

# 建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指 数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：中国国际金融股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 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 .....	5
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 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
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 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	42
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 .....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58

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 .....	58
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
7.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
8.4 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 .....	61
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
10.4 基金投资策略的改变 .....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
10.8 其他重大事件 .....	63
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>64</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 .....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>64</b>
12.1 备查文件目录 .....	64
12.2 存放地点 .....	65
12.3 查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	建信 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	建信 MSCI
基金主代码	512180
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 19 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国国际金融股份有限公司
报告期末基金份额总额	112,048,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 21 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，本基金的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际通指数(英文：MSCI China A Inclusion RMB Index)。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。

### 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	中国国际金融股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	陈艳艳
	联系电话	010-66228888	010-65051166-1964
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	AC_Product@cicc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	010-65353060; 010-65351622
传真		010-66228001	010-65059873
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区建外门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝	北京市朝阳区建外门外大街 1 号

	国际金融中心 16 层	国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
邮政编码	100033	100004
法定代表人	孙志晨	沈如军

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	20,148,521.85
本期利润	14,773,673.81
加权平均基金份额本期利润	0.1260
本期加权平均净值利润率	8.07%
本期基金份额净值增长率	8.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	72,298,208.75
期末可供分配基金份额利润	0.6452
期末基金资产净值	184,346,208.75
期末基金份额净值	1.6452
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	64.52%

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。

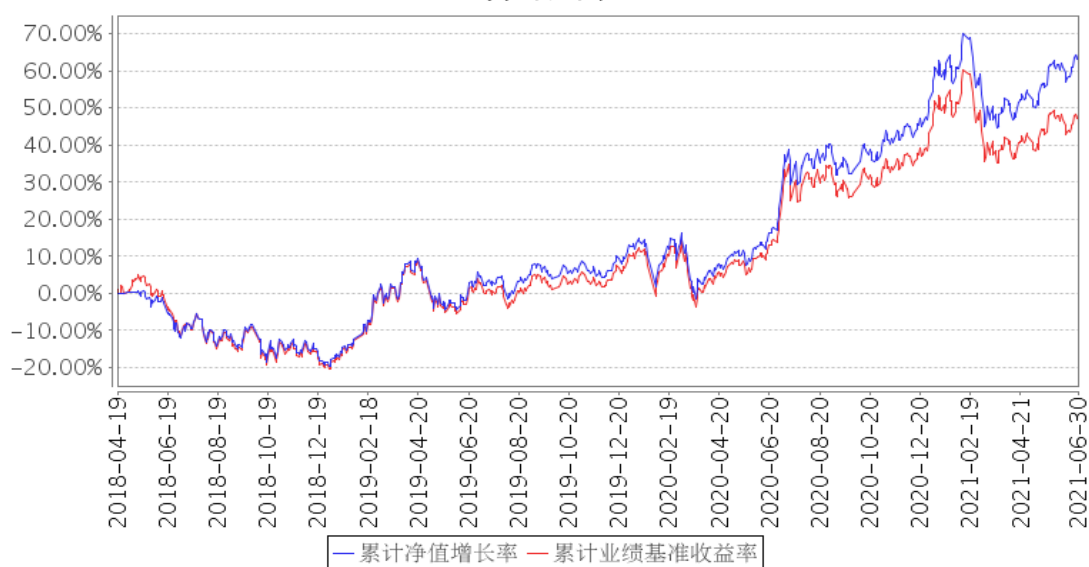
## 3.2 基金净值表现

### 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

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	1.44%	0.81%	-0.55%	0.84%	1.99%	-0.03%
过去三个月	10.57%	0.93%	6.84%	0.98%	3.73%	-0.05%
过去六个月	8.29%	1.29%	3.38%	1.32%	4.91%	-0.03%
过去一年	38.43%	1.30%	28.40%	1.33%	10.03%	-0.03%
过去三年	79.12%	1.33%	59.85%	1.36%	19.27%	-0.03%
自基金合同生效起至今	64.52%	1.31%	48.10%	1.34%	16.42%	-0.03%

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

建信MSCI中国A股国际通ETF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、国际投资与业务发展部、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、证券公司客户部、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 2021 年 6 月 30 日，公司旗下有建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信利率债债券型证券投资基金基金、建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金、建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信恒久价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信环保产业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、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金(FOF)、建信睿丰纯债定期开放债券型发起



式证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金 (FOF)、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金、建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信短债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、建信稳定得利债券型证券投资基金、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、建信多因子量化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、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、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、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数证券投资基金 (LOF)、建信优势动力混合型证券投资基金 (LOF)、建信周盈安心理财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、建信裕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、建信现金增利货币市场基金、建信睿享纯债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、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、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、建信上海金交易型开放式证券投资基金、建信上海金交易型开放式证券投资基金联接基金、建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人 (MOM) 证券投资基金、建信智能生活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)、建信安心回报 6 个月定期开放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、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、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、建信收益增强债券型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信鑫稳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、建信中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、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发起式联接基金、建信臻选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、建信恒安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、建信高端医疗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、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣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、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金、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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信利率债策略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、建信食品饮料行业股票型证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金、建信高端装备股票型证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金(QDII)、建信新兴市场优选混合型证券投资基金(QDII)、建信富时 100 指数型证券投资基金(QDII)、建信中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、建信泓利一年持有期债券型证券投资基金、建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、建信裕丰利率债三个月定期开放债券型证券投资基金共计 135 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 5785.77 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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理，本基金	2018 年 4 月 19 日	-	18 年	梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理，博士。特许金融分析师（CFA）。2003 年 1 月至 2005 年 8 月就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划

	金的基金经理			<p>发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005 年 8 月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009 年 11 月 5 日起任建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理；2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 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；2011 年 9 月 8 日至 2016 年 7 月 20 日任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金（ETF）及其联接基金的基金经理；2012 年 3 月 16 日起任建信深证 100 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 3 月 25 日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理，该基金自 2020 年 5 月 7 日转型为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF），梁洪昀继续担任该基金的基金经理；2015 年 7 月 31 日至 2018 年 7 月 31 日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 6 日至 2016 年 10 月 25 日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 6 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 6 月 13 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2018 年 2 月 7 日起任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 4 月 19 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 5 月 16 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</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证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

无。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》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

