

建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指 数证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
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
§ 4 管理人报告	8
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	13
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	14
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
§ 5 托管人报告	14
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65

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	66
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	66
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	66
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	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
§ 8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末上市基金前十名持有人	67
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
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	68
§ 9 开放式基金份额变动	68
§ 10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
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	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
10.8 其他重大事件	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 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 (扩位简称: MSCIA 股 ETF 基金)
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	98,048,000.00 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	严格
	联系电话	010-66228888	010-65051166
	电子邮箱	xinzipilu@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 号英蓝国际	北京市朝阳区建外门外大街 1

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

注：1、2022 年 5 月 13 日，建信基金管理有限责任公司发布公告，孙志晨先生于 2022 年 5 月 11 日离任，暂由总裁张军红先生代为履行董事长职务。

2、建信基金管理有限责任公司法定代表人已于 2022 年 7 月 27 日变更为刘军先生。

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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,032,277.32
本期利润	-13,686,414.26
加权平均基金份额本期利润	-0.1286
本期加权平均净值利润率	-8.67%
本期基金份额净值增长率	-7.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	54,653,952.09
期末可供分配基金份额利润	0.5574
期末基金资产净值	152,701,952.09
期末基金份额净值	1.5574
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	55.74%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	10.17%	1.04%	9.38%	1.07%	0.79%	-0.03%
过去三个月	7.61%	1.42%	6.60%	1.46%	1.01%	-0.04%
过去六个月	-7.36%	1.42%	-9.07%	1.46%	1.71%	-0.04%
过去一年	-5.34%	1.20%	-12.39%	1.24%	7.05%	-0.04%
过去三年	51.38%	1.23%	28.25%	1.27%	23.13%	-0.04%
自基金合同生效起至今	55.74%	1.28%	29.75%	1.32%	25.99%	-0.04%

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、基础设施投资部、交易部、研究部、创新发展部、银行业务部、品牌推广部（二级部）、机构业务部、网络金融业务部、证券公司业务部、投资顾问与客户服务部、办公室、人力资源部、计划财务部、基金会计部、注册登记部、金融科技部、投资风险管理部、风险与合规管理部和审计部，以及北京、上海、广州、成都、深圳五家分公司，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 2022 年 6 月 30 日，公司旗下有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、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、建信货币市场基金、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、建信龙祥稳进 6 个月持有期混合型基金中基金(FOF)、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、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒瑞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、建信彭博政策性银行债券 1-5 年指数证券投资基金、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、建信中关村产业园封闭式基础设施证券投资基金、建信沃信一年持有期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、建信荣瑞一年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、建信智能汽车股票型证券投资基金、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、建信汇益一年持有期混合型证券投资基金、建信卓越成长一年持有期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、建信裕丰利率债三个月定期开放债券型证券投资基金、建信普泽养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、建信鑫怡 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、建信优享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、建信创新驱动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、建信兴润一年持有期混合型证券投资基金、建信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信国证新能源车电池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、建信中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、建信中证饮料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、建信泓利一年持有期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、建信鑫悦 90 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、建信食品饮料行业股票型证券投资基金、建信港股通精选混合型证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金、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、建信中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、建信高端装备股票型证券投资基金、建信纳斯达克 100 指数型证券投资基金 (QDII)、建信新兴市场优

选混合型证券投资基金、建信富时 100 指数型证券投资基金(QDII)、建信医疗健康行业股票型证券投资基金、建信鑫享短债债券型证券投资基金、建信普泽养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、建信鑫恒 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、建信兴衡优选一年持有期混合型证券投资基金共计 154 只证券投资基金, 管理的基金净资产规模共计为 7150.00 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	金融工程及指数投资部总经理，本基金的基金经理	2018 年 4 月 19 日	-	19 年	梁洪先生，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。
--	--	--	--	--	---

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

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《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》的规定。

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

本基金跟踪的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际通指数，该指数由纳入 MSCI 新兴市场指数的 A 股上市公司组成成分股，市值风格上偏大盘。该指数对于 A 股具有良好的代表性，收益性，流动性和足够的宽度，也是 A 股国际化发展过程中的重要指数。

