

# 建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2018 年半年度报告

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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	15
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	22

<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	63
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	64
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	64
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注.....	65
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>67</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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.....	68
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>69</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>70</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	73
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>74</b>
11.1 备查文件目录.....	74
11.2 存放地点.....	74

11.3 查阅方式.....74

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	建信中证 500 指数增强	
基金主代码	000478	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 1 月 27 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	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	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，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。</p> <p>在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p>	
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税前）。	
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。	
	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C

### 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
注册地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层	北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层	北京市东城区朝阳门北大街9号
邮政编码		100033	100010
法定代表人		孙志晨	李庆萍

### 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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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
本期加权平均净值利润率	-15.16%	-14.95%
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)	
期末可供分配利润	1,486,810,997.30	215,422,543.93
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	103.22%	-14.49%

- 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	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----



	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差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%

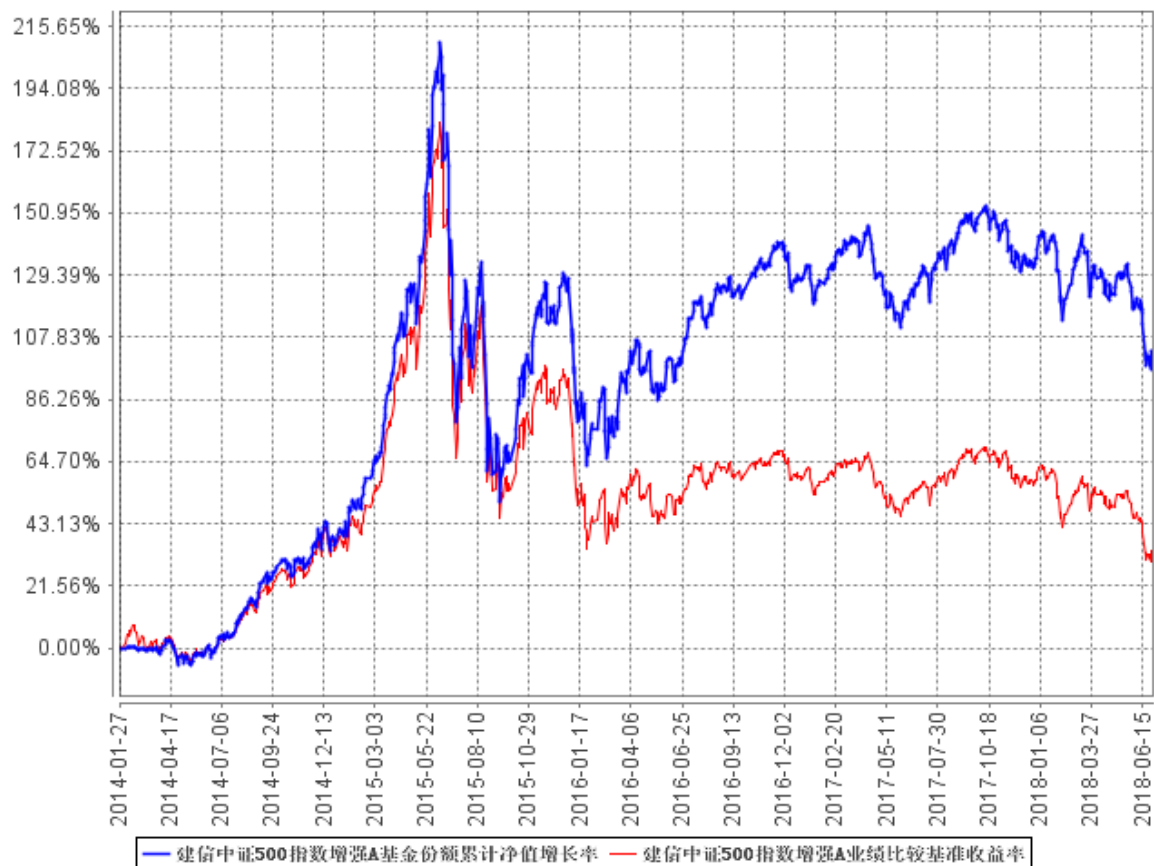
## 建信中证 500 指数增强 C

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%

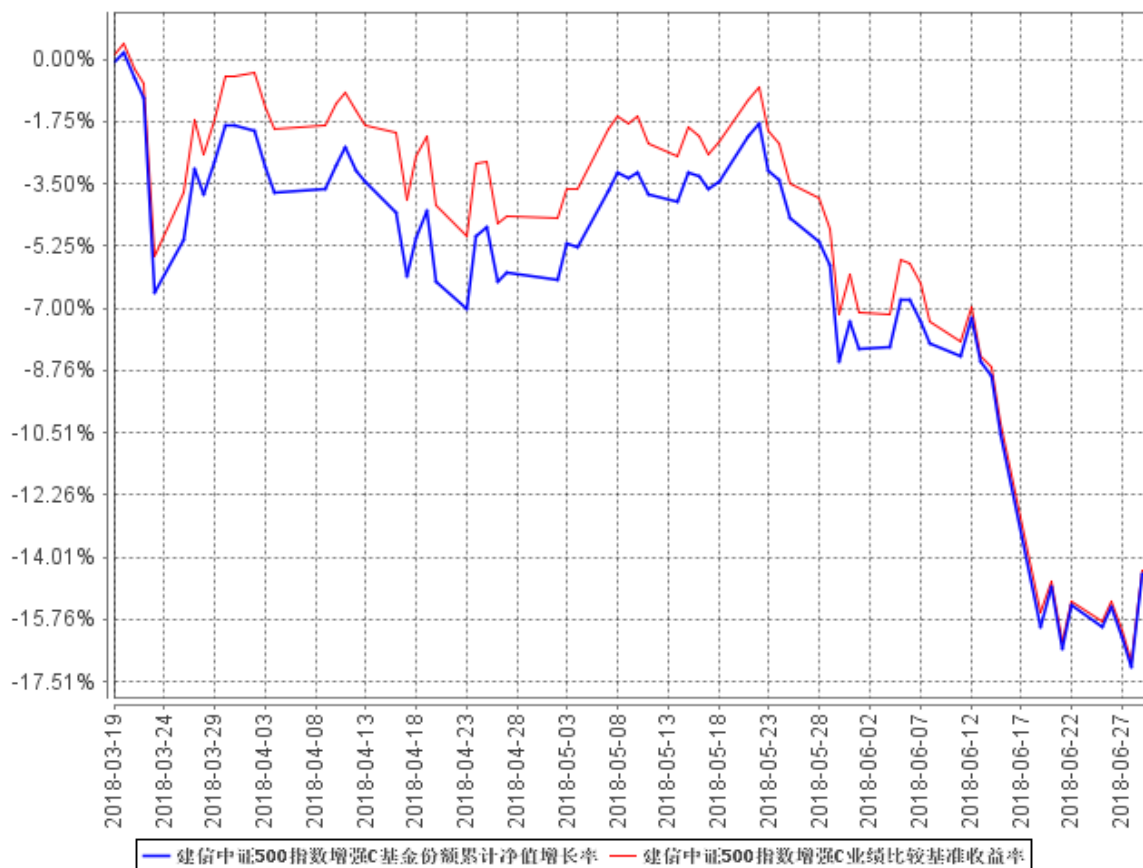
本基金业绩比较基准为  $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率 (税前)}$ 。中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体情况。

### 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、建信现代服务业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 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

本报告期内中证 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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	30,000,000.00
应收证券清算款		113,001,903.46	33,575,296.98
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,396,586,468.94	1,980,183,100.23
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	649,404.22	587,759.02
负债合计		44,612,184.04	19,403,963.30
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,649,740,743.67	833,121,208.94
未分配利润	6.4.7.10	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
<b>一、收入</b>		-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	6.4.7.11	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	6.4.7.12	-87,585,373.95	3,903,690.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	22,711.20	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-9,885,340.00	-1,251,340.31
股利收益	6.4.7.16	23,432,419.02	5,255,148.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-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）	6.4.7.18	1,902,362.46	502,230.04
<b>减：二、费用</b>		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	6.4.7.19	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	6.4.7.20	451,063.36	291,107.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-434,093,202.31	7,945,786.96
