

建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2018 年半年度报告 摘要

2018 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：2018 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示

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。本半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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	1,649,740,743.67 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	1,440,445,990.12 份	209,294,753.55 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	李修滨
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	lixubini@citicbank.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024

2.4 信息披露方式

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

§ 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

基金级别	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-88,946,727.09	-13,461,854.59
本期利润	-402,685,929.89	-31,407,272.42
加权平均基金份额本期利润	-0.3444	-0.3268
本期基金份额净值增长率	-13.65%	-14.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	1.0322	1.0293
期末基金资产净值	2,927,256,987.42	424,717,297.48
期末基金份额净值	2.0322	2.0293

1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）；

3、上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。

4、本基金于 2018 年 3 月 16 日新增 C 类份额，原有基金全部转换为 A 类份额。

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	-7.66%	1.80%	-8.86%	1.77%	1.20%	0.03%
过去三个月	-12.75%	1.34%	-13.96%	1.31%	1.21%	0.03%
过去六个月	-13.65%	1.40%	-15.71%	1.37%	2.06%	0.03%
过去一年	-10.95%	1.17%	-14.21%	1.16%	3.26%	0.01%
过去三年	-15.78%	1.88%	-39.40%	1.80%	23.62%	0.08%
自基金合同生效起至今	103.22%	1.78%	33.70%	1.74%	69.52%	0.04%