本基金在报告期内，保持高仓位运行，以满足上市运作以及对标的指数的跟踪要求。

在报告期内，基金标的指数的成分股进行了两次例行调整以及若干次临时调整。管理人根据指数编制公司发布的相应信息，对申赎清单文件及基金投资组合进行了相应的必要操作，比较有效地控制了组合的跟踪误差，同时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存在一定的差异，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。

在遵守基金合同，确保基金平稳运行的前提下，本基金参与了一级市场申购，并适时进行了兑现，力求为持有人进一步增厚基金回报。

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-7.36%，波动率 1.42%，业绩比较基准收益率-9.07%，波动率 1.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，市场大幅波动，呈明显的 V 型走势，截至报告期末，尚未完全收复失地。一季度受疫情、俄乌战争、通胀等多因素影响，资金拥挤度较高的成长股大幅下跌，成长属性的创业板指跌幅明显。进入二季度，前期影响市场的风险因素有所缓解，在稳增长政策的刺激下，成长板块迎来大幅反弹。在挂钩中证 1000 指数的衍生品上市的助推下，小盘成长成为市场上涨的主线。

展望 2022 年下半年，全球经济面临着中短期内通货膨胀持续，并逐渐转向衰退的预期。地缘政治风险与上半年相比，预计难有缓解，从而继续加剧上述压力。

国内宏观经济方面，疫情防控仍是重要工作，在上半年所取得的经验教训基础上，政策将更为注重防疫和保证经济活动正常运行之间的平衡。部分高负债行业可能造成的风险外溢如何有效化解，对于政策制定是个考验，也将是市场关注的焦点。投资者预期会随着这些因素的变化不断发生调整。在预期发生重大变化时，市场波动会随之放大。在小盘成长风格充分演绎后，大盘风格在下半年的相对优势不断提升。

本管理人将根据基金合同，继续做好对指数的复制追踪，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

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

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

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

4.7 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。

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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,514,020.27	7,916,518.13
结算备付金		8,015.94	11,150.34
存出保证金		21,523.43	35,786.08
交易性金融资产	6.4.7.2	148,601,080.88	171,111,983.48
其中：股票投资		148,601,080.88	171,111,983.48
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,669.55
资产总计		154,144,640.52	179,077,107.58
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			

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		-	-
应付清算款		1,071,452.84	411,647.35
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		63,464.93	78,541.93
应付托管费		12,692.96	15,708.36
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	295,077.70	292,411.22
负债合计		1,442,688.43	798,308.86
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	98,048,000.00	106,048,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	54,653,952.09	72,230,798.72
净资产合计		152,701,952.09	178,278,798.72
负债和净资产总计		154,144,640.52	179,077,107.58

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5574 元，基金份额总额 98,048,000.00 份。

（2）以下比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 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
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-13,064,214.21	15,591,596.53
1. 利息收入		20,309.07	30,551.96
其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,309.07	30,550.37
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）		2,593,739.30	20,900,335.33
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,167,557.71	19,668,960.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	7,731.36	7,606.97
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,418,450.23	1,223,767.37
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-15,718,691.58	-5,374,848.04
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	40,429.00	35,557.28
减：二、营业总支出		622,200.05	817,922.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	392,190.35	455,554.43
2. 托管费	6.4.10.2.2	78,438.11	91,110.88
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	151,571.59	271,257.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,686,414.26	14,773,673.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,686,414.26	14,773,673.81
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-13,686,414.26	14,773,673.81

注：以下比较数据已根据本年《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〉》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	106,048,000.00	-	72,230,798.72	178,278,798.72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	106,048,000.00	-	72,230,798.72	178,278,798.72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,000,000.00	-	-17,576,846.63	-25,576,846.63
(一)、综合收益总额	-	-	-13,686,414.26	-13,686,414.26
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值)	-8,000,000.00	-	-3,890,432.37	-11,890,432.37