本报告期内未出现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。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在报告期内，保持高仓位运行，以满足上市运作以及跟踪误差控制要求。在报告期内，基金标的指数成分股进行了两次例行调整，此外，还发生过若干次成分股临时调整。管理人根据相应信息，对申赎清单文件及基金组合进行了相应操作，比较有效地控制了组合的跟踪误差，也保证了基金的平稳运作。由于四舍五入取整等原因，基金申赎清单中股票的权重结构与标的指数成分股的权重之间可能存在一定差异，这会给基金组合对标的指数的跟踪造成一定误差。管理人对组合结构进行适当调整，尽力降低了这些不利影响，跟踪误差和偏离度都保持在了合理水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 8.29% 波动率 1.29% 业绩比较基准收益率 3.38% 波动率 1.32%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年，随着疫苗的推出，全球经济和生活从疫情的巨大冲击中逐渐恢复。各国央行此前为应对冲击，普遍实施了力度很大的宽松货币政策，从而对通胀水平及其预期以及资产价格波动均产生了影响。而 Covid-19 变异病毒的出现导致各国疫情出现反复，从而扰动了经济恢复和流动性回收的节奏，未来仍需紧密关注国际和国内货币政策和流动性环境的变化情况。2021 年年中，国家出台了一系列行业政策改革，对于资本市场产生了一定影响。着眼于改善民生、科技强国等角度的政策改革可能会成为长期趋势，影响到股市相应的行业，并提升国家经济的整体竞争力和发展潜力，进一步改善资本市场的基本面。本管理人将根据基金合同，继续秉承复制策略，力争将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

#### 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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国国际金融股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《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有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，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地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，本基金未进行收益分配。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,726,941.13	4,830,455.16
结算备付金		124,267.49	50,294.71
存出保证金		33,044.05	83,132.59

交易性金融资产	6.4.7.2	175,855,809.45	192,980,091.63
其中：股票投资		175,855,809.45	192,969,091.68
基金投资		-	-
债券投资		-	10,999.95
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		270,105.31	206,199.59
应收利息	6.4.7.5	2,263.11	1,136.92
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		188,012,430.54	198,151,310.60
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		74,510.54	79,922.26
应付托管费		14,902.14	15,984.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,344,725.05	3,309,642.09
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	232,084.06	202,624.50
负债合计		3,666,221.79	3,608,173.26
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	112,048,000.00	128,048,000.00
未分配利润	6.4.7.10	72,298,208.75	66,495,137.34
所有者权益合计		184,346,208.75	194,543,137.34
负债和所有者权益总计		188,012,430.54	198,151,310.60

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6452 元，基金份额总额 112,048,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 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
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		15,591,596.53	11,777,522.96
1. 利息收入		30,551.96	69,905.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,550.37	69,905.67
债券利息收入		1.59	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,900,335.33	30,944,387.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	19,668,960.99	29,205,400.71
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,606.97	-
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	1,223,767.37	1,738,986.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,374,848.04	-19,556,173.58
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	35,557.28	319,403.42
减：二、费用		817,922.72	1,630,156.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	455,554.43	764,015.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	91,110.88	152,803.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	119,786.69	535,274.91
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	151,470.72	178,063.18



三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,773,673.81	10,147,366.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,773,673.81	10,147,366.32

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	128,048,000.00	66,495,137.34	194,543,137.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,773,673.81	14,773,673.81
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）	-16,000,000.00	-8,970,602.40	-24,970,602.40
其中：1. 基金申购款	8,000,000.00	4,377,540.14	12,377,540.14
2. 基金赎回款	-24,000,000.00	-13,348,142.54	-37,348,142.54
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）	112,048,000.00	72,298,208.75	184,346,208.75
项目	上年度可比期间 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）	388,048,000.00	44,801,126.77	432,849,126.77
二、本期经营活	-	10,147,366.32	10,147,366.32

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-200,000,000.00	-19,495,289.87	-219,495,289.87
其中：1. 基金申购款	114,000,000.00	8,536,871.14	122,536,871.14
2. 基金赎回款	-314,000,000.00	-28,032,161.01	-342,032,161.01
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）	188,048,000.00	35,453,203.22	223,501,203.22

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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(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]503 号《关于准予建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 2,046,048,000.00 元(含募集股票市值),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 0258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,046,048,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国国际金融

股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”) 上证自律监管决定书[2018]61 号审核同意, 本基金于 2018 年 5 月 21 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股、国内依法发行上市的非成份股(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(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)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)。基金的投资组合比例为: 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%, 且不低于非现金基金资产的 80%; 权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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, 对现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: MSCI 中国 A 股国际通指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款税后利率 $\times$ 5%。本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司以本基金为目标 ETF, 募集成立了建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“建信 MSCI 联接基金”)。建信 MSCI 联接基金为契约型开放式基金, 投资目标与本基金类似, 将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 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 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	11,726,941.13
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	11,726,941.13

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	132,187,633.08	175,855,809.45	43,668,176.37
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	132,187,633.08	175,855,809.45	43,668,176.37

## 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 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,192.31
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	55.90
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	14.90
合计	2,263.11

## 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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,344,725.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,344,725.05

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付指数使用费	97,781.50
预提费用	134,302.56
合计	232,084.06

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,048,000.00	128,048,000.00
本期申购	8,000,000.00	8,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-24,000,000.00	-24,000,000.00
- 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	112,048,000.00	112,048,000.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	61,100,840.73	5,394,296.61	66,495,137.34
本期利润	20,148,521.85	-5,374,848.04	14,773,673.81
本期基金份额交易产生的变动数	-8,575,800.52	-394,801.88	-8,970,602.40
其中：基金申购款	4,586,910.96	-209,370.82	4,377,540.14
基金赎回款	-13,162,711.48	-185,431.06	-13,348,142.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,673,562.06	-375,353.31	72,298,208.75

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	29,578.88
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	589.39
其他	382.10
合计	30,550.37

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,015,958.78
股票投资收益——赎回差价收入	4,653,002.21
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	19,668,960.99

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	43,345,576.08
减：卖出股票成本总额	28,329,617.30
买卖股票差价收入	15,015,958.78

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	37,348,142.54
减：现金支付赎回款总额	16,446,711.54
减：赎回股票成本总额	16,248,428.79
赎回差价收入	4,653,002.21

##### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

##### 6.4.7.12.5 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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021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	7,606.97
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	7,606.97

## 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	18,608.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,999.95
减：应收利息总额	1.78
买卖债券差价收入	7,606.97

## 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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,223,767.37
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	1,223,767.37

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,374,848.04
股票投资	-5,374,848.04
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	-5,374,848.04

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	35,557.28
合计	35,557.28

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	119,786.69
银行间市场交易费用	-
合计	119,786.69

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,611.16
指数使用费	65,157.00
其他	400.00
合计	151,470.72

#### 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、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	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
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
建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“建信 MSCI 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中金公司	31,585,645.91	47.62	231,017,707.20	69.54

## 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	29,386.81	47.98	3,324,548.13	99.40
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	215,149.39	69.87	3,229,525.64	99.12

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	455,554.43
其中：支付销售机构的客户维护费	49,417.07	66,682.98

注：支付基金管理人的管理人报酬按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。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	91,110.88

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.10%/ 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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自有资金投资本基金的情况

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）

建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	46,318,100.00	41.34	50,145,600.00	39.16
------------------------------------	---------------	-------	---------------	-------

#### 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

无。

#### 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(2021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
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新发未上市	24.60	163.00	223	5,485.80	36,349.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年07月12日	新发未上市	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新发未上市	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新发未上市	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新发未上市	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极	2021年	2021年	新发未上市	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-