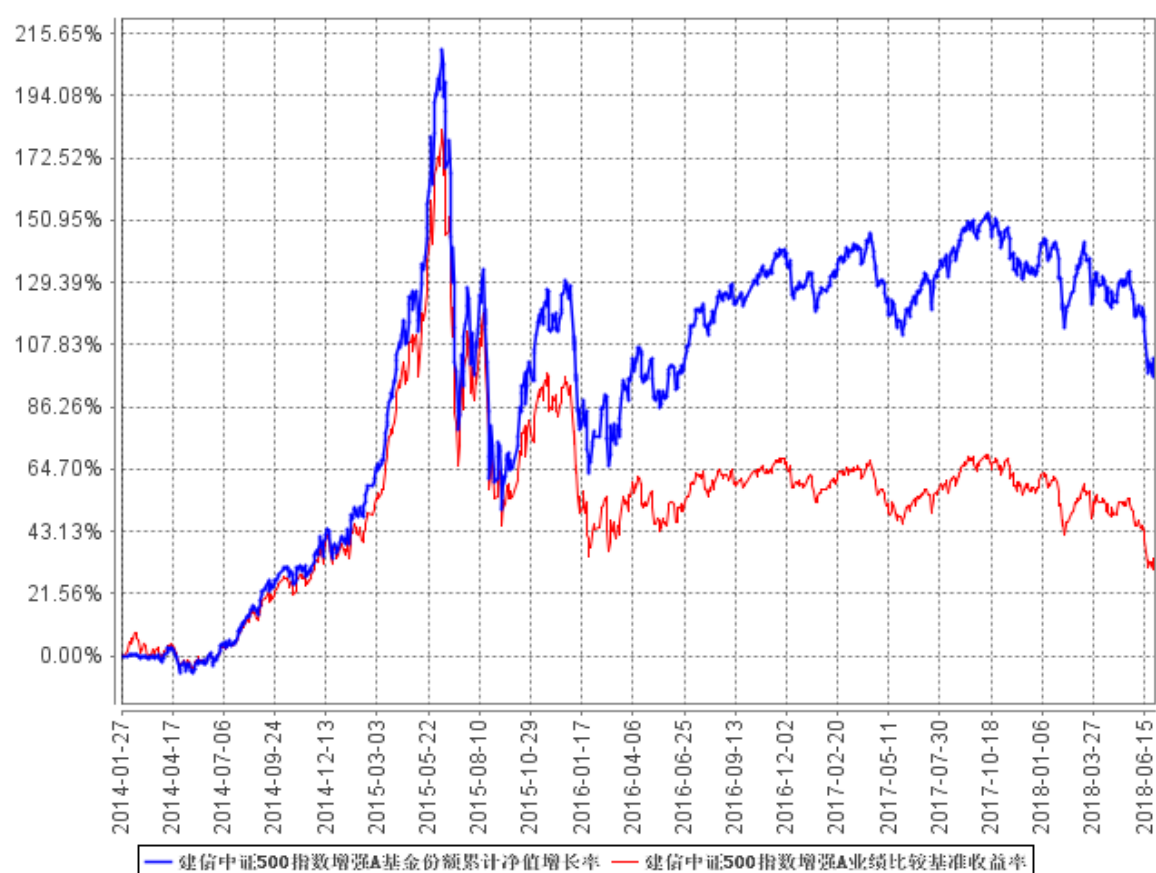
建信中证 500 指数增强 C

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	-7.67%	1.80%	-8.86%	1.77%	1.19%	0.03%
过去三个月	-12.87%	1.34%	-13.96%	1.31%	1.09%	0.03%
自基金合同生效起至今	-14.49%	1.45%	-14.37%	1.40%	-0.12%	0.05%

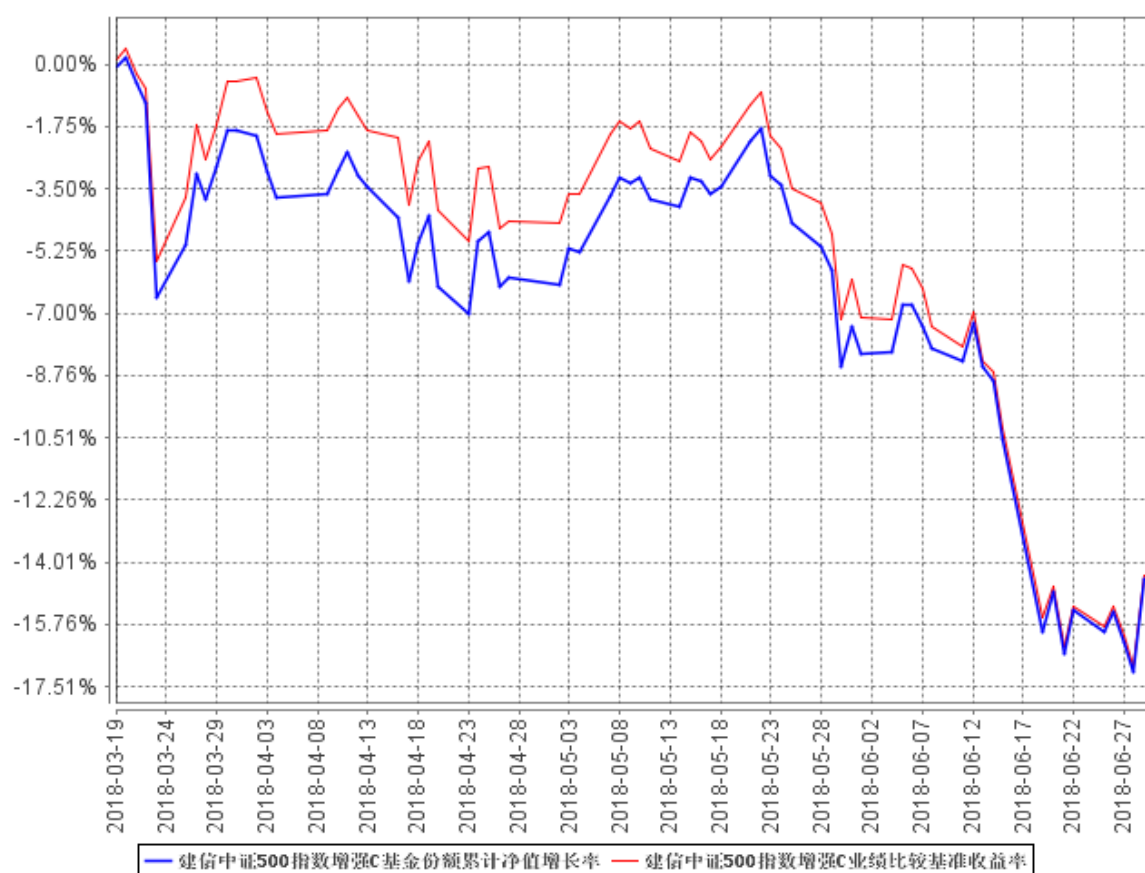
本基金业绩比较基准为 $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税前）}$ 。中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场中小市值公司的整体情况。

