

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1. 1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况	12
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§ 7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26

§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	70
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	70
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	70
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	72
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	72
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况	73
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8 其他重大事件	77
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	77
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金		
基金简称	建信中证 1000 指数增强		
基金主代码	006165		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018 年 11 月 22 日		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	651,215,311.89 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E
下属分级基金的交易代码	006165	006166	013442
报告期末下属分级基金的份额总额	449,591,906.77 份	196,748,095.87 份	4,875,309.25 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 1000 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，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。</p> <p>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	本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款税后利率 \times 5%

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、债券型基金、混合型基金。
--------	--

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	上海浦东发展银行股份有限公司
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	95528
传真	010-66228001	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码	100033	200126
法定代表人	生柳荣	张为忠

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年			2023 年			2022 年		
	建信中 证 1000 指数增 强 A	建信中 证 1000 指数增 强 C	建信中 证 1000 指数增 强发起 E	建信中 证 1000 指数增 强 A	建信中 证 1000 指数增 强 C	建信中 证 1000 指数增 强发起 E	建信中 证 1000 指数增 强 A	建信中 证 1000 指数增 强 C	建信中 证 1000 指数增 强发起 E
本期已	41,131	17,825	-8,108	-52,69	-52,38	-17,95	-39,95	-15,67	-742,0

实现收益	, 115. 1 4	, 435. 1 0	, 026. 5 8	6, 623. 85	3, 185. 10	4, 170. 32	6, 736. 54	1, 756. 03	36. 74
本期利润	49, 230 , 993. 1 6	45, 828 , 173. 8 8	-7, 795 , 057. 0 5	-33, 63 6, 679. 00	-70, 42 3, 370. 44	-22, 54 2, 778. 76	-79, 03 7, 699. 89	-31, 70 4, 994. 10	-1, 805 , 510. 5 5
加权平均基金份额本期利润	0. 0834	0. 1202	-0. 232 8	-0. 062 0	-0. 173 4	-0. 237 3	-0. 403 4	-0. 454 5	-0. 422 1
本期加权平均净值利润率	6. 07%	9. 00%	-17. 46 %	-3. 79%	-10. 83 %	-15. 08 %	-21. 50 %	-24. 56 %	-22. 54 %
本期基金份额净值增长率	3. 89%	3. 48%	3. 47%	-1. 89%	-2. 28%	-2. 26%	-12. 74 %	-13. 10 %	-13. 09 %
3. 1. 2 期末数据和指标	2024 年末			2023 年末			2022 年末		
期末可供分配利润	183, 02 9, 819. 28	72, 572 , 818. 7 8	1, 800, 789. 74	159, 00 2, 473. 20	102, 04 8, 488. 35	21, 237 1, 053. 1 9	190, 01 0, 785. 91	55, 326 , 743. 9 2	2, 832, 722. 32
期末可供分配基金份额利润	0. 4071	0. 3689	0. 3694	0. 2778	0. 2488	0. 2493	0. 4127	0. 3848	0. 3852
期末基金资产净值	699, 78 9, 376. 91	298, 52 6, 127. 94	7, 399, 632. 21	857, 37 9, 882. 15	601, 52 3, 326. 03	124, 94 3, 042. 98	720, 30 6, 360. 43	220, 69 1, 381. 97	11, 290 , 417. 3 0
期末基金份额净值	1. 5565	1. 5173	1. 5178	1. 4982	1. 4663	1. 4669	1. 5645	1. 5350	1. 5354
3. 1. 3 累计期末指标	2024 年末			2023 年末			2022 年末		
基金份额累计净值增长率	110. 42 %	105. 38 %	-11. 03 %	102. 54 %	98. 47%	-14. 01 %	106. 44 %	103. 10 %	-12. 02 %

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 1000 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
过去三个月	5.19%	2.25%	4.23%	2.28%	0.96%	-0.03%
过去六个月	20.43%	2.11%	20.68%	2.13%	-0.25%	-0.02%
过去一年	3.89%	2.04%	1.41%	2.01%	2.48%	0.03%
过去三年	-11.06%	1.58%	-24.13%	1.54%	13.07%	0.04%
过去五年	58.01%	1.52%	7.52%	1.49%	50.49%	0.03%
自基金合同生效起至今	110.42%	1.49%	22.85%	1.49%	87.57%	0.00%

建信中证 1000 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
过去三个月	5.08%	2.25%	4.23%	2.28%	0.85%	-0.03%
过去六个月	20.18%	2.11%	20.68%	2.13%	-0.50%	-0.02%
过去一年	3.48%	2.04%	1.41%	2.01%	2.07%	0.03%
过去三年	-12.12%	1.58%	-24.13%	1.54%	12.01%	0.04%
过去五年	54.88%	1.52%	7.52%	1.49%	47.36%	0.03%
自基金合同生效起至今	105.38%	1.49%	22.85%	1.49%	82.53%	0.00%

建信中证 1000 指数增强发起 E

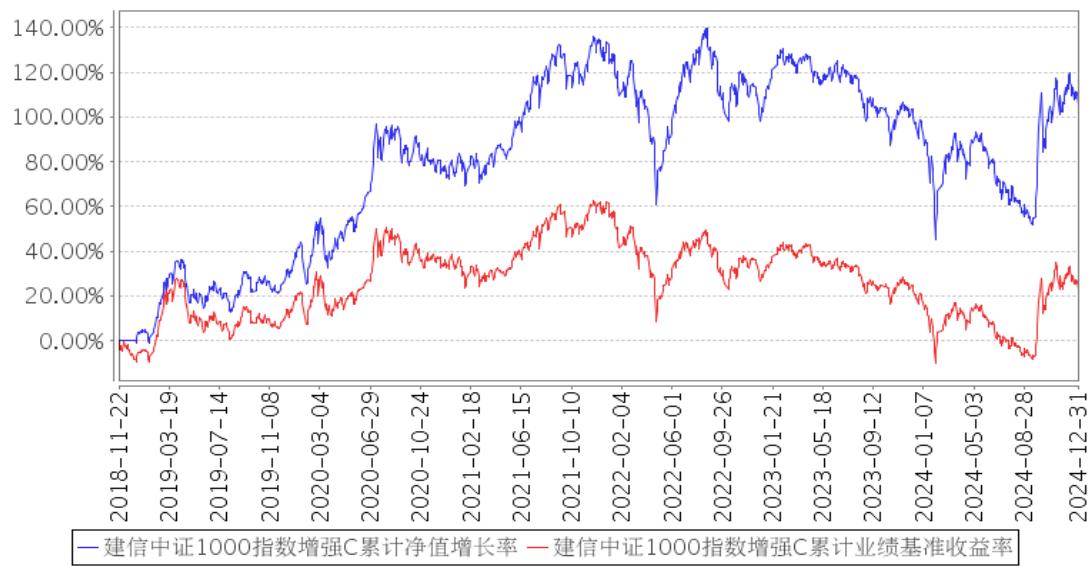
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.08%	2.25%	4.23%	2.28%	0.85%	-0.03%
过去六个月	20.17%	2.11%	20.68%	2.13%	-0.51%	-0.02%
过去一年	3.47%	2.04%	1.41%	2.01%	2.06%	0.03%
过去三年	-12.11%	1.58%	-24.13%	1.54%	12.02%	0.04%
自基金合同生效起至今	-11.03%	1.54%	-22.90%	1.51%	11.87%	0.03%

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

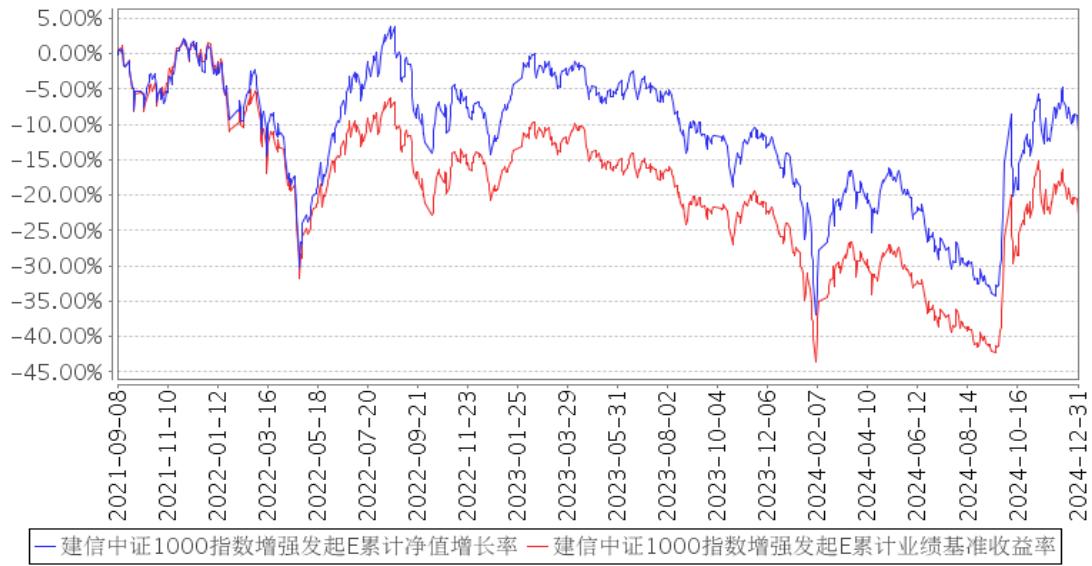
建信中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



