

建信中证 500 指数增强型证券投资基金 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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57

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	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	建信中证 500 指数增强	
基金主代码	000478	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 1 月 27 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,177,181,135.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	000478	005633
报告期末下属分级基金的份额总额	1,698,703,949.72 份	478,477,186.05 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p>
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	滕菲菲
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-81-95533; 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100033	100020
法定代表人		生柳荣	方合英

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	-126,323,793.29	-33,901,688.89
本期利润	-85,358,488.62	-29,426,946.28
加权平均基金份 额本期利润	-0.0506	-0.0655
本期加权平均净 值利润率	-2.10%	-2.80%
本期基金份额净 值增长率	-2.43%	-2.67%

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	2,325,793,127.86	619,414,044.57
期末可供分配基金份额利润	1.3692	1.2946
期末基金资产净值	4,024,497,077.58	1,097,891,230.62
期末基金份额净值	2.3692	2.2946
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	136.92%	-3.31%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信中证 500 指数增强 A

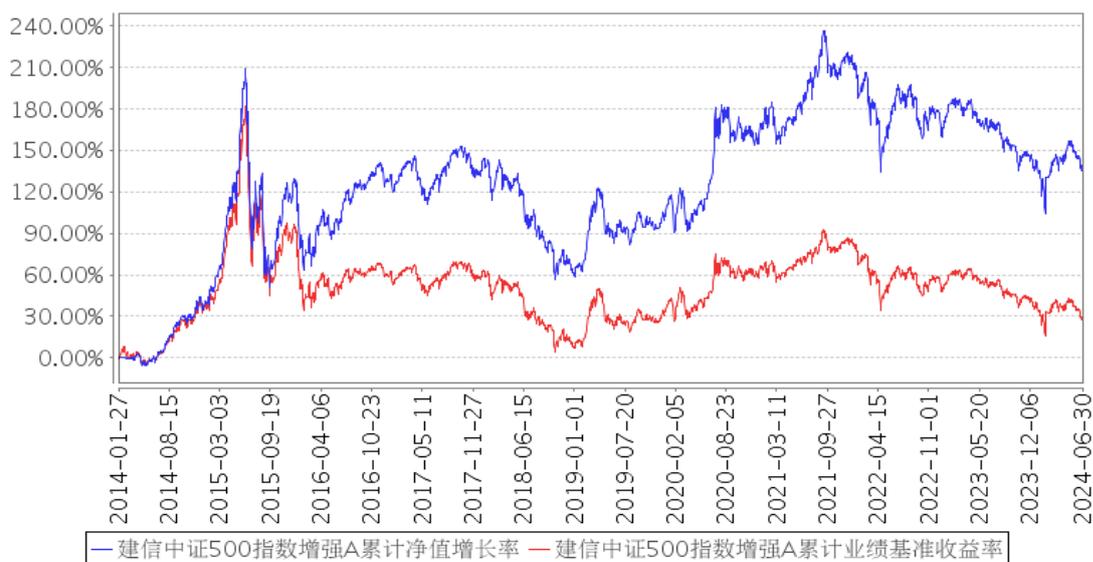
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.92%	0.79%	-6.55%	0.91%	1.63%	-0.12%
过去三个月	-1.44%	0.95%	-6.16%	1.09%	4.72%	-0.14%
过去六个月	-2.43%	1.36%	-8.46%	1.53%	6.03%	-0.17%
过去一年	-12.18%	1.10%	-16.71%	1.21%	4.53%	-0.11%
过去三年	-18.70%	1.12%	-26.00%	1.14%	7.30%	-0.02%
自基金合同生效起至今	136.92%	1.51%	27.94%	1.49%	108.98%	0.02%

建信中证 500 指数增强 C

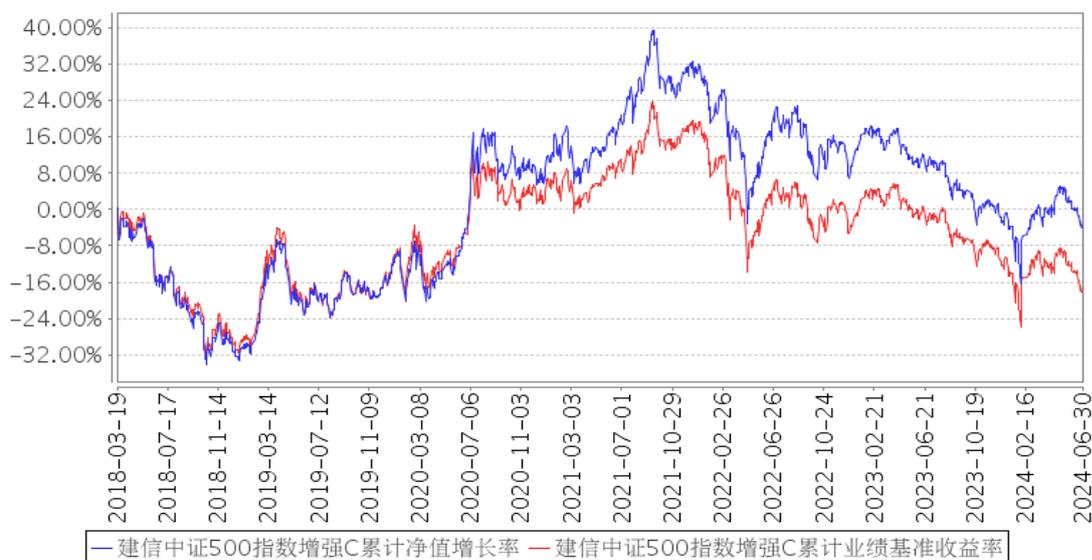
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.96%	0.79%	-6.55%	0.91%	1.59%	-0.12%
过去三个月	-1.56%	0.95%	-6.16%	1.09%	4.60%	-0.14%
过去六个月	-2.67%	1.36%	-8.46%	1.53%	5.79%	-0.17%
过去一年	-12.62%	1.10%	-16.71%	1.21%	4.09%	-0.11%
过去三年	-19.91%	1.12%	-26.00%	1.14%	6.09%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-3.31%	1.29%	-18.06%	1.28%	14.75%	0.01%

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

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



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



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，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		
叶乐天	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2014 年 1 月 27 日	-	16	叶乐天先生，数量投资部副总经理，博士。曾任中国国际金融有限公司市场风险管理分析员、量化分析经理。2011 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理。2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理，该基金自 2021 年 1 月 1 日起转型为建信央视财经 50 指数证券投资基金（LOF），叶乐天继续担任该基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 4 月 18 日至 2023 年 11 月 17 日任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 22 日至 2024 年 2 月 5 日任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 1 月 10 日至 2022 年 8 月 9 日任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 8 月 24 日至 2022 年 11 月 17 日任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日起任建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日起任建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 15 日起任建信灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2022 年 12 月 23 日起任建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理。

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《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 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

本基金为指数增强型基金，管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型进行指数增强和风险管理。本基金自成立以来一直严格控制与标的指数的行业偏离和风格偏离，在个股选择上进行了一定的主动暴露。由于基金规模相对较大，基金管理人采用分散持仓、适当降低换手率、采用算法交易等方式尽量降低交易成本，同时对风险事件进行实时监控，以尽量避免负面事件影响。报告期内市场环境变化较大，但本基金仍取得了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率-2.43%，波动率 1.36%，业绩比较基准收益率-8.46%，波动率 1.53%。本报告期本基金 C 净值增长率-2.67%，波动率 1.36%，业绩比较基准收益率-8.46%，波动率 1.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在报告期内，指数整体呈现震荡下行的走势。市场风格变动较大，微盘股在经历了前几年的高歌猛进后在 2024 年的春节前夕大幅下跌，引发了流动性风险，使得大家也更关注市值偏离带来的组合风险。红利风格则一直保持着较好的表现，继续获得青睐。从整个报告期来看，市场整体呈现大盘价值风格占优的局面。