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基金份额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基金份额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



本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理

部和内控合规部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。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“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2018 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、

建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债 1-3 年指数证券投资基金 (LOF)、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金 (LOF)、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金 (FOF)、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金，共计 101 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 6,342.88 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶乐天	金融工程及指数投资部副总经理、本基金的基金经理	2014 年 1 月 27 日	-	10	叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理，硕士。2008 年 5 月至 2011 年 9 月就职于中国国际金融有限公司，历任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资。2011 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工

					程及指数投资部总经理助理、副总经理，2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 4 月 18 日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 22 日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 1 月 10 日起任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行

为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》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 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

报告期间，本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，坚持量化增强策略，并获得了一定的超额收益。本基金管理人主要采用多因子选股模型，力争保持行业以及风格中性，在保持较低跟踪误差的同时争取较高的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期中证 500A 净值增长率-13.65%，波动率 1.4%，业绩比较基准收益率为-15.71%，波动率为 1.37%；中证 500C 净值增长率-14.49%，波动率 1.45%，业绩比较基准收益率-14.37%，波动率 1.4%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2018 年上半年，市场波动率明显放大，市场风格切换较快。进入二季度，受贸易战、去杠杆等因素影响，市场普遍下跌，中证 500 指数下跌幅度较大。展望下半年，随着国务院常务会议提出更为积极的财政政策，以及松紧适度的货币政策，标志着政策层面的实质性放松，预计下半年虽然市场波动仍然较大，但指数相比上半年有更多的机会，需要在做好风险控制的基础上进一步精选个股。

本基金管理人将坚持量化分析研究，进一步改进指数增强策略，努力克服市场的波动，持续获取稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本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。

§ 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《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 2018 年上半年度基金的的投资运作，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《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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《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建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2018 年半年度报告中的财务指标、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，未发现有关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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
-----	-----	------------------------	--------------------------

资 产:			
银行存款		238,014,468.27	118,644,671.43
结算备付金		53,513,060.41	28,355,358.17
存出保证金		45,928,056.10	12,484,079.52
交易性金融资产		2,930,412,765.96	1,749,296,507.36
其中: 股票投资		2,930,412,765.96	1,749,087,808.73
基金投资		-	-
债券投资		-	208,698.63
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	30,000,000.00
应收证券清算款		113,001,903.46	33,575,296.98
应收利息		70,802.02	95,040.63
应收股利		-	-
应收申购款		15,645,412.72	7,732,146.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,396,586,468.94	1,980,183,100.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	7,682,721.71
应付赎回款		29,319,336.51	5,184,442.45
应付管理人报酬		2,564,440.74	1,378,441.81
应付托管费		512,888.15	275,688.38
应付销售服务费		115,501.02	-
应付交易费用		11,450,613.40	4,294,909.93
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		649,404.22	587,759.02
负债合计		44,612,184.04	19,403,963.30
所有者权益:			
实收基金		1,649,740,743.67	833,121,208.94
未分配利润		1,702,233,541.23	1,127,657,927.99
所有者权益合计		3,351,974,284.90	1,960,779,136.93
负债和所有者权益总计		3,396,586,468.94	1,980,183,100.23

报告截止日 2018 年 6 月 30 日，建信中证 500 指数增强 A 基金份额净值 2.0322 元，基金份额总额 1,440,445,990.12 份；建信中证 500 指数增强 C 基金份额净值 2.0293 元，基金份额总额 209,294,753.55 份。建信中证 500 指数增强份额总额合计为 1,649,740,743.67 份。