	光	1月27日	8月3日	上市							
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新发未上市	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36		-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新发未上市	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55		-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新发未上市	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12		-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新发未上市	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08		-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新发未上市	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47		-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新发未上市	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20		-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新发未上市	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24		-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新发未上市	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80		-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新发未上市	47.33	251.96	132	6,247.56	33,258.72		-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新发未上市	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00		-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新发未上市	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67		-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新发未上市	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44		-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新发未上市	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78		-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新发未上市	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05		-



300972	万辰生物	2021年 4月8日	2021年 10月19日	新发未上市	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年 4月8日	2021年 10月15日	新发未上市	28.28	115.71	174	4,920.72	20,133.54	-
300978	东箭科技	2021年 4月15日	2021年 10月26日	新发未上市	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300986	志特新材	2021年 4月21日	2021年 11月1日	新发未上市	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300992	泰福泵业	2021年 5月17日	2021年 11月25日	新发未上市	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年 5月17日	2021年 11月24日	新发未上市	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年 5月17日	2021年 11月26日	新发未上市	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021年 5月26日	2021年 12月2日	新发未上市	4.94	13.05	899	4,441.06	11,731.95	-
300998	宁波方正	2021年 5月25日	2021年 12月2日	新发未上市	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301004	嘉益股份	2021年 6月18日	2021年 12月27日	新发未上市	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年 6月4日	2021年 12月16日	新发未上市	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年 6月8日	2021年 12月17日	新发未上市	12.54	27.89	565	7,085.10	15,757.85	-
301010	晶雪节能	2021年 6月9日	2021年 12月20日	新发未上市	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年 6月9日	2021年 12月17日	新发未上市	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年 6月15日	2021年 12月	新发未上市	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-

		日	22 日								
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新发未 上市	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81		-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新发未 上市	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46		-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新发未 上市	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50		-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新发未 上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70		-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新发未 上市	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30		-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新发未 上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14		-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新发未 上市	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40		-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新发未 上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39		-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新发未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44		-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新发未 上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06		-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新发未 上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48		-
688276	百克生物	2021 年 6 月 17 日	2021 年 12 月 27 日	新发未 上市	36.35	79.48	1,287	46,782.45	102,290.76		-
688565	力源科技	2021 年 5 月 6 日	2021 年 11 月 15 日	新发未 上市	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00		-
688606	奥泰生物	2021 年 3 月 17 日	2021 年 9 月 27 日	新发未 上市	133.67	139.31	811	108,406.37	112,980.41		-
688661	和林	2021 年	2021 年	新发未	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52		-

	微纳	3月19日	9月29日	上市						
--	----	-------	-------	----	--	--	--	--	--	--

#### 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
600460	士兰微	2021年6月30日	重大资产重组	56.35	2021年7月1日	59.49	5,200	85,847.66	293,020.00	-
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项	5.59	2021年7月6日	6.15	37,500	382,322.79	209,625.00	-

#### 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	10,999.95
未评级	-	-
合计	-	10,999.95

注：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、资产支持证券及同业存单等

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	11,726,941.13	-	-	-	11,726,941.13
结算备付金	124,267.49	-	-	-	124,267.49
存出保证金	33,044.05	-	-	-	33,044.05
交易性金融资产	-	-	-	175,855,809.45	175,855,809.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	270,105.31	270,105.31
应收利息	-	-	-	2,263.11	2,263.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,884,252.67	-	-	176,128,177.87	188,012,430.54
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	74,510.54	74,510.54
应付托管费	-	-	-	14,902.14	14,902.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,344,725.05	3,344,725.05

应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	232,084.06	232,084.06
负债总计	-	-	-	3,666,221.79	3,666,221.79
利率敏感度缺口	11,884,252.67	-	-	-172,461,956.08	184,346,208.75
上年度末 2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	4,830,455.16	-	-	-	4,830,455.16
结算备付金	50,294.71	-	-	-	50,294.71
存出保证金	83,132.59	-	-	-	83,132.59
交易性金融资产	-	-	10,999.95	192,969,091.68	192,980,091.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	206,199.59	206,199.59
应收利息	-	-	-	1,136.92	1,136.92
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,963,882.46	-	10,999.95	193,176,428.19	198,151,310.60
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	79,922.26	79,922.26
应付托管费	-	-	-	15,984.41	15,984.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,309,642.09	3,309,642.09
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	202,624.50	202,624.50
负债总计	-	-	-	3,608,173.26	3,608,173.26
利率敏感度缺口	4,963,882.46	-	10,999.95	189,568,254.93	194,543,137.34

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。

#### 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。

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	175,855,809.45	95.39	192,969,091.68	99.19
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	10,999.95	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	175,855,809.45	95.39	192,980,091.63	99.20

#### 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	8,948,062.85	9,502,471.39
	业绩比较基准下降5%	-8,948,062.85	-9,502,471.39

#### 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2021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174,425,413.18元，属于第二层次的余额为人民币664,794.21元，属于第三层次的余额为人民币765,602.06元（于2020年12月31日，属于第一层次的余额为人民币192,254,086.80元，属于第二层次的余额为人民币71,353.33元，属于第三层次的余额为人民币654,651.50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	175,855,809.45	93.53
	其中：股票	175,855,809.45	93.53
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	11,851,208.62	6.30
8	其他各项资产	305,412.47	0.16
9	合计	188,012,430.54	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	1,932,364.12	1.05
B	采矿业	4,391,019.98	2.38
C	制造业	103,340,296.88	56.06
D	电力、热力、燃气	3,185,692.18	1.73

	及水生产和供应业		
E	建筑业	2,117,582.80	1.15
F	批发和零售业	2,253,270.33	1.22
G	交通运输、仓储和邮政业	5,089,826.53	2.76
H	住宿和餐饮业	199,325.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,266,594.60	2.86
J	金融业	33,045,643.64	17.93
K	房地产业	3,740,100.33	2.03
L	租赁和商务服务业	3,161,418.60	1.71
M	科学研究和技术服务业	2,591,700.84	1.41
N	水利、环境和公共设施管理业	197,163.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	185,921.00	0.10
Q	卫生和社会工作	2,727,781.57	1.48
R	文化、体育和娱乐业	842,740.60	0.46
S	综合	-	-
	合计	174,268,442.00	94.53

### 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	11,290.28	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,324,834.63	0.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	89,166.82	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	15,540.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,137.81	0.01
J	金融业	34,721.10	0.02
K	房地产业	10,095.90	0.01
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	51,546.08	0.03
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,587,367.45	0.86