展望 2024 年下半年，红利策略在连续占优多年后也存在风格过于拥挤的问题，仍需谨慎。我们觉得 2024 年下半年的市场风格变化会比较大，美国大选也会带来不小的扰动。市场整体可能存在一定机会，但风格的把握更为重要，结构性行情仍然存在，如何判断风格以及如何优选个股仍是投资的关键因素。作为指数增强基金，对风格暴露的控制以获取稳健的超额收益仍是至关重要的。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年上半年的基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为

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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司在建信中证 500 指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：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	564,722,737.76	370,293,407.24
结算备付金		334,662,102.41	397,115,051.52

存出保证金		60,460,839.56	44,935,072.17
交易性金融资产	6.4.7.2	4,195,401,404.12	4,132,876,017.27
其中：股票投资		4,195,401,404.12	4,132,876,017.27
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,964,272.16	2,816,062.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		5,157,211,356.01	4,948,035,610.69
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		233,628.64	42,246.94
应付赎回款		8,593,132.45	4,658,140.74
应付管理人报酬		4,312,025.86	4,149,197.69
应付托管费		862,405.18	829,839.54
应付销售服务费		459,147.13	430,860.50
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	20,362,708.55	37,927,543.81
负债合计		34,823,047.81	48,037,829.22
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,177,181,135.77	2,030,522,283.97
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,945,207,172.43	2,869,475,497.50

净资产合计		5,122,388,308.20	4,899,997,781.47
负债和净资产总计		5,157,211,356.01	4,948,035,610.69

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,177,181,135.77 份，其中建信中证 500 指数增强 A 基金份额总额 1,698,703,949.72 份，基金份额净值人民币 2.3692 元；建信中证 500 指数增强 C 基金份额总额 478,477,186.05 份，基金份额净值人民币 2.2946 元。

6.2 利润表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：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		-81,123,485.43	106,855,279.58
1. 利息收入		4,415,106.45	5,291,966.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,415,106.45	5,291,966.83
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）		-131,125,715.11	62,314,382.64
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-167,040,005.02	-5,878,785.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-39,643,432.87	14,596,678.83
股利收益	6.4.7.19	75,557,722.78	53,596,488.97
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	45,440,047.28	38,596,643.70
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	147,075.95	652,286.41

减：二、营业总支出		33,661,949.47	33,549,765.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	25,441,704.63	26,356,389.28
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,088,340.91	5,271,277.81
3. 销售服务费		2,608,185.96	1,320,828.37
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		-	61,107.83
8. 其他费用	6.4.7.23	523,717.97	540,161.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-114,785,434.90	73,305,514.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-114,785,434.90	73,305,514.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-114,785,434.90	73,305,514.39

6.3 净资产变动表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：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	2,030,522,283.97	-	2,869,475,497.50	4,899,997,781.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,030,522,283.97	-	2,869,475,497.50	4,899,997,781.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	146,658,851.80	-	75,731,674.93	222,390,526.73
（一）、综合收益	-	-	-114,785,434.90	-114,785,434.90

总额			0	
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	146,658,851.80	-	190,517,109.83	337,175,961.63
其中: 1. 基金申购款	286,240,669.32	-	382,427,537.34	668,668,206.66
2. 基金赎回款	-139,581,817.52	-	-191,910,427.51	-331,492,245.03
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,177,181,135.77	-	2,945,207,172.43	5,122,388,308.20
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、上期期末净资产	1,951,566,158.04	-	3,246,449,917.62	5,198,016,075.66
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,951,566,158.04	-	3,246,449,917.62	5,198,016,075.66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	33,968,555.17	-	96,755,681.19	130,724,236.36
(一)、综合收益总额	-	-	73,305,514.39	73,305,514.39
(二)、本期基金	33,968,555.17	-	23,450,166.80	57,418,721.97

份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	387,222,921.26	-	657,108,700.58	1,044,331,621.84
2. 基金赎回款	-353,254,366.09	-	-633,658,533.78	-986,912,899.87
(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	1,985,534,713.21	-	3,343,205,598.81	5,328,740,312.02

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

建信中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]615 号《关于核准建信中证 500 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 308,106,805.84 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2014）第 039 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2014 年 1 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 308,165,342.91 份基金份额，其中认购资金利息折合

58,537.07 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《建信中证 500 指数增强型证券投资基金新增 C 类基金份额及修改基金合同的公告》并报证监会备案，本基金于 2018 年 3 月 16 日起根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同，将本基金基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。2018 年 3 月 16 日前原有的基金份额在开放申购赎回后，全部转换为建信中证 500 指数增强 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为不低于 90%，其中投资于中证 500 成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为 $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率}$ （税前）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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	564,722,737.76
等于：本金	564,612,120.25
加：应计利息	110,617.51
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	564,722,737.76

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	4,321,188,541.99	-	4,195,401,404.12	-125,787,137.87

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	4,321,188,541.99	-	4,195,401,404.12	-125,787,137.87

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	509,168,000.00	-	-	-
其中：股指期货投资	509,168,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	509,168,000.00	-	-	-

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

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2407	IC2407	240.00	236,044,800.00	-4,537,960.00
IM2407	IM2407	270.00	262,332,000.00	-6,253,240.00
合计				-10,791,200.00
减：可抵销期货				-10,791,200.00

暂收款				
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	21,915.71
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	19,930,929.72
其中：交易所市场	19,930,929.72
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	210,936.98
预提费用	198,926.14
合计	20,362,708.55

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 500 指数增强 A

项目	本期 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	1,599,228,067.44	1,599,228,067.44
本期申购	212,441,907.19	212,441,907.19
本期赎回（以“-”号填列）	-112,966,024.91	-112,966,024.91
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,698,703,949.72	1,698,703,949.72

建信中证 500 指数增强 C

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	431,294,216.53	431,294,216.53
本期申购	73,798,762.13	73,798,762.13
本期赎回（以“-”号填列）	-26,615,792.61	-26,615,792.61
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	478,477,186.05	478,477,186.05

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

建信中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,637,188,823.65	-353,223,320.67	2,283,965,502.98
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,637,188,823.65	-353,223,320.67	2,283,965,502.98
本期利润	-126,323,793.29	40,965,304.67	-85,358,488.62
本期基金份额交易产生的变动数	160,159,503.77	-32,973,390.27	127,186,113.50
其中：基金申购款	334,832,482.86	-50,172,107.02	284,660,375.84
基金赎回款	-174,672,979.09	17,198,716.75	-157,474,262.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,671,024,534.13	-345,231,406.27	2,325,793,127.86

建信中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	678,359,403.64	-92,849,409.12	585,509,994.52
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	678,359,403.64	-92,849,409.12	585,509,994.52
本期利润	-33,901,688.89	4,474,742.61	-29,426,946.28
本期基金份额交易产生的变动数	69,692,181.42	-6,361,185.09	63,330,996.33
其中：基金申购款	108,021,304.43	-10,254,142.93	97,767,161.50
基金赎回款	-38,329,123.01	3,892,957.84	-34,436,165.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	714,149,896.17	-94,735,851.60	619,414,044.57

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	1,673,185.04
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,735,246.32
其他	6,675.09
合计	4,415,106.45

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	-167,040,005.02
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	-167,040,005.02