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-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、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,945,786.96	7,945,786.96
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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	238,014,468.27
定期存款	-
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	-
合计:	238,014,468.27

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,298,598,191.81	2,930,412,765.96	-368,185,425.85
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	3,298,598,191.81	2,930,412,765.96	-368,185,425.85

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	231,124,880.00	-	-	
其中：股指期货投资	231,124,880.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	231,124,880.00	-	-	

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。于 2018 年 06 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC1807	中证 500 指数 期货 IC1807 合约	216	224,121,600.00	-7,003,280.00
总额合计	-	216	224,121,600.00	-7,003,280.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-7,003,280.00
期货投资净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	74,724.41
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	25,972.95
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-30,392.04
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	496.70
合计	70,802.02

**6.4.7.6 其他资产**

无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	11,450,613.40
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,450,613.40

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	108,520.83
预提费用	320,870.52
应付指数使用费	220,012.87

合计	649,404.22
----	------------

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 500 指数增强 A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	833,121,208.94	833,121,208.94
本期申购	1,109,775,590.58	1,109,775,590.58
本期赎回(以“-”号填列)	-502,450,809.40	-502,450,809.40
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,440,445,990.12	1,440,445,990.12

金额单位：人民币元

建信中证 500 指数增强 C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	213,932,804.09	213,932,804.09
本期赎回(以“-”号填列)	-4,638,050.54	-4,638,050.54
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	209,294,753.55	209,294,753.55

申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

建信中证 500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	970,189,502.48	157,468,425.51	1,127,657,927.99
本期利润	-88,946,727.09	-313,739,202.80	-402,685,929.89
本期基金份额交易	705,640,591.55	56,198,407.65	761,838,999.20

产生的变动数			
其中：基金申购款	1,298,137,979.17	108,431,251.68	1,406,569,230.85
基金赎回款	-592,497,387.62	-52,232,844.03	-644,730,231.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,586,883,366.94	-100,072,369.64	1,486,810,997.30

单位：人民币元

建信中证 500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-13,461,854.59	-17,945,417.83	-31,407,272.42
本期基金份额交易产生的变动数	243,379,857.36	3,449,958.99	246,829,816.35
其中：基金申购款	248,689,770.39	3,586,560.83	252,276,331.22
基金赎回款	-5,309,913.03	-136,601.84	-5,446,514.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	229,918,002.77	-14,495,458.84	215,422,543.93

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,048,424.51
定期存款利息收入	40,277.78
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	480,135.35
其他	30,056.52
合计	1,598,894.16

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,438,252,564.05
减：卖出股票成本总额	4,525,837,938.00
买卖股票差价收入	-87,585,373.95

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	22,711.20
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	22,711.20

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	231,485.31
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	208,698.63
减：应收利息总额	75.48
买卖债券差价收入	22,711.20

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-9,885,340.00

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	23,432,419.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,432,419.02

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-324,007,111.86
——股票投资	-324,007,111.86
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-



——其他	-
2. 衍生工具	-7,677,508.77
——权证投资	-
——股指期货投资	-7,677,508.77
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	-331,684,620.63

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	1,820,491.28
基金转换费收入	81,871.18
合计	1,902,362.46

