

# 建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	53
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	建信中证 1000 指数增强	
基金主代码	006165	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 11 月 22 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	31,250,123.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	006165	006166
报告期末下属分级基金的份额总额	22,347,014.48 份	8,903,108.74 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	<p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 1000 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。</p> <p>本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。</p> <p>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	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场

基金、债券型基金、混合型基金。
-----------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	胡波
	联系电话	010-66228888	021-61618888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95528
传真		010-66228001	021-63602540
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	上海市北京东路 689 号
邮政编码		100033	200001
法定代表人		孙志晨	郑杨

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)	
	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	7,070,220.61	2,495,150.44
本期利润	8,273,609.12	2,918,744.50
加权平均基金份 额本期利润	0.3718	0.3627

本期加权平均净值利润率	25.66%	25.15%
本期基金份额净值增长率	28.30%	28.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	13,186,201.86	5,163,512.94
期末可供分配基金份额利润	0.5901	0.5800
期末基金资产净值	37,488,194.50	14,840,850.56
期末基金份额净值	1.6775	1.6669
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	70.86%	69.79%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。 2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	11.57%	0.86%	8.21%	0.85%	3.36%	0.01%

过去三个月	23.90%	1.12%	15.59%	1.17%	8.31%	-0.05%
过去六个月	28.30%	1.78%	12.92%	1.79%	15.38%	-0.01%
过去一年	38.85%	1.48%	17.93%	1.48%	20.92%	0.00%
自基金合同生效起 至今	70.86%	1.49%	29.03%	1.58%	41.83%	-0.09%

建信中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①-③	②-④
过去一个月	11.54%	0.86%	8.21%	0.85%	3.33%	0.01%
过去三个月	23.79%	1.12%	15.59%	1.17%	8.20%	-0.05%
过去六个月	28.05%	1.78%	12.92%	1.79%	15.13%	-0.01%
过去一年	38.36%	1.48%	17.93%	1.48%	20.43%	0.00%
自基金合同生效起 至今	69.79%	1.49%	29.03%	1.58%	40.76%	-0.09%

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

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



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



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，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 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、基础设施投资部、网络金融部、人力资源管理部、基金会计部、注册登记部、财务管理部、金融科技部、投资风险管理部、内控合规部和审计部，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、石家庄六个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司以及在香港设立建信资产管理（香港）有限公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家资产管理行业的领跑者”。

截至 2020 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、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、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、建信富时 100 指数型证券投资基金、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、建信灵活配置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 6 个月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、建信短债债券型证券投资基金、建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、建信睿怡纯债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（LOF）、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 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及其联接基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、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、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、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 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、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、建信优享稳健养老目标一年持有期

混合型基金中基金（FOF）、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金，建信高股息主题股票型证券投资基金、建信科技创新混合型证券投资基金、建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金共计 126 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 4939.77 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		
赵云煜	本基金的基金经理	2018 年 11 月 22 日	-	7 年	赵云煜先生，硕士。2012 年 11 月加入太平资产管理有限公司，任风险管理分析师；2014 年 7 月加入建信基金，历任助理研究员、研究员、基金经理助理、基金经理。2016 年 6 月 22 日至 2018 年 11 月 7 日任专户投资经理。2018 年 11 月 16 日起任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日起任建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 9 月 11 日起任建信中证红利潜力指数证券投资基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日起任建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。
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	2018 年 11 月 22 日	-	12 年	叶乐天先生，金融工程及指数投资部副总经理，博士。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

				<p>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;2018年8月24日起任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年11月22日起任建信中证1000指数增强型发起式证券投资基金的基金经理;2019年11月13日起任建信MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的涵含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人,保护投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办

法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 2 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，权益市场波动较大，整体上行，本基金平稳开展投资运作。本基金为指数增强基金，目标是在跟踪指数的基础上，力争超越指数本身的收益。基金在严格管理股票组合和基准之间的相对风险的基础上，主要采用以建信多因子模型为主的量化选股模型进行个股选择。报告期间，从相对风险角度，基金组合与基准指数基本保持了行业和风格配置的中性，较好地控制了基金的跟踪误差。同时，从超额收益角度，本基金成功超越了基准，获取了较高的超额回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 28.30%，波动率 1.78%，本报告期本基金 C 净值增长率 28.05%，波动率 1.78%；业绩比较基准收益率 12.92%，波动率 1.79%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年上半年，主要受到疫情的影响，权益市场波动较为剧烈。在流动性较为宽松和部分行业景气提升的背景下，A 股仍取得上行。细分来看，权益市场一季度涨跌互现，二季度整体向好；风格层面，中小市值股票表现优于大市值，医药和部分消费行业表现强劲，而部分周期行业表现弱势。展望下半年，于内经济仍将持续修复改善，流动性继续收紧的风险较小，而各类产业政策对国内经济新的格局的形成值得关注。于外，全球经济尚待复苏，中美形势仍面临较多的扰动。对于股票市场，各板块盈利情况的变化仍是最为主要的因素，整体市场预期将继续保持区间震荡。本基金将密切跟踪市场动态，持续提升模型的效果，精选个券，谨慎管理组合风险，力争为投资