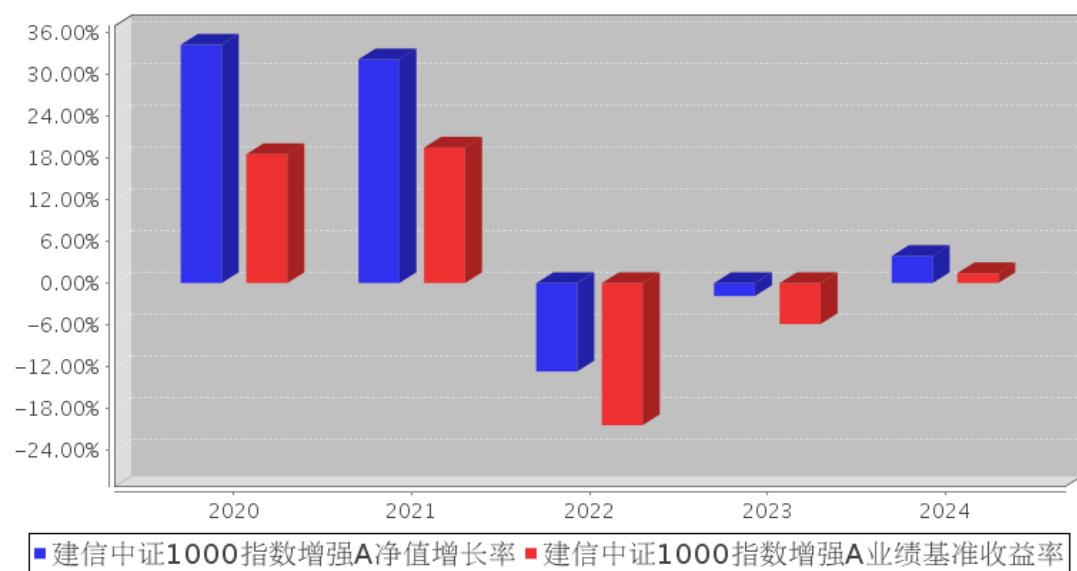
建信中证1000指数增强发起E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



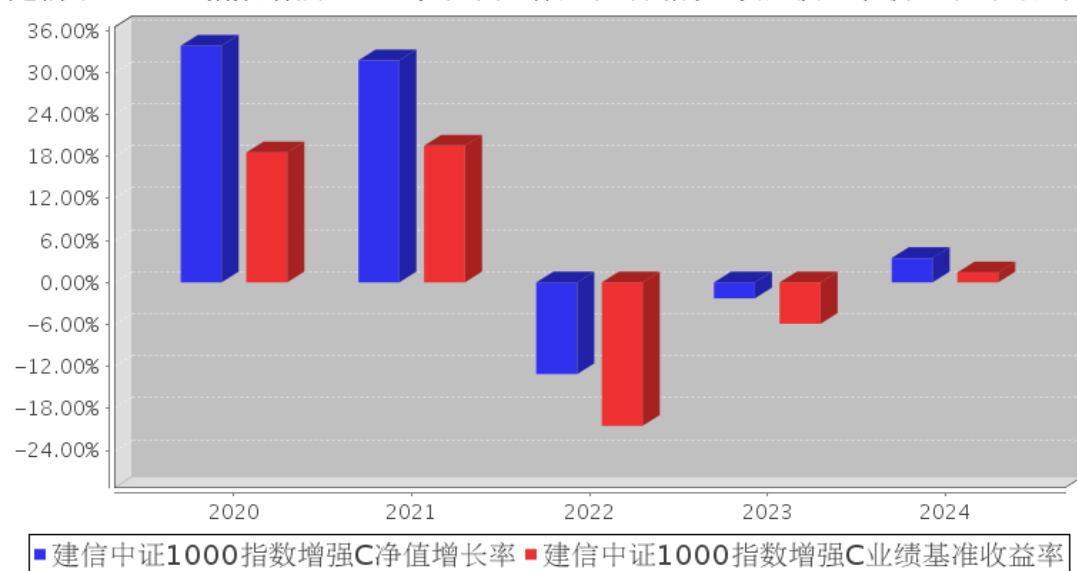
注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

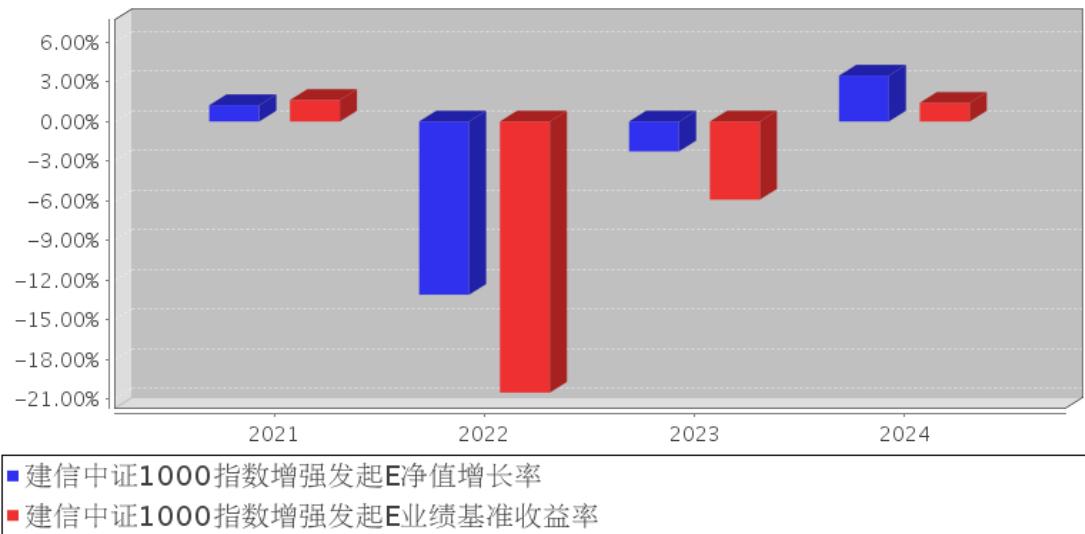
建信中证1000指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



建信中证1000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



建信中证1000指数增强发起E基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

建信中证 1000 指数增强 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	0.3700	10,543,873.96	10,526,525.04	21,070,399.00	-
2022 年	2.9000	58,962,910.65	51,146,145.35	110,109,056.00	-
合计	3.2700	69,506,784.61	61,672,670.39	131,179,455.00	-

建信中证 1000 指数增强 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	0.3400	13,351,365.39	2,333,598.04	15,684,963.43	-
2022 年	2.9000	24,934,492.56	13,164,323.55	38,098,816.11	-
合计	3.2400	38,285,857.95	15,497,921.59	53,783,779.54	-

建信中证 1000 指数增强发起 E

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注

2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	0.3400	2,802,213.20	2,442,680.85	5,244,894.05	-
2022 年	2.9000	1,452,295.01	610,447.84	2,062,742.85	-
合计	3.2400	4,254,508.21	3,053,128.69	7,307,636.90	-

§ 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12月31日，公司管理运作167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1.22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	2018年11月22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。
赵云煜	数量投资部总经理助理，本基金的基金经理	2018 年 11 月 22 日	-	12	赵云煜先生，数量投资部总经理助理，硕士。曾任太平资产管理有限公司风险管理分析师。2014 年 7 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部研究员、基金经理助理、基金经理、总经理助理等职务。2016 年 6 月 22 日至 2018 年 11 月 7 日任专户投资经理。2018 年 11 月 16 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 9 月 11 日起任建信中证红利潜力指数证券投资基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日起任建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
赵云煜	公募基金	3	1,178,021,341.99	2018 年 11 月 16 日
	私募资产管理计划	5	300,046,800.87	2016 年 6 月 22 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	1,478,068,142.86	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