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	8,213,973,934.98
减：卖出股票成本总额	8,361,020,807.14
减：交易费用	19,993,132.86
买卖股票差价收入	-167,040,005.02

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-39,643,432.87

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	75,557,722.78
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	75,557,722.78

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	55,976,607.28
股票投资	55,976,607.28

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	-10,536,560.00
权证投资	-
期货投资	-10,536,560.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	45,440,047.28

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	144,353.56
基金转换费收入	2,722.39
合计	147,075.95

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	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,224.53
指数使用费	407,067.30
银行间账户维护费	9,000.00
合计	523,717.97

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

根据本基金管理人于 2024 年 7 月 9 日发布的《建信中证 500 指数增强型证券投资基金增加 E

类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，基金管理人经与托管人协商一致，本基金在原有份额的基础上增设 E 类基金份额，同时根据最新法律法规对本基金基金合同进行了相应修改。

除上述情况外，截至本财务报表批准报出日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	25,441,704.63	26,356,389.28
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,328,855.62	9,586,158.01
应支付基金管理人的净管理费	16,112,849.01	16,770,231.27

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	5,088,340.91	5,271,277.81

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C	合计
建信基金	-	830,346.54	830,346.54
合计	-	830,346.54	830,346.54
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C	合计
建信基金	-	467,876.72	467,876.72
合计	-	467,876.72	467,876.72

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 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%。销售服务费的计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中信银行-活期	564,722,737.76	1,673,185.04	268,623,757.12	1,075,746.14

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	2024	6个月	新发	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-

	安电 工	年 3 月 19 日		未上 市						
001387	雪 祺 电 气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新发 未上 市	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
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	-
301502	华 阳 智 能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新发 未上 市	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
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	-
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	2024	6 个月	新发	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-

	新科技	年 3 月 6 日		未上市						
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新发未上市	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
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	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新发未上市	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
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	2024	6 个月	新发	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-

	芯股份	年 4 月 2 日		未上市						
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新发未上市	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
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	1,045	16,396.05	19,635.55	-
688717	艾罗能源	2023 年 12 月 26 日	6 个月	新发未上市	55.66	47.02	11,303	629,124.98	531,467.06	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

险。

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，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	564,722,737.76	-	-	-	564,722,737.76
结算备付金	334,662,102.41	-	-	-	334,662,102.41
存出保证金	60,460,839.56	-	-	-	60,460,839.56
交易性金融资产	-	-	-	-4,195,401,404.12	4,195,401,404.12
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	-	-	-	1,964,272.16	1,964,272.16
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	959,845,679.73	-	-	-4,197,365,676.28	5,157,211,356.01
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	-	-	-	233,628.64	233,628.64
应付赎回款	-	-	-	8,593,132.45	8,593,132.45
应付管理人报酬	-	-	-	4,312,025.86	4,312,025.86
应付托管费	-	-	-	862,405.18	862,405.18
应付销售服务费	-	-	-	459,147.13	459,147.13
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	20,362,708.55	20,362,708.55
负债总计	-	-	-	34,823,047.81	34,823,047.81
利率敏感度缺口	959,845,679.73	-	-	-4,162,542,628.47	5,122,388,308.20
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	370,293,407.24	-	-	-	370,293,407.24
结算备付金	397,115,051.52	-	-	-	397,115,051.52
存出保证金	44,935,072.17	-	-	-	44,935,072.17
交易性金融资产	-	-	-	-4,132,876,017.27	4,132,876,017.27
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	-	-	-	2,816,062.49	2,816,062.49
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	812,343,530.93	-	-	-4,135,692,079.76	4,948,035,610.69

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	-	-	-	42,246.94	42,246.94
应付赎回款	-	-	-	4,658,140.74	4,658,140.74
应付管理人报酬	-	-	-	4,149,197.69	4,149,197.69
应付托管费	-	-	-	829,839.54	829,839.54
应付销售服务费	-	-	-	430,860.50	430,860.50
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	37,927,543.81	37,927,543.81
负债总计	-	-	-	48,037,829.22	48,037,829.22
利率敏感度缺口	812,343,530.93	-	-	-4,087,654,250.54	4,899,997,781.47

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	4,195,401,404.12	81.90	4,132,876,017.27	84.34
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	4,195,401,404.12	81.90	4,132,876,017.27	84.34

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%	227,067,397.72	222,728,199.48
	业绩比较基准下降 5%	-227,067,397.72	-222,728,199.48

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	4,194,622,279.10	4,129,949,429.93
第二层次	45,611.11	1,732,272.02
第三层次	733,513.91	1,194,315.32
合计	4,195,401,404.12	4,132,876,017.27

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义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	4,195,401,404.12	81.35
	其中：股票	4,195,401,404.12	81.35
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	899,384,840.17	17.44
8	其他各项资产	62,425,111.72	1.21
9	合计	5,157,211,356.01	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	48,070,022.91	0.94
B	采矿业	287,854,695.00	5.62
C	制造业	2,277,286,061.70	44.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	174,966,728.09	3.42
E	建筑业	58,402,615.00	1.14
F	批发和零售业	57,443,837.30	1.12
G	交通运输、仓储和邮政业	150,838,039.40	2.94
H	住宿和餐饮业	5,106,074.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,851,662.03	2.13
J	金融业	328,516,191.31	6.41
K	房地产业	14,900,120.96	0.29
L	租赁和商务服务业	26,259,408.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,349,386.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	59,517.00	-
Q	卫生和社会工作	12,077,880.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	88,004,503.20	1.72
S	综合	29,291,328.00	0.57
	合计	3,686,278,069.90	71.96

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	1,486,062.00	0.03
B	采矿业	12,681,770.00	0.25
C	制造业	316,227,462.64	6.17

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	113,570.00	0.00
E	建筑业	2,083,202.00	0.04
F	批发和零售业	4,055,380.40	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	6,998,439.00	0.14
H	住宿和餐饮业	86,736.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	105,686,636.70	2.06
J	金融业	27,749,167.00	0.54
K	房地产业	2,731,824.00	0.05
L	租赁和商务服务业	4,441,000.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	3,214,896.42	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	16,810,252.00	0.33
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	4,756,936.06	0.09
S	综合	-	-
	合计	509,123,334.22	9.94

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	002128	电投能源	2,524,279	53,262,286.90	1.04
2	688169	石头科技	126,902	49,821,725.20	0.97
3	600282	南钢股份	9,417,500	46,899,150.00	0.92
4	000883	湖北能源	7,773,500	46,718,735.00	0.91
5	600642	申能股份	5,173,627	45,683,126.41	0.89
6	000933	神火股份	2,229,500	45,102,785.00	0.88
7	600066	宇通客车	1,718,275	44,331,495.00	0.87
8	600985	淮北矿业	2,641,320	44,215,696.80	0.86
9	603379	三美股份	1,113,900	43,598,046.00	0.85