减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	6,000,000.00	-	3,120,913.07	9,120,913.07
2. 基金赎回款	-14,000,000.00	-	-7,011,345.44	-21,011,345.44
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	98,048,000.00	-	54,653,952.09	152,701,952.09
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	128,048,000.00	-	66,495,137.34	194,543,137.34
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	128,048,000.00	-	66,495,137.34	194,543,137.34
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“- ” 号 填 列)	-16,000,000.00	-	5,803,071.41	-10,196,928.59
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	14,773,673.81	14,773,673.81
(二)、 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
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其 他 综 合 收 益 结 转 留	-	-	-	-

存收益				
四、本期期末净资产(基金净值)	112,048,000.00	-	72,298,208.75	184,346,208.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

吴曙明

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信 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。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于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、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、权证、股指期货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）。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。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以

外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益

的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,916,518.13 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,646.45 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,918,164.58 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 11,150.34 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 5.39 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价

值为人民币 11,155.73 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 35,786.08 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 17.71 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 35,803.79 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,669.55 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 1,646.45 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 5.39 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 17.71 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

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

6.4.6.2 增值税

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

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

取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

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

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

6.4.6.3 企业所得税

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

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

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	5,514,020.27
等于：本金	5,512,980.01
加：应计利息	1,040.26
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,514,020.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	131,475,165.42	-	148,601,080.88	17,125,915.46
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	131,475,165.42	-	148,601,080.88	17,125,915.46

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	86,964.82
其中：交易所市场	86,964.82

银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	63,619.50
预提费用	144,493.38
合计	295,077.70

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	106,048,000.00	106,048,000.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-14,000,000.00	-14,000,000.00
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	98,048,000.00	98,048,000.00

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。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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
本期期初	83,100,362.35	-10,869,563.63	72,230,798.72
本期利润	2,032,277.32	-15,718,691.58	-13,686,414.26
本期基金份额交易产生的变动数	-6,403,733.66	2,513,301.29	-3,890,432.37
其中：基金申购款	4,719,556.39	-1,598,643.32	3,120,913.07
基金赎回款	-11,123,290.05	4,111,944.61	-7,011,345.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,728,906.01	-24,074,953.92	54,653,952.09

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	活期存款利息收入	19,793.24
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	244.66	

其他	271.17
合计	20,309.07

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	315,978.72
股票投资收益——赎回差价收入	851,578.99
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	1,167,557.71

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	18,627,488.35
减：卖出股票成本总额	18,251,329.07
减：交易费用	60,180.56
买卖股票差价收入	315,978.72

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	21,011,345.44
减：现金支付赎回款总额	9,408,147.44
减：赎回股票成本总额	10,751,619.01
减：交易费用	-
赎回差价收入	851,578.99

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	3.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,727.93
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	7,731.36

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	36,731.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	28,999.87
减：应计利息总额	3.56
减：交易费用	0.04
买卖债券差价收入	7,727.93

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,418,450.23
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	1,418,450.23

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-15,718,691.58
股票投资	-15,718,691.58
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	-15,718,691.58

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	40,429.00
合计	40,429.00

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022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	443.38
指数使用费	66,825.65
合计	151,571.59

6.4.7.24 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、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
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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	15,585,460.62	49.26	31,585,645.91	47.62

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 2022年1月1日至2022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	14,514.94	49.57	54,736.19	62.94
关联方名称	上年度可比期间 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

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。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等。

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	392,190.35
其中：支付销售机构的客户维护费	38,254.15	49,417.07

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 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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日

当期发生的基金应支付的托管费	78,438.11	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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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固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 2022年6月30日		上年度末 2021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	45,673,700.00	46.58	44,002,400.00	41.49
------------------------------------	---------------	-------	---------------	-------

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金因指数投资而持有关联方建设银行（证券代码：601939）的持仓数量为 33,423.00 股，占本基金总净值的比例为 0.13%。持有关联方中金公司（证券代码：601995）的持仓数量为 4,000.00 股，占本基金总净值的比例为 0.12%。（于 2021 年 6 月 30 日，本基金因指数投资而持有关联方建设银行（证券代码：601939）的持仓数量为 37,623.00 股，占本基金总净值的比例为 0.14%。）