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-401,746,930.00	16,827,633.17
1.利息收入		2,050,911.90	476,788.22
其中：存款利息收入		1,598,894.16	390,232.99
债券利息收入		58.62	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		451,959.12	86,555.23
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-74,015,583.73	7,907,498.36
其中：股票投资收益		-87,585,373.95	3,903,690.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益		22,711.20	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-9,885,340.00	-1,251,340.31
股利收益		23,432,419.02	5,255,148.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-331,684,620.63	7,941,116.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		1,902,362.46	502,230.04
减：二、费用		32,346,272.31	8,881,846.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,750,809.76	4,076,220.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,750,161.99	815,244.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	295,707.43	-
4. 交易费用		15,070,755.70	3,699,274.18
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		27,774.07	-

7. 其他费用		451,063.36	291,107.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-434,093,202.31	7,945,786.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-434,093,202.31	7,945,786.96

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	833,121,208.94	1,127,657,927.99	1,960,779,136.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-434,093,202.31	-434,093,202.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	816,619,534.73	1,008,668,815.55	1,825,288,350.28
其中：1.基金申购款	1,323,708,394.67	1,658,845,562.07	2,982,553,956.74
2.基金赎回款	-507,088,859.94	-650,176,746.52	-1,157,265,606.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,649,740,743.67	1,702,233,541.23	3,351,974,284.90
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	274,328,367.01	351,186,649.15	625,515,016.16
二、本期经营活动产生	-	7,945,786.96	7,945,786.96

的基金净值变动数（本期净利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	284,825,485.58	357,700,712.76	642,526,198.34
其中：1.基金申购款	463,172,286.25	593,068,546.81	1,056,240,833.06
2.基金赎回款	-178,346,800.67	-235,367,834.05	-413,714,634.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	559,153,852.59	716,833,148.87	1,275,987,001.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 张军红	_____ 吴曙明	_____ 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]第 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 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、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的,称为 A 类基金份额;不收取申购

费用，而是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。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增加收取销售服务费的 C 类收费模式后，全部转换为 A 类基金份额。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金 基金合同》和在中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对于内地投资者持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照 7% 的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10% 的税率代扣代缴所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
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
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,750,809.76	4,076,220.23
其中：支付销售机构的客户维护费	4,145,264.80	1,415,984.79

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 X1.00%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,750,161.99	815,244.04

支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2%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 X0.2%/当年天数。

6.4.8.2.3 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-	292, 420. 53	292, 420. 53
合计	-	292, 420. 53	292, 420. 53
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
合计	-	-	-

1、支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，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。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值 X 0.50%/ 当年天数。

2、本基金于 2018 年 3 月 16 日新增 C 类份额, 原有基金全部转换为 A 类份额。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	238,014,468.27	1,048,424.51	104,237,290.38	297,595.90

本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601138	工业富联	2018 年 5 月 28 日	2019 年 6 月 10 日	新发未上市	13.77	16.40	2,343,558	32,270,793.66	38,434,351.20	
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新发未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	
603105	芯能科技	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月	新发未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	

			9 日							
--	--	--	-----	--	--	--	--	--	--	--

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000426	兴业矿业	2018 年 6 月 19 日	重大资产重组	7.21	-	-	2,811,143	25,214,779.15	20,268,341.03	-
300324	旋极信息	2018 年 5 月 30 日	重大资产重组	9.49	-	-	1,712,750	18,117,828.65	16,253,997.50	-
300266	兴源环境	2018 年 2 月 5 日	重大资产重组	16.67	2018 年 7 月 2 日	17.99	634,743	17,248,491.14	10,581,165.81	-
002359	北讯集团	2018 年 5 月 21 日	重大资产重组	19.58	2018 年 8 月 21 日	17.62	501,900	12,523,268.71	9,827,202.00	-
002051	中工国际	2018 年 4 月 4 日	重大资产重组	15.27	-	-	563,192	10,547,343.53	8,599,941.84	-
002668	奥马电器	2018 年 6 月 15 日	重大资产重组	20.10	-	-	381,000	8,370,476.60	7,658,100.00	-
000669	金鸿控股	2018 年 5 月 18 日	重大资产重组	7.25	2018 年 8 月 6 日	6.53	682,563	5,236,484.05	4,948,581.75	-
600759	洲际油气	2018 年 3 月 27 日	重大资产重组	3.94	-	-	1,243,595	4,448,130.00	4,899,764.30	-
600022	山东钢铁	2018 年	重大资产	2.02	2018 年	1.83	1,505,600	3,242,546.00	3,041,312.00	-