10	600582	天地科技	6,192,209	42,664,320.01	0.83
11	600901	江苏金租	8,422,812	42,535,200.60	0.83
12	300502	新易盛	381,800	40,298,990.00	0.79
13	600968	海油发展	9,775,900	40,276,708.00	0.79
14	600873	梅花生物	4,012,400	40,204,248.00	0.78
15	000423	东阿阿胶	628,200	39,325,320.00	0.77
16	002138	顺络电子	1,417,023	38,911,451.58	0.76
17	601567	三星医疗	1,103,802	38,633,070.00	0.75
18	600566	济川药业	1,184,505	37,560,653.55	0.73
19	000598	兴蓉环境	4,942,459	37,167,291.68	0.73
20	000738	航发控制	1,846,700	37,063,269.00	0.72
21	002078	太阳纸业	2,635,948	36,771,474.60	0.72
22	002595	豪迈科技	932,758	35,603,372.86	0.70
23	601958	金钼股份	3,414,086	35,540,635.26	0.69
24	002064	华峰化学	4,885,899	35,031,895.83	0.68
25	603338	浙江鼎力	555,581	33,568,204.02	0.66
26	600398	海澜之家	3,632,500	33,564,300.00	0.66
27	600885	宏发股份	1,212,452	33,560,671.36	0.66
28	002444	巨星科技	1,346,020	33,246,694.00	0.65
29	688188	柏楚电子	178,513	32,944,574.15	0.64
30	601577	长沙银行	4,013,400	32,829,612.00	0.64
31	600820	隧道股份	4,996,600	32,627,798.00	0.64
32	300765	新诺威	1,291,180	32,576,471.40	0.64
33	601231	环旭电子	2,004,339	32,169,640.95	0.63
34	600704	物产中大	7,355,715	31,923,803.10	0.62
35	300394	天孚通信	359,743	31,808,476.06	0.62
36	601216	君正集团	8,543,700	31,526,253.00	0.62
37	000039	中集集团	3,338,516	30,914,658.16	0.60
38	600521	华海药业	1,788,000	30,485,400.00	0.60
39	600598	北大荒	2,440,259	30,478,834.91	0.60
40	002625	光启技术	1,737,700	30,149,095.00	0.59
41	002532	天山铝业	3,711,200	30,097,832.00	0.59
42	002408	齐翔腾达	5,320,480	29,794,688.00	0.58
43	600707	彩虹股份	4,323,700	29,444,397.00	0.57
44	600062	华润双鹤	1,503,280	29,434,222.40	0.57
45	600673	东阳光	4,160,700	29,291,328.00	0.57
46	600967	内蒙一机	4,017,100	28,923,120.00	0.56
47	600517	国网英大	6,631,400	28,713,962.00	0.56
48	002372	伟星新材	1,857,936	28,649,373.12	0.56
49	688475	萤石网络	838,000	28,584,180.00	0.56
50	002653	海思科	926,400	28,440,480.00	0.56
51	688172	燕东微	1,749,600	28,308,528.00	0.55
52	000987	越秀资本	5,647,276	28,010,488.96	0.55

53	601058	赛轮轮胎	1,990,305	27,864,270.00	0.54
54	600529	山东药玻	1,048,500	26,568,990.00	0.52
55	600909	华安证券	6,278,530	26,432,611.30	0.52
56	603786	科博达	395,642	25,380,434.30	0.50
57	601598	中国外运	4,486,900	25,261,247.00	0.49
58	601298	青岛港	2,611,900	24,969,764.00	0.49
59	601000	唐山港	5,311,298	24,963,100.60	0.49
60	601077	渝农商行	4,927,700	24,737,054.00	0.48
61	601019	山东出版	2,065,800	24,417,756.00	0.48
62	002340	格林美	3,803,400	24,227,658.00	0.47
63	002414	高德红外	4,028,900	23,730,221.00	0.46
64	603156	养元饮品	1,086,300	23,105,601.00	0.45
65	603606	东方电缆	462,900	22,594,149.00	0.44
66	600970	中材国际	1,872,500	22,582,350.00	0.44
67	002683	广东宏大	1,099,000	22,122,870.00	0.43
68	601198	东兴证券	2,731,200	21,740,352.00	0.42
69	002497	雅化集团	2,434,400	21,714,848.00	0.42
70	600299	安迪苏	2,190,100	21,243,970.00	0.41
71	601098	中南传媒	1,698,900	21,100,338.00	0.41
72	000830	鲁西化工	1,783,000	20,664,970.00	0.40
73	002273	水晶光电	1,213,300	20,601,834.00	0.40
74	601555	东吴证券	3,456,600	20,393,940.00	0.40
75	002223	鱼跃医疗	532,806	20,033,505.60	0.39
76	003022	联泓新科	1,434,840	19,671,656.40	0.38
77	688819	天能股份	806,103	19,233,617.58	0.38
78	601456	国联证券	1,903,300	18,347,812.00	0.36
79	603228	景旺电子	575,400	18,297,720.00	0.36
80	600350	山东高速	1,940,300	17,171,655.00	0.34
81	600098	广州发展	2,675,200	17,121,280.00	0.33
82	603883	老百姓	915,070	16,800,685.20	0.33
83	601156	东航物流	825,434	16,797,581.90	0.33
84	603529	爱玛科技	597,264	16,323,225.12	0.32
85	603568	伟明环保	793,000	16,319,940.00	0.32
86	002558	巨人网络	1,726,900	16,301,936.00	0.32
87	001872	招商港口	833,200	16,039,100.00	0.31
88	601665	齐鲁银行	3,132,500	15,380,575.00	0.30
89	300001	特锐德	740,774	14,904,372.88	0.29
90	300207	欣旺达	981,400	14,887,838.00	0.29
91	600373	中文传媒	1,001,780	14,866,415.20	0.29
92	600612	老凤祥	254,996	14,838,217.24	0.29
93	002008	大族激光	705,100	14,666,080.00	0.29
94	002262	恩华药业	617,760	14,665,622.40	0.29
95	600096	云天化	754,400	14,650,448.00	0.29

96	601928	凤凰传媒	1,317,700	14,441,992.00	0.28
97	600126	杭钢股份	3,459,560	14,218,791.60	0.28
98	002500	山西证券	3,020,300	14,195,410.00	0.28
99	600153	建发股份	1,575,900	14,072,787.00	0.27
100	688772	珠海冠宇	937,730	13,972,177.00	0.27
101	000155	川能动力	1,290,000	13,893,300.00	0.27
102	601179	中国西电	1,689,300	13,581,972.00	0.27
103	601128	常熟银行	1,792,999	13,573,002.43	0.26
104	603317	天味食品	1,172,553	13,378,829.73	0.26
105	603658	安图生物	288,700	13,300,409.00	0.26
106	000519	中兵红箭	886,200	13,000,554.00	0.25
107	601717	郑煤机	861,500	12,750,200.00	0.25
108	300529	健帆生物	455,200	12,385,992.00	0.24
109	601168	西部矿业	684,100	12,279,595.00	0.24
110	300724	捷佳伟创	223,764	12,085,493.64	0.24
111	300251	光线传媒	1,346,000	11,319,860.00	0.22
112	600755	厦门国贸	1,558,200	11,172,294.00	0.22
113	000959	首钢股份	4,098,800	11,148,736.00	0.22
114	600808	马钢股份	5,471,400	11,052,228.00	0.22
115	002850	科达利	144,000	10,998,720.00	0.21
116	601666	平煤股份	978,500	10,959,200.00	0.21
117	603688	石英股份	368,322	10,906,014.42	0.21
118	300776	帝尔激光	231,780	10,652,608.80	0.21
119	000683	远兴能源	1,524,500	10,534,295.00	0.21
120	002572	索菲亚	669,700	10,266,501.00	0.20
121	002281	光迅科技	274,331	10,251,749.47	0.20
122	002984	森麒麟	424,800	10,233,432.00	0.20
123	601118	海南橡胶	2,222,800	10,113,740.00	0.20
124	000066	中国长城	1,151,200	10,073,000.00	0.20
125	002563	森马服饰	1,703,750	9,898,787.50	0.19
126	600763	通策医疗	183,000	9,891,150.00	0.19
127	300357	我武生物	487,644	9,860,161.68	0.19
128	601966	玲珑轮胎	535,518	9,837,465.66	0.19
129	600699	均胜电子	642,400	9,520,368.00	0.19
130	000937	冀中能源	1,407,638	9,431,174.60	0.18
131	002517	恺英网络	984,700	9,403,885.00	0.18
132	688099	晶晨股份	156,260	9,269,343.20	0.18
133	000400	许继电气	265,338	9,130,280.58	0.18
134	000932	华菱钢铁	2,016,800	8,934,424.00	0.17
135	603160	汇顶科技	128,430	8,829,562.50	0.17
136	600737	中粮糖业	915,992	8,784,363.28	0.17
137	688122	西部超导	227,465	8,716,458.80	0.17
138	603056	德邦股份	640,459	8,390,012.90	0.16