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2022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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新发未上市	55.57	30.03	106	5,890.42	3,183.18	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	新发未上市	52.37	47.83	140	7,331.80	6,696.20	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新发未上市	32.77	32.02	166	5,440.00	5,315.32	-
301109	军信	2022年	6个月	新发未	23.21	16.14	378	8,772.12	6,100.92	-

	股份	4月6日		上市							
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新发未上市	11.40	20.46	505	5,757.00	10,332.30		-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新发未上市	13.73	15.49	660	9,061.80	10,223.40		-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新发未上市	22.55	37.70	217	4,893.35	8,180.90		-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新发未上市	31.98	26.26	195	6,236.10	5,120.70		-
301136	招标股份	2021年12月31日	6个月	新发未上市	10.52	19.74	5,246	55,187.92	103,556.04		-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新发未上市	15.37	15.99	391	6,009.67	6,252.09		-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新发未上市	38.39	23.90	200	7,678.00	4,780.00		-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新发未上市	30.82	21.46	192	5,917.44	4,120.32		-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新发未上市	26.27	32.33	249	6,541.23	8,050.17		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新发未上市	40.25	30.59	143	5,755.75	4,374.37		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新发未上市	64.08	37.52	65	4,165.20	2,438.80		-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新发未上市	76.56	51.92	109	8,345.04	5,659.28		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新发未上市	56.88	56.42	109	6,199.92	6,149.78		-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新发未上市	3.80	6.39	2,013	7,649.40	12,863.07		-

301219	腾远 钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新发未 上市	97.11	87.82	43	4,175.52	3,776.26	-
301222	浙江 恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新发未 上市	33.98	28.96	176	5,980.48	5,096.96	-
301228	实朴 检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新发未 上市	20.08	20.34	323	6,485.84	6,569.82	-
301236	软通 动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新发未 上市	48.59	31.38	198	9,620.16	6,213.24	-
301237	和顺 科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新发未 上市	56.69	41.86	105	5,952.45	4,395.30	-
301248	杰创 智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新发未 上市	39.07	29.87	195	7,618.65	5,824.65	-
301256	华融 化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新发未 上市	8.05	10.08	761	6,126.05	7,670.88	-
301258	富士 莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新发未 上市	48.30	41.68	103	4,974.90	4,293.04	-
301259	艾布 鲁	2022 年 4 月 18 日	6 个月	新发未 上市	18.39	24.94	353	6,491.67	8,803.82	-
301263	泰恩 康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新发未 上市	19.93	31.38	269	5,361.17	8,441.22	-
301268	铭利 达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新发未 上市	28.50	34.87	188	5,358.00	6,555.56	-
301279	金道 科技	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新发未 上市	31.20	22.81	174	5,428.80	3,968.94	-
301288	清研 环境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新发未 上市	19.09	19.98	396	7,559.64	7,912.08	-
688207	格灵 深瞳	2022 年 3 月 9 日	6 个月	新发未 上市	39.49	26.38	2,976	117,522.24	78,506.88	-
688209	英集 芯	2022 年 4 月 12	6 个月	新发未 上市	24.23	27.58	2,729	66,123.67	75,265.82	-

		日								
688234	天岳先进	2022 年 1 月 5 日	6 个月	新发未上市	82.79	65.19	918	76,001.22	59,844.42	-
688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新发未上市	41.27	41.27	1,512	62,400.24	62,400.24	-
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	6 个月	新发未上市	41.98	47.75	1,482	62,214.36	70,765.50	-

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、由风险管理与内控合规委员会、 督察长、风险与合规管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和 其他业务部门的督察长和风险与合规管理部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检 查、监督及报告。