		3 月 27 日	重组		8 月 16 日					
600751	海航 科技	2018 年 1 月 16 日	重大 资产 重组	6.49	-	-	410,415	2,563,445.21	2,663,593.35	-
002426	胜利 精密	2018 年 6 月 19 日	重大 资产 重组	3.60	2018 年 7 月 3 日	3.26	649,700	2,573,420.00	2,338,920.00	-
002573	清新 环境	2018 年 6 月 19 日	重大 资产 重组	11.55	-	-	201,700	3,401,905.65	2,329,635.00	-
600750	江中 药业	2018 年 5 月 2 日	重大 资产 重组	17.75	2018 年 8 月 1 日	16.12	113,827	2,047,566.96	2,020,429.25	-
000666	经纬 纺机	2018 年 3 月 12 日	重大 资产 重组	18.08	-	-	109,300	1,808,970.99	1,976,144.00	-
300197	铁汉 生态	2018 年 5 月 28 日	重大 资产 重组	5.37	-	-	357,900	2,769,367.42	1,921,923.00	-
600745	闻泰 科技	2018 年 4 月 17 日	重大 资产 重组	25.56	-	-	48,600	1,182,338.25	1,242,216.00	-
002699	美盛 文化	2018 年 2 月 5 日	重大 资产 重组	18.76	2018 年 7 月 2 日	16.88	64,540	1,133,027.19	1,210,770.40	-
000008	神州 高铁	2018 年 6 月 8 日	重大 事项	4.96	2018 年 8 月 7 日	4.46	206,100	1,180,620.61	1,022,256.00	-
300229	拓尔 思	2018 年 4 月 17 日	重大 资产 重组	15.88	2018 年 7 月 17 日	14.29	43,200	616,407.33	686,016.00	-
002011	盾安 环境	2018 年	重大 资产	6.40	-	-	15,349	125,210.79	98,233.60	-

		5 月 2 日	重组							
002089	新 海 宜	2018 年 4 月 20 日	重大 资产 重组	6.05	2018 年 7 月 20 日	5.45	16,100	90,761.80	97,405.00	-
002431	棕 榈 股 份	2018 年 5 月 30 日	重大 事项	6.71	-	-	13,100	125,535.45	87,901.00	-
002512	达 华 智 能	2018 年 6 月 19 日	重大 事项	9.70	-	-	8,703	98,748.47	84,419.10	-
002477	雏 鹰 农 牧	2018 年 6 月 14 日	重大 事项	3.31	-	-	8,000	29,211.00	26,480.00	-
600335	国 机 汽 车	2018 年 4 月 3 日	重大 资产 重组	10.43	-	-	22	218.37	229.46	-

本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,788,053,863.22 元，属于第二层次的余额为 142,358,902.74 元，无属于第三层次的余额(2017 年 06 月 30 日：第一层次 1,083,833,661.12 元，第二层次 34,169,339.91 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 06 月 30 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

§ 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	2,930,412,765.96	86.28
	其中：股票	2,930,412,765.96	86.28
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	291,527,528.68	8.58
7	其他各项资产	174,646,174.30	5.14
8	合计	3,396,586,468.94	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	60,033,387.80	1.79
B	采矿业	119,569,487.80	3.57
C	制造业	1,153,470,826.32	34.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,269,790.61	0.93
E	建筑业	48,683,818.80	1.45
F	批发和零售业	229,360,239.24	6.84
G	交通运输、仓储和邮政业	67,237,903.93	2.01
H	住宿和餐饮业	6,188,440.28	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	223,481,958.72	6.67
J	金融业	15,105,186.80	0.45
K	房地产业	158,185,240.44	4.72
L	租赁和商务服务业	25,371,447.67	0.76
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	12,910,800.81	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	12,844,182.54	0.38
R	文化、体育和娱乐业	26,129,622.48	0.78
S	综合	—	—