139	600315	上海家化	460,300	8,184,134.00	0.16
140	600177	雅戈尔	1,136,600	8,092,592.00	0.16
141	600546	山煤国际	550,800	8,052,696.00	0.16
142	000729	燕京啤酒	894,100	7,894,903.00	0.15
143	600329	达仁堂	241,600	7,825,424.00	0.15
144	688516	奥特维	184,905	7,730,878.05	0.15
145	001203	大中矿业	789,000	7,582,290.00	0.15
146	601866	中远海发	2,930,600	7,560,948.00	0.15
147	300003	乐普医疗	505,000	7,494,200.00	0.15
148	002299	圣农发展	548,200	7,477,448.00	0.15
149	601636	旗滨集团	1,123,271	7,245,097.95	0.14
150	002384	东山精密	339,800	7,033,860.00	0.14
151	000878	云南铜业	559,014	6,965,314.44	0.14
152	601997	贵阳银行	1,311,300	6,910,551.00	0.13
153	600377	宁沪高速	546,200	6,882,120.00	0.13
154	002945	华林证券	686,324	6,849,513.52	0.13
155	688002	睿创微纳	244,800	6,847,056.00	0.13
156	000513	丽珠集团	184,000	6,846,640.00	0.13
157	688276	百克生物	231,012	6,553,810.44	0.13
158	000728	国元证券	1,060,000	6,423,600.00	0.13
159	300866	安克创新	84,310	6,003,715.10	0.12
160	600801	华新水泥	434,460	5,973,825.00	0.12
161	002268	电科网安	385,600	5,487,088.00	0.11
162	600348	华阳股份	540,464	5,383,021.44	0.11
163	688375	国博电子	76,165	5,380,295.60	0.11
164	002465	海格通信	518,700	5,373,732.00	0.10
165	601233	桐昆股份	335,900	5,360,964.00	0.10
166	002025	航天电器	115,000	5,333,700.00	0.10
167	600928	西安银行	1,599,500	5,230,365.00	0.10
168	603185	弘元绿能	305,817	5,226,412.53	0.10
169	002244	滨江集团	697,700	5,065,302.00	0.10
170	002152	广电运通	479,600	5,016,616.00	0.10
171	600486	扬农化工	88,660	5,004,857.00	0.10
172	600655	豫园股份	969,500	4,992,925.00	0.10
173	600879	航天电子	639,700	4,970,469.00	0.10
174	002155	湖南黄金	271,800	4,919,580.00	0.10
175	601108	财通证券	732,400	4,841,164.00	0.09
176	300677	英科医疗	179,420	4,810,250.20	0.09
177	600380	健康元	428,800	4,789,696.00	0.09
178	600325	华发股份	732,800	4,763,200.00	0.09
179	002557	洽洽食品	168,966	4,763,151.54	0.09
180	601158	重庆水务	988,000	4,742,400.00	0.09
181	301236	软通动力	133,082	4,685,817.22	0.09

182	603225	新凤鸣	300,303	4,681,723.77	0.09
183	002966	苏州银行	623,019	4,672,642.50	0.09
184	000401	冀东水泥	1,044,000	4,238,640.00	0.08
185	600141	兴发集团	218,800	4,174,704.00	0.08
186	600765	中航重机	203,800	4,157,520.00	0.08
187	688520	神州细胞	105,000	4,131,750.00	0.08
188	688063	派能科技	101,640	4,036,124.40	0.08
189	000997	新大陆	282,325	3,927,140.75	0.08
190	000887	中鼎股份	316,856	3,878,317.44	0.08
191	002608	江苏国信	494,800	3,834,700.00	0.07
192	300002	神州泰岳	451,700	3,667,804.00	0.07
193	000630	铜陵有色	1,012,800	3,656,208.00	0.07
194	603893	瑞芯微	60,100	3,556,117.00	0.07
195	002019	亿帆医药	287,600	3,554,736.00	0.07
196	688213	思特威	72,600	3,521,100.00	0.07
197	601568	北元集团	948,500	3,518,935.00	0.07
198	300474	景嘉微	55,300	3,496,619.00	0.07
199	600663	陆家嘴	390,128	3,440,928.96	0.07
200	301165	锐捷网络	114,900	3,428,616.00	0.07
201	600583	海油工程	573,100	3,387,021.00	0.07
202	600535	天士力	264,100	3,322,378.00	0.06
203	603979	金诚信	65,600	3,314,768.00	0.06
204	002056	横店东磁	262,600	3,274,622.00	0.06
205	002028	思源电气	48,300	3,231,270.00	0.06
206	688234	天岳先进	67,767	3,179,627.64	0.06
207	002373	千方科技	349,245	3,167,652.15	0.06
208	688348	昱能科技	53,600	3,162,400.00	0.06
209	600170	上海建工	1,424,500	3,062,675.00	0.06
210	600988	赤峰黄金	185,900	3,037,606.00	0.06
211	000958	电投产融	796,500	2,915,190.00	0.06
212	000050	深天马 A	398,800	2,903,264.00	0.06
213	600131	国网信通	170,600	2,878,022.00	0.06
214	000921	海信家电	89,000	2,869,360.00	0.06
215	600032	浙江新能	384,200	2,796,976.00	0.05
216	600549	厦门钨业	161,700	2,789,325.00	0.05
217	600563	法拉电子	36,300	2,765,334.00	0.05
218	300253	卫宁健康	467,800	2,760,020.00	0.05
219	601990	南京证券	353,300	2,713,344.00	0.05
220	002153	石基信息	460,152	2,636,670.96	0.05
221	688220	翱捷科技	70,281	2,632,726.26	0.05
222	600258	首旅酒店	211,000	2,605,850.00	0.05
223	000778	新兴铸管	748,400	2,604,432.00	0.05
224	002423	中粮资本	347,500	2,602,775.00	0.05