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	15,070,755.70
银行间市场交易费用	-
合计	15,070,755.70

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	47,604.81
信息披露费	148,689.00
指数使用费	220,012.87
债券托管账户维护费	13,500.00
银行划款手续费	21,256.68
其他	-
合计	451,063.36

指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000 元。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、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。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	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。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	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 0.20%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 X0.20%/当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 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。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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9日	新发未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

##### 6.4.12.2 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	-

			重组							
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 3月 27日	重大 资产 重组	2.02	2018 年 8月 16日	1.83	1,505,600	3,242,546.00	3,041,312.00	-
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 纺织 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5月2日	重大资产重组	6.40	-	-	15,349	125,210.79	98,233.60	-
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。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.12.4 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、由风险管理委员会、督察长、内控合规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内控合规部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

### 6.4.12.5 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

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

#### 6.4.12.5.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.12.5.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.12.5.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.12.5.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	208,698.63
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	208,698.63

以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、同业存单及资产支持证券等。

#### 6.4.12.5.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.12.5.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.12.6 流动性风险

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

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

##### 6.4.12.6.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 6.4.12.6.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.12.7 市场风险

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

##### 6.4.12.7.1 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于

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

#### 6.4.12.7.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	238,014,468.27	0.00	-	-	238,014,468.27
结算备付金	53,513,060.41	-	-	-	53,513,060.41
存出保证金	45,928,056.10	-	-	-	45,928,056.10
交易性金融资产	-	-	-	-2,930,412,765.96	2,930,412,765.96
衍生金融资产	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	113,001,903.46	113,001,903.46
应收利息	-	-	-	70,802.02	70,802.02
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	15,645,412.72	15,645,412.72
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	337,455,584.78	0.00	0.00	3,059,130,884.16	3,396,586,468.94
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	-	-	0.00
短期借款	-	-	-	-	0.00
交易性金融负债	-	-	-	-	0.00
衍生金融负债	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	29,319,336.51	29,319,336.51
应付管理人报酬	-	-	-	2,564,440.74	2,564,440.74
应付托管费	-	-	-	512,888.15	512,888.15
应付销售服务费	-	-	-	115,501.02	115,501.02
应付交易费用	-	-	-	11,450,613.40	11,450,613.40
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	649,404.22	649,404.22
负债总计	0.00	0.00	0.00	44,612,184.04	44,612,184.04
利率敏感度缺口	337,455,584.78	0.00	0.00	3,014,518,700.12	3,351,974,284.90
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	118,644,671.43	0.00	-	-	118,644,671.43
结算备付金	28,355,358.17	-	-	-	28,355,358.17
存出保证金	12,484,079.52	-	-	-	12,484,079.52
交易性金融资产	0.00	0.00	208,698.63	1,749,087,808.73	1,749,296,507.36
衍生金融资产	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	30,000,000.00	0.00	-	-	30,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	33,575,296.98	33,575,296.98
应收利息	-	-	-	95,040.63	95,040.63
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	7,732,146.14	7,732,146.14
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	189,484,109.12	0.00	208,698.63	1,790,490,292.48	1,980,183,100.23
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	-	-	0.00
短期借款	-	-	-	-	0.00
交易性金融负债	-	-	-	-	0.00
衍生金融负债	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	7,682,721.71	7,682,721.71
应付赎回款	-	-	-	5,184,442.45	5,184,442.45
应付管理人报酬	-	-	-	1,378,441.81	1,378,441.81
应付托管费	-	-	-	275,688.38	275,688.38
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	4,294,909.93	4,294,909.93
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	587,759.02	587,759.02
负债总计	0.00	0.00	0.00	19,403,963.30	19,403,963.30
利率敏感度缺口	189,484,109.12	0.00	208,698.63	1,771,086,329.18	1,960,779,136.93

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

#### 6.4.12.7.1.2 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。

#### 6.4.12.7.2 外汇风险

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

### 6.4.12.7.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金为以完全复制为目标的被动型指数基金，按照成份股在中证 500 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.12.7.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	2,930,412,765.96	87.42	1,749,087,808.73	89.20
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	208,698.63	0.01
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	2,930,412,765.96	87.42	1,749,296,507.36	89.21

#### 6.4.12.7.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	166,731,347.43	96,595,462.94
	业绩比较基准下降 5%	-166,731,347.43	-96,595,462.94

#### 6.4.12.7.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.13 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。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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
11	000581	威孚高科	1,133,837	25,069,136.07	0.75
12	600056	中国医药	1,328,224	24,266,652.48	0.72
13	002056	横店东磁	3,382,117	23,708,640.17	0.71
14	002251	步步高	2,059,325	23,435,118.50	0.70
15	000926	福星股份	3,229,977	23,223,534.63	0.69
16	600499	科达洁能	3,071,184	21,068,322.24	0.63
17	000592	平潭发展	7,391,151	20,990,868.84	0.63
18	600017	日照港	6,528,850	20,957,608.50	0.63
19	000501	鄂武商 A	1,652,904	20,314,190.16	0.61
20	000426	兴业矿业	2,811,143	20,268,341.03	0.60
21	002299	圣农发展	1,276,712	19,776,268.88	0.59
22	000887	中鼎股份	1,333,300	19,212,853.00	0.57
23	600755	厦门国贸	2,628,341	19,160,605.89	0.57
24	600872	中炬高新	671,217	18,794,076.00	0.56
25	002176	江特电机	1,910,640	18,571,420.80	0.55
26	300055	万邦达	1,593,695	18,311,555.55	0.55