	合计	2,189,842,334.24	65.33
--	----	------------------	-------

以上行业分类以 2018 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	7,636,998.66	0.23
B	采矿业	8,265,569.99	0.25
C	制造业	497,416,665.15	14.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,966,070.80	0.21
E	建筑业	27,101,715.76	0.81
F	批发和零售业	21,517,176.58	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	32,127,809.59	0.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	67,618,306.66	2.02
J	金融业	18,028,632.00	0.54
K	房地产业	11,693,864.28	0.35
L	租赁和商务服务业	16,592,779.55	0.50
M	科学研究和技术服务业	1,313,774.07	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	13,852,169.14	0.41
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	9,158,799.49	0.27
S	综合	1,280,100.00	0.04
	合计	740,570,431.72	22.09

以上行业分类以 2018 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资港股通股票。

7.4 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

7.4.1 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前十名股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	002373	千方科技	3,573,695	46,636,719.75	1.39
2	000975	银泰资源	4,084,183	41,413,615.62	1.24
3	000547	航天发展	4,429,200	34,592,052.00	1.03
4	300113	顺网科技	1,934,751	33,684,014.91	1.00
5	600525	长园集团	3,060,966	32,354,410.62	0.97
6	600216	浙江医药	2,221,006	28,362,246.62	0.85
7	000078	海王生物	5,776,476	27,784,849.56	0.83
8	600201	生物股份	1,618,464	27,659,549.76	0.83
9	002244	滨江集团	4,970,659	25,847,426.80	0.77
10	600511	国药股份	942,686	25,405,387.70	0.76

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

7.4.2 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前五名股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	601138	工业富联	2,343,558	38,434,351.20	1.15
2	300212	易华录	1,086,827	25,703,458.55	0.77
3	000568	泸州老窖	418,217	25,452,686.62	0.76
4	002061	浙江交科	1,804,994	18,898,287.18	0.56
5	002245	澳洋顺昌	2,751,585	17,802,754.95	0.53

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 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	002373	千方科技	55,546,389.48	2.83
2	601138	工业富联	46,101,133.80	2.35
3	000975	银泰资源	45,347,030.74	2.31
4	000547	航天发展	40,778,443.90	2.08
5	600266	北京城建	39,507,335.67	2.01
6	002463	沪电股份	37,559,224.42	1.92
7	300113	顺网科技	36,919,744.34	1.88

8	002517	恺英网络	35,384,649.83	1.80
9	600216	浙江医药	35,195,410.36	1.79
10	002001	新和成	35,129,475.21	1.79
11	600056	中国医药	35,095,482.61	1.79
12	600525	长园集团	34,848,382.47	1.78
13	000078	海王生物	34,497,624.03	1.76
14	300055	万邦达	32,587,911.76	1.66
15	002308	威创股份	32,070,541.17	1.64
16	002244	滨江集团	31,256,031.10	1.59
17	000426	兴业矿业	30,512,529.72	1.56
18	002056	横店东磁	30,266,405.30	1.54
19	300212	易华录	29,270,844.34	1.49
20	002299	圣农发展	29,121,671.72	1.49

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。

7.5.2 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	002195	二三四五	49,642,046.29	2.53
2	300297	蓝盾股份	47,653,355.85	2.43
3	600380	健康元	42,154,207.42	2.15
4	600240	华业资本	40,586,556.51	2.07
5	000050	深天马 A	35,717,432.50	1.82
6	002308	威创股份	35,477,942.82	1.81
7	600260	凯乐科技	32,989,417.93	1.68
8	600409	三友化工	30,872,077.47	1.57
9	600325	华发股份	30,786,004.76	1.57
10	002410	广联达	30,574,765.92	1.56
11	600037	歌华有线	29,298,031.53	1.49
12	000998	隆平高科	27,570,603.58	1.41
13	002422	科伦药业	27,181,325.40	1.39
14	600572	康恩贝	27,128,524.23	1.38
15	600266	北京城建	26,840,542.66	1.37
16	600516	方大炭素	26,699,697.11	1.36
17	000090	天健集团	25,140,684.00	1.28
18	601138	工业富联	25,076,098.10	1.28