兼任基金经理所管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩不直接与兼任基金经理薪酬激励挂钩，公司会根据实际情况对兼任基金经理的公募产品及所管理的私募资产管理计划进行考核，并依据考核结果对薪酬激励进行评定和调整。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

该基金经理在兼任私募资产管理计划投资经理并管理多个组合期间，严格遵守相应的制度和流程。公司通过系统和人工等方式在各个环节严格控制公平交易执行，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，不存在兼任行为潜在利益冲突而未执行公平交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

报告期内，九月底前产品基准指数中证 1000 明显下行，虽中间有反弹，但整体趋势较弱。九月底之后，指数快速上行并延续高位偏多头震荡，最终全年整体收平。本基金稳健开展投资运作，并成功跑赢了基准指数。

本基金为指数增强基金，主要目标是在跟踪基准指数的基础上超越指数的收益。本基金采用量化多因子模型进行选股和组合管理。具体来说，个股选择方面，产品主要通过多因子模型，从基本面、技术面等不同维度提供筛选股票的依据；相对偏离方面，产品亦采用量化风险模型对市场的风险特征进行建模，从而通过保持组合整体的风格、行业配置与基准指数接近，以管理产品的跟踪误差。此外，本基金也积极参与新股申购力争进一步增厚产品收益。

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 3.89%，波动率 2.04%，业绩比较基准收益率 1.41%，波动率 2.01%。本报告期本基金 C 净值增长率 3.48%，波动率 2.04%，业绩比较基准收益率 1.41%，波动率 2.01%。本报告期本基金 E 净值增长率 3.47%，波动率 2.04%，业绩比较基准收益率 1.41%，波动率 2.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年全年，A 股市场呈现出“W 型”的走势，全年经历了两次较为明显的探底回升，主要由政策密集发力和估值扩张驱动。从基本面情况看，经济处于持续修复的状态。市场年初因内外部风险因素快速下跌后反弹，其中小微盘资产的波动相对较大；后市场继续调整，而在九月后一系列利好政策（如降准降息、地产松绑等）叠加美联储降息落地，推动市场强势回升，最终 A 股整体收涨。风格方面，大盘价值显著优于小盘成长，银行、保险等高股息资产表现突出，而科技

成长在政策宽松和 AI 产业周期带动下后来居上。

展望后市，我们认为 A 股市场长期的表现值得期待。随着政策效果的逐步显现和市场信心的恢复，预计 2025 年的经济将展现出较为乐观的迹象，企业盈利也有望温和增长，特别是在科技制造、消费和服务等行业。在当前环境下，A 股的流动性情况将保持相对稳定，为市场提供支撑。投资端也仍需注意全球市场贸易状况及金融环境带来的风险。本基金将密切跟踪市场动态，持续提升模型的效果，精选个股，谨慎管理组合风险，力争为投资者提供稳健超越业绩基准的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司风险与合规管理部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总裁和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

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

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

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

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

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

改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、风险与合规管理部、投资风险管理部和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部负责人、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、风险管理工作的，熟悉业内法律法规的专家型人员。

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由建信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明 (2025) 审字第 70071792_A79 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年度财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年度的财务状况、经营成果和现金流量。</p>

	基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉</p>

	<p>及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	田志勇 马剑英
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2025 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	138,325,882.18	198,255,158.06
结算备付金		6,188,990.49	13,010,496.91
存出保证金		10,205,913.60	13,930,564.37
交易性金融资产	7.4.7.2	848,853,964.49	1,370,405,776.29
其中：股票投资		848,853,964.49	1,370,405,776.29
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	7. 4. 7. 3	-	-
买入返售金融资产	7. 4. 7. 4	-	-
债权投资	7. 4. 7. 5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7. 4. 7. 6	-	-
其他权益工具投资	7. 4. 7. 7	-	-
应收清算款		-	30,716,870.20
应收股利		-	-
应收申购款		8,593,360.76	1,478,281.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	7. 4. 7. 8	-	-
资产总计		1,012,168,111.52	1,627,797,146.95
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 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	7. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	13,124,978.79
应付赎回款		5,067,747.50	22,932,531.84
应付管理人报酬		866,357.17	1,400,844.04
应付托管费		173,271.42	280,168.81
应付销售服务费		103,399.26	272,481.57
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	7. 4. 7. 9	242,199.11	5,939,890.74
负债合计		6,452,974.46	43,950,895.79
净资产：			
实收基金	7. 4. 7. 10	651,215,311.89	1,067,682,305.87
其他综合收益	7. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	7. 4. 7. 12	354,499,825.17	516,163,945.29
净资产合计		1,005,715,137.06	1,583,846,251.16
负债和净资产总计		1,012,168,111.52	1,627,797,146.95

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 651,215,311.89 份，其中建信中证 1000 指数

增强 A 基金份额总额 449,591,906.77 份，基金份额净值人民币 1.5565 元；建信中证 1000 指数增

强 C 基金份额总额 196,748,095.87 份, 基金份额净值人民币 1.5173 元; 建信中证 1000 指数增强发起 E 基金份额总额 4,875,309.25 份, 基金份额净值人民币 1.5178 元。

7.2 利润表

会计主体: 建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		106,359,183.53	-102,812,065.66
1. 利息收入		867,925.95	1,001,913.73
其中: 存款利息收入	7.4.7.13	867,925.95	1,001,913.73
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)		67,235,710.90	-101,102,872.89
其中: 股票投资收益	7.4.7.14	39,238,354.82	-110,389,690.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	11,740,537.18	-6,968,737.42
股利收益	7.4.7.19	16,256,818.90	16,255,555.49
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损 失以“-”号填列)	7.4.7.20	36,415,586.33	-3,568,848.93
4. 汇兑收益 (损失以“-” 号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-” 号填列)	7.4.7.21	1,839,960.35	857,742.43
减: 二、营业总支出		19,095,073.54	23,790,762.54
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	13,674,762.75	16,794,939.10
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,734,952.58	3,358,987.77

3. 销售服务费		2,226,467.45	3,167,089.01
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		47,366.81	7,686.39
8. 其他费用	7.4.7.23	411,523.95	462,060.27
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		87,264,109.99	-126,602,828.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		87,264,109.99	-126,602,828.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		87,264,109.99	-126,602,828.20

7.3 净资产变动表

会计主体：建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,067,682,305.87	-	516,163,945.29	1,583,846,251.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,067,682,305.87	-	516,163,945.29	1,583,846,251.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-416,466,993.98	-	-161,664,120.12	-578,131,114.10
(一)、综合收益总额	-	-	87,264,109.99	87,264,109.99
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-416,466,993.98	-	-248,928,230.11	-665,395,224.09

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	938,430,305.76	-	381,584,867.88	1,320,015,173.64
2. 基金赎回款	-1,354,897,299.74	-	-630,513,097.99	-1,985,410,397.73
(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	651,215,311.89	-	354,499,825.17	1,005,715,137.06
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	611,543,514.51	-	340,744,645.19	952,288,159.70
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	611,543,514.51	-	340,744,645.19	952,288,159.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	456,138,791.36	-	175,419,300.10	631,558,091.46
(一)、综合收益总额	-	-	-126,602,828.20	-126,602,828.20
(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)	456,138,791.36	-	344,022,384.78	800,161,176.14

其中：1. 基金申购款	1, 551, 032, 483. 85	-	1, 026, 889, 937. 37	2, 577, 922, 421. 2 2
2. 基金赎回款	-1, 094, 893, 692. . 49	-	-682, 867, 552. 5 9	-1, 777, 761, 245. 08
(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）	-	-	-42, 000, 256. 48	-42, 000, 256. 48
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1, 067, 682, 305. 87	-	516, 163, 945. 29	1, 583, 846, 251. 1 6

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

谢海玉

莫红

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（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[2018]1029 号《关于准予建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》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 1000 指数增强型发起式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 99, 635, 875. 53 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（2018）第 0686 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 99, 645, 967. 84 份基金份额，其中认购资金利息折合 10, 092. 31 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/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；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。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。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2021 年 9 月 6 日起本基金新增 E 类基金份额，从本类别基金资产中计提销售服务费，且在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用。根据更新的《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金份额包括建信中证 1000 指数增强基金之 A 类份额、建信中证 1000 指数增强基金之 C 类份额和建信中证 1000 指数增强基金之 E 类份额。本基金各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 1000 指数增强型发起式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（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、货币市场工具（含同业存单）、银行存款、债券回购、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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80% 投资于中证 1000 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；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）占基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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。本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款税后利率 \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体

