10
247	002812	恩捷股份	11,700	370,305.00	0.10
248	688599	天合光能	21,652	366,351.84	0.10
249	300142	沃森生物	32,000	364,160.00	0.10
250	300450	先导智能	21,800	362,534.00	0.10
251	605117	德业股份	4,788	355,939.92	0.09
252	600460	士兰微	19,900	348,449.00	0.09
253	002007	华兰生物	21,903	345,848.37	0.09
254	601238	广汽集团	44,140	341,643.60	0.09
255	300496	中科创达	7,300	332,807.00	0.09
256	300751	迈为股份	2,780	332,154.40	0.09
257	603260	合盛硅业	7,100	331,641.00	0.09
258	301269	华大九天	4,300	331,315.00	0.09
259	300759	康龙化成	17,750	329,795.00	0.09
260	601319	中国人保	63,600	327,540.00	0.09
261	300999	金龙鱼	11,900	325,465.00	0.09
262	600018	上港集箱	55,616	321,460.48	0.08
263	000733	振华科技	7,700	319,781.00	0.08
264	002821	凯莱英	4,800	315,840.00	0.08
265	600918	中泰证券	55,500	314,685.00	0.08
266	601799	星宇股份	2,800	313,712.00	0.08
267	300413	芒果超媒	14,920	311,828.00	0.08
268	688009	中国通号	51,500	309,000.00	0.08
269	603806	福斯特	20,860	306,642.00	0.08
270	601865	福莱特	15,100	303,510.00	0.08
271	603659	璞泰来	21,270	300,545.10	0.08
272	603195	公牛集团	3,869	298,377.28	0.08
273	600132	重庆啤酒	4,800	291,360.00	0.08

274	600061	国投资本	51,144	288,963.60	0.08
275	300919	中伟股份	9,320	288,826.80	0.08
276	000617	中油资本	50,400	278,208.00	0.07
277	601059	信达证券	19,400	275,674.00	0.07
278	000708	中信特钢	20,100	272,757.00	0.07
279	688303	大全能源	12,678	258,504.42	0.07
280	688187	时代电气	5,200	256,776.00	0.07
281	002603	以岭药业	16,600	254,478.00	0.07
282	002410	广联达	26,500	253,870.00	0.07
283	300454	深信服	5,000	252,650.00	0.07
284	002841	视源股份	8,400	248,052.00	0.07
285	300442	润泽科技	10,300	246,685.00	0.07
286	603899	晨光股份	7,400	231,472.00	0.06
287	688363	华熙生物	3,700	209,309.00	0.06
288	601808	中海油服	11,800	202,960.00	0.05
289	600732	爱旭股份	21,860	197,833.00	0.05
290	603833	欧派家居	3,600	192,816.00	0.05
291	300979	华利集团	3,000	182,550.00	0.05
292	601236	红塔证券	28,200	181,044.00	0.05
293	601698	中国卫通	12,600	177,534.00	0.05
294	300957	贝泰妮	3,400	164,288.00	0.04
295	000800	一汽解放	18,500	144,855.00	0.04
296	688082	盛美上海	1,700	143,667.00	0.04
297	603296	华勤技术	1,800	99,414.00	0.03
298	001289	龙源电力	3,000	51,750.00	0.01

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	688717	艾罗能源	6,062	285,035.24	0.08
2	301565	中仑新材	7,103	174,381.42	0.05
3	688692	达梦数据	143	25,014.99	0.01
4	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
5	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
6	301526	国际复材	5,895	19,630.35	0.01
7	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
8	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
9	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
10	688709	成都华微	666	12,514.14	0.00
11	601096	宏盛华源	2,848	11,648.32	0.00
12	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
13	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
14	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
15	301413	安培龙	214	8,848.90	0.00