27	300418	昆仑万维	942,662	17,797,458.56	0.53
28	000703	恒逸石化	1,186,831	17,660,045.28	0.53
29	002640	跨境通	1,173,300	17,622,966.00	0.53
30	002268	卫士通	801,300	17,492,379.00	0.52
31	002416	爱施德	2,959,320	17,371,208.40	0.52
32	000732	泰禾集团	872,900	16,977,905.00	0.51
33	600282	南钢股份	3,697,461	16,342,777.62	0.49
34	002491	通鼎互联	1,475,652	16,335,467.64	0.49
35	300324	旋极信息	1,712,750	16,253,997.50	0.48
36	000656	金科股份	3,365,500	16,154,400.00	0.48
37	300308	中际旭创	268,600	16,126,744.00	0.48
38	002179	中航光电	412,359	16,082,001.00	0.48
39	000488	晨鸣纸业	1,227,381	15,857,762.52	0.47
40	600618	氯碱化工	1,836,034	15,624,649.34	0.47
41	600801	华新水泥	1,038,325	15,606,024.75	0.47
42	002463	沪电股份	4,135,042	15,465,057.08	0.46
43	002589	瑞康医药	1,124,350	15,336,134.00	0.46
44	000039	中集集团	1,123,357	14,918,180.96	0.45
45	000541	佛山照明	2,465,207	14,766,589.93	0.44
46	600521	华海药业	548,321	14,634,687.49	0.44
47	002583	海能达	1,751,760	14,627,196.00	0.44
48	600597	光明乳业	1,481,195	14,619,394.65	0.44
49	002127	南极电商	1,552,910	14,581,824.90	0.44
50	002340	格林美	2,393,000	14,477,650.00	0.43
51	600649	城投控股	2,358,693	14,435,201.16	0.43
52	002078	太阳纸业	1,471,402	14,257,885.38	0.43
53	600584	长电科技	839,667	14,223,958.98	0.42
54	600748	上实发展	2,814,882	14,187,005.28	0.42
55	000552	靖远煤电	4,326,505	14,147,671.35	0.42
56	000830	鲁西化工	798,101	13,631,565.08	0.41
57	601000	唐山港	5,769,380	13,558,043.00	0.40
58	600642	申能股份	2,635,942	13,232,428.84	0.39
59	600062	华润双鹤	537,458	13,194,593.90	0.39
60	300244	迪安诊断	675,654	12,844,182.54	0.38
61	600655	豫园股份	1,354,010	12,795,394.50	0.38
62	300182	捷成股份	1,682,400	12,752,592.00	0.38
63	600260	凯乐科技	474,742	12,742,075.28	0.38
64	601168	西部矿业	2,025,703	12,721,414.84	0.38
65	600765	中航重机	1,669,325	12,419,778.00	0.37

66	002118	紫鑫药业	1,730,100	12,370,215.00	0.37
67	600426	华鲁恒升	694,800	12,221,532.00	0.36
68	002428	云南锗业	1,579,713	12,195,384.36	0.36
69	002603	以岭药业	867,100	12,122,058.00	0.36
70	603019	中科曙光	262,941	12,061,103.67	0.36
71	002709	天赐材料	312,300	12,036,042.00	0.36
72	600970	中材国际	1,784,575	11,920,961.00	0.36
73	002129	中环股份	1,521,500	11,913,345.00	0.36
74	002440	闰土股份	1,013,550	11,848,399.50	0.35
75	002390	信邦制药	1,603,545	11,737,949.40	0.35
76	300315	掌趣科技	2,728,200	11,403,876.00	0.34
77	600460	士兰微	909,900	11,100,780.00	0.33
78	002110	三钢闽光	691,700	11,087,951.00	0.33
79	002384	东山精密	459,560	11,029,440.00	0.33
80	601928	凤凰传媒	1,801,043	10,950,341.44	0.33
81	000977	浪潮信息	448,600	10,699,110.00	0.32
82	000661	长春高新	46,826	10,662,280.20	0.32
83	000636	风华高科	669,598	10,633,216.24	0.32
84	603025	大豪科技	548,757	10,612,960.38	0.32
85	300266	兴源环境	634,743	10,581,165.81	0.32
86	600729	重庆百货	314,690	10,369,035.50	0.31
87	600787	中储股份	1,289,340	9,979,491.60	0.30
88	300274	阳光电源	1,112,162	9,976,093.14	0.30
89	002049	紫光国微	225,013	9,927,573.56	0.30
90	002332	仙琚制药	1,132,400	9,908,500.00	0.30
91	002359	北讯集团	501,900	9,827,202.00	0.29
92	300383	光环新网	714,601	9,582,799.41	0.29
93	000997	新大陆	574,261	9,044,610.75	0.27
94	601020	华钰矿业	652,554	8,998,719.66	0.27
95	600160	巨化股份	1,201,066	8,791,803.12	0.26
96	002048	宁波华翔	708,562	8,736,569.46	0.26
97	002051	中工国际	563,192	8,599,941.84	0.26
98	600179	安通控股	837,218	8,481,018.34	0.25
99	300287	飞利信	1,163,400	8,364,846.00	0.25
100	601717	郑煤机	1,434,110	8,332,179.10	0.25
101	002261	拓维信息	1,799,800	8,279,080.00	0.25
102	002041	登海种业	1,205,965	8,224,681.30	0.25
103	603766	隆鑫通用	1,508,609	8,191,746.87	0.24
104	600466	蓝光发展	1,314,021	8,146,930.20	0.24