19	000158	常山北明	24,673,061.00	1.26
20	002517	恺英网络	24,402,067.97	1.24

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。

7.5.3 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	6,030,604,901.59
卖出股票收入（成交）总额	4,438,252,564.05

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。

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1807	IC1807	216	224,121,600.00	-7,003,280.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-7,003,280.00
股指期货投资本期收益（元）					-9,885,340.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-7,677,508.77

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未披露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。

7.13.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	45,928,056.10
2	应收证券清算款	113,001,903.46
3	应收股利	-
4	应收利息	70,802.02
5	应收申购款	15,645,412.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	174,646,174.30

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601138	工业富联	38,434,351.20	1.15	新发未上市

7.13.6 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	288,204	4,998.01	180,733,806.75	12.55%	1,259,712,183.37	87.45%

中证 500 指数增强 A						
建信中证 500 指数增强 C	739	283,213.47	206,544,181.18	98.69%	2,750,572.37	1.31%
合计	288,943	5,709.57	387,277,987.93	23.48%	1,262,462,755.74	76.52%

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	2,494,070.92	0.17%
	建信中证 500 指数增强 C	3,371.43	0.00%
	合计	2,497,442.35	0.15%

基金管理人的从业人员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）。

8.3 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信中证 500 指数增强 A	0~10
	建信中证 500 指数增强 C	0~10
	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	0~10

	建信中证 500 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 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	833,121,208.94	—
本报告期基金总申购份额	1,109,775,590.58	213,932,804.09
减：本报告期基金总赎回份额	502,450,809.40	4,638,050.54
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,440,445,990.12	209,294,753.55

总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

经本基金管理人建信基金管理有限责任公司 2018 年第一次临时股东会和第五届董事会第一次会议审议通过，自 2018 年 4 月 18 日起，许会斌先生不再担任本公司董事长（法定代表人），由孙志晨先生担任本公司董事长（法定代表人）；孙志晨先生不再担任本公司总裁，由张军红先生担任本公司总裁。上述事项本公司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并于 2018 年 4 月 20 日公告。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
民族证券	1	1,232,318,549.05	11.83%	1,123,054.81	11.67%	-
中金公司	2	1,224,569,119.04	11.75%	1,132,916.01	11.78%	-
太平洋证券	1	1,024,065,251.85	9.83%	953,713.66	9.91%	-
海通证券	1	981,624,952.82	9.42%	914,202.46	9.50%	-
安信证券	1	706,228,357.21	6.78%	657,722.03	6.84%	-
广发证券	1	658,390,742.79	6.32%	613,165.51	6.37%	-
天风证券	1	645,397,360.24	6.19%	588,139.33	6.11%	-
信达证券	2	548,481,512.95	5.26%	502,811.18	5.23%	-

中投证券	1	527,911,591.53	5.07%	481,159.31	5.00%	-
东北证券	1	492,895,360.21	4.73%	459,049.29	4.77%	-
民生证券	1	489,991,025.80	4.70%	456,336.17	4.74%	-
国泰君安证券	1	465,163,834.13	4.46%	423,916.35	4.41%	-
光大证券	2	335,913,930.63	3.22%	312,833.97	3.25%	-
宏信证券	1	295,829,245.11	2.84%	275,507.72	2.86%	-
中信建投	1	264,567,375.32	2.54%	241,141.44	2.51%	-
华融证券	1	237,117,727.59	2.28%	220,823.97	2.30%	-
上海证券	1	129,715,738.64	1.24%	118,199.28	1.23%	-
兴业证券	1	120,749,189.92	1.16%	110,045.22	1.14%	-
东兴证券	1	39,319,530.99	0.38%	36,618.31	0.38%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

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、个股、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、本基金本期新增安信证券、海通证券和华融证券各一个交易单元，未剔除交易单元。

4、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
民族证券	-	-	150,000,000.00	20.27%	-	-
中金公司	-	-	110,000,000.00	14.86%	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	250,000,000.00	33.78%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	110,000,000.00	14.86%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	20,000,000.00	2.70%	-	-
华融证券	231,485.31	100.00%	-	-	-	-
上海证券	-	-	100,000,000.00	13.51%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司
2018 年 8 月 25 日