16	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
17	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
18	603341	龙旗科技	205	7,685.45	0.00
19	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
20	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
21	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
22	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
23	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
24	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
25	603325	博隆技术	59	4,015.54	0.00
26	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
27	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
28	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
29	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
30	603231	索宝蛋白	161	2,743.44	0.00
31	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
32	001358	兴欣新材	122	2,503.44	0.00
33	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
34	688065	凯赛生物	40	1,815.60	0.00
35	688653	康希通信	48	618.24	0.00
36	002202	金风科技	34	228.48	0.00
37	601083	锦江航运	17	162.52	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	002714	牧原股份	2,429,250.00	0.68
2	600900	长江电力	1,604,806.00	0.45
3	600519	贵州茅台	997,550.00	0.28
4	600760	中航沈飞	961,781.00	0.27
5	600161	天坛生物	622,907.00	0.17
6	000807	云铝股份	610,652.00	0.17
7	300418	昆仑万维	592,190.00	0.17
8	000002	万科 A	578,570.00	0.16
9	300750	宁德时代	531,141.60	0.15
10	603259	药明康德	519,900.00	0.15
11	001965	招商公路	495,681.00	0.14
12	600027	华电国际	490,354.00	0.14
13	300832	新产业	471,035.00	0.13
14	600026	中远海能	468,040.00	0.13
15	600415	小商品城	460,208.00	0.13
16	601318	中国平安	428,661.00	0.12

17	601006	大秦铁路	418,803.00	0.12
18	002371	北方华创	400,419.00	0.11
19	688223	晶科能源	360,904.47	0.10
20	600036	招商银行	353,026.00	0.10

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002714	牧原股份	2,112,812.20	0.59
2	600760	中航沈飞	877,361.80	0.25
3	000001	平安银行	605,463.00	0.17
4	600919	江苏银行	572,302.00	0.16
5	600028	中国石化	541,482.00	0.15
6	000002	万 科 A	501,088.00	0.14
7	002202	金风科技	408,048.00	0.11
8	601615	明阳智能	375,723.00	0.11
9	688692	达梦数据	337,194.00	0.09
10	300124	汇川技术	298,339.00	0.08
11	002142	宁波银行	298,311.00	0.08
12	600016	民生银行	270,140.00	0.08
13	300763	锦浪科技	255,689.00	0.07
14	688717	艾罗能源	250,239.36	0.07
15	300750	宁德时代	243,396.00	0.07
16	600754	锦江酒店	240,412.00	0.07
17	603486	科沃斯	229,059.00	0.06
18	603290	斯达半导	222,821.20	0.06
19	000069	华侨城 A	218,324.00	0.06
20	688065	凯赛生物	206,962.83	0.06

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	31,383,554.01
卖出股票收入（成交）总额	14,701,466.04

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,192.51
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	108,857.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	116,049.59

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688717	艾罗能源	285,035.24	0.08	新发未上市
2	688692	达梦数据	25,014.99	0.01	新发未上市
3	603285	键邦股份	24,002.55	0.01	新发未上市
4	603350	安乃达	21,608.56	0.01	新发未上市
5	301565	中仑新材	13,494.78	0.00	新发未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
19,235	13,987.22	31,402,302.85	11.67	237,641,884.55	88.33

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	邱桂芳	215,296.00	9.26
2	李晓年	197,689.00	8.50
3	何剑虹	128,976.00	5.54
4	郭念发	121,054.00	5.20
5	徐捷	101,500.00	4.36
6	余宏	86,300.00	3.71
7	方雪梅	60,111.00	2.58
8	杨利萍	53,800.00	2.31
9	郑凯鹏	47,181.00	2.03

10	刘冬梅	46,905.00	2.02
----	-----	-----------	------

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	20,532.97	0.01

8.4 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

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2009 年 11 月 5 日) 基金份额总额	5,326,413,369.61
本报告期期初基金份额总额	257,058,909.46
本报告期基金总申购份额	29,024,677.58
减：本报告期基金总赎回份额	17,039,399.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	269,044,187.40

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2024 年 3 月 30 日发布公告，自 2024 年 3 月 28 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司首席信息官。上述事项均已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
浙商证券	1	13,804,545.54	30.73	12,940.48	30.72	-
东方证券	3	12,263,537.04	27.30	11,477.35	27.25	-
中信建投	1	6,532,687.94	14.54	6,179.34	14.67	-
银河证券	2	6,397,977.62	14.24	5,987.64	14.21	-
东北证券	2	5,916,441.13	13.17	5,537.33	13.15	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	4	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	-

国开证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际 证券	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、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信华南	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华宝证	-	-	-	-	-	-

券						
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

无。

§ 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沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 设立的文件；
- 2、《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；

- 3、《建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2024 年 8 月 29 日