会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期

损益；

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

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

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

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

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

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

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

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

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

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信

息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

- (3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；
- (4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；
- (5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；
- (6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

7.4.6.2 增值税

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

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

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

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

人为增值税纳税人；

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

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

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

7.4.6.3 企业所得税

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

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

7.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差

别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自 2013 年 1 月 1 日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税;

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	79,419,893.16	198,255,158.06
等于: 本金	79,410,614.43	198,232,869.20
加: 应计利息	9,278.73	22,288.86
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	58,905,989.02	—
等于: 本金	58,901,675.55	—
加: 应计利息	4,313.47	—
减: 坏账准备	—	—
合计	138,325,882.18	198,255,158.06

注: 其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	870,740,011.54	—	848,853,964.49	-21,886,047.05
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		870,740,011.54	-	848,853,964.49	-21,886,047.05
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,430,504,929.67	-	1,370,405,776.29	-60,099,153.38
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		1,430,504,929.67	-	1,370,405,776.29	-60,099,153.38

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	89,144,400.00	-	-	-
其中：股指期货投资	89,144,400.00	-	-	-
其他衍	-	-	-	-

生工具				
合计	89,144,400.00	-	-	-
上年度末 2023 年 12 月 31 日				
项目	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍 生工具	-	-	-	
货币衍 生工具	-	-	-	
权益衍 生工具	114,949,760.00	-	-	
其中：股 指期货 投资	114,949,760.00	-	-	
其他衍 生工具	-	-	-	
合计	114,949,760.00	-	-	

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。

7.4.7.3.2 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
IM2501	IM2501	24.00	28,587,840.00	-1,154,800.00
IM2503	IM2503	48.00	56,461,440.00	-2,940,320.00
合计				-4,095,120.00
减：可抵销期货 暂收款				-4,095,120.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资**7.4.7.5.1 债权投资情况**

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资**7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资**7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	7,138.35	1,838.86
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	—	5,688,084.25
其中：交易所市场	—	5,688,084.25
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
应付指数使用费	52,060.76	69,967.63
预提费用	183,000.00	180,000.00
合计	242,199.11	5,939,890.74

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 1000 指数增强 A

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	账面金额
上年度末	572, 284, 641. 61	572, 284, 641. 61
本期申购	535, 549, 128. 79	535, 549, 128. 79
本期赎回 (以“-”号填列)	-658, 241, 863. 63	-658, 241, 863. 63
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	449, 591, 906. 77	449, 591, 906. 77

建信中证 1000 指数增强 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	账面金额
上年度末	410, 222, 204. 30	410, 222, 204. 30
本期申购	373, 601, 051. 13	373, 601, 051. 13
本期赎回 (以“-”号填列)	-587, 075, 159. 56	-587, 075, 159. 56
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	196, 748, 095. 87	196, 748, 095. 87

建信中证 1000 指数增强发起 E

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	账面金额
上年度末	85, 175, 459. 96	85, 175, 459. 96
本期申购	29, 280, 125. 84	29, 280, 125. 84
本期赎回 (以“-”号填列)	-109, 580, 276. 55	-109, 580, 276. 55
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	4, 875, 309. 25	4, 875, 309. 25

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

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

建信中证 1000 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	159,002,473.20	126,092,767.34	285,095,240.54
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	159,002,473.20	126,092,767.34	285,095,240.54
本期利润	41,131,115.14	8,099,878.02	49,230,993.16
本期基金份额交易产生的变动数	-17,103,769.06	-67,024,994.50	-84,128,763.56
其中：基金申购款	82,500,164.39	150,855,290.64	233,355,455.03
基金赎回款	-99,603,933.45	-217,880,285.14	-317,484,218.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	183,029,819.28	67,167,650.86	250,197,470.14

建信中证 1000 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	102,048,488.35	89,252,633.38	191,301,121.73
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	102,048,488.35	89,252,633.38	191,301,121.73
本期利润	17,825,435.10	28,002,738.78	45,828,173.88
本期基金份额交易产生的变动数	-47,301,104.67	-88,050,158.87	-135,351,263.54
其中：基金申购款	51,142,459.00	87,452,055.39	138,594,514.39
基金赎回款	-98,443,563.67	-175,502,214.26	-273,945,777.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,572,818.78	29,205,213.29	101,778,032.07

建信中证 1000 指数增强发起 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,237,053.19	18,530,529.83	39,767,583.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	21,237,053.19	18,530,529.83	39,767,583.02
本期利润	-8,108,026.58	312,969.53	-7,795,057.05
本期基金份额交易产生的变动数	-11,328,236.87	-18,119,966.14	-29,448,203.01
其中：基金申购款	2,964,213.38	6,670,685.08	9,634,898.46
基金赎回款	-14,292,450.25	-24,790,651.22	-39,083,101.47
本期已分配利润	-	-	-

本期末	1,800,789.74	723,533.22	2,524,322.96
-----	--------------	------------	--------------

7.4.7.13 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12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	350,384.69	732,362.75
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	262,228.15	—
结算备付金利息收入	254,598.20	254,339.13
其他	714.91	15,211.85
合计	867,925.95	1,001,913.73

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	39,238,354.82	-110,389,690.96
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	39,238,354.82	-110,389,690.96

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
卖出股票成交总额	8,610,597,801.58	9,720,419,389.11
减：卖出股票成本总额	8,558,715,664.87	9,806,884,564.16
减：交易费用	12,643,781.89	23,924,515.91
买卖股票差价收	39,238,354.82	-110,389,690.96

入		
---	--	--

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	11,740,537.18	-6,968,737.42

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	16,256,818.90	16,255,555.49
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	16,256,818.90	16,255,555.49

7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	38,213,106.33	-3,634,528.93
股票投资	38,213,106.33	-3,634,528.93
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	-1,797,520.00	65,680.00
权证投资	-	-
期货投资	-1,797,520.00	65,680.00
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	36,415,586.33	-3,568,848.93

7.4.7.21 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,823,392.26	851,504.05
基金转换费收入	16,568.09	6,238.38
合计	1,839,960.35	857,742.43

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	63,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	—	—
银行划款手续费	8,927.70	13,341.22
指数使用费	218,796.25	268,719.05
其他	800.00	—
合计	411,523.95	462,060.27

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国华电集团产融控股有限公司	基金管理人的股东
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
建信资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注: 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,674,762.75	16,794,939.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,147,396.20	4,516,905.48
应支付基金管理人的净管理费	9,527,366.55	12,278,033.62

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

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,734,952.58	3,358,987.77

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：日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E	合计
建信基金	-	7,403.93	5,518.92	12,922.85
上海浦东发展银行	-	10,100.04	-	10,100.04
中国建设银行	-	71,304.25	-	71,304.25
合计	-	88,808.22	5,518.92	94,327.14
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 12 月 31 日			
	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E	合计
建信基金	-	213,454.85	182,260.60	395,715.45
上海浦东发展银行	-	11,837.87	-	11,837.87
中国建设银行	-	60,439.52	-	60,439.52
合计	-	285,732.24	182,260.60	467,992.84

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

日销售服务费=前一日基金资产净值×约定年费率/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数 增强 C	建信中证 1000 指数 增强发起 E
报告期初持有的基金 份额	329,280.17	-	-
报告期内申购/买入 总份额	-	-	-
报告期内因拆分变动 份额	-	-	-
减：报告期内赎回/卖 出总份额	329,280.17	-	-
报告期末持有的基金 份额	-	-	-
报告期末持有的基金 份额 占基金总份额比例	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数 增强 C	建信中证 1000 指数 增强发起 E
报告期初持有的基金 份额	13,173,876.83	-	-
报告期内申购/买入 总份额	329,280.17	-	-
报告期内因拆分变动 份额	-	-	-
减：报告期内赎回/卖 出总份额	13,173,876.83	-	-
报告期末持有的基金 份额	329,280.17	-	-
报告期末持有的基金 份额 占基金总份额比例	0.06%	-	-

注：分级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。

期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行-活期	79,419,893.16	350,384.69	198,255,158.06	732,362.75

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 股))	期末成本总额	期末估值总额	备注
301552	科力装备	2024年7月15日	6个月	新发未上市	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301571	国科天成	2024年8月14日	6个月	新发未上市	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024年12月10日	6个月	新发未上市	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024年8月21日	6个月	新发未上市	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔	2024	6个月	新发	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-