105	600582	天地科技	2,204,277	8,089,696.59	0.24
106	600428	中远海特	2,271,626	8,064,272.30	0.24
107	002366	台海核电	564,500	8,049,770.00	0.24
108	600094	大名城	1,383,330	7,967,980.80	0.24
109	002191	劲嘉股份	1,065,539	7,959,576.33	0.24
110	000536	华映科技	2,883,009	7,928,274.75	0.24
111	600694	大商股份	243,801	7,925,970.51	0.24
112	300376	易事特	1,465,600	7,870,272.00	0.23
113	000543	皖能电力	1,775,600	7,830,396.00	0.23
114	600557	康缘药业	619,469	7,650,442.15	0.23
115	600058	五矿发展	918,021	7,628,754.51	0.23
116	000778	新兴铸管	1,753,300	7,504,124.00	0.22
117	603816	顾家家居	101,910	7,491,404.10	0.22
118	600300	维维股份	2,259,781	7,366,886.06	0.22
119	603328	依顿电子	676,657	7,341,728.45	0.22
120	600418	江淮汽车	1,120,500	7,294,455.00	0.22
121	002657	中科金财	454,700	7,202,448.00	0.21
122	600338	西藏珠峰	340,360	7,052,259.20	0.21
123	300088	长信科技	1,197,300	6,944,340.00	0.21
124	600256	广汇能源	1,694,480	6,930,423.20	0.21
125	600859	王府井	324,835	6,909,240.45	0.21
126	000612	焦作万方	1,302,406	6,837,631.50	0.20
127	600298	安琪酵母	187,536	6,691,284.48	0.20
128	600266	北京城建	710,903	6,682,488.20	0.20
129	002345	潮宏基	761,100	6,545,460.00	0.20
130	300001	特锐德	561,891	6,383,081.76	0.19
131	002588	史丹利	1,217,500	6,306,650.00	0.19
132	600006	东风汽车	1,530,447	6,259,528.23	0.19
133	002544	杰赛科技	456,134	6,244,474.46	0.19
134	600600	青岛啤酒	140,080	6,139,706.40	0.18
135	002180	纳思达	220,300	6,049,438.00	0.18
136	600183	生益科技	651,979	5,972,127.64	0.18
137	000418	小天鹅 A	85,120	5,903,072.00	0.18
138	600664	哈药股份	1,452,260	5,765,472.20	0.17
139	002707	众信旅游	594,530	5,707,488.00	0.17
140	000028	国药一致	113,685	5,672,881.50	0.17
141	002503	搜于特	1,610,834	5,637,919.00	0.17
142	600410	华胜天成	643,238	5,628,332.50	0.17
143	600151	航天机电	1,373,802	5,577,636.12	0.17

144	000686	东北证券	864,500	5,541,445.00	0.17
145	603883	老百姓	66,600	5,538,456.00	0.17
146	000513	丽珠集团	125,748	5,526,624.60	0.16
147	600614	鹏起科技	911,002	5,201,821.42	0.16
148	603369	今世缘	227,218	5,187,386.94	0.15
149	002663	普邦股份	1,745,753	5,184,886.41	0.15
150	002038	双鹭药业	134,473	5,108,629.27	0.15
151	600863	内蒙华电	2,235,693	5,075,023.11	0.15
152	600743	华远地产	1,949,974	5,011,433.18	0.15
153	600108	亚盛集团	1,730,822	5,002,075.58	0.15
154	600885	宏发股份	166,996	4,996,520.32	0.15
155	600657	信达地产	1,166,180	4,956,265.00	0.15
156	600759	洲际油气	1,243,595	4,899,764.30	0.15
157	603444	吉比特	38,100	4,868,799.00	0.15
158	601233	桐昆股份	279,454	4,812,197.88	0.14
159	300166	东方国信	325,500	4,794,615.00	0.14
160	000807	云铝股份	921,200	4,771,816.00	0.14
161	600623	华谊集团	476,600	4,756,468.00	0.14
162	000930	中粮生化	434,440	4,474,732.00	0.13
163	300159	新研股份	615,600	4,358,448.00	0.13
164	600598	北大荒	468,800	4,294,208.00	0.13
165	600350	山东高速	1,057,100	4,281,255.00	0.13
166	603556	海兴电力	232,680	4,227,795.60	0.13
167	002439	启明星辰	197,704	4,195,278.88	0.13
168	000031	中粮地产	703,090	4,063,860.20	0.12
169	600545	卓郎智能	496,679	3,943,631.26	0.12
170	600315	上海家化	98,700	3,911,481.00	0.12
171	600835	上海机电	206,499	3,894,571.14	0.12
172	600258	首旅酒店	139,900	3,801,083.00	0.11
173	000528	柳工	341,839	3,661,095.69	0.11
174	600737	中粮糖业	481,100	3,627,494.00	0.11
175	002285	世联行	530,573	3,326,692.71	0.10
176	002815	崇达技术	205,800	3,313,380.00	0.10
177	002073	软控股份	550,897	3,167,657.75	0.09
178	000021	深科技	454,100	3,096,962.00	0.09
179	000690	宝新能源	444,800	3,095,808.00	0.09
180	002221	东华能源	312,125	3,049,461.25	0.09
181	600022	山东钢铁	1,505,600	3,041,312.00	0.09
182	603169	兰石重装	597,322	2,992,583.22	0.09