225	300017	网宿科技	324,034	2,559,868.60	0.05
226	000825	太钢不锈	750,500	2,536,690.00	0.05
227	603444	吉比特	14,200	2,527,742.00	0.05
228	002120	韵达股份	326,300	2,525,562.00	0.05
229	002429	兆驰股份	525,000	2,525,250.00	0.05
230	600754	锦江酒店	108,800	2,500,224.00	0.05
231	688153	唯捷创芯	67,192	2,486,104.00	0.05
232	600129	太极集团	85,600	2,475,552.00	0.05
233	603218	日月股份	241,000	2,475,070.00	0.05
234	300285	国瓷材料	137,600	2,456,160.00	0.05
235	000703	恒逸石化	344,900	2,445,341.00	0.05
236	600497	驰宏锌锗	444,700	2,374,698.00	0.05
237	002756	永兴材料	66,000	2,361,480.00	0.05
238	002353	杰瑞股份	66,900	2,346,852.00	0.05
239	000960	锡业股份	148,800	2,304,912.00	0.04
240	002185	华天科技	279,600	2,278,740.00	0.04
241	688778	厦钨新能	72,600	2,268,024.00	0.04
242	000156	华数传媒	349,500	2,194,860.00	0.04
243	002044	美年健康	578,500	2,186,730.00	0.04
244	600399	抚顺特钢	382,900	2,155,727.00	0.04
245	002266	浙富控股	727,400	2,029,446.00	0.04
246	600859	王府井	165,100	1,938,274.00	0.04
247	002409	雅克科技	30,456	1,915,986.96	0.04
248	300144	宋城演艺	231,400	1,858,142.00	0.04
249	600862	中航高科	97,912	1,838,787.36	0.04
250	300390	天华新能	105,700	1,815,926.00	0.04
251	688005	容百科技	72,600	1,690,128.00	0.03
252	002791	坚朗五金	65,200	1,686,724.00	0.03
253	600511	国药股份	53,400	1,644,186.00	0.03
254	600848	上海临港	179,000	1,630,690.00	0.03
255	002507	涪陵榨菜	112,436	1,377,341.00	0.03
256	600927	永安期货	82,000	914,300.00	0.02
257	002065	东华软件	190,800	862,416.00	0.02
258	601828	美凯龙	261,600	667,080.00	0.01
259	688387	信科移动	127,800	644,112.00	0.01
260	000785	居然之家	142,900	347,247.00	0.01
261	600416	湘电股份	34,700	344,918.00	0.01
262	002430	杭氧股份	14,700	327,075.00	0.01
263	603885	吉祥航空	25,200	276,948.00	0.01
264	600390	五矿资本	63,920	258,876.00	0.01
265	601608	中信重工	66,150	252,031.50	0.00
266	002939	长城证券	31,200	209,040.00	0.00
267	688390	固德威	3,387	190,078.44	0.00

268	600739	辽宁成大	17,200	143,964.00	0.00
269	600339	中油工程	41,600	129,792.00	0.00
270	002531	天顺风能	12,400	110,856.00	0.00
271	600352	浙江龙盛	11,800	101,362.00	0.00
272	603596	伯特利	2,520	98,028.00	0.00
273	000818	航锦科技	4,300	94,944.00	0.00
274	000591	太阳能	19,900	93,729.00	0.00
275	300558	贝达药业	2,000	65,100.00	0.00
276	603826	坤彩科技	2,240	64,892.80	0.00
277	300861	美畅股份	3,080	59,598.00	0.00
278	002607	中公教育	38,900	59,517.00	0.00
279	002195	岩山科技	22,200	55,722.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688328	深科达	1,493,700	21,255,351.00	0.41
2	300225	金力泰	3,869,600	18,999,736.00	0.37
3	688287	观典防务	3,054,200	16,065,092.00	0.31
4	603556	海兴电力	336,500	15,758,295.00	0.31
5	300081	恒信东方	3,364,300	14,870,206.00	0.29
6	688369	致远互联	792,838	12,471,341.74	0.24
7	300871	回盛生物	1,304,100	12,441,114.00	0.24
8	300369	绿盟科技	2,249,100	11,492,901.00	0.22
9	600640	国脉文化	1,054,000	10,908,900.00	0.21
10	601838	成都银行	697,100	10,588,949.00	0.21
11	002463	沪电股份	286,513	10,457,724.50	0.20
12	688229	博睿数据	374,879	9,641,887.88	0.19
13	300854	中兰环保	961,100	9,553,334.00	0.19
14	002318	久立特材	396,400	9,248,012.00	0.18
15	601001	晋控煤业	559,400	9,241,288.00	0.18
16	688590	新致软件	659,000	8,501,100.00	0.17
17	603657	春光科技	711,300	8,101,707.00	0.16
18	002981	朝阳科技	431,380	7,898,567.80	0.15
19	002422	科伦药业	258,613	7,843,732.29	0.15
20	002736	国信证券	874,600	7,600,274.00	0.15
21	688201	信安世纪	623,400	7,362,354.00	0.14
22	688079	美迪凯	914,800	6,787,816.00	0.13
23	003019	宸展光电	264,380	6,696,745.40	0.13
24	300440	运达科技	1,219,700	6,403,425.00	0.13
25	600276	恒瑞医药	162,900	6,265,134.00	0.12
26	300329	海伦钢琴	1,626,400	6,131,528.00	0.12
27	688253	英诺特	152,636	5,816,957.96	0.11
28	300929	华骐环保	734,200	5,374,344.00	0.10

29	600295	鄂尔多斯	489,800	4,858,816.00	0.09
30	000922	佳电股份	403,800	4,817,334.00	0.09
31	301234	五洲医疗	208,487	4,513,743.55	0.09
32	300709	精研科技	176,000	4,449,280.00	0.09
33	688371	菲沃泰	434,200	4,359,368.00	0.09
34	688278	特宝生物	76,453	4,094,058.15	0.08
35	603565	中谷物流	464,800	4,062,352.00	0.08
36	002796	世嘉科技	504,800	4,013,160.00	0.08
37	605333	沪光股份	136,700	3,807,095.00	0.07
38	002123	梦网科技	522,000	3,669,660.00	0.07
39	002908	德生科技	468,000	3,589,560.00	0.07
40	300760	迈瑞医疗	12,200	3,549,102.00	0.07
41	300211	亿通科技	656,800	3,474,472.00	0.07
42	603739	蔚蓝生物	257,500	3,326,900.00	0.06
43	000403	派林生物	122,100	3,255,186.00	0.06
44	601187	厦门银行	608,400	3,242,772.00	0.06
45	688798	艾为电子	54,800	3,102,776.00	0.06
46	301015	百洋医药	130,300	3,065,959.00	0.06
47	002332	仙琚制药	262,600	2,996,266.00	0.06
48	600160	巨化股份	123,150	2,971,609.50	0.06
49	603598	引力传媒	226,500	2,881,080.00	0.06
50	000599	青岛双星	805,700	2,844,121.00	0.06
51	300264	佳创视讯	718,800	2,824,884.00	0.06
52	688095	福昕软件	61,000	2,794,410.00	0.05
53	601127	赛力斯	30,200	2,751,824.00	0.05
54	600007	中国国贸	124,400	2,731,824.00	0.05
55	688062	迈威生物	94,200	2,726,148.00	0.05
56	688519	南亚新材	104,400	2,669,508.00	0.05
57	002030	达安基因	517,800	2,589,000.00	0.05
58	688503	聚和材料	91,800	2,579,580.00	0.05
59	300810	中科海讯	168,100	2,573,611.00	0.05
60	603928	兴业股份	321,620	2,518,284.60	0.05
61	688609	九联科技	283,200	2,497,824.00	0.05
62	601801	皖新传媒	354,942	2,459,748.06	0.05
63	688509	正元地信	831,854	2,404,058.06	0.05
64	688329	艾隆科技	160,800	2,389,488.00	0.05
65	002468	申通快递	277,900	2,334,360.00	0.05
66	688233	神工股份	115,393	2,223,623.11	0.04
67	601211	国泰君安	156,500	2,120,575.00	0.04
68	605218	伟时电子	131,300	2,120,495.00	0.04
69	301032	新柴股份	315,000	2,113,650.00	0.04
70	601318	中国平安	50,400	2,084,544.00	0.04
71	603267	鸿远电子	60,400	2,059,640.00	0.04