### 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	600519	贵州茅台	4,996	10,275,273.20	5.57
2	300750	宁德时代	9,200	4,920,160.00	2.67
3	000858	五粮液	15,307	4,559,802.23	2.47
4	600036	招商银行	80,482	4,361,319.58	2.37
5	601318	中国平安	42,578	2,736,913.84	1.48
6	601888	中国中免	7,686	2,306,568.60	1.25
7	300760	迈瑞医疗	4,800	2,304,240.00	1.25
8	600900	长江电力	89,084	1,838,693.76	1.00
9	603288	海天味业	14,043	1,810,844.85	0.98
10	002594	比亚迪	7,212	1,810,212.00	0.98
11	601012	隆基股份	19,905	1,768,360.20	0.96
12	000001	平安银行	76,728	1,735,587.36	0.94
13	600276	恒瑞医药	25,256	1,716,650.32	0.93
14	601166	兴业银行	80,966	1,663,851.30	0.90
15	603259	药明康德	9,976	1,562,141.84	0.85
16	300015	爱尔眼科	21,134	1,500,091.32	0.81
17	600809	山西汾酒	3,301	1,478,848.00	0.80
18	000568	泸州老窖	5,800	1,368,452.00	0.74
19	600309	万华化学	12,500	1,360,250.00	0.74
20	300059	东方财富	40,844	1,339,274.76	0.73
21	601398	工商银行	248,398	1,284,217.66	0.70
22	002475	立讯精密	27,632	1,271,072.00	0.69

23	002714	牧原股份	20,796	1,264,812.72	0.69
24	002304	洋河股份	5,988	1,240,713.60	0.67
25	002352	顺丰控股	18,033	1,220,834.10	0.66
26	300122	智飞生物	6,300	1,176,399.00	0.64
27	600000	浦发银行	115,300	1,153,000.00	0.63
28	601919	中远海控	37,600	1,148,304.00	0.62
29	603501	韦尔股份	3,400	1,094,800.00	0.59
30	600436	片仔癀	2,400	1,075,920.00	0.58
31	600030	中信证券	41,100	1,025,034.00	0.56
32	000333	美的集团	13,961	996,396.57	0.54
33	600031	三一重工	33,845	983,874.15	0.53
34	002142	宁波银行	23,747	925,420.59	0.50
35	000002	万科A	38,440	915,256.40	0.50
36	601288	农业银行	293,200	888,396.00	0.48
37	600887	伊利股份	24,088	887,161.04	0.48
38	601816	京沪高铁	164,400	869,676.00	0.47
39	000725	京东方A	133,800	834,912.00	0.45
40	002812	恩捷股份	3,500	819,350.00	0.44
41	601601	中国太保	26,908	779,524.76	0.42
42	300014	亿纬锂能	7,496	779,059.28	0.42
43	601668	中国建筑	166,812	775,675.80	0.42
44	601328	交通银行	154,675	757,907.50	0.41
45	300124	汇川技术	10,198	757,303.48	0.41
46	600438	通威股份	17,500	757,225.00	0.41
47	601899	紫金矿业	76,538	741,653.22	0.40
48	300782	卓胜微	1,360	731,000.00	0.40
49	002493	荣盛石化	39,975	690,368.25	0.37
50	600019	宝钢股份	87,400	667,736.00	0.36
51	300274	阳光电源	5,800	667,348.00	0.36
52	600104	上汽集团	30,318	666,086.46	0.36
53	600690	海尔智家	25,328	656,248.48	0.36
54	600585	海螺水泥	15,941	654,378.05	0.35
55	000661	长春高新	1,600	619,200.00	0.34
56	600016	民生银行	140,024	617,505.84	0.33
57	600346	恒力石化	23,407	614,199.68	0.33
58	601818	光大银行	162,400	613,872.00	0.33
59	002230	科大讯飞	8,750	591,325.00	0.32
60	000538	云南白药	5,090	589,014.80	0.32
61	300433	蓝思科技	19,700	579,377.00	0.31
62	600048	保利地产	47,800	575,512.00	0.31
63	002241	歌尔股份	13,400	572,716.00	0.31
64	300759	康龙化成	2,600	564,174.00	0.31

65	600196	复星医药	7,800	562,614.00	0.31
66	600703	三安光电	17,552	562,541.60	0.31
67	002371	北方华创	2,000	554,760.00	0.30
68	600893	航发动力	10,365	551,314.35	0.30
69	600028	中国石化	125,400	546,744.00	0.30
70	002027	分众传媒	58,000	545,780.00	0.30
71	600999	招商证券	28,568	543,363.36	0.29
72	002311	海大集团	6,600	538,560.00	0.29
73	002460	赣锋锂业	4,387	531,221.83	0.29
74	601066	中信建投	16,800	528,024.00	0.29
75	600406	国电南瑞	22,053	512,511.72	0.28
76	601088	中国神华	25,991	507,344.32	0.28
77	000063	中兴通讯	15,200	505,096.00	0.27
78	601658	邮储银行	99,300	498,486.00	0.27
79	601211	国泰君安	28,800	493,632.00	0.27
80	600763	通策医疗	1,200	493,200.00	0.27
81	603799	华友钴业	4,302	491,288.40	0.27
82	300413	芒果超媒	7,000	480,200.00	0.26
83	600745	闻泰科技	4,900	474,810.00	0.26
84	601225	陕西煤业	39,500	468,075.00	0.25
85	603986	兆易创新	2,484	466,743.60	0.25
86	002129	中环股份	12,000	463,200.00	0.25
87	000625	长安汽车	17,600	462,528.00	0.25
88	601229	上海银行	55,833	457,830.60	0.25
89	601688	华泰证券	28,400	448,720.00	0.24
90	601857	中国石油	84,500	447,005.00	0.24
91	601100	恒立液压	5,180	445,065.60	0.24
92	600660	福耀玻璃	7,800	435,630.00	0.24
93	600588	用友网络	13,021	433,078.46	0.23
94	600837	海通证券	37,200	427,800.00	0.23
95	000100	TCL 科技	55,500	424,575.00	0.23
96	000338	潍柴动力	23,700	423,519.00	0.23
97	601988	中国银行	137,462	423,382.96	0.23
98	601390	中国中铁	80,500	421,820.00	0.23
99	600919	江苏银行	59,253	420,696.30	0.23
100	601009	南京银行	39,800	418,696.00	0.23
101	000166	申万宏源	88,942	416,248.56	0.23
102	300454	深信服	1,600	415,168.00	0.23
103	603486	科沃斯	1,800	410,544.00	0.22
104	601169	北京银行	83,692	407,580.04	0.22
105	300601	康泰生物	2,643	393,807.00	0.21
106	600760	中航沈飞	6,451	388,995.30	0.21