者提供稳健超越业绩基准的回报。

#### 4.6 管理人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、投资风险管理部门和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 23 日，本基金基金资产净值低于五千万元超过连续 20 个工作日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》（2014 年 8 月 8 日生效）第四十一条的要求，现将该情况在本次报告中予以披露。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由建信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,561,847.47	3,609,141.15
结算备付金		304,294.94	251,292.39
存出保证金		19,120.37	16,002.76
交易性金融资产	6.4.7.2	49,004,915.14	38,920,808.89
其中：股票投资		49,004,915.14	38,920,808.89
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		3,047.88	-
应收利息	6.4.7.5	865.57	1,546.99
应收股利		-	-
应收申购款		617,298.78	40,618.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		53,511,390.15	42,839,410.93
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019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		496,679.27	5.40
应付赎回款		319,156.91	893,125.73
应付管理人报酬		40,426.94	36,056.02
应付托管费		8,085.41	7,211.19
应付销售服务费		4,283.51	3,862.17
应付交易费用	6.4.7.7	175,822.08	135,023.12
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	137,890.97	378,103.25
负债合计		1,182,345.09	1,453,386.88
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	31,250,123.22	31,687,184.76
未分配利润	6.4.7.10	21,078,921.84	9,698,839.29
所有者权益合计		52,329,045.06	41,386,024.05
负债和所有者权益总计		53,511,390.15	42,839,410.93

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 31,250,123.22 份，其中建信中证 1000 指数增强 A 基金份额总额 22,347,014.48 份，基金份额净值 1.6775 元；建信中证 1000 指数增强 C 基金份额总额 8,903,108.74 份，基金份额净值 1.6669 元。

## 6.2 利润表

会计主体：建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		12,034,878.88	6,113,498.39
1. 利息收入		25,317.43	30,464.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,317.43	26,688.76
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,775.35
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,328,679.89	6,406,360.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,035,582.54	6,077,876.86
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.16	293,097.35	328,484.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,626,982.57	-384,238.71
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	53,898.99	60,912.06
减：二、费用		842,525.26	894,052.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	217,988.34	177,402.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	43,597.67	35,480.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	23,029.41	18,888.04
4. 交易费用	6.4.7.19	487,183.50	417,565.62
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	70,726.34	244,716.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,192,353.62	5,219,445.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,192,353.62	5,219,445.74

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	31,687,184.76	9,698,839.29	41,386,024.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,192,353.62	11,192,353.62
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）	-437,061.54	187,728.93	-249,332.61
其中：1. 基金申购款	26,074,468.73	11,560,694.51	37,635,163.24
2. 基金赎回款	-26,511,530.27	-11,372,965.58	-37,884,495.85
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）	31,250,123.22	21,078,921.84	52,329,045.06
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	29,370,128.89	70,598.41	29,440,727.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,219,445.74	5,219,445.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	6,749,520.87	3,004,821.40	9,754,342.27

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	38,255,965.01	8,369,691.13	46,625,656.14
2. 基金赎回款	-31,506,444.14	-5,364,869.73	-36,871,313.87
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)	36,119,649.76	8,294,865.55	44,414,515.31

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

吴灵玲

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 1000 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可 [2018]1029 号《关于准予建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 99,635,875.53 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0686 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 99,645,967.84 份基金份额,其中认购资金利息折合 10,092.31 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的,称为 A 类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基

基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、货币市场工具（含同业存单）、银行存款、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于中证 1000 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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[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]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。

(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。

(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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	3,561,847.47
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	3,561,847.47

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	46,328,465.26	49,004,915.14	2,676,449.88
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	46,328,465.26	49,004,915.14	2,676,449.88

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	719.97
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	136.90
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	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	8.70
合计	865.57

## 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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	175,822.08
银行间市场应付交易费用	-
合计	175,822.08