183	601128	常熟银行	488,600	2,794,792.00	0.08
184	002212	南洋股份	234,000	2,782,260.00	0.08
185	600751	海航科技	410,415	2,663,593.35	0.08
186	002482	广田集团	445,000	2,656,650.00	0.08
187	300134	大富科技	283,502	2,534,507.88	0.08
188	600754	锦江股份	64,593	2,387,357.28	0.07
189	000990	诚志股份	170,308	2,384,312.00	0.07
190	002426	胜利精密	649,700	2,338,920.00	0.07
191	002414	高德红外	173,570	2,332,780.80	0.07
192	002573	清新环境	201,700	2,329,635.00	0.07
193	600079	人福医药	174,141	2,302,144.02	0.07
194	002266	浙富控股	612,830	2,298,112.50	0.07
195	000750	国海证券	637,900	2,277,303.00	0.07
196	600277	亿利洁能	425,507	2,229,656.68	0.07
197	000006	深振业 A	361,600	2,118,976.00	0.06
198	601689	拓普集团	108,900	2,117,016.00	0.06
199	002916	深南电路	32,600	2,070,426.00	0.06
200	002128	露天煤业	228,210	2,067,582.60	0.06
201	000598	兴蓉环境	501,511	2,036,134.66	0.06
202	600750	江中药业	113,827	2,020,429.25	0.06
203	300197	铁汉生态	357,900	1,921,923.00	0.06
204	603188	亚邦股份	187,500	1,912,500.00	0.06
205	002317	众生药业	178,343	1,885,085.51	0.06
206	603589	口子窖	30,593	1,879,939.85	0.06
207	600640	号百控股	183,581	1,867,018.77	0.06
208	600875	东方电气	250,053	1,852,892.73	0.06
209	600823	世茂股份	434,140	1,814,705.20	0.05
210	600643	爱建集团	192,322	1,807,826.80	0.05
211	002400	省广集团	553,600	1,788,128.00	0.05
212	002223	鱼跃医疗	90,429	1,762,461.21	0.05
213	002505	大康农业	803,180	1,718,805.20	0.05
214	000012	南玻 A	346,932	1,717,313.40	0.05
215	000729	燕京啤酒	238,800	1,607,124.00	0.05
216	603899	晨光文具	49,600	1,571,824.00	0.05
217	000563	陕国投 A	447,500	1,521,500.00	0.05
218	002152	广电运通	248,239	1,459,645.32	0.04
219	600317	营口港	634,218	1,433,332.68	0.04
220	600138	中青旅	71,600	1,426,988.00	0.04
221	002093	国脉科技	181,300	1,397,823.00	0.04



222	002509	天广中茂	479,700	1,395,927.00	0.04
223	603806	福斯特	62,500	1,375,625.00	0.04
224	600064	南京高科	185,240	1,359,661.60	0.04
225	601311	骆驼股份	114,100	1,308,727.00	0.04
226	002276	万马股份	209,300	1,222,312.00	0.04
227	002699	美盛文化	64,540	1,210,770.40	0.04
228	600291	西水股份	87,000	1,162,320.00	0.03
229	300133	华策影视	104,200	1,109,730.00	0.03
230	600267	海正药业	75,700	1,100,678.00	0.03
231	603868	飞科电器	22,600	1,093,162.00	0.03
232	603515	欧普照明	23,210	1,084,835.40	0.03
233	601969	海南矿业	195,200	1,069,696.00	0.03
234	000008	神州高铁	206,100	1,022,256.00	0.03
235	600325	华发股份	128,200	990,986.00	0.03
236	600639	浦东金桥	73,701	919,788.48	0.03
237	600366	宁波韵升	141,287	861,850.70	0.03
238	002424	贵州百灵	75,000	852,000.00	0.03
239	300026	红日药业	218,300	796,795.00	0.02
240	002281	光迅科技	36,400	771,680.00	0.02
241	600978	宜华生活	105,607	721,295.81	0.02
242	600673	东阳光科	64,060	661,739.80	0.02
243	002368	太极股份	22,200	645,354.00	0.02
244	600651	飞乐音响	164,782	642,649.80	0.02
245	000877	天山股份	87,700	591,975.00	0.02
246	600862	中航高科	75,400	463,710.00	0.01
247	000960	锡业股份	33,200	398,732.00	0.01
248	000089	深圳机场	49,639	379,738.35	0.01
249	000829	天音控股	51,400	376,762.00	0.01
250	002690	美亚光电	6,300	150,192.00	0.00
251	002642	荣之联	15,000	137,850.00	0.00
252	600329	中新药业	7,000	133,000.00	0.00
253	600884	杉杉股份	5,954	131,583.40	0.00
254	000848	承德露露	11,547	122,282.73	0.00
255	300199	翰宇药业	8,033	114,711.24	0.00
256	603355	莱克电气	3,622	108,841.10	0.00
257	601098	中南传媒	8,401	106,188.64	0.00
258	600270	外运发展	4,921	103,144.16	0.00
259	002011	盾安环境	15,349	98,233.60	0.00
260	002431	棕榈股份	13,100	87,901.00	0.00

261	002512	达华智能	8,703	84,419.10	0.00
262	002477	雏鹰农牧	8,000	26,480.00	0.00
263	600335	国机汽车	22	229.46	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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
6	300398	飞凯材料	860,786	16,836,974.16	0.50
7	600153	建发股份	1,818,006	16,343,873.94	0.49
8	600059	古越龙山	1,876,269	15,291,592.35	0.46
9	000858	五粮液	196,300	14,918,800.00	0.45
10	002626	金达威	856,336	14,857,429.60	0.44
11	300226	上海钢联	242,756	14,528,946.60	0.43
12	002001	新和成	766,180	14,526,772.80	0.43
13	002095	生意宝	403,506	14,481,830.34	0.43
14	002429	兆驰股份	5,546,700	13,755,816.00	0.41
15	002518	科士达	1,282,161	12,783,145.17	0.38
16	600093	易见股份	1,080,517	10,891,611.36	0.32
17	300294	博雅生物	330,179	10,232,247.21	0.31
18	300422	博世科	672,200	9,578,850.00	0.29
19	300415	伊之密	1,015,013	9,459,921.16	0.28
20	300174	元力股份	437,738	9,271,290.84	0.28
21	600809	山西汾酒	146,700	9,225,963.00	0.28
22	300011	鼎汉技术	1,425,159	9,092,514.42	0.27
23	600346	恒力股份	610,433	8,948,947.78	0.27
24	000876	新希望	1,320,401	8,371,342.34	0.25
25	600009	上海机场	149,800	8,310,904.00	0.25
26	002644	佛慈制药	761,400	7,857,648.00	0.23
27	002449	国星光电	730,340	7,770,817.60	0.23
28	002668	奥马电器	381,000	7,658,100.00	0.23