107	002709	天赐材料	3,640	387,951.20	0.21
108	603806	福斯特	3,640	382,673.20	0.21
109	600570	恒生电子	4,040	376,730.00	0.20
110	300142	沃森生物	6,100	376,370.00	0.20
111	600132	重庆啤酒	1,900	376,105.00	0.20
112	601989	中国重工	90,700	373,684.00	0.20
113	002821	凯莱英	1,000	372,600.00	0.20
114	601336	新华保险	8,108	372,238.28	0.20
115	601628	中国人寿	10,944	370,892.16	0.20
116	601155	新城控股	8,900	370,240.00	0.20
117	002049	紫光国微	2,400	370,056.00	0.20
118	601633	长城汽车	8,400	366,156.00	0.20
119	601138	工业富联	29,300	363,613.00	0.20
120	300498	温氏股份	25,220	362,411.40	0.20
121	000895	双汇发展	11,371	361,597.80	0.20
122	000596	古井贡酒	1,500	359,250.00	0.19
123	000776	广发证券	23,400	354,276.00	0.19
124	300595	欧普康视	3,410	353,105.50	0.19
125	603993	洛阳钼业	67,700	349,332.00	0.19
126	002179	中航光电	4,400	347,688.00	0.19
127	600926	杭州银行	23,440	345,740.00	0.19
128	001979	招商蛇口	31,363	343,424.85	0.19
129	603833	欧派家居	2,416	342,975.36	0.19
130	002050	三花智控	14,200	340,516.00	0.18
131	600989	宝丰能源	24,700	337,896.00	0.18
132	000799	酒鬼酒	1,300	332,280.00	0.18
133	600741	华域汽车	12,400	325,748.00	0.18
134	002841	视源股份	2,600	323,154.00	0.18
135	603185	上机数控	1,800	322,110.00	0.17
136	600600	青岛啤酒	2,775	320,928.75	0.17
137	603659	璞泰来	2,340	319,644.00	0.17
138	000963	华东医药	6,901	317,515.01	0.17
139	603899	晨光文具	3,700	312,872.00	0.17
140	600015	华夏银行	50,500	312,595.00	0.17
141	002601	龙佰集团	8,900	307,762.00	0.17
142	300408	三环集团	7,200	305,424.00	0.17
143	600150	中国船舶	18,400	303,784.00	0.16
144	603882	金域医学	1,900	303,563.00	0.16
145	688008	澜起科技	4,860	303,166.80	0.16
146	300628	亿联网络	3,600	301,680.00	0.16
147	688002	睿创微纳	3,000	299,490.00	0.16
148	002001	新和成	10,240	293,683.20	0.16

149	600460	士兰微	5,200	293,020.00	0.16
150	600111	北方稀土	14,150	292,905.00	0.16
151	601985	中国核电	57,600	291,456.00	0.16
152	300347	泰格医药	1,500	289,950.00	0.16
153	000768	中航西飞	10,900	286,452.00	0.16
154	601877	正泰电器	8,488	283,329.44	0.15
155	600547	山东黄金	14,452	277,767.44	0.15
156	600010	包钢股份	178,800	277,140.00	0.15
157	603127	昭衍新药	1,500	275,625.00	0.15
158	300529	健帆生物	3,170	273,761.20	0.15
159	002736	国信证券	25,300	271,975.00	0.15
160	603737	三棵树	1,540	271,040.00	0.15
161	603369	今世缘	5,000	270,800.00	0.15
162	601901	方正证券	28,900	270,504.00	0.15
163	600886	国投电力	28,100	270,041.00	0.15
164	002568	百润股份	2,840	269,203.60	0.15
165	002648	卫星石化	6,860	268,843.40	0.15
166	600584	长电科技	7,100	267,528.00	0.15
167	300496	中科创达	1,700	267,002.00	0.14
168	000301	东方盛虹	12,700	265,430.00	0.14
169	601788	光大证券	14,827	265,255.03	0.14
170	002007	华兰生物	7,220	264,829.60	0.14
171	601600	中国铝业	49,900	264,470.00	0.14
172	600426	华鲁恒升	8,520	263,694.00	0.14
173	000786	北新建材	6,700	262,975.00	0.14
174	000876	新希望	17,800	261,126.00	0.14
175	002064	华峰化学	18,300	259,860.00	0.14
176	601916	浙商银行	65,400	259,638.00	0.14
177	000157	中联重科	27,990	258,627.60	0.14
178	300316	晶盛机电	5,100	257,550.00	0.14
179	002600	领益智造	27,900	256,401.00	0.14
180	002414	高德红外	9,296	256,383.68	0.14
181	603345	安井食品	1,000	254,020.00	0.14
182	002791	坚朗五金	1,300	252,265.00	0.14
183	002236	大华股份	11,877	250,604.70	0.14
184	601939	建设银行	37,623	250,192.95	0.14
185	600176	中国巨石	15,988	247,973.88	0.13
186	000938	紫光股份	11,262	246,412.56	0.13
187	600029	南方航空	40,865	246,007.30	0.13
188	000069	华侨城 A	32,407	241,108.08	0.13
189	601966	玲珑轮胎	5,500	240,570.00	0.13
190	600779	水井坊	1,900	240,065.00	0.13



191	300033	同花顺	2,100	236,838.00	0.13
192	601669	中国电建	60,700	234,909.00	0.13
193	601360	三六零	19,052	232,624.92	0.13
194	601377	兴业证券	24,040	232,226.40	0.13
195	603613	国联股份	2,300	229,931.00	0.12
196	600115	中国东航	45,000	228,600.00	0.12
197	300661	圣邦股份	900	227,457.00	0.12
198	601799	星宇股份	1,000	225,720.00	0.12
199	300003	乐普医疗	7,000	224,840.00	0.12
200	601233	桐昆股份	9,300	224,037.00	0.12
201	002074	国轩高科	5,100	222,156.00	0.12
202	688006	杭可科技	2,600	221,000.00	0.12
203	300146	汤臣倍健	6,700	220,430.00	0.12
204	603160	汇顶科技	1,700	220,371.00	0.12
205	600845	宝信软件	4,320	219,888.00	0.12
206	002938	鹏鼎控股	6,100	218,868.00	0.12
207	002916	深南电路	1,940	215,592.20	0.12
208	600143	金发科技	10,300	214,858.00	0.12
209	600958	东方证券	21,490	214,685.10	0.12
210	600183	生益科技	9,100	213,031.00	0.12
211	603658	安图生物	2,790	211,398.30	0.11
212	601618	中国中冶	70,700	210,686.00	0.11
213	600061	国投资本	24,776	210,348.24	0.11
214	002024	苏宁易购	37,500	209,625.00	0.11
215	601111	中国国航	26,700	207,726.00	0.11
216	002459	晶澳科技	4,200	205,800.00	0.11
217	601021	春秋航空	3,600	204,840.00	0.11
218	603517	绝味食品	2,400	202,296.00	0.11
219	300207	欣旺达	6,200	201,872.00	0.11
220	603816	顾家家居	2,600	200,928.00	0.11
221	601636	旗滨集团	10,800	200,448.00	0.11
222	002555	三七互娱	8,300	199,366.00	0.11
223	600754	锦江酒店	3,500	199,325.00	0.11
224	002252	上海莱士	26,600	199,234.00	0.11
225	002920	德赛西威	1,800	198,144.00	0.11
226	000425	徐工机械	31,000	197,470.00	0.11
227	601878	浙商证券	15,000	196,200.00	0.11
228	600332	白云山	5,767	195,212.95	0.11
229	300285	国瓷材料	4,000	195,000.00	0.11
230	603267	鸿远电子	1,500	191,880.00	0.10
231	600161	天坛生物	5,600	191,800.00	0.10
232	300223	北京君正	1,900	191,748.00	0.10