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	631.32
应付证券出借违约金	-
应付指数使用费	10,000.00
预提费用	127,259.65
合计	137,890.97

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,682,792.79	23,682,792.79
本期申购	13,095,456.16	13,095,456.16
本期赎回（以“-”号填列）	-14,431,234.47	-14,431,234.47
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	22,347,014.48	22,347,014.48

建信中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,004,391.97	8,004,391.97
本期申购	12,979,012.57	12,979,012.57
本期赎回（以“-”号填列）	-12,080,295.80	-12,080,295.80
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	8,903,108.74	8,903,108.74

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

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

建信中证 1000 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,304,110.91	979,028.43	7,283,139.34
本期利润	7,070,220.61	1,203,388.51	8,273,609.12
本期基金份额 交易产生的变 动数	-188,129.66	-227,438.78	-415,568.44
其中：基金申	5,598,955.87	261,547.61	5,860,503.48

购款			
基金赎回款	-5,787,085.53	-488,986.39	-6,276,071.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,186,201.86	1,954,978.16	15,141,180.02
建信中证 1000 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,086,430.05	329,269.90	2,415,699.95
本期利润	2,495,150.44	423,594.06	2,918,744.50
本期基金份额交易产生的变动数	581,932.45	21,364.92	603,297.37
其中：基金申购款	5,351,159.46	349,031.57	5,700,191.03
基金赎回款	-4,769,227.01	-327,666.65	-5,096,893.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,163,512.94	774,228.88	5,937,741.82

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
活期存款利息收入		23,332.01
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		1,838.45
其他		146.97
合计		25,317.43

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		10,035,582.54
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		10,035,582.54

## 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	161,658,051.71
减：卖出股票成本总额	151,622,469.17
买卖股票差价收入	10,035,582.54

## 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 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

无。

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

## 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

无。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	293,097.35
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	293,097.35

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	1,626,982.57
股票投资	1,626,982.57
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,626,982.57

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	52,340.01
基金转换费收入	1,558.98
合计	53,898.99

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	487,183.50
银行间市场交易费用	-
合计	487,183.50

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,000.30
指数使用费	20,000.00
合计	70,726.34

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	217,988.34	177,402.46
其中：支付销售机构的客户维护费	58,849.85	61,430.98

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

## 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
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	43,597.67	35,480.51

注：支付基金托管人上海浦东发展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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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 1000 指数增强	建信中证 1000 指数增强	合计
	A	C	
中国建设银行	-	10,025.84	10,025.84
建信基金	-	207.51	207.51
上海浦东发展银行	-	800.36	800.36
合计	-	11,033.71	11,033.71
获得销售服务费的各关联	上年度可比期间		

方名称	2019 年 1 月 1 日至 2019 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 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C	合计
中国建设银行	-	7,070.12	7,070.12
建信基金	-	229.19	229.19
上海浦东发展银行	-	517.03	517.03
合计	-	7,816.34	7,816.34

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.4%。销售服务费的计算公式为： $\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}$ 。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
		建信中证 1000 指数增强 A
基金合同生效日(2018 年 11 月 22 日)持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	10,186,234.82	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,186,234.82	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	45.58%	-
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
	建信中证1000指数增强A	建信中证1000指数增强C
基金合同生效日(2018年11月22日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	37.37%	-

注：分级持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
上海浦东发展银行-活期	3,561,847.47	23,332.01	2,919,760.61	23,067.46

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

无。

## 6.4.12 期末(2020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
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新发未上市	5.94	5.94	900	5,346.00	5,346.00	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新发未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新发未上市	17.63	17.63	423	7,457.49	7,457.49	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新发未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