	锋智能	年 7 月 3 日		未上市						
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新发未上市	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301607	富特科技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	新发未上市	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新发未上市	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂玛科技	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新发未上市	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301617	博苑股份	2024 年 12 月 3 日	6 个月	新发未上市	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	6 个月	新发未上市	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301626	苏州天脉	2024 年 10 月 17 日	6 个月	新发未上市	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1 个月内(含)	新发未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新发未上市	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603194	中力股份	2024 年 12 月 17 日	6 个月	新发未上市	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
603205	健尔	2024 年 10	6 个月	新发未上	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-

	康	月 29 日		市						
603207	小方制药	2024 年 8 月 19 日	6 个月	新发未上市	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新发未上市	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新发未上市	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新发未上市	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新发未上市	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新发未上市	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新发未上市	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新发未上市	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新发未上市	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新发未上市	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，

则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管

理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	138,325,882.18	-	-	-	138,325,882.18
结算备付金	6,188,990.49	-	-	-	6,188,990.49
存出保证金	10,205,913.60	-	-	-	10,205,913.60
交易性金融资产	-	-	-	848,853,964.49	848,853,964.49
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	-	-	-	8,593,360.76	8,593,360.76
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	154,720,786.27	-	-	857,447,325.25	1,012,168,111.52
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	-	-	-	5,067,747.50	5,067,747.50
应付管理人报酬	-	-	-	866,357.17	866,357.17
应付托管费	-	-	-	173,271.42	173,271.42

应付销售服务费	-	-	-	103,399.26	103,399.26
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	242,199.11	242,199.11
负债总计	-	-	-	6,452,974.46	6,452,974.46
利率敏感度缺口	154,720,786.27	-	-	850,994,350.79	1,005,715,137.06
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	198,255,158.06	-	-	-	198,255,158.06
结算备付金	13,010,496.91	-	-	-	13,010,496.91
存出保证金	13,930,564.37	-	-	-	13,930,564.37
交易性金融资产	-	-	-	1,370,405,776.29	1,370,405,776.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	30,716,870.20	30,716,870.20
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,478,281.12	1,478,281.12
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	225,196,219.34	-	-	1,402,600,927.61	1,627,797,146.95
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	-	-	-	13,124,978.79	13,124,978.79
应付赎回款	-	-	-	22,932,531.84	22,932,531.84
应付管理人报酬	-	-	-	1,400,844.04	1,400,844.04
应付托管费	-	-	-	280,168.81	280,168.81
应付销售服务费	-	-	-	272,481.57	272,481.57
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,939,890.74	5,939,890.74
负债总计	-	-	-	43,950,895.79	43,950,895.79
利率敏感度缺口	225,196,219.34	-	-	1,358,650,031.82	1,583,846,251.16

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大

影响（上年末：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	848,853,964.49	84.40	1,370,405,776.29	86.52
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	848,853,964.49	84.40	1,370,405,776.29	86.52

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）

	业绩比较基准上升 5%	50,038,179.06	79,615,395.09
	业绩比较基准下降 5%	-50,038,179.06	-79,615,395.09

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	848,451,367.96	1,368,305,062.33
第二层次	27,736.50	898,742.02
第三层次	374,860.03	1,201,971.94
合计	848,853,964.49	1,370,405,776.29

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨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的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,201,971.94	1,201,971.94
当期购买	-	151,018.30	151,018.30
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,201,971.94	1,201,971.94
当期利得或损失总额	-	223,841.73	223,841.73
其中：计入损益的利得或损失	-	223,841.73	223,841.73
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	374,860.03	374,860.03
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	223,841.73	223,841.73
项目	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	债券投资	股票投资	合计
期初余额	-	2,481,172.33	2,481,172.33
当期购买	-	1,103,415.44	1,103,415.44
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,481,172.33	2,481,172.33
当期利得或损失总额	-	98,556.50	98,556.50
其中：计入损益的利得或损失	-	98,556.50	98,556.50
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,201,971.94	1,201,971.94
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	98,556.50	98,556.50

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期股票投资	374,860.03	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.2665–4.9648	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期股票投资	1,201,971.94	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.1462–2.1988	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

本财务报表已于 2025 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	848,853,964.49	83.86
	其中：股票	848,853,964.49	83.86
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	144,514,872.67	14.28
8	其他各项资产	18,799,274.36	1.86
9	合计	1,012,168,111.52	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	1,321,290.00	0.13
B	采矿业	15,284,946.00	1.52
C	制造业	466,873,918.26	46.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,448,885.00	1.54
E	建筑业	14,484,071.00	1.44
F	批发和零售业	18,660,089.00	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	17,485,867.00	1.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	82,668,153.80	8.22
J	金融业	17,207,386.00	1.71
K	房地产业	3,286,133.00	0.33
L	租赁和商务服务业	15,514,846.50	1.54
M	科学研究和技术服务业	17,605,604.00	1.75
N	水利、环境和公共设施管理业	2,345,825.00	0.23
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	9,981,556.32	0.99
S	综合	-	-
	合计	698,168,570.88	69.42

8.2.2 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	4,258,628.00	0.42
B	采矿业	3,745,202.00	0.37
C	制造业	103,259,050.53	10.27

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	1, 583, 301.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14, 884, 588.52	1.48
J	金融业	8, 881, 258.00	0.88
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	6, 630, 278.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	11, 148.56	0.00
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	1, 449, 888.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	5, 982, 051.00	0.59
S	综合	—	—
	合计	150, 685, 393.61	14.98

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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	002204	大连重工	3, 049, 600	15, 187, 008.00	1.51
2	688315	诺禾致源	1, 002, 600	12, 532, 500.00	1.25
3	002991	甘源食品	107, 300	10, 034, 696.00	1.00
4	688007	光峰科技	662, 000	9, 790, 980.00	0.97
5	600267	海正药业	1, 178, 300	9, 779, 890.00	0.97
6	688586	江航装备	974, 600	9, 326, 922.00	0.93
7	600216	浙江医药	576, 000	9, 135, 360.00	0.91
8	001301	尚太科技	133, 000	9, 117, 150.00	0.91
9	688432	有研硅	803, 400	9, 078, 420.00	0.90

10	002701	奥瑞金	1,559,000	8,839,530.00	0.88
11	688100	威胜信息	229,771	8,317,710.20	0.83
12	002020	京新药业	647,600	8,289,280.00	0.82
13	600718	东软集团	744,600	8,019,342.00	0.80
14	600562	国睿科技	394,200	7,856,406.00	0.78
15	603093	南华期货	627,200	7,463,680.00	0.74
16	300455	航天智装	561,200	7,273,152.00	0.72
17	300772	运达股份	542,300	7,180,052.00	0.71
18	600662	外服控股	1,410,700	7,152,249.00	0.71
19	600248	陕建股份	1,551,700	6,951,616.00	0.69
20	002456	欧菲光	567,700	6,801,046.00	0.68
21	300685	艾德生物	292,500	6,669,000.00	0.66
22	600640	国脉文化	540,400	6,452,376.00	0.64
23	300525	博思软件	409,100	6,373,778.00	0.63
24	301078	孩子王	549,700	6,255,586.00	0.62
25	300257	开山股份	676,400	6,168,768.00	0.61
26	600120	浙江东方	1,317,200	6,138,152.00	0.61
27	603699	纽威股份	275,500	6,107,835.00	0.61
28	002626	金达威	399,000	6,024,900.00	0.60
29	002108	沧州明珠	1,631,700	5,857,803.00	0.58
30	002176	江特电机	747,000	5,535,270.00	0.55
31	300623	捷捷微电	160,700	5,489,512.00	0.55
32	000498	山东路桥	922,300	5,487,685.00	0.55
33	601777	千里科技	717,300	5,487,345.00	0.55
34	601369	陕鼓动力	618,600	5,381,820.00	0.54
35	601222	林洋能源	692,500	4,895,975.00	0.49
36	600269	赣粤高速	871,300	4,887,993.00	0.49
37	000415	渤海租赁	1,272,600	4,797,702.00	0.48
38	301050	雷电微力	92,800	4,786,624.00	0.48
39	300679	电连技术	79,800	4,764,060.00	0.47
40	002378	章源钨业	726,900	4,703,043.00	0.47
41	002978	安宁股份	165,100	4,692,142.00	0.47
42	600428	中远海特	630,800	4,604,840.00	0.46
43	300346	南大光电	118,600	4,576,774.00	0.46
44	301035	润丰股份	92,500	4,506,600.00	0.45
45	300598	诚迈科技	92,600	4,481,840.00	0.45
46	301180	万祥科技	285,500	4,416,685.00	0.44
47	002668	TCL 智家	328,400	4,308,608.00	0.43
48	688232	新点软件	147,800	4,284,722.00	0.43
49	300618	寒锐钴业	122,200	4,126,694.00	0.41
50	600812	华北制药	796,500	4,117,905.00	0.41
51	000422	湖北宜化	325,700	4,110,334.00	0.41
52	688582	芯动联科	79,200	3,984,552.00	0.40