72	688383	新益昌	39,000	2,032,290.00	0.04
73	300628	亿联网络	54,800	2,014,996.00	0.04
74	300254	仟源医药	254,200	1,998,012.00	0.04
75	300457	赢合科技	109,600	1,954,168.00	0.04
76	688146	中船特气	65,000	1,940,250.00	0.04
77	300331	苏大维格	118,200	1,900,656.00	0.04
78	688292	浩瀚深度	122,078	1,887,325.88	0.04
79	601336	新华保险	60,400	1,813,812.00	0.04
80	603507	振江股份	54,800	1,798,536.00	0.04
81	688766	普冉股份	18,480	1,795,701.60	0.04
82	301125	腾亚精工	180,740	1,787,518.60	0.03
83	301550	斯菱股份	37,100	1,777,461.00	0.03
84	301067	显盈科技	89,700	1,767,987.00	0.03
85	002905	金逸影视	284,300	1,762,660.00	0.03
86	000553	安道麦 A	385,249	1,749,030.46	0.03
87	688158	优刻得	168,400	1,722,732.00	0.03
88	603993	洛阳钼业	196,800	1,672,800.00	0.03
89	601668	中国建筑	302,200	1,604,682.00	0.03
90	000915	华特达因	52,800	1,592,448.00	0.03
91	300688	创业黑马	62,900	1,559,920.00	0.03
92	603182	嘉华股份	145,000	1,525,400.00	0.03
93	301209	联合化学	69,300	1,517,670.00	0.03
94	301498	乖宝宠物	28,200	1,517,160.00	0.03
95	300155	安居宝	420,900	1,468,941.00	0.03
96	603727	博迈科	109,600	1,442,336.00	0.03
97	603516	淳中科技	45,600	1,439,592.00	0.03
98	300968	格林精密	154,200	1,427,892.00	0.03
99	605296	神农集团	39,500	1,388,425.00	0.03
100	300841	康华生物	27,400	1,387,536.00	0.03
101	300958	建工修复	129,400	1,375,522.00	0.03
102	300386	飞天诚信	124,800	1,299,168.00	0.03
103	301321	翰博高新	103,800	1,194,738.00	0.02
104	605006	山东玻纤	260,100	1,147,041.00	0.02
105	301053	远信工业	56,000	1,117,760.00	0.02
106	001211	双枪科技	71,500	1,089,660.00	0.02
107	002976	瑞玛精密	45,300	1,087,200.00	0.02
108	301419	阿莱德	41,800	1,037,894.00	0.02
109	600819	耀皮玻璃	242,400	1,022,928.00	0.02
110	603186	华正新材	42,500	1,010,650.00	0.02
111	600750	江中药业	42,800	989,108.00	0.02
112	001260	坤泰股份	69,100	962,563.00	0.02
113	600184	光电股份	111,000	944,610.00	0.02
114	301159	三维天地	31,900	850,773.00	0.02

115	002583	海能达	202,600	824,582.00	0.02
116	688246	嘉和美康	40,200	818,472.00	0.02
117	002826	易明医药	101,700	806,481.00	0.02
118	300892	品渥食品	57,400	782,936.00	0.02
119	688662	富信科技	30,800	751,520.00	0.01
120	300658	延江股份	167,100	705,162.00	0.01
121	605118	力鼎光电	44,900	668,561.00	0.01
122	688071	华依科技	30,200	654,434.00	0.01
123	605255	天普股份	53,700	645,474.00	0.01
124	002863	今飞凯达	145,400	591,778.00	0.01
125	603190	亚通精工	24,700	567,112.00	0.01
126	300218	安利股份	37,500	565,500.00	0.01
127	601999	出版传媒	102,400	534,528.00	0.01
128	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.01
129	688480	赛恩斯	18,200	507,052.00	0.01
130	300492	华图山鼎	5,300	499,260.00	0.01
131	300515	三德科技	46,200	455,994.00	0.01
132	688517	金冠电气	29,400	411,012.00	0.01
133	300025	华星创业	38,800	408,176.00	0.01
134	688078	龙软科技	16,400	377,692.00	0.01
135	600161	天坛生物	15,008	366,195.20	0.01
136	300540	蜀道装备	17,500	356,300.00	0.01
137	603070	万控智造	30,700	343,533.00	0.01
138	600746	江苏索普	56,200	331,018.00	0.01
139	688227	品高股份	27,182	329,174.02	0.01
140	600259	广晟有色	11,900	325,346.00	0.01
141	601107	四川成渝	60,500	317,625.00	0.01
142	301235	华康医疗	17,800	308,830.00	0.01
143	688147	微导纳米	12,337	307,191.30	0.01
144	688100	威胜信息	8,000	305,200.00	0.01
145	600664	哈药股份	110,300	291,192.00	0.01
146	600026	中远海能	18,200	284,102.00	0.01
147	688077	大地熊	17,906	283,451.98	0.01
148	300539	横河精密	35,200	283,360.00	0.01
149	002165	红宝丽	85,600	282,480.00	0.01
150	605158	华达新材	42,800	275,204.00	0.01
151	688469	芯联集成	66,000	261,360.00	0.01
152	301197	工大科雅	19,400	254,528.00	0.00
153	002907	华森制药	20,100	253,662.00	0.00
154	300161	华中数控	11,000	247,390.00	0.00
155	301199	迈赫股份	10,200	246,636.00	0.00
156	301283	聚胶股份	8,500	241,145.00	0.00
157	600633	浙数文化	27,200	239,632.00	0.00

158	688053	思科瑞	8,660	213,209.20	0.00
159	688015	交控科技	11,800	212,046.00	0.00
160	002068	黑猫股份	28,700	203,770.00	0.00
161	688709	成都华微	10,448	201,301.51	0.00
162	688112	鼎阳科技	7,372	198,970.28	0.00
163	301035	润丰股份	4,400	195,976.00	0.00
164	603119	浙江荣泰	10,564	187,194.08	0.00
165	002946	新乳业	20,900	183,084.00	0.00
166	603937	丽岛新材	23,200	180,032.00	0.00
167	688510	航亚科技	9,739	179,294.99	0.00
168	603006	黎明股份	18,400	179,032.00	0.00
169	688101	三达膜	15,545	176,902.10	0.00
170	300823	建科智能	14,420	175,203.00	0.00
171	688013	天臣医疗	11,696	173,568.64	0.00
172	603929	亚翔集成	7,100	169,690.00	0.00
173	688310	迈得医疗	12,846	168,796.44	0.00
174	301536	星辰科技	4,809	167,218.27	0.00
175	688578	艾力斯	2,600	165,724.00	0.00
176	002991	甘源食品	2,700	163,755.00	0.00
177	688652	京仪装备	4,157	162,497.13	0.00
178	603258	电魂网络	10,000	161,500.00	0.00
179	688050	爱博医疗	2,129	156,098.28	0.00
180	688092	爱科科技	7,280	155,428.00	0.00
181	301580	爱迪特	2,018	153,513.06	0.00
182	688186	广大特材	15,400	149,842.00	0.00
183	301525	儒竞科技	2,660	149,704.80	0.00
184	688338	赛科希德	6,716	145,401.40	0.00
185	301362	民爆光电	4,191	142,745.46	0.00
186	688322	奥比中光	5,312	141,883.52	0.00
187	688580	伟思医疗	5,118	136,957.68	0.00
188	688108	赛诺医疗	15,200	135,888.00	0.00
189	688591	泰凌微	6,806	133,057.30	0.00
190	688232	新点软件	6,543	129,027.96	0.00
191	300551	古鳌科技	22,900	128,927.00	0.00
192	600223	福瑞达	17,800	125,846.00	0.00
193	605599	菜百股份	9,500	120,935.00	0.00
194	000776	广发证券	9,900	120,483.00	0.00
195	603341	龙旗科技	2,978	115,638.42	0.00
196	688125	安达智能	3,691	115,233.02	0.00
197	001331	胜通能源	8,200	113,570.00	0.00
198	603282	亚光股份	6,700	112,962.00	0.00
199	301516	中远通	6,033	112,394.79	0.00
200	002971	和远气体	4,500	111,510.00	0.00