## 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、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。

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情

况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	3,561,847.47	-	-	-	3,561,847.47
结算备付金	304,294.94	-	-	-	304,294.94
存出保证金	19,120.37	-	-	-	19,120.37
交易性金融资产	-	-	-	49,004,915.14	49,004,915.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,047.88	3,047.88
应收利息	-	-	-	865.57	865.57
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	617,298.78	617,298.78
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,885,262.78	-	-	49,626,127.37	53,511,390.15
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	496,679.27	496,679.27
应付赎回款	-	-	-	319,156.91	319,156.91
应付管理人报酬	-	-	-	40,426.94	40,426.94
应付托管费	-	-	-	8,085.41	8,085.41
应付销售服务费	-	-	-	4,283.51	4,283.51
应付交易费用	-	-	-	175,822.08	175,822.08
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	137,890.97	137,890.97
负债总计	-	-	-	1,182,345.09	1,182,345.09
利率敏感度缺口	3,885,262.78	-	-	48,443,782.28	52,329,045.06
上年度末 2019 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	3,609,141.15	-	-	-	3,609,141.15
结算备付金	251,292.39	-	-	-	251,292.39
存出保证金	16,002.76	-	-	-	16,002.76
交易性金融资产	-	-	-	38,920,808.89	38,920,808.89
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,546.99	1,546.99
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	40,618.75	40,618.75
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,876,436.30	-	-	38,962,974.63	42,839,410.93
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	5.40	5.40
应付赎回款	-	-	-	893,125.73	893,125.73
应付管理人报酬	-	-	-	36,056.02	36,056.02
应付托管费	-	-	-	7,211.19	7,211.19
应付销售服务费	-	-	-	3,862.17	3,862.17
应付交易费用	-	-	-	135,023.12	135,023.12
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	378,103.25	378,103.25
负债总计	-	-	1,453,386.88	1,453,386.88
利率敏感度缺口	3,876,436.30	-	37,509,587.75	41,386,024.05

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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。

本基金采用指数增强型投资策略，以中证 1000 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于中证 1000 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	49,004,915.14	93.65	38,920,808.89	94.04
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	49,004,915.14	93.65	38,920,808.89	94.04

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	2,557,582.98	1,945,390.17
	业绩比较基准下降5%	-2,557,582.98	-1,945,390.17

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

###### 6.4.14.1.1 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，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2020年6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人民币48,980,782.67元，属于第二层次的余额为人民币24,132.47元，属

于第三层次的余额为人民币 0.00 元(于 2019 年 6 月 30 日, 属于第一层次的余额为人民币 41,633,782.94 元, 属于第二层次的余额为人民币 33,869.94 元, 属于第三层次的余额为人民币 0.00 元)。

#### 6.4.14.1.2.2 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可转换债券等证券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况, 本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次, 并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次, 确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 6.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 6.4.14.2 承诺事项

无。

#### 6.4.14.3 其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	49,004,915.14	91.58
	其中: 股票	49,004,915.14	91.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,866,142.41	7.22
8	其他各项资产	640,332.60	1.20

9	合计	53,511,390.15	100.00
---	----	---------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	168,726.00	0.32
B	采矿业	1,543,245.00	2.95
C	制造业	24,693,673.92	47.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	454,230.00	0.87
E	建筑业	1,214,984.00	2.32
F	批发和零售业	2,480,540.00	4.74
G	交通运输、仓储和邮政业	597,221.00	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,485,485.60	10.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	492,115.00	0.94
L	租赁和商务服务业	661,532.00	1.26
M	科学研究和技术服务业	767,574.80	1.47
N	水利、环境和公共设施管理业	987,601.00	1.89
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	618,953.00	1.18
S	综合	252,873.00	0.48
	合计	40,418,754.32	77.24

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	49,200.00	0.09
B	采矿业	86,724.00	0.17
C	制造业	6,492,408.20	12.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,554.96	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	325,004.80	0.62

G	交通运输、仓储和邮政业	391,008.90	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	254,628.96	0.49
J	金融业	-	-
K	房地产业	418,033.00	0.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	130,848.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	107,400.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	323,350.00	0.62
S	综合	-	-
	合计	8,586,160.82	16.41

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603111	康尼机电	135,000	835,650.00	1.60
2	002531	天顺风能	134,514	804,393.72	1.54
3	300036	超图软件	31,100	783,098.00	1.50
4	002216	三全食品	32,100	767,190.00	1.47
5	601001	大同煤业	155,000	607,600.00	1.16
6	603360	百傲化学	31,100	604,273.00	1.15
7	002697	红旗连锁	51,700	564,564.00	1.08
8	300607	拓斯达	13,680	556,639.20	1.06
9	600963	岳阳林纸	156,600	555,930.00	1.06
10	603063	禾望电气	77,000	548,240.00	1.05
11	002912	中新赛克	3,100	507,129.00	0.97
12	300737	科顺股份	25,600	505,088.00	0.97
13	000965	天保基建	151,420	492,115.00	0.94