53	688612	威迈斯	168,600	3,968,844.00	0.39
54	603218	日月股份	329,100	3,965,655.00	0.39
55	600961	株冶集团	502,900	3,957,823.00	0.39
56	301015	百洋医药	161,200	3,902,652.00	0.39
57	002911	佛燃能源	307,400	3,885,536.00	0.39
58	603920	世运电路	131,100	3,854,340.00	0.38
59	688336	三生国健	176,600	3,782,772.00	0.38
60	002130	沃尔核材	146,200	3,691,550.00	0.37
61	600100	同方股份	510,800	3,631,788.00	0.36
62	600169	太原重工	1,458,000	3,630,420.00	0.36
63	000686	东北证券	454,100	3,605,554.00	0.36
64	300181	佐力药业	234,400	3,600,384.00	0.36
65	002125	湘潭电化	352,200	3,550,176.00	0.35
66	688690	纳微科技	197,800	3,481,280.00	0.35
67	301031	中熔电气	33,400	3,474,268.00	0.35
68	300409	道氏技术	252,900	3,441,969.00	0.34
69	688208	道通科技	87,777	3,437,347.32	0.34
70	300443	金雷股份	169,100	3,368,472.00	0.33
71	300079	数码视讯	619,700	3,352,577.00	0.33
72	300770	新媒股份	82,500	3,333,825.00	0.33
73	002416	爱施德	203,800	3,315,826.00	0.33
74	300726	宏达电子	106,400	3,309,040.00	0.33
75	688568	中科星图	64,400	3,286,332.00	0.33
76	300861	美畅股份	161,200	3,215,940.00	0.32
77	600996	贵广网络	371,400	3,175,470.00	0.32
78	688027	国盾量子	10,600	3,162,616.00	0.31
79	300627	华测导航	75,564	3,158,575.20	0.31
80	688183	生益电子	80,429	3,157,642.54	0.31
81	300083	创世纪	485,000	3,157,350.00	0.31
82	600422	昆药集团	193,500	3,066,975.00	0.30
83	600602	云赛智联	192,500	3,045,350.00	0.30
84	600550	保变电气	387,800	3,044,230.00	0.30
85	600163	中闽能源	493,100	3,002,979.00	0.30
86	300180	华峰超纤	469,500	2,957,850.00	0.29
87	300080	易成新能	676,200	2,954,994.00	0.29
88	603530	神马电力	116,800	2,886,128.00	0.29
89	600780	通宝能源	505,600	2,846,528.00	0.28
90	300762	上海瀚讯	135,300	2,845,359.00	0.28
91	002139	拓邦股份	206,200	2,806,382.00	0.28
92	000719	中原传媒	245,800	2,792,288.00	0.28
93	000727	冠捷科技	990,600	2,753,868.00	0.27
94	300779	惠城环保	28,000	2,732,800.00	0.27
95	600894	广日股份	185,500	2,708,300.00	0.27

96	002312	川发龙蟒	186,000	2,691,420.00	0.27
97	002145	中核钛白	634,000	2,688,160.00	0.27
98	000690	宝新能源	591,500	2,649,920.00	0.26
99	600446	金证股份	152,400	2,627,376.00	0.26
100	300527	中船应急	325,000	2,622,750.00	0.26
101	688107	安路科技	88,000	2,603,040.00	0.26
102	002583	海能达	181,500	2,579,115.00	0.26
103	603713	密尔克卫	49,100	2,513,920.00	0.25
104	300049	福瑞股份	78,600	2,479,044.00	0.25
105	002023	海特高新	241,100	2,447,165.00	0.24
106	601096	宏盛华源	557,000	2,422,950.00	0.24
107	300768	迪普科技	138,000	2,415,000.00	0.24
108	688131	皓元医药	66,400	2,370,480.00	0.24
109	300068	南都电源	146,100	2,358,054.00	0.23
110	300035	中科电气	154,300	2,306,785.00	0.23
111	300088	长信科技	351,800	2,300,772.00	0.23
112	301367	怡和嘉业	36,500	2,299,500.00	0.23
113	300821	东岳硅材	293,000	2,273,680.00	0.23
114	688383	新益昌	50,200	2,252,474.00	0.22
115	688608	恒玄科技	6,800	2,212,516.00	0.22
116	002174	游族网络	234,600	2,193,510.00	0.22
117	300666	江丰电子	31,100	2,159,895.00	0.21
118	688206	概伦电子	112,000	2,117,920.00	0.21
119	300134	大富科技	179,600	2,106,708.00	0.21
120	300757	罗博特科	9,300	2,095,476.00	0.21
121	603039	泛微网络	42,100	2,062,900.00	0.21
122	300085	银之杰	53,800	2,057,850.00	0.20
123	000928	中钢国际	321,000	2,044,770.00	0.20
124	300185	通裕重工	794,800	2,042,636.00	0.20
125	301511	德福科技	162,600	2,042,256.00	0.20
126	600633	浙数文化	195,100	2,040,746.00	0.20
127	600866	星湖科技	310,300	2,007,641.00	0.20
128	300133	华策影视	276,400	1,995,608.00	0.20
129	600363	联创光电	41,600	1,991,808.00	0.20
130	002777	久远银海	115,300	1,985,466.00	0.20
131	301262	海看股份	79,700	1,982,139.00	0.20
132	600179	安通控股	691,700	1,957,511.00	0.19
133	600751	海航科技	732,800	1,927,264.00	0.19
134	600929	雪天盐业	341,500	1,908,985.00	0.19
135	688631	莱斯信息	21,800	1,898,562.00	0.19
136	000791	甘肃能源	313,400	1,889,802.00	0.19
137	601028	玉龙股份	164,500	1,885,170.00	0.19
138	601900	南方传媒	124,700	1,884,217.00	0.19

139	301238	瑞泰新材	120, 300	1, 883, 898. 00	0. 19
140	300735	光弘科技	67, 100	1, 878, 129. 00	0. 19
141	300741	华宝股份	107, 900	1, 876, 381. 00	0. 19
142	000761	本钢板材	573, 500	1, 835, 200. 00	0. 18
143	601279	英利汽车	474, 900	1, 818, 867. 00	0. 18
144	300303	聚飞光电	264, 600	1, 804, 572. 00	0. 18
145	600171	上海贝岭	45, 300	1, 797, 504. 00	0. 18
146	000503	国新健康	162, 500	1, 784, 250. 00	0. 18
147	300827	上能电气	40, 600	1, 782, 340. 00	0. 18
148	000682	东方电子	165, 800	1, 775, 718. 00	0. 18
149	688658	悦康药业	120, 400	1, 734, 964. 00	0. 17
150	600675	中华企业	616, 900	1, 733, 489. 00	0. 17
151	600552	凯盛科技	148, 400	1, 693, 244. 00	0. 17
152	000935	四川双马	115, 900	1, 678, 232. 00	0. 17
153	002270	华明装备	96, 200	1, 624, 818. 00	0. 16
154	688116	天奈科技	41, 400	1, 606, 734. 00	0. 16
155	002332	仙琚制药	158, 500	1, 575, 490. 00	0. 16
156	000680	山推股份	162, 000	1, 571, 400. 00	0. 16
157	301207	华兰疫苗	89, 300	1, 563, 643. 00	0. 16
158	688776	国光电气	33, 000	1, 561, 890. 00	0. 16
159	600641	XD 万业企	106, 200	1, 552, 644. 00	0. 15
160	688066	航天宏图	76, 000	1, 550, 400. 00	0. 15
161	000913	钱江摩托	85, 100	1, 532, 651. 00	0. 15
162	301171	易点天下	54, 100	1, 525, 079. 00	0. 15
163	688700	东威科技	50, 800	1, 496, 568. 00	0. 15
164	603327	福蓉科技	122, 400	1, 485, 936. 00	0. 15
165	600556	天下秀	284, 500	1, 479, 400. 00	0. 15
166	600861	北京人力	75, 870	1, 468, 084. 50	0. 15
167	000969	安泰科技	131, 600	1, 467, 340. 00	0. 15
168	002488	金固股份	140, 400	1, 465, 776. 00	0. 15
169	301297	富乐德	34, 400	1, 462, 000. 00	0. 15
170	000657	中钨高新	158, 500	1, 459, 785. 00	0. 15
171	600575	淮河能源	367, 100	1, 457, 387. 00	0. 14
172	600110	诺德股份	361, 800	1, 447, 200. 00	0. 14
173	000917	电广传媒	202, 200	1, 429, 554. 00	0. 14
174	301175	中科环保	258, 100	1, 393, 740. 00	0. 14
175	688037	芯源微	16, 000	1, 338, 080. 00	0. 13
176	600645	中源协和	69, 100	1, 333, 630. 00	0. 13
177	300579	数字认证	42, 300	1, 329, 066. 00	0. 13
178	605296	神农集团	47, 700	1, 321, 290. 00	0. 13
179	300850	新强联	69, 000	1, 318, 590. 00	0. 13
180	300475	香农芯创	45, 700	1, 301, 993. 00	0. 13
181	000688	国城矿业	109, 000	1, 296, 010. 00	0. 13