29	000998	隆平高科	404,931	7,636,998.66	0.23
30	002376	新北洋	451,545	7,468,554.30	0.22
31	300033	同花顺	185,400	7,206,498.00	0.21
32	002812	创新股份	146,000	7,172,980.00	0.21
33	300477	合纵科技	353,400	6,813,552.00	0.20
34	603799	华友钴业	68,800	6,705,936.00	0.20
35	300607	拓斯达	109,265	6,569,011.80	0.20
36	002343	慈文传媒	342,940	6,436,983.80	0.19
37	000059	华锦股份	898,994	6,194,068.66	0.18
38	000938	紫光股份	98,800	6,184,880.00	0.18
39	600966	博汇纸业	1,375,095	5,926,659.45	0.18
40	000961	中南建设	886,200	5,591,922.00	0.17
41	000537	广宇发展	578,167	5,573,529.88	0.17
42	300232	洲明科技	555,605	5,489,377.40	0.16
43	000413	东旭光电	899,200	5,449,152.00	0.16
44	601222	林洋能源	1,092,000	5,438,160.00	0.16
45	601898	中煤能源	1,113,053	5,376,045.99	0.16
46	002055	得润电子	323,700	5,163,015.00	0.15
47	002334	英威腾	878,325	5,138,201.25	0.15
48	002531	天顺风能	1,180,873	5,136,797.55	0.15
49	300207	欣旺达	557,776	5,025,561.76	0.15
50	000669	金鸿控股	682,563	4,948,581.75	0.15
51	002501	利源精制	785,480	4,869,976.00	0.15
52	300309	吉艾科技	236,330	4,792,772.40	0.14
53	002832	比音勒芬	127,495	4,717,315.00	0.14
54	000639	西王食品	358,513	4,599,721.79	0.14
55	002303	美盈森	865,800	4,571,424.00	0.14
56	002536	西泵股份	411,601	4,515,262.97	0.13
57	600480	凌云股份	460,200	4,427,124.00	0.13
58	603986	兆易创新	40,600	4,405,912.00	0.13
59	300467	迅游科技	136,216	4,372,533.60	0.13
60	300388	国祯环保	221,700	4,272,159.00	0.13
61	600438	通威股份	604,746	4,172,747.40	0.12
62	300145	中金环境	510,493	3,997,160.19	0.12
63	002462	嘉事堂	203,400	3,945,960.00	0.12
64	002304	洋河股份	29,500	3,882,200.00	0.12
65	600702	舍得酒业	107,500	3,879,675.00	0.12
66	300298	三诺生物	185,516	3,836,470.88	0.11
67	300142	沃森生物	187,200	3,740,256.00	0.11

68	600516	方大炭素	151,013	3,681,696.94	0.11
69	002724	海洋王	643,024	3,594,504.16	0.11
70	300618	寒锐钴业	27,900	3,580,686.00	0.11
71	601997	贵阳银行	288,500	3,565,860.00	0.11
72	000786	北新建材	188,660	3,495,869.80	0.10
73	300427	红相股份	234,630	3,378,672.00	0.10
74	300004	南风股份	849,700	3,330,824.00	0.10
75	600919	江苏银行	499,300	3,200,513.00	0.10
76	002534	杭锅股份	472,692	3,200,124.84	0.10
77	002106	莱宝高科	553,462	3,187,941.12	0.10
78	300122	智飞生物	66,989	3,064,076.86	0.09
79	600567	山鹰纸业	789,400	3,047,084.00	0.09
80	601137	博威合金	350,400	2,831,232.00	0.08
81	002124	天邦股份	632,382	2,731,890.24	0.08
82	000725	京东方 A	755,500	2,674,470.00	0.08
83	601186	中国铁建	302,959	2,611,506.58	0.08
84	000719	中原传媒	388,601	2,599,740.69	0.08
85	002311	海大集团	121,786	2,569,684.60	0.08
86	601288	农业银行	744,600	2,561,424.00	0.08
87	300219	鸿利智汇	257,600	2,493,568.00	0.07
88	600057	厦门象屿	497,315	2,481,601.85	0.07
89	000100	TCL 集团	855,100	2,479,790.00	0.07
90	002314	南山控股	582,330	2,346,789.90	0.07
91	600061	国投资本	237,119	2,200,464.32	0.07
92	002567	唐人神	485,100	2,197,503.00	0.07
93	300328	宜安科技	290,380	2,172,042.40	0.06
94	000666	经纬纺机	109,300	1,976,144.00	0.06
95	601058	赛轮金宇	791,000	1,922,130.00	0.06
96	300101	振芯科技	134,900	1,906,137.00	0.06
97	600019	宝钢股份	242,500	1,889,075.00	0.06
98	600028	中国石化	278,800	1,809,412.00	0.05
99	000099	中信海直	278,987	1,774,357.32	0.05
100	002685	华东重机	214,580	1,765,993.40	0.05
101	300178	腾邦国际	124,539	1,751,018.34	0.05
102	600015	华夏银行	228,100	1,699,345.00	0.05
103	603889	新澳股份	159,900	1,664,559.00	0.05
104	601166	兴业银行	113,600	1,635,840.00	0.05
105	300409	道氏技术	39,000	1,564,290.00	0.05
106	600211	西藏药业	43,675	1,561,381.25	0.05