14	603727	博迈科	27,700	491,675.00	0.94
15	603368	柳药股份	20,820	477,819.00	0.91
16	300502	新易盛	7,520	474,662.40	0.91
17	300684	中石科技	13,500	468,450.00	0.90
18	600477	杭萧钢构	122,200	443,586.00	0.85
19	300709	精研科技	4,520	434,598.00	0.83
20	300679	电连技术	13,500	431,730.00	0.83
21	603363	傲农生物	18,100	422,997.00	0.81
22	603359	东珠生态	24,900	416,577.00	0.80
23	300476	胜宏科技	17,300	416,065.00	0.80
24	002312	三泰控股	90,200	410,410.00	0.78
25	300031	宝通科技	16,200	405,648.00	0.78
26	002568	百润股份	8,876	402,260.32	0.77
27	603345	安井食品	3,400	401,200.00	0.77
28	601116	三江购物	27,200	388,688.00	0.74
29	300256	星星科技	61,000	386,740.00	0.74
30	002214	大立科技	13,300	374,794.00	0.72
31	002777	久远银海	12,140	369,177.40	0.71
32	000555	神州信息	23,900	367,582.00	0.70
33	002562	兄弟科技	69,800	366,450.00	0.70
34	300552	万集科技	8,440	359,375.20	0.69
35	002245	澳洋顺昌	92,500	357,975.00	0.68
36	300770	新媒股份	1,600	357,856.00	0.68
37	300457	赢合科技	10,550	336,334.00	0.64
38	000034	神州数码	13,800	335,892.00	0.64
39	300394	天孚通信	5,600	333,480.00	0.64
40	002519	银河电子	79,400	329,510.00	0.63
41	600496	精工钢构	97,400	326,290.00	0.62
42	603612	索通发展	28,000	319,760.00	0.61
43	002063	远光软件	25,200	318,276.00	0.61
44	300533	冰川网络	8,600	311,148.00	0.59
45	002512	达华智能	61,100	308,555.00	0.59
46	002705	新宝股份	8,300	302,784.00	0.58
47	002435	长江健康	82,000	302,580.00	0.58
48	600400	红豆股份	87,600	296,088.00	0.57
49	603018	中设集团	30,380	295,597.40	0.56
50	300604	长川科技	9,600	295,584.00	0.56
51	300699	光威复材	4,700	294,831.00	0.56
52	601900	南方传媒	31,900	288,376.00	0.55
53	600055	万东医疗	18,000	288,180.00	0.55
54	603313	梦百合	12,100	284,713.00	0.54
55	300266	兴源环境	86,500	283,720.00	0.54

56	300702	天宇股份	2,600	276,432.00	0.53
57	300661	圣邦股份	900	274,545.00	0.52
58	600966	博汇纸业	26,800	272,020.00	0.52
59	601058	赛轮轮胎	76,800	271,104.00	0.52
60	300773	拉卡拉	7,600	264,252.00	0.50
61	603686	龙马环卫	10,600	258,322.00	0.49
62	002443	金洲管道	37,800	257,418.00	0.49
63	601020	华钰矿业	32,900	256,620.00	0.49
64	300379	东方通	5,900	253,877.00	0.49
65	603596	伯特利	7,100	249,920.00	0.48
66	000915	山大华特	7,600	248,900.00	0.48
67	002015	协鑫能科	46,900	246,694.00	0.47
68	002727	一心堂	6,600	244,926.00	0.47
69	300424	航新科技	18,000	240,840.00	0.46
70	300238	冠昊生物	13,500	240,435.00	0.46
71	300662	科锐国际	5,400	240,300.00	0.46
72	600882	妙可蓝多	6,600	239,514.00	0.46
73	603713	密尔克卫	2,300	239,246.00	0.46
74	002100	天康生物	14,600	235,060.00	0.45
75	002706	良信电器	14,000	233,520.00	0.45
76	300723	一品红	5,400	232,686.00	0.44
77	300223	北京君正	2,300	232,162.00	0.44
78	600136	当代文体	28,400	231,744.00	0.44
79	603456	九洲药业	8,500	230,350.00	0.44
80	603708	家家悦	4,500	221,670.00	0.42
81	300676	华大基因	1,400	218,274.00	0.42
82	300176	派生科技	40,400	214,928.00	0.41
83	603008	喜临门	20,000	214,600.00	0.41
84	600636	国新文化	17,100	210,330.00	0.40
85	600063	皖维高新	63,700	207,662.00	0.40
86	002791	坚朗五金	2,200	206,998.00	0.40
87	300388	国祯环保	22,200	204,684.00	0.39
88	603533	掌阅科技	5,200	198,276.00	0.38
89	002428	云南锗业	17,200	196,080.00	0.37
90	002318	久立特材	26,700	194,910.00	0.37
91	300724	捷佳伟创	2,200	194,766.00	0.37
92	601137	博威合金	12,300	192,372.00	0.37
93	002869	金溢科技	2,900	191,632.00	0.37
94	603666	亿嘉和	2,180	191,316.80	0.37
95	600603	广汇物流	39,600	186,516.00	0.36
96	000544	中原环保	27,800	180,978.00	0.35
97	002065	东华软件	14,000	175,280.00	0.33