182	300027	华谊兄弟	486,700	1,275,154.00	0.13
183	300077	国民技术	53,200	1,268,288.00	0.13
184	300366	创意信息	133,500	1,241,550.00	0.12
185	688372	伟测科技	21,200	1,240,624.00	0.12
186	000062	深圳华强	55,200	1,236,480.00	0.12
187	300457	赢合科技	64,600	1,236,444.00	0.12
188	600787	中储股份	189,200	1,207,096.00	0.12
189	603693	江苏新能	119,200	1,174,120.00	0.12
190	601595	上海电影	47,500	1,173,250.00	0.12
191	600210	紫江企业	175,700	1,161,377.00	0.12
192	002400	省广集团	144,900	1,157,751.00	0.12
193	688526	科前生物	81,000	1,157,490.00	0.12
194	688063	派能科技	28,000	1,121,400.00	0.11
195	688392	骄成超声	26,800	1,093,440.00	0.11
196	300432	富临精工	69,500	1,068,910.00	0.11
197	600301	华锡有色	62,800	1,068,228.00	0.11
198	300393	中来股份	156,900	980,625.00	0.10
199	000035	中国天楹	195,500	952,085.00	0.09
200	300593	新雷能	84,800	949,760.00	0.09
201	000676	智度股份	111,000	939,060.00	0.09
202	300773	拉卡拉	52,700	932,790.00	0.09
203	605365	立达信	58,600	920,020.00	0.09
204	300101	振芯科技	41,800	905,388.00	0.09
205	603305	旭升集团	68,400	899,460.00	0.09
206	300451	创业慧康	198,160	887,756.80	0.09
207	300663	科蓝软件	50,800	881,888.00	0.09
208	301155	海力风电	16,500	879,615.00	0.09
209	688348	昱能科技	18,000	878,400.00	0.09
210	600158	中体产业	104,116	861,039.32	0.09
211	000528	柳工	71,100	857,466.00	0.09
212	000088	盐田港	176,000	857,120.00	0.09
213	688503	聚和材料	19,200	850,368.00	0.08
214	300438	鹏辉能源	30,000	843,300.00	0.08
215	605123	派克新材	15,500	833,280.00	0.08
216	688318	财富趋势	4,800	820,800.00	0.08
217	600285	羚锐制药	36,700	813,272.00	0.08
218	000603	盛达资源	67,400	808,126.00	0.08
219	300352	北信源	149,300	788,304.00	0.08
220	002428	云南锗业	41,600	786,240.00	0.08
221	688018	乐鑫科技	3,600	784,800.00	0.08
222	605376	博迁新材	26,800	775,860.00	0.08
223	002194	武汉凡谷	69,000	774,180.00	0.08
224	002498	汉缆股份	227,700	771,903.00	0.08

225	688019	安集科技	5,400	752,544.00	0.07
226	301268	铭利达	45,300	751,074.00	0.07
227	001696	宗申动力	29,400	732,060.00	0.07
228	002091	江苏国泰	98,400	720,288.00	0.07
229	600037	歌华有线	96,100	716,906.00	0.07
230	002043	兔宝宝	60,100	713,988.00	0.07
231	603612	索通发展	51,600	697,116.00	0.07
232	603328	依顿电子	70,200	692,172.00	0.07
233	688408	中信博	9,600	691,200.00	0.07
234	603989	艾华集团	41,400	624,312.00	0.06
235	600055	万东医疗	39,600	597,960.00	0.06
236	600331	宏达股份	75,400	574,548.00	0.06

8.3.2 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	688161	威高骨科	337,200	8,504,184.00	0.85
2	300433	蓝思科技	246,100	5,389,590.00	0.54
3	600790	轻纺城	1,411,700	5,293,875.00	0.53
4	603938	三孚股份	478,220	5,169,558.20	0.51
5	601319	中国人保	661,400	5,039,868.00	0.50
6	688055	龙腾光电	1,048,400	4,329,892.00	0.43
7	300750	宁德时代	15,500	4,123,000.00	0.41
8	600418	江淮汽车	99,300	3,723,750.00	0.37
9	300907	康平科技	163,700	3,444,248.00	0.34
10	688371	菲沃泰	212,400	3,296,448.00	0.33
11	301025	读客文化	327,300	3,119,169.00	0.31
12	603823	百合花	333,800	3,104,340.00	0.31
13	300476	胜宏科技	73,600	3,097,824.00	0.31
14	300972	万辰集团	37,600	3,023,416.00	0.30
15	301056	森赫股份	365,700	2,991,426.00	0.30
16	601918	新集能源	411,500	2,954,570.00	0.29
17	300758	七彩化学	243,200	2,913,536.00	0.29
18	300002	神州泰岳	248,600	2,881,274.00	0.29
19	601999	出版传媒	456,600	2,862,882.00	0.28
20	300502	新易盛	24,200	2,797,036.00	0.28
21	688519	南亚新材	122,000	2,593,720.00	0.26
22	300341	麦克奥迪	146,100	2,558,211.00	0.25
23	688246	嘉和美康	92,800	2,301,440.00	0.23
24	688553	汇宇制药	149,800	2,276,960.00	0.23
25	688079	美迪凯	254,400	2,203,104.00	0.22
26	300339	润和软件	43,796	2,191,113.88	0.22
27	688636	智明达	76,400	2,146,840.00	0.21
28	300698	万马科技	59,400	2,046,924.00	0.20

29	600316	洪都航空	61,500	1,975,380.00	0.20
30	688472	阿特斯	149,600	1,878,976.00	0.19
31	601728	中国电信	251,100	1,812,942.00	0.18
32	300127	银河磁体	71,300	1,752,554.00	0.17
33	001216	华瓷股份	134,800	1,718,700.00	0.17
34	603659	璞泰来	107,600	1,711,916.00	0.17
35	688588	凌志软件	118,800	1,639,440.00	0.16
36	300033	同花顺	5,700	1,638,750.00	0.16
37	300184	力源信息	169,700	1,583,301.00	0.16
38	300006	莱美药业	414,300	1,516,338.00	0.15
39	300486	东杰智能	218,700	1,495,908.00	0.15
40	000516	国际医学	274,600	1,449,888.00	0.14
41	688593	新相微	76,400	1,398,120.00	0.14
42	688015	交控科技	69,400	1,376,202.00	0.14
43	002027	分众传媒	190,100	1,336,403.00	0.13
44	002625	光启技术	27,700	1,324,060.00	0.13
45	600184	光电股份	127,500	1,315,800.00	0.13
46	002980	华盛昌	49,300	1,264,545.00	0.13
47	002939	长城证券	152,200	1,248,040.00	0.12
48	002772	众兴菌业	167,600	1,235,212.00	0.12
49	301301	川宁生物	98,200	1,164,652.00	0.12
50	301036	双乐股份	28,800	1,128,960.00	0.11
51	605058	澳弘电子	56,900	1,128,327.00	0.11
52	300082	奥克股份	170,100	1,066,527.00	0.11
53	688109	品茗科技	42,200	1,034,322.00	0.10
54	300581	晨曦航空	89,400	1,002,174.00	0.10
55	688093	世华科技	49,600	1,001,424.00	0.10
56	300320	海达股份	104,300	1,001,280.00	0.10
57	688070	纵横股份	27,800	981,340.00	0.10
58	688488	艾迪药业	124,000	974,640.00	0.10
59	300003	乐普医疗	85,600	970,704.00	0.10
60	300523	辰安科技	48,800	965,752.00	0.10
61	600390	五矿资本	148,000	954,600.00	0.09
62	603529	爱玛科技	22,000	902,440.00	0.09
63	301362	民爆光电	22,900	898,138.00	0.09
64	688009	中国通号	135,000	845,100.00	0.08
65	300217	东方电热	186,000	838,860.00	0.08
66	002653	海思科	24,800	824,600.00	0.08
67	000426	兴业银锡	71,100	790,632.00	0.08
68	301528	多浦乐	19,700	768,300.00	0.08
69	688312	燕麦科技	23,600	726,880.00	0.07
70	300342	天银机电	44,500	722,235.00	0.07
71	600573	惠泉啤酒	59,900	674,474.00	0.07