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 2022年6月30日	上年度末 2021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，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 2022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	5,514,020.27	-	-	-	5,514,020.27
结算备付金	8,015.94	-	-	-	8,015.94
存出保证金	21,523.43	-	-	-	21,523.43
交易性金融资产	-	-	-	148,601,080.88	148,601,080.88
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	5,543,559.64	-	-	148,601,080.88	154,144,640.52
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,071,452.84	1,071,452.84
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	63,464.93	63,464.93
应付托管费	-	-	-	12,692.96	12,692.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	295,077.70	295,077.70
负债总计	-	-	-	1,442,688.43	1,442,688.43

利率敏感度缺口	5,543,559.64	-	-	-147,158,392.45	152,701,952.09
上年度末 2021 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	7,916,518.13	-	-	-	7,916,518.13
结算备付金	11,150.34	-	-	-	11,150.34
存出保证金	35,786.08	-	-	-	35,786.08
交易性金融资产	-	-	-	-171,111,983.48	171,111,983.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,669.55	1,669.55
资产总计	7,963,454.55	-	-	-171,113,653.03	179,077,107.58
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	-	-	-	411,647.35	411,647.35
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	78,541.93	78,541.93
应付托管费	-	-	-	15,708.36	15,708.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	292,411.22	292,411.22
负债总计	-	-	-	798,308.86	798,308.86
利率敏感度缺口	7,963,454.55	-	-	-170,315,344.17	178,278,798.72

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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 2022年6月30日		上年度末 2021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	148,601,080.88	97.31	171,111,983.48	95.98
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	148,601,080.88	97.31	171,111,983.48	95.98

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月）

			31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	7,343,774.28	8,553,473.43
	业绩比较基准下降 5%	-7,343,774.28	-8,553,473.43

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	147,961,379.41	169,394,191.88
第二层次	62,400.24	210,338.17
第三层次	577,301.23	1,507,453.43
合计	148,601,080.88	171,111,983.48

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	148,601,080.88	96.40
	其中：股票	148,601,080.88	96.40
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	5,522,036.21	3.58
8	其他各项资产	21,523.43	0.01
9	合计	154,144,640.52	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	1,798,783.72	1.18
B	采矿业	5,729,984.96	3.75
C	制造业	87,751,037.97	57.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,803,444.68	2.49
E	建筑业	2,586,460.84	1.69
F	批发和零售业	1,185,316.10	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	4,509,060.26	2.95

H	住宿和餐饮业	291,710.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,538,078.27	2.97
J	金融业	25,820,816.79	16.91
K	房地产业	2,621,074.12	1.72
L	租赁和商务服务业	2,117,632.98	1.39
M	科学研究和技术服务业	1,732,120.04	1.13
N	水利、环境和公共设施管理业	304,863.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,267,130.83	0.83
R	文化、体育和娱乐业	457,141.05	0.30
S	综合	120,061.00	0.08
	合计	146,634,716.61	96.03

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,250,826.45	0.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,441.22	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	468,927.85	0.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	173,700.69	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	59,152.74	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	5,315.32	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,966,364.27	1.29

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	4,396	8,989,820.00	5.89
2	300750	宁德时代	8,000	4,272,000.00	2.80
3	600036	招商银行	71,882	3,033,420.40	1.99
4	000858	五粮液	13,507	2,727,468.51	1.79
5	002594	比亚迪	6,412	2,138,337.88	1.40
6	600900	长江电力	79,084	1,828,422.08	1.20
7	601318	中国平安	37,678	1,759,185.82	1.15
8	601012	隆基绿能	26,207	1,746,172.41	1.14
9	601888	中国中免	6,886	1,603,955.98	1.05
10	601166	兴业银行	72,366	1,440,083.40	0.94
11	600809	山西汾酒	4,221	1,370,980.80	0.90
12	300760	迈瑞医疗	4,200	1,315,440.00	0.86
13	000568	泸州老窖	5,100	1,257,354.00	0.82
14	603288	海天味业	13,377	1,208,745.72	0.79
15	300059	东方财富	45,913	1,166,190.20	0.76
16	600309	万华化学	11,000	1,066,890.00	0.70
17	601398	工商银行	218,798	1,043,666.46	0.68
18	000001	平安银行	67,628	1,013,067.44	0.66
19	002714	牧原股份	18,296	1,011,219.92	0.66
20	002304	洋河股份	5,288	968,497.20	0.63
21	600438	通威股份	15,800	945,788.00	0.62
22	002352	顺丰控股	16,933	945,030.73	0.62
23	603259	药明康德	8,876	923,015.24	0.60
24	600030	中信证券	42,480	920,116.80	0.60
25	601288	农业银行	296,300	894,826.00	0.59
26	300015	爱尔眼科	18,804	841,855.08	0.55
27	600887	伊利股份	21,588	840,852.60	0.55
28	002475	立讯精密	24,632	832,315.28	0.55