233	300676	华大基因	1,600	189,760.00	0.10
234	600079	人福医药	6,700	189,409.00	0.10
235	002602	世纪华通	29,340	188,362.80	0.10
236	600383	金地集团	18,300	187,392.00	0.10
237	600089	特变电工	14,544	186,890.40	0.10
238	002607	中公教育	8,900	185,921.00	0.10
239	002624	完美世界	7,700	184,107.00	0.10
240	603444	吉比特	347	183,910.00	0.10
241	600009	上海机场	3,811	183,423.43	0.10
242	300751	迈为股份	400	181,880.00	0.10
243	601865	福莱特	4,600	181,838.00	0.10
244	600674	川投能源	14,700	181,251.00	0.10
245	601881	中国银河	16,700	180,026.00	0.10
246	603456	九洲药业	3,700	179,746.00	0.10
247	601838	成都银行	14,200	179,488.00	0.10
248	601933	永辉超市	37,800	178,794.00	0.10
249	002625	光启技术	8,500	176,885.00	0.10
250	601727	上海电气	41,700	176,808.00	0.10
251	600362	江西铜业	7,900	176,802.00	0.10
252	600018	上港集团	37,000	176,490.00	0.10
253	600606	绿地控股	32,372	176,427.40	0.10
254	600352	浙江龙盛	12,800	175,872.00	0.10
255	002340	格林美	18,800	175,780.00	0.10
256	600885	宏发股份	2,800	175,560.00	0.10
257	300677	英科医疗	1,400	174,720.00	0.09
258	300144	宋城演艺	10,383	174,434.40	0.09
259	600315	上海家化	2,900	174,406.00	0.09
260	000703	恒逸石化	14,580	174,231.00	0.09
261	600298	安琪酵母	3,200	174,016.00	0.09
262	300450	先导智能	2,880	173,203.20	0.09
263	300558	贝达药业	1,600	173,184.00	0.09
264	002080	中材科技	6,600	172,722.00	0.09
265	002508	老板电器	3,695	171,817.50	0.09
266	601216	君正集团	33,700	171,533.00	0.09
267	601117	中国化学	19,400	169,944.00	0.09
268	002353	杰瑞股份	3,800	169,860.00	0.09
269	000066	中国长城	11,600	169,360.00	0.09
270	600862	中航高科	5,500	169,290.00	0.09
271	000825	太钢不锈	22,500	168,525.00	0.09
272	600489	中金黄金	19,500	168,090.00	0.09
273	002185	华天科技	10,800	166,212.00	0.09
274	002202	金风科技	13,593	165,290.88	0.09

275	688009	中国通号	29,000	165,010.00	0.09
276	600219	南山铝业	45,600	164,160.00	0.09
277	601162	天风证券	33,500	162,810.00	0.09
278	603589	口子窖	2,400	162,456.00	0.09
279	300724	捷佳伟创	1,400	162,414.00	0.09
280	000977	浪潮信息	5,720	160,903.60	0.09
281	601607	上海医药	7,600	160,588.00	0.09
282	000783	长江证券	21,900	160,308.00	0.09
283	300037	新宙邦	1,600	160,160.00	0.09
284	000932	华菱钢铁	24,100	159,060.00	0.09
285	300699	光威复材	2,080	157,976.00	0.09
286	002120	韵达股份	11,480	155,324.40	0.08
287	002013	中航机电	15,400	155,078.00	0.08
288	002444	巨星科技	4,500	153,360.00	0.08
289	002223	鱼跃医疗	4,000	152,520.00	0.08
290	601990	南京证券	14,320	150,646.40	0.08
291	002690	美亚光电	2,700	150,552.00	0.08
292	600188	兖州煤业	9,800	150,528.00	0.08
293	601696	中银证券	7,300	150,307.00	0.08
294	601689	拓普集团	4,000	149,720.00	0.08
295	601872	招商轮船	32,400	149,688.00	0.08
296	600655	豫园股份	12,900	149,511.00	0.08
297	000807	云铝股份	12,400	147,560.00	0.08
298	600109	国金证券	11,600	147,204.00	0.08
299	002157	正邦科技	12,300	146,985.00	0.08
300	002673	西部证券	17,714	146,140.50	0.08
301	601108	财通证券	13,900	145,811.00	0.08
302	002409	雅克科技	1,800	145,800.00	0.08
303	600486	扬农化工	1,300	145,301.00	0.08
304	601699	潞安环能	12,200	144,082.00	0.08
305	000027	深圳能源	15,660	143,602.20	0.08
306	002511	中顺洁柔	5,200	143,260.00	0.08
307	600704	物产中大	18,100	142,447.00	0.08
308	603233	大参林	2,780	142,085.80	0.08
309	002384	东山精密	6,800	141,712.00	0.08
310	603939	益丰药房	2,526	141,683.34	0.08
311	002044	美年健康	15,475	140,977.25	0.08
312	000830	鲁西化工	7,500	140,475.00	0.08
313	002032	苏泊尔	2,200	140,338.00	0.08
314	002603	以岭药业	4,800	139,968.00	0.08
315	002078	太阳纸业	10,400	138,840.00	0.08
316	601077	渝农商行	34,700	138,453.00	0.08

317	000739	普洛药业	4,700	138,180.00	0.07
318	603605	珀莱雅	700	137,697.00	0.07
319	000728	国元证券	17,270	137,641.90	0.07
320	601319	中国人保	23,200	137,576.00	0.07
321	000050	深天马 A	9,701	137,560.18	0.07
322	002180	纳思达	4,258	137,107.60	0.07
323	300253	卫宁健康	8,390	136,505.30	0.07
324	600699	均胜电子	5,300	135,256.00	0.07
325	300357	我武生物	2,100	134,652.00	0.07
326	002294	信立泰	4,088	134,495.20	0.07
327	600872	中炬高新	3,200	134,464.00	0.07
328	000983	山西焦煤	16,160	134,289.60	0.07
329	600705	中航产融	34,700	134,289.00	0.07
330	603638	艾迪精密	3,120	133,754.40	0.07
331	000800	一汽解放	12,300	133,086.00	0.07
332	002405	四维图新	9,000	132,300.00	0.07
333	002507	涪陵榨菜	3,500	131,810.00	0.07
334	002430	杭氧股份	3,800	131,442.00	0.07
335	600827	百联股份	6,500	130,975.00	0.07
336	002372	伟星新材	6,300	130,221.00	0.07
337	601615	明阳智能	8,000	129,520.00	0.07
338	000723	美锦能源	16,900	127,764.00	0.07
339	002156	通富微电	5,300	127,412.00	0.07
340	600038	中直股份	2,400	126,576.00	0.07
341	600233	圆通速递	12,600	126,126.00	0.07
342	601058	赛轮轮胎	12,600	125,874.00	0.07
343	600372	中航电子	7,600	125,780.00	0.07
344	600803	新奥股份	7,600	125,476.00	0.07
345	300251	光线传媒	11,600	125,396.00	0.07
346	600369	西南证券	25,600	124,672.00	0.07
347	601555	东吴证券	14,890	124,182.60	0.07
348	002138	顺络电子	3,200	124,064.00	0.07
349	600739	辽宁成大	5,955	123,923.55	0.07
350	002152	广电运通	9,500	123,785.00	0.07
351	600039	四川路桥	19,600	122,892.00	0.07
352	600011	华能国际	29,100	122,802.00	0.07
353	002541	鸿路钢构	2,100	122,535.00	0.07
354	000860	顺鑫农业	2,900	122,322.00	0.07
355	000656	金科股份	21,100	122,169.00	0.07
356	600392	盛和资源	7,000	121,520.00	0.07
357	603707	健友股份	2,910	121,492.50	0.07
358	600521	华海药业	5,790	120,895.20	0.07