107	002557	洽洽食品	101,754	1,551,748.50	0.05
108	600012	皖通高速	260,092	1,550,148.32	0.05
109	600736	苏州高新	245,800	1,487,090.00	0.04
110	601888	中国国旅	22,800	1,468,548.00	0.04
111	600519	贵州茅台	2,000	1,462,920.00	0.04
112	002454	松芝股份	241,450	1,417,311.50	0.04
113	002738	中矿资源	60,459	1,313,774.07	0.04
114	600805	悦达投资	251,000	1,280,100.00	0.04
115	600745	闻泰科技	48,600	1,242,216.00	0.04
116	601111	中国国航	138,800	1,233,932.00	0.04
117	000671	阳光城	196,200	1,171,314.00	0.03
118	002556	辉隆股份	223,100	1,115,500.00	0.03
119	600708	光明地产	259,335	1,115,140.50	0.03
120	603808	歌力思	49,300	1,109,743.00	0.03
121	300021	大禹节水	212,000	1,098,160.00	0.03
122	601628	中国人寿	48,000	1,080,960.00	0.03
123	002240	威华股份	82,700	1,075,100.00	0.03
124	002537	海联金汇	110,920	1,047,084.80	0.03
125	002594	比亚迪	21,600	1,029,888.00	0.03
126	603993	洛阳钼业	154,200	969,918.00	0.03
127	601633	长城汽车	95,200	934,864.00	0.03
128	600662	强生控股	234,300	934,857.00	0.03
129	002614	奥佳华	44,917	929,332.73	0.03
130	002565	顺灏股份	176,700	881,733.00	0.03
131	000791	甘肃电投	195,300	859,320.00	0.03
132	600486	扬农化工	13,800	771,834.00	0.02
133	300459	金科文化	74,200	716,772.00	0.02
134	601988	中国银行	195,300	705,033.00	0.02
135	002737	葵花药业	32,300	698,649.00	0.02
136	300229	拓尔思	43,200	686,016.00	0.02
137	300353	东土科技	52,800	675,312.00	0.02
138	000823	超声电子	94,939	670,269.34	0.02
139	300335	迪森股份	60,955	648,561.20	0.02
140	000776	广发证券	45,800	607,766.00	0.02
141	600566	济川药业	12,481	601,459.39	0.02
142	601238	广汽集团	52,473	584,549.22	0.02
143	000063	中兴通讯	42,200	549,866.00	0.02
144	300204	舒泰神	49,500	535,590.00	0.02
145	600676	交运股份	104,800	520,856.00	0.02

146	600873	梅花生物	122,000	509,960.00	0.02
147	300323	华灿光电	38,200	493,544.00	0.01
148	600023	浙能电力	104,400	486,504.00	0.01
149	300476	胜宏科技	30,600	471,240.00	0.01
150	300432	富临精工	51,100	447,636.00	0.01
151	300406	九强生物	30,100	433,440.00	0.01
152	601318	中国平安	6,646	389,322.68	0.01
153	601788	光大证券	34,800	382,104.00	0.01
154	300367	东方网力	17,600	220,000.00	0.01
155	002383	合众思壮	9,800	162,190.00	0.00
156	002050	三花智控	8,200	154,570.00	0.00
157	300061	康旗股份	13,800	147,660.00	0.00
158	300271	华宇软件	8,300	146,744.00	0.00
159	600742	一汽富维	11,710	143,213.30	0.00
160	002132	恒星科技	43,600	131,672.00	0.00
161	002405	四维图新	6,250	126,562.50	0.00
162	002099	海翔药业	24,491	125,638.83	0.00
163	600104	上汽集团	3,550	124,214.50	0.00
164	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.00
165	002153	石基信息	4,236	122,844.00	0.00
166	600373	中文传媒	9,500	122,075.00	0.00
167	300365	恒华科技	5,900	121,717.00	0.00
168	002624	完美世界	3,907	121,156.07	0.00
169	300258	精锻科技	8,742	120,202.50	0.00
170	300124	汇川技术	3,600	118,152.00	0.00
171	300081	恒信东方	10,242	111,842.64	0.00
172	600782	新钢股份	19,900	111,042.00	0.00
173	601699	潞安环能	11,900	110,194.00	0.00
174	000915	山大华特	5,427	109,136.97	0.00
175	300554	三超新材	3,060	107,834.40	0.00
176	000423	东阿阿胶	1,989	107,028.09	0.00
177	002164	宁波东力	18,358	106,109.24	0.00
178	600085	同仁堂	2,973	104,887.44	0.00
179	300201	海伦哲	22,700	102,377.00	0.00
180	002089	新海宜	16,100	97,405.00	0.00
181	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
182	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
183	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00
184	601330	绿色动力	71	1,160.14	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	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。

### 7.4.2 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	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。

### 7.4.3 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	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。

### 7.5 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。

### 7.6 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

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所有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。

## 7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	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

**7.12.4 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。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

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。

**7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

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

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
建信中证 500 指数增强 A	288,204	4,998.01	180,733,806.75	12.55%	1,259,712,183.37	87.45%
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	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2018年6月30日
2	建信基金管理有限责任公司关于调整旗下部分开放式基金申购、赎回、转换业务规则的公告	指定报刊和/或公司网站	2018年6月15日
3	关于建信基金管理有限责任公司旗下部分证券投资基金修改基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2018年3月23日
4	关于建信基金管理有限责任公司旗下部分证券投资基金调整赎回费率及赎回费计入基金财产比例的公告	指定报刊和/或公司网站	2018年3月23日
5	关于公司旗下部分开放式基金参加光大银行电子渠道基金申购及定投费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2018年3月20日
6	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	指定报刊和/或公司网站	2018年3月15日

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 11.3 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

2018 年 8 月 25 日