29	002142	宁波银行	23,012	824,059.72	0.54
30	600276	恒瑞医药	22,156	821,766.04	0.54
31	600000	浦发银行	102,100	817,821.00	0.54
32	600436	片仔癀	2,200	784,806.00	0.51
33	601668	中国建筑	146,012	776,783.84	0.51
34	601088	中国神华	22,891	762,270.30	0.50
35	002812	恩捷股份	3,000	751,350.00	0.49
36	600048	保利发展	41,600	726,336.00	0.48
37	601225	陕西煤业	33,800	715,884.00	0.47
38	601816	京沪高铁	142,500	715,350.00	0.47
39	000002	万科 A	33,940	695,770.00	0.46
40	601328	交通银行	136,575	680,143.50	0.45
41	002129	TCL 中环	11,400	671,346.00	0.44
42	601899	紫金矿业	71,738	669,315.54	0.44
43	300014	亿纬锂能	6,696	652,860.00	0.43
44	600406	国电南瑞	23,264	628,128.00	0.41
45	300122	智飞生物	5,600	621,656.00	0.41
46	601919	中远海控	44,180	614,102.00	0.40
47	300124	汇川技术	9,198	605,872.26	0.40
48	002459	晶澳科技	7,660	604,374.00	0.40
49	600690	海尔智家	21,828	599,396.88	0.39
50	002460	赣锋锂业	3,987	592,866.90	0.39
51	600031	三一重工	29,645	565,033.70	0.37
52	601601	中国太保	23,808	560,202.24	0.37
53	002493	荣盛石化	35,075	539,804.25	0.35
54	603799	华友钴业	5,553	530,977.86	0.35
55	002371	北方华创	1,900	526,528.00	0.34
56	000725	京东方 A	130,500	514,170.00	0.34
57	603501	韦尔股份	2,900	501,787.00	0.33
58	300274	阳光电源	5,100	501,075.00	0.33
59	000625	长安汽车	28,852	499,716.64	0.33
60	601658	邮储银行	92,500	498,575.00	0.33
61	600585	海螺水泥	13,941	491,838.48	0.32
62	688599	天合光能	7,400	482,850.00	0.32
63	600104	上汽集团	27,018	481,190.58	0.32
64	300498	温氏股份	22,020	468,805.80	0.31
65	600019	宝钢股份	77,600	467,152.00	0.31
66	600016	民生银行	123,524	459,509.28	0.30
67	600028	中国石化	110,700	451,656.00	0.30
68	600111	北方稀土	12,550	441,258.00	0.29
69	601766	中国中车	84,700	440,440.00	0.29
70	601390	中国中铁	71,500	439,010.00	0.29