72	688172	燕东微	31,400	629,570.00	0.06
73	300987	川网传媒	43,700	618,792.00	0.06
74	300601	康泰生物	36,000	617,400.00	0.06
75	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
76	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
77	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
78	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
79	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
80	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
81	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
82	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
83	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
84	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
85	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
86	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
87	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
88	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
89	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
90	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
91	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
92	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
93	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
94	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
95	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
96	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
97	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
98	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
99	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300602	飞荣达	39,591,709.00	2.50
2	601567	三星医疗	39,155,675.00	2.47
3	688158	优刻得	38,459,472.52	2.43
4	688608	恒玄科技	37,196,727.39	2.35
5	603871	嘉友国际	34,971,362.23	2.21
6	603348	文灿股份	34,045,884.00	2.15
7	002456	欧菲光	33,001,323.00	2.08
8	603556	海兴电力	32,841,323.10	2.07
9	603699	纽威股份	31,568,632.93	1.99
10	300475	香农芯创	28,892,634.65	1.82

11	600312	平高电气	28,385,570.00	1.79
12	002583	海能达	28,342,328.32	1.79
13	603160	汇顶科技	28,182,255.06	1.78
14	300458	全志科技	27,581,152.50	1.74
15	002245	蔚蓝锂芯	27,572,597.26	1.74
16	000860	顺鑫农业	27,490,053.59	1.74
17	300857	协创数据	27,232,578.00	1.72
18	600248	陕建股份	26,463,596.00	1.67
19	600750	江中药业	26,355,020.02	1.66
20	600601	方正科技	26,012,891.00	1.64

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603871	嘉友国际	45,233,440.10	2.86
2	603556	海兴电力	44,404,330.00	2.80
3	603699	纽威股份	42,377,536.27	2.68
4	300602	飞荣达	41,839,980.80	2.64
5	601567	三星医疗	41,680,278.00	2.63
6	688158	优刻得	39,040,780.38	2.46
7	603328	依顿电子	37,721,947.60	2.38
8	600750	江中药业	37,279,892.12	2.35
9	603530	神马电力	36,030,822.22	2.27
10	688608	恒玄科技	35,350,632.63	2.23
11	603348	文灿股份	34,703,792.00	2.19
12	300475	香农芯创	33,004,118.00	2.08
13	002583	海能达	32,510,047.20	2.05
14	688578	艾力斯	32,469,288.39	2.05
15	601019	山东出版	30,555,817.00	1.93
16	688100	威胜信息	30,161,789.90	1.90
17	600312	平高电气	29,951,279.00	1.89
18	300857	协创数据	29,934,523.00	1.89
19	000737	北方铜业	29,616,902.80	1.87
20	600675	中华企业	28,081,578.44	1.77

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,998,950,746.74
卖出股票收入（成交）总额	8,610,597,801.58

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不

包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货的投资，始终以套期保值为准则。报告期内，本基金主要采用多头套期保值，即通过买入对应基准的指数期货的方式，在跟踪基准的同时，增加仓位调节的灵活度，亦可降低频繁交易股票带来的成本。具体交易时，本基金综合分析不同合约的标的指数、期限、基差和流动性的情况后进行配置。本基金投资于股指期货，对基金相对风险的影响较小，并符合既定的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,205,913.60
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	8,593,360.76
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	18,799,274.36

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
建信中证 1000 指数增强 A	32,941	13,648.40	110,602,486.15	24.60	338,989,420.62	75.40
建信中证 1000 指数	43,069	4,568.21	10,732,936.33	5.46	186,015,159.54	94.54

增强 C						
建信中证 1000 指数增强发起 E	888	5,490.21	86,338.25	1.77	4,788,971.00	98.23
合计	76,898	8,468.56	121,421,760.73	18.65	529,793,551.16	81.35

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信中证 1000 指数增强 A	395,948.06	0.09
	建信中证 1000 指数增强 C	2,436.40	0.00
	建信中证 1000 指数增强发起 E	289,164.55	5.93
	合计	687,549.01	0.11

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信中证 1000 指数增强 A	0~10
	建信中证 1000 指数增强 C	0~10
	建信中证 1000 指数增强发起 E	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	建信中证 1000 指数增强 A	0~10
	建信中证 1000 指数增强 C	-
	建信中证 1000 指数增强发起 E	-
	合计	0~10

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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间(万份)
赵云煜	公募基金	10~50
	私募资产管理计划	-
	合计	10~50

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	97,814.30	0.02	-	-	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	97,814.30	0.02	-	-	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	建信中证 1000 指数增强发起 E
基金合同生效日 (2018 年 11 月 22 日) 基金份额总额	50,945,615.13	48,700,352.71	-
本报告期期初基金份额总额	572,284,641.61	410,222,204.30	85,175,459.96
本报告期基金总申购份额	535,549,128.79	373,601,051.13	29,280,125.84
减：本报告期基金总赎回份额	658,241,863.63	587,075,159.56	109,580,276.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	449,591,906.77	196,748,095.87	4,875,309.25

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

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 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；基金管理人于 2024 年 9 月 21 日发布公告，自 2024 年 9 月 20 日起张力铮先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2024 年 10 月 26 日发布公告，自 2024 年 10 月 25 日起聘任莫红女士担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2024 年 12 月 28 日发布公告，自 2024 年 12 月 27 日起聘任谢海玉女士担任建信基金管理有限责任公司总裁，张军红先生不再担任建信基金管理有限责任公司总裁。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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内会计师事务所未发生改变。本年度审计费用为人民币 63000 元。该会计师事务所自 2019 年起为本公司旗下所有公募基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	建信基金管理有限责任公司
受到稽查或处罚等措施的时间	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

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
国信证券	3	15,757,180.9 53.86	94.88	6,694,568.64	92.04	-
浙商证券	1	339,920,600. 16	2.05	250,155.06	3.44	-
中信建投	1	257,878,312. 37	1.55	192,353.72	2.64	-
中金财富 证券	3	251,870,113. 43	1.52	136,374.77	1.87	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、公司选择证券公司的标准

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 10 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，研究业务线最近两年未因发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；
- (6) 能及时为公司提供高质量的研究服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走势分析、个股分析报告及其他专门报告。

2、证券公司服务评价程序

- (1) 证券公司服务的评价包括定期的证券公司评价打分以及对证券公司投研支持服务的定额激励。
- (2) 公司对证券公司实行“核心名单”管理。在所有公司合作机构中筛选部分机构进入“核

心名单”。公司的评价打分仅针对进入“核心名单”的机构，“核心名单”定期调整、动态优化。

(3) 定期的证券公司评价打分：根据证券公司服务记录，投研人员定期在投研系统平台对核心名单的证券公司服务进行评价打分。

(4) 证券公司服务的定额激励：根据证券公司服务记录，投研各部门可提出定额激励作为对证券公司投研支持服务的补充激励。证券公司投研支持服务的范围包括但不限于：重点推荐、定向路演邀请、投研课题委托、产业链调研、数据模型及支持等服务内容。

(5) 证券公司服务评价、交易佣金分配建议等证券公司服务的定期考核评价结果，由研究部进行汇总，提交公司投资决策委员会授权的投研部门总经理联席会议审议。

3、本基金本报告期内增加国信证券 3 个交易单元和中金财富证券 3 个交易单元，无剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

4、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《建信基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-

证券						
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增民生银行为建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 12 月 4 日
2	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 11 月 12 日
3	关于新增华福证券有限责任公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 9 月 26 日
4	关于新增中国中金财富证券为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 4 月 2 日
5	关于建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金证券交易模式转换完成的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 1 月 18 日
6	关于建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金证券交易模式转换有关事项的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 1 月 16 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

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 11 月 13 日	437,964,287.98	26,633,522.73	464,597,810.71	-	-

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

13.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司
2025 年 3 月 28 日