359	600875	东方电气	11,001	120,680.97	0.07
360	600177	雅戈尔	18,300	120,597.00	0.07
361	600642	申能股份	19,573	120,178.22	0.07
362	000513	丽珠集团	2,400	120,048.00	0.07
363	600522	中天科技	12,000	120,000.00	0.07
364	000547	航天发展	6,300	118,881.00	0.06
365	000021	深科技	6,200	118,668.00	0.06
366	603866	桃李面包	3,800	118,560.00	0.06
367	002797	第一创业	16,600	118,524.00	0.06
368	002030	达安基因	5,552	117,924.48	0.06
369	300136	信维通信	3,800	117,344.00	0.06
370	002299	圣农发展	4,900	117,012.00	0.06
371	601198	东兴证券	10,700	116,951.00	0.06
372	603338	浙江鼎力	1,980	116,206.20	0.06
373	600998	九州通	7,489	115,105.93	0.06
374	601456	国联证券	7,443	114,622.20	0.06
375	600848	上海临港	6,360	113,844.00	0.06
376	002422	科伦药业	5,700	113,715.00	0.06
377	002939	长城证券	10,200	113,526.00	0.06
378	600415	小商品城	22,000	113,300.00	0.06
379	600895	张江高科	6,200	113,274.00	0.06
380	300482	万孚生物	1,750	113,207.50	0.06
381	002385	大北农	16,600	112,880.00	0.06
382	600549	厦门钨业	5,400	112,482.00	0.06
383	600516	方大炭素	14,990	111,525.60	0.06
384	000630	铜陵有色	41,000	111,520.00	0.06
385	600066	宇通客车	8,800	109,912.00	0.06
386	002429	兆驰股份	17,900	108,653.00	0.06
387	600380	健康元	7,900	108,467.00	0.06
388	603218	日月股份	4,000	108,320.00	0.06
389	603712	七一二	3,000	108,300.00	0.06
390	300308	中际旭创	2,800	107,856.00	0.06
391	002563	森马服饰	8,900	106,355.00	0.06
392	002266	浙富控股	21,200	105,788.00	0.06
393	002463	沪电股份	6,800	105,196.00	0.06
394	600598	北大荒	7,000	104,720.00	0.06
395	000999	华润三九	3,900	104,325.00	0.06
396	000975	银泰黄金	10,940	104,039.40	0.06
397	002373	千方科技	6,200	103,540.00	0.06
398	000709	河钢股份	42,000	103,320.00	0.06
399	600536	中国软件	1,800	102,474.00	0.06
400	603858	步长制药	4,495	101,092.55	0.05

401	002010	传化智联	13,100	101,001.00	0.05
402	002925	盈趣科技	2,590	100,776.90	0.05
403	600988	赤峰黄金	6,700	100,433.00	0.05
404	002926	华西证券	10,400	100,152.00	0.05
405	600170	上海建工	35,400	97,704.00	0.05
406	002065	东华软件	12,300	97,539.00	0.05
407	601231	环旭电子	5,800	97,498.00	0.05
408	002242	九阳股份	3,000	97,470.00	0.05
409	002146	荣盛发展	17,200	97,008.00	0.05
410	600801	华新水泥	5,500	96,635.00	0.05
411	600867	通化东宝	8,033	95,914.02	0.05
412	600511	国药股份	2,900	95,874.00	0.05
413	002456	欧菲光	10,696	94,980.48	0.05
414	002075	沙钢股份	8,700	94,917.00	0.05
415	002500	山西证券	14,140	94,879.40	0.05
416	002127	南极电商	9,700	94,769.00	0.05
417	002958	青农商行	22,000	94,160.00	0.05
418	000988	华工科技	4,000	94,080.00	0.05
419	000423	东阿阿胶	2,617	93,976.47	0.05
420	000738	航发控制	4,500	93,735.00	0.05
421	600160	巨化股份	10,600	93,704.00	0.05
422	002153	石基信息	3,960	93,099.60	0.05
423	002212	天融信	4,700	92,919.00	0.05
424	300463	迈克生物	2,200	92,598.00	0.05
425	000987	越秀金控	7,300	92,418.00	0.05
426	600027	华电国际	26,800	92,192.00	0.05
427	000750	国海证券	21,560	91,414.40	0.05
428	300070	碧水源	12,500	91,375.00	0.05
429	600688	上海石化	24,254	91,195.04	0.05
430	600153	建发股份	11,211	90,809.10	0.05
431	300773	拉卡拉	3,200	90,336.00	0.05
432	601099	太平洋	26,600	90,174.00	0.05
433	600256	广汇能源	26,900	89,577.00	0.05
434	600859	王府井	3,100	89,528.00	0.05
435	601992	金隅集团	33,100	89,039.00	0.05
436	601598	中国外运	17,626	89,011.30	0.05
437	002558	巨人网络	6,680	88,844.00	0.05
438	000961	中南建设	14,900	88,208.00	0.05
439	300383	光环新网	6,100	87,779.00	0.05
440	002705	新宝股份	3,300	86,625.00	0.05
441	002557	洽洽食品	2,000	86,200.00	0.05
442	002151	北斗星通	2,000	86,140.00	0.05