71	601066	中信建投	15,100	436,541.00	0.29
72	600346	恒力石化	19,607	436,059.68	0.29
73	601818	光大银行	143,800	432,838.00	0.28
74	601985	中国核电	62,700	430,122.00	0.28
75	600893	航发动力	9,265	421,650.15	0.28
76	002709	天赐材料	6,780	420,766.80	0.28
77	300896	爱美客	700	420,007.00	0.28
78	601669	中国电建	53,300	419,471.00	0.27
79	002049	紫光国微	2,200	417,384.00	0.27
80	601988	中国银行	122,262	398,574.12	0.26
81	601857	中国石油	75,100	398,030.00	0.26
82	601211	国泰君安	26,000	395,200.00	0.26
83	002241	歌尔股份	11,700	393,120.00	0.26
84	600919	江苏银行	54,653	389,129.36	0.25
85	000776	广发证券	20,700	387,090.00	0.25
86	000538	云南白药	6,346	383,234.94	0.25
87	000596	古井贡酒	1,500	374,490.00	0.25
88	600999	招商证券	25,968	374,198.88	0.25
89	600050	中国联通	107,800	372,988.00	0.24
90	600010	包钢股份	158,600	372,710.00	0.24
91	001979	招商蛇口	27,563	370,171.09	0.24
92	600745	闻泰科技	4,300	365,973.00	0.24
93	601688	华泰证券	25,700	364,940.00	0.24
94	601009	南京银行	34,900	363,658.00	0.24
95	600089	特变电工	13,144	360,014.16	0.24
96	688111	金山办公	1,800	354,816.00	0.23
97	603986	兆易创新	2,484	353,249.64	0.23
98	603993	洛阳钼业	61,500	352,395.00	0.23
99	000063	中兴通讯	13,800	352,314.00	0.23
100	000895	双汇发展	11,971	350,750.30	0.23
101	000661	长春高新	1,500	350,130.00	0.23
102	002311	海大集团	5,800	348,058.00	0.23
103	600188	兖矿能源	8,800	347,424.00	0.23
104	000651	格力电器	10,300	347,316.00	0.23
105	603392	万泰生物	2,220	344,766.00	0.23
106	601138	工业富联	34,700	341,448.00	0.22
107	601006	大秦铁路	51,700	340,703.00	0.22
108	002027	分众传媒	50,200	337,846.00	0.22
109	000166	申万宏源	78,342	336,087.18	0.22
110	601169	北京银行	73,492	333,653.68	0.22
111	002230	科大讯飞	8,050	331,821.00	0.22
112	600837	海通证券	33,600	329,616.00	0.22

113	601229	上海银行	49,333	323,131.15	0.21
114	300759	康龙化成	3,300	314,226.00	0.21
115	300751	迈为股份	640	314,176.00	0.21
116	600196	复星医药	7,100	313,039.00	0.20
117	002920	德赛西威	2,100	310,800.00	0.20
118	600926	杭州银行	20,740	310,685.20	0.20
119	600989	宝丰能源	21,100	309,115.00	0.20
120	603806	福斯特	4,656	305,061.12	0.20
121	300316	晶盛机电	4,500	304,155.00	0.20
122	601628	中国人寿	9,644	299,735.52	0.20
123	300763	锦浪科技	1,400	298,200.00	0.20
124	600150	中国船舶	15,700	297,986.00	0.20
125	600660	福耀玻璃	7,100	296,851.00	0.19
126	000338	潍柴动力	23,600	294,292.00	0.19
127	600522	中天科技	12,600	291,060.00	0.19
128	603833	欧派家居	1,916	288,702.88	0.19
129	601633	长城汽车	7,700	285,208.00	0.19
130	601100	恒立液压	4,580	282,677.60	0.19
131	600029	南方航空	38,565	281,910.15	0.18
132	000963	华东医药	6,201	280,037.16	0.18
133	603659	璞泰来	3,280	276,832.00	0.18
134	300999	金龙鱼	5,100	275,502.00	0.18
135	300782	卓胜微	2,016	272,160.00	0.18
136	300142	沃森生物	5,600	270,984.00	0.18
137	600886	国投电力	25,800	270,900.00	0.18
138	600958	东方证券	26,500	270,565.00	0.18
139	603290	斯达半导	700	270,130.00	0.18
140	002074	国轩高科	5,900	269,040.00	0.18
141	688012	中微公司	2,300	268,525.00	0.18
142	601111	中国国航	23,100	268,191.00	0.18
143	601868	中国能建	112,900	267,573.00	0.18
144	601877	正泰电器	7,388	264,342.64	0.17
145	600132	重庆啤酒	1,800	263,880.00	0.17
146	002821	凯莱英	900	260,100.00	0.17
147	601689	拓普集团	3,800	260,034.00	0.17
148	601238	广汽集团	17,000	259,080.00	0.17
149	000733	振华科技	1,900	258,343.00	0.17
150	600588	用友网络	11,821	256,633.91	0.17
151	600741	华域汽车	11,100	255,300.00	0.17
152	600460	士兰微	4,900	254,800.00	0.17
153	688008	澜起科技	4,200	254,436.00	0.17
154	002180	纳思达	4,958	250,973.96	0.16