98	300397	天和防务	7,100	173,311.00	0.33
99	002301	齐心集团	10,500	172,410.00	0.33
100	600975	新五丰	18,300	168,726.00	0.32
101	603606	东方电缆	11,600	168,664.00	0.32
102	002695	煌上煌	6,600	166,452.00	0.32
103	300078	思创医惠	12,100	163,713.00	0.31
104	300326	凯利泰	5,600	162,960.00	0.31
105	600093	易见股份	13,900	162,908.00	0.31
106	300363	博腾股份	4,700	162,432.00	0.31
107	300327	中颖电子	5,000	162,000.00	0.31
108	300559	佳发教育	7,500	159,150.00	0.30
109	002436	兴森科技	11,800	151,394.00	0.29
110	002683	宏大爆破	4,300	150,070.00	0.29
111	603127	昭衍新药	1,380	145,079.40	0.28
112	000996	中国中期	16,400	141,696.00	0.27
113	300119	瑞普生物	6,300	140,805.00	0.27
114	600057	厦门象屿	25,300	138,644.00	0.26
115	002850	科达利	2,000	138,400.00	0.26
116	600612	老凤祥	2,869	138,257.11	0.26
117	600449	宁夏建材	11,300	138,086.00	0.26
118	300037	新宙邦	2,500	137,650.00	0.26
119	603887	城地股份	5,600	136,640.00	0.26
120	300613	富瀚微	1,200	135,960.00	0.26
121	300602	飞荣达	4,096	134,430.72	0.26
122	002335	科华恒盛	6,300	132,867.00	0.25
123	002135	东南网架	17,700	130,095.00	0.25
124	002139	拓邦股份	23,000	129,490.00	0.25
125	300735	光弘科技	6,920	127,674.00	0.24
126	603005	晶方科技	1,600	125,856.00	0.24
127	002332	仙琚制药	7,300	122,932.00	0.23
128	300409	道氏技术	10,900	122,298.00	0.23
129	002261	拓维信息	14,900	121,584.00	0.23
130	000733	振华科技	5,400	121,446.00	0.23
131	300659	中孚信息	2,000	120,040.00	0.23
132	603648	畅联股份	13,600	119,680.00	0.23
133	300666	江丰电子	1,900	113,392.00	0.22
134	002409	雅克科技	2,100	109,557.00	0.21
135	300284	苏交科	14,600	108,624.00	0.21
136	002605	姚记科技	2,800	106,400.00	0.20
137	300463	迈克生物	1,800	104,814.00	0.20
138	600764	中国海防	3,800	96,140.00	0.18
139	300497	富祥药业	4,800	93,936.00	0.18

140	002626	金达威	3,400	88,264.00	0.17
141	002567	唐人神	9,000	85,680.00	0.16
142	603118	共进股份	7,100	84,419.00	0.16
143	600285	羚锐制药	8,945	83,635.75	0.16
144	000035	中国天楹	16,200	82,620.00	0.16
145	300674	宇信科技	1,900	81,985.00	0.16
146	603308	应流股份	3,900	79,560.00	0.15
147	000498	山东路桥	16,300	79,055.00	0.15
148	300369	绿盟科技	3,200	74,528.00	0.14
149	601965	中国汽研	8,300	72,376.00	0.14
150	600200	江苏吴中	10,100	66,357.00	0.13
151	601949	中国出版	12,400	65,100.00	0.12
152	000711	京蓝科技	19,800	63,162.00	0.12
153	000818	航锦科技	2,800	62,524.00	0.12
154	603601	再升科技	4,700	61,570.00	0.12
155	600546	山煤国际	5,100	59,925.00	0.11
156	600601	方正科技	16,500	54,285.00	0.10
157	603520	司太立	600	50,436.00	0.10
158	300226	上海钢联	600	47,160.00	0.09
159	300066	三川智慧	9,400	46,248.00	0.09
160	300755	华致酒行	1,400	45,360.00	0.09
161	300455	康拓红外	2,554	37,926.90	0.07
162	300682	朗新科技	2,200	37,444.00	0.07
163	300191	潜能恒信	2,000	37,280.00	0.07
164	300352	北信源	5,200	36,660.00	0.07
165	000928	中钢国际	9,200	36,156.00	0.07
166	300788	中信出版	700	33,733.00	0.06
167	600131	国网信通	1,400	26,558.00	0.05