443	002465	海格通信	9,104	86,123.84	0.05
444	603883	老百姓	1,620	85,341.60	0.05
445	000671	阳光城	16,300	84,760.00	0.05
446	002019	亿帆医药	4,900	84,525.00	0.05
447	600340	华夏幸福	16,040	84,049.60	0.05
448	002081	金螳螂	10,600	83,952.00	0.05
449	600026	中远海能	13,600	83,776.00	0.05
450	000998	隆平高科	5,200	83,408.00	0.05
451	002683	宏大爆破	3,000	83,310.00	0.05
452	603027	千禾味业	3,120	82,024.80	0.04
453	600498	烽火通信	4,400	81,972.00	0.04
454	600879	航天电子	10,700	80,464.00	0.04
455	002506	协鑫集成	23,100	80,388.00	0.04
456	000729	燕京啤酒	11,100	80,364.00	0.04
457	300088	长信科技	9,700	80,122.00	0.04
458	000402	金融街	11,800	79,650.00	0.04
459	002727	一心堂	2,400	79,464.00	0.04
460	300296	利亚德	10,100	78,982.00	0.04
461	600583	海油工程	17,500	78,750.00	0.04
462	600529	山东药玻	2,300	78,085.00	0.04
463	000629	攀钢钒钛	34,000	77,860.00	0.04
464	000686	东北证券	9,100	76,895.00	0.04
465	000540	中天金融	27,700	75,621.00	0.04
466	300418	昆仑万维	4,600	75,348.00	0.04
467	001914	招商积余	4,200	72,156.00	0.04
468	000623	吉林敖东	4,600	71,254.00	0.04
469	000627	天茂集团	19,500	70,590.00	0.04
470	300212	易华录	2,580	69,427.80	0.04
471	000581	威孚高科	3,311	68,968.13	0.04
472	601128	常熟银行	10,900	67,580.00	0.04
473	000401	冀东水泥	5,300	65,455.00	0.04
474	002399	海普瑞	4,100	65,313.00	0.04
475	601098	中南传媒	7,110	62,710.20	0.03
476	002131	利欧股份	26,700	62,478.00	0.03
477	600909	华安证券	9,751	54,313.07	0.03
478	002572	索菲亚	1,800	43,560.00	0.02

### 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	002271	东方雨虹	5,050	279,366.00	0.15

2	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.09
3	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.07
4	688606	奥泰生物	811	112,980.41	0.06
5	688276	百克生物	1,287	102,290.76	0.06
6	300920	润阳科技	2,064	69,515.52	0.04
7	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
8	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.03
9	300894	火星人	536	36,448.00	0.02
10	300919	中伟股份	223	36,349.00	0.02
11	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
12	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.02
13	300957	贝泰妮	132	33,258.72	0.02
14	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
15	300973	立高食品	174	20,133.54	0.01
16	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
17	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
18	301009	可靠股份	565	15,757.85	0.01
19	000089	深圳机场	2,000	15,540.00	0.01
20	300925	法本信息	529	13,907.41	0.01
21	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
22	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
23	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
24	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
25	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
26	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
27	300997	欢乐家	899	11,731.95	0.01
28	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.01
29	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
30	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.01
31	300917	特发服务	365	10,095.90	0.01
32	300956	英力股份	371	9,571.80	0.01
33	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
34	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
35	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
36	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
37	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
38	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
39	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
40	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
41	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
42	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
43	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
44	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00



45	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
46	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
47	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
48	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
49	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
50	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
51	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
52	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
53	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
54	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
55	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
56	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
57	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
58	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
59	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
60	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	601816	京沪高铁	699,239.00	0.36
2	300760	迈瑞医疗	636,021.00	0.33
3	002352	顺丰控股	542,056.00	0.28
4	300759	康龙化成	466,092.00	0.24
5	601658	邮储银行	428,624.00	0.22
6	000858	五粮液	425,252.00	0.22
7	300750	宁德时代	408,196.00	0.21
8	600989	宝丰能源	370,419.00	0.19
9	600276	恒瑞医药	330,331.00	0.17
10	600150	中国船舶	323,592.00	0.17
11	600584	长电科技	298,923.00	0.15
12	688008	澜起科技	290,349.12	0.15
13	688002	睿创微纳	284,176.65	0.15
14	603185	上机数控	265,506.00	0.14
15	603127	昭衍新药	249,734.00	0.13
16	002064	华峰化学	230,005.00	0.12
17	000301	东方盛虹	223,498.00	0.11
18	002648	卫星石化	218,713.00	0.11
19	688006	杭可科技	216,294.00	0.11
20	603486	科沃斯	216,235.00	0.11

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	000333	美的集团	2,934,900.00	1.51
2	002415	海康威视	2,473,224.76	1.27
3	000858	五粮液	1,082,986.00	0.56
4	300750	宁德时代	916,673.00	0.47
5	601766	中国中车	677,920.00	0.35
6	300760	迈瑞医疗	521,771.00	0.27
7	600050	中国联通	519,332.61	0.27
8	000001	平安银行	438,983.00	0.23
9	601186	中国铁建	431,025.00	0.22
10	601006	大秦铁路	396,126.00	0.20
11	002271	东方雨虹	373,561.00	0.19
12	002352	顺丰控股	368,756.00	0.19
13	300015	爱尔眼科	365,273.00	0.19
14	002714	牧原股份	354,149.00	0.18
15	688131	皓元医药	329,004.00	0.17
16	000568	泸州老窖	319,939.00	0.16
17	688690	纳微科技	318,145.50	0.16
18	300863	卡倍亿	313,412.79	0.16
19	002304	洋河股份	307,971.00	0.16
20	002475	立讯精密	294,566.00	0.15

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	26,973,462.90
卖出股票收入（成交）总额	43,345,576.08

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

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

#### 7.12.2

基金投资的前十名股票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	33,044.05
2	应收证券清算款	270,105.31
3	应收股利	-
4	应收利息	2,263.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	305,412.47

#### 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

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	688661	和林微纳	121,982.52	0.07	新发未上市
2	688606	奥泰生物	112,980.41	0.06	新发未上市
3	688276	百克生物	102,290.76	0.06	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

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)

2,130	52,604.69	51,598,900.00	46.05	60,449,100.00	53.95
-------	-----------	---------------	-------	---------------	-------

注：机构投资者包含建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。

### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
中国国际金融股份有限公司-建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	46,318,100.00	41.34

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中信证券股份有限公司	3,364,900.00	3.00
2	刘海涛	1,500,000.00	1.34
3	郭少华	1,096,000.00	0.98
4	长盛基金-东兴证券股份有限公司-长盛-长兴优选 1 号单一资产管理计划	1,088,000.00	0.97
5	蒲巴甲	1,000,000.00	0.89
5	王锦华	1,000,000.00	0.89
5	张建军	1,000,000.00	0.89
8	方正证券股份有限公司	636,200.00	0.57
9	高为	580,000.00	0.52
10	黄郭明娥	540,000.00	0.48
11	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	46,318,100.00	41.34

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 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

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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 4 月 19 日）基金份额总额	2,046,048,000.00
本报告期期初基金份额总额	128,048,000.00
本报告期基金总申购份额	8,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	24,000,000.00
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	112,048,000.00

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

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，经本基金托管人中国国际金融股份有限公司（简称公司）研究决定，聘请严格同志为公司资产托管部负责人，张萱同志不再担任资产托管部负责人职务，公司另有任用。

### 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

本报告期未发生公司和董事、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	
中金公司	4	31,585,645.91	47.62%	29,386.81	47.98%	-

中信证券	1	24,339,659.69	36.70%	22,181.41	36.21%	-
天风证券	1	10,399,646.43	15.68%	9,685.12	15.81%	-
长江证券	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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	18,608.70	100.00%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

无。

## § 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 (%)
建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2021 年 01 月 01 日-2021 年 06 月 30 日	50,145,600.00		-3,827,500.00	46,318,100.00	41.34

注：本基金本报告期申购、赎回份额中包含了买入、卖出份额。

### 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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数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

2021 年 8 月 30 日