201	688121	卓然股份	9,221	110,836.42	0.00
202	002948	青岛银行	32,600	109,862.00	0.00
203	603297	永新光学	1,800	108,882.00	0.00
204	301456	盘古智能	4,061	105,951.49	0.00
205	000408	藏格矿业	4,300	103,501.00	0.00
206	688105	诺唯赞	4,916	98,369.16	0.00
207	301566	达利凯普	5,755	97,662.35	0.00
208	002772	众兴菌业	16,300	97,637.00	0.00
209	301222	浙江恒威	3,900	96,564.00	0.00
210	002988	豪美新材	6,100	93,635.00	0.00
211	688610	埃科光电	2,747	92,381.61	0.00
212	688443	智翔金泰	3,033	90,201.42	0.00
213	301587	中瑞股份	3,056	89,267.06	0.00
214	301329	信音电子	4,577	88,473.41	0.00
215	301591	肯特股份	2,184	88,113.42	0.00
216	301413	安培龙	2,123	87,786.05	0.00
217	000428	华天酒店	31,200	86,736.00	0.00
218	003020	立方制药	4,680	85,550.40	0.00
219	688255	凯尔达	4,220	84,611.00	0.00
220	301499	维科精密	3,709	84,305.57	0.00
221	688653	康希通信	6,478	83,436.64	0.00
222	688563	航材股份	1,501	79,372.88	0.00
223	688157	松井股份	2,300	79,120.00	0.00
224	688129	东来技术	5,633	70,356.17	0.00
225	605566	福莱茵特	4,600	70,058.00	0.00
226	000617	中油资本	12,300	67,896.00	0.00
227	688695	中创股份	1,856	63,082.50	0.00
228	301588	美新科技	2,568	59,238.22	0.00
229	688716	中研股份	2,668	56,561.60	0.00
230	000895	双汇发展	2,300	54,671.00	0.00
231	301502	华阳智能	1,375	53,673.83	0.00
232	688323	瑞华泰	5,200	52,364.00	0.00
233	301291	明阳电气	1,206	36,240.30	0.00
234	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
235	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
236	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
237	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
238	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
239	688627	精智达	222	10,305.24	0.00
240	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
241	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
242	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
243	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00

244	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
245	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
246	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
247	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
248	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
249	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	600985	淮北矿业	99,594,087.29	2.03
2	002532	天山铝业	79,888,041.00	1.63
3	000933	神火股份	72,942,154.00	1.49
4	600707	彩虹股份	70,227,837.00	1.43
5	300394	天孚通信	67,936,727.54	1.39
6	601958	金钼股份	66,257,431.36	1.35
7	600968	海油发展	64,532,131.00	1.32
8	002128	电投能源	63,973,518.70	1.31
9	601636	旗滨集团	63,558,437.15	1.30
10	688617	惠泰医疗	60,443,947.12	1.23
11	002408	齐翔腾达	59,362,512.00	1.21
12	300682	朗新集团	58,378,417.35	1.19
13	600873	梅花生物	56,361,471.00	1.15
14	000039	中集集团	55,515,831.10	1.13
15	300502	新易盛	52,615,029.52	1.07
16	688169	石头科技	50,563,926.38	1.03
17	300765	新诺威	50,506,100.72	1.03
18	601058	赛轮轮胎	50,485,428.11	1.03
19	002444	巨星科技	50,185,509.76	1.02
20	000975	银泰黄金	49,864,879.00	1.02

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	600985	淮北矿业	88,286,302.24	1.80
2	600066	宇通客车	87,780,127.19	1.79
3	601958	金钼股份	84,070,752.00	1.72
4	600707	彩虹股份	74,833,168.00	1.53
5	601168	西部矿业	74,131,110.00	1.51
6	600862	中航高科	70,473,528.18	1.44

7	601636	旗滨集团	67,796,419.00	1.38
8	688617	惠泰医疗	64,689,180.36	1.32
9	002532	天山铝业	62,210,034.00	1.27
10	600415	小商品城	60,369,100.53	1.23
11	300394	天孚通信	59,968,182.00	1.22
12	601058	赛轮轮胎	59,854,598.01	1.22
13	600161	天坛生物	57,550,135.95	1.17
14	603228	景旺电子	56,900,142.90	1.16
15	688169	石头科技	56,115,856.52	1.15
16	002028	思源电气	55,478,338.25	1.13
17	600737	中粮糖业	53,851,948.00	1.10
18	002600	领益智造	53,627,798.00	1.09
19	300682	朗新集团	51,268,373.10	1.05
20	000400	许继电气	50,634,751.01	1.03

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	8,367,569,586.71
卖出股票收入（成交）总额	8,213,973,934.98

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	60,460,839.56
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,964,272.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,425,111.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
建信中证 500 指数增强 A	343,389	4,946.88	190,691,717.82	11.23	1,508,012,231.90	88.77
建信中证 500 指数增强 C	24,789	19,302.00	426,713,805.99	89.18	51,763,380.06	10.82
合计	368,178	5,913.39	617,405,523.81	28.36	1,559,775,611.96	71.64

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信中证 500 指数增强 A	352,144.52	0.02
	建信中证 500 指数增强 C	17,031.53	0.00
	合计	369,176.05	0.02

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、	建信中证 500 指数增强 A	0~10

基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信中证 500 指数增强 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	建信中证 500 指数增强 A	-
	建信中证 500 指数增强 C	-
	合计	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2014 年 1 月 27 日) 基金份额总额	308,165,342.91	-
本报告期期初基金份额总额	1,599,228,067.44	431,294,216.53
本报告期基金总申购份额	212,441,907.19	73,798,762.13
减：本报告期基金总赎回份额	112,966,024.91	26,615,792.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,698,703,949.72	478,477,186.05

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未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金财产、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未受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中金财富证券	1	2,218,736,821.71	13.38	2,076,480.29	14.01	-
中信建投	1	2,046,045,489.60	12.34	1,914,877.82	12.92	-
长江证券	3	2,032,002,849.51	12.26	1,922,087.48	12.97	-
国投证券	2	1,728,770,697.61	10.43	1,624,848.66	10.96	-
中信证券	4	1,454,950,424.06	8.78	1,361,658.72	9.19	-
方正证券	3	1,191,731,189.60	7.19	1,127,269.62	7.60	-
国泰君安	1	1,152,351,22	6.95	1,078,472.52	7.28	-

证券		2.31				
兴业证券	2	759,252,154.04	4.58	497,524.15	3.36	-
国盛证券	1	707,189,364.16	4.27	668,936.69	4.51	-
国金证券	2	658,125,723.63	3.97	370,982.42	2.50	-
广发证券	2	593,980,205.22	3.58	561,853.05	3.79	-
银河证券	2	562,572,363.17	3.39	419,626.02	2.83	-
海通证券	1	516,442,657.89	3.11	488,502.78	3.30	-
东北证券	2	496,813,119.23	3.00	365,593.57	2.47	-
中泰证券	2	461,338,433.39	2.78	344,113.94	2.32	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了

提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

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

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

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

(4) 佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内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(%)
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

国金证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
中信华 南	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国新证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-

天风证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增恒丰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	2024 年 1 月 19 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024 年 01 月 01 日-2024 年 01 月 31 日	423,348,018.29	-	-	423,348,018.29	19.44

注：本基金本报告期末不存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；

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

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2024 年 8 月 29 日