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300214	日科化学	51,500	419,210.00	0.80
2	002244	滨江集团	97,900	418,033.00	0.80
3	300482	万孚生物	3,700	384,800.00	0.74
4	603611	诺力股份	16,100	345,506.00	0.66
5	300129	泰胜风能	94,000	344,980.00	0.66
6	603679	华体科技	8,400	330,204.00	0.63
7	300133	华策影视	44,600	323,350.00	0.62
8	603501	韦尔股份	1,600	323,120.00	0.62
9	300447	全信股份	29,500	296,180.00	0.57

10	002414	高德红外	9,300	272,304.00	0.52
11	300308	中际旭创	4,100	258,300.00	0.49
12	002555	三七互娱	5,200	243,360.00	0.47
13	000708	中信特钢	13,180	225,246.20	0.43
14	300041	回天新材	14,200	215,414.00	0.41
15	601872	招商轮船	36,000	209,880.00	0.40
16	002847	盐津铺子	2,200	209,484.00	0.40
17	603416	信捷电气	4,800	191,328.00	0.37
18	603079	圣达生物	6,200	183,706.00	0.35
19	600026	中远海能	27,400	177,004.00	0.34
20	600745	闻泰科技	1,400	176,330.00	0.34
21	300558	贝达药业	1,200	167,976.00	0.32
22	603707	健友股份	2,500	161,425.00	0.31
23	300548	博创科技	2,620	156,676.00	0.30
24	300206	理邦仪器	8,500	155,040.00	0.30
25	000513	丽珠集团	3,200	153,632.00	0.29
26	002124	天邦股份	11,800	151,630.00	0.29
27	603197	保隆科技	4,800	141,984.00	0.27
28	002434	万里扬	15,700	136,276.00	0.26
29	603233	大参林	1,640	133,200.80	0.25
30	603200	上海洗霸	3,200	130,848.00	0.25
31	002901	大博医疗	1,000	119,290.00	0.23
32	300417	南华仪器	6,540	118,243.20	0.23
33	002048	宁波华翔	7,500	115,800.00	0.22
34	603031	安德利	3,200	113,600.00	0.22
35	300416	苏试试验	4,850	109,658.50	0.21
36	603882	金域医学	1,200	107,400.00	0.21
37	002876	三利谱	1,900	100,510.00	0.19
38	601808	中海油服	6,600	86,724.00	0.17
39	600998	九州通	4,200	78,204.00	0.15
40	002223	鱼跃医疗	1,800	65,520.00	0.13
41	300577	开润股份	2,400	64,728.00	0.12
42	603866	桃李面包	1,200	61,068.00	0.12
43	002548	金新农	7,530	59,411.70	0.11
44	603566	普莱柯	1,900	52,611.00	0.10
45	300715	凯伦股份	1,400	52,192.00	0.10
46	002714	牧原股份	600	49,200.00	0.09
47	002557	洽洽食品	800	43,352.00	0.08
48	600060	海信视像	3,400	41,310.00	0.08
49	300639	凯普生物	600	31,158.00	0.06
50	300842	帝科股份	440	17,916.80	0.03
51	603087	甘李药业	150	15,045.00	0.03
52	300839	博汇股份	469	10,979.29	0.02

53	600956	新天绿能	1,499	7,554.96	0.01
54	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
55	300845	捷安高科	423	7,457.49	0.01
56	300840	酷特智能	900	5,346.00	0.01
57	600106	重庆路桥	1,670	4,124.90	0.01
58	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.01

## 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	002244	滨江集团	1,184,333.00	2.86
2	601058	赛轮轮胎	1,024,301.00	2.47
3	600285	羚锐制药	955,943.13	2.31
4	300424	航新科技	943,949.24	2.28
5	603111	康尼机电	943,056.00	2.28
6	002912	中新赛克	934,767.00	2.26
7	002531	天顺风能	907,863.59	2.19
8	300114	中航电测	902,090.00	2.18
9	600496	精工钢构	901,452.00	2.18
10	603063	禾望电气	898,557.00	2.17
11	603360	百傲化学	896,482.40	2.17
12	603596	伯特利	873,574.04	2.11
13	300036	超图软件	832,998.00	2.01
14	002697	红旗连锁	830,908.00	2.01
15	300369	绿盟科技	821,279.00	1.98
16	300709	精研科技	810,486.00	1.96
17	000829	天音控股	805,145.68	1.95
18	002832	比音勒芬	768,998.00	1.86
19	600720	祁连山	765,846.00	1.85
20	000810	创维数字	738,573.00	1.78

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002792	通宇通讯	1,285,740.44	3.11
2	300130	新国都	1,224,526.00	2.96
3	300602	飞荣达	1,205,273.22	2.91
4	300369	绿盟科技	1,138,106.00	2.75
5	600720	祁连山	1,111,597.00	2.69
6	603609	禾丰牧业	1,089,284.00	2.63

7	300726	宏达电子	1,038,404.29	2.51
8	300487	蓝晓科技	1,031,384.70	2.49
9	601058	赛轮轮胎	1,012,170.00	2.45
10	002511	中顺洁柔	1,008,567.00	2.44
11	002557	洽洽食品	972,880.00	2.35
12	002832	比音勒芬	964,193.00	2.33
13	600612	老凤祥	961,524.00	2.32
14	002367	康力电梯	927,282.00	2.24
15	600459	贵研铂业	907,340.35	2.19
16	601677	明泰铝业	891,564.00	2.15
17	002697	红旗连锁	887,294.00	2.14
18	300043	星辉娱乐	857,470.00	2.07
19	300596	利安隆	854,755.00	2.07
20	300114	中航电测	849,621.00	2.05
21	300595	欧普康视	847,735.00	2.05
22	300118	东方日升	844,878.00	2.04
23	600285	羚锐制药	831,077.00	2.01

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	160,079,592.85
卖出股票收入（成交）总额	161,658,051.71

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无。

**7.10 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**

无。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

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

无。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

无。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1**

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，南京康尼机电股份有限公司于 2020 年 5 月 13 日发布公告，公司于 2020 年 5 月 12 日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字【2020】28 号）。经查明，康尼机电涉嫌违法的事实如下：康尼机电披露的《重组报告书》未披露龙昕科技存单质押情况；2015 年至 2017 年，龙昕科技存在虚增收入、利润等财务造假行为，康尼机电披露的《重组报告书（草案）》、《重组报告书》存在虚假记载。中国证监会拟决定对南京康尼机电股份有限公司责令改正、给予警告，并处以 30 万元罚款。

**7.12.2**

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	19,120.37
2	应收证券清算款	3,047.88

3	应收股利	-
4	应收利息	865.57
5	应收申购款	617,298.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	640,332.60

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

无。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
建信中证1000指数增强A	2,080	10,743.76	10,186,234.82	45.58	12,160,779.66	54.42
建信中证1000指数	2,087	4,265.98	-	-	8,903,108.74	100.00

增强 C						
合计	4,167	7,499.43	10,186,234.82	32.60	21,063,888.40	67.40

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信中证 1000 指数增强 A	61,759.01	0.28
	建信中证 1000 指数增强 C	17,103.07	0.19
	合计	78,862.08	0.25

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

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,186,234.82	32.60	10,186,234.82	32.60	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,186,234.82	32.60	10,186,234.82	32.60	3 年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 1000 指数增强 A	建信中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2018 年 11 月 22 日) 基金份额总额	50,945,615.13	48,700,352.71
本报告期期初基金份 额总额	23,682,792.79	8,004,391.97
本报告期基金总申购 份额	13,095,456.16	12,979,012.57
减：本报告期基金总 赎回份额	14,431,234.47	12,080,295.80
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	22,347,014.48	8,903,108.74

注：上述总申购份额含转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

## § 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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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

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

师事务所未发生改变。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期末发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、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。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	
长城证券	1	216,061,944.02	67.28%	201,219.24	67.76%	-
长江证券	1	105,092,732.93	32.72%	95,728.43	32.24%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

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

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

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

（4）佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 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	建信基金管理有限责任公司关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-10
2	建信基金管理有限责任公司关于新增阳光人寿为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-05
3	建信基金管理有限责任公司关于增加大连网金基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-30
4	建信基金管理有限责任公司关于增加华瑞保险销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-08

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2020 年 01 月 01 日-2020 年 06 月 30 日	10,186,234.82	-	-	10,186,234.82	32.60
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况,可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险,敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制,持续做好基金流动性风险的管控工作,审慎评估大额申赎对基金运作的影响,采取有效措施切实保护持有							

人合法权益。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2020 年 8 月 28 日