155	002001	新和成	10,868	247,899.08	0.16
156	600600	青岛啤酒	2,375	246,810.00	0.16
157	300661	圣邦股份	1,350	245,727.00	0.16
158	300769	德方纳米	600	245,208.00	0.16
159	601615	明阳智能	7,200	243,360.00	0.16
160	600795	国电电力	62,100	242,811.00	0.16
161	688396	华润微	4,100	242,187.00	0.16
162	600176	中国巨石	13,888	241,790.08	0.16
163	000876	新希望	15,800	241,740.00	0.16
164	600233	圆通速递	11,800	240,602.00	0.16
165	600256	广汇能源	22,800	240,312.00	0.16
166	000100	TCL 科技	49,200	235,668.00	0.15
167	600015	华夏银行	44,800	233,408.00	0.15
168	000301	东方盛虹	13,800	233,358.00	0.15
169	600547	山东黄金	12,452	231,109.12	0.15
170	601336	XD 新华保	7,108	228,806.52	0.15
171	601865	福莱特	6,000	228,600.00	0.15
172	300628	亿联网络	3,000	228,450.00	0.15
173	002756	永兴材料	1,500	228,315.00	0.15
174	600570	恒生电子	5,156	224,492.24	0.15
175	603260	合盛硅业	1,900	224,124.00	0.15
176	600011	华能国际	31,800	223,872.00	0.15
177	688036	传音控股	2,500	223,075.00	0.15
178	000799	酒鬼酒	1,200	222,972.00	0.15
179	300413	芒果超媒	6,600	220,176.00	0.14
180	688005	容百科技	1,700	220,048.00	0.14
181	603486	科沃斯	1,800	219,402.00	0.14
182	603369	今世缘	4,300	219,300.00	0.14
183	603185	上机数控	1,400	218,386.00	0.14
184	601618	中国中冶	62,200	217,700.00	0.14
185	300957	贝泰妮	1,000	217,530.00	0.14
186	600884	杉杉股份	7,300	216,956.00	0.14
187	601600	中国铝业	45,400	215,650.00	0.14
188	002648	卫星化学	8,299	214,529.15	0.14
189	600845	宝信软件	3,920	214,032.00	0.14
190	601788	光大证券	13,527	213,185.52	0.14
191	601360	三六零	24,952	212,591.04	0.14
192	002736	国信证券	22,200	212,454.00	0.14
193	600383	金地集团	15,800	212,352.00	0.14
194	600426	华鲁恒升	7,220	210,824.00	0.14
195	600763	通策医疗	1,200	209,328.00	0.14
196	300496	中科创达	1,600	208,768.00	0.14

197	002938	鹏鼎控股	6,900	208,449.00	0.14
198	000786	北新建材	6,000	207,720.00	0.14
199	601838	成都银行	12,500	207,250.00	0.14
200	300408	三环集团	6,800	204,680.00	0.13
201	601939	建设银行	33,423	202,543.38	0.13
202	601117	中国化学	21,100	198,551.00	0.13
203	601155	新城控股	7,800	198,354.00	0.13
204	605117	德业股份	700	195,923.00	0.13
205	688180	君实生物	2,600	195,884.00	0.13
206	600754	锦江酒店	3,100	194,990.00	0.13
207	601916	浙商银行	58,300	193,556.00	0.13
208	000938	紫光股份	9,962	193,262.80	0.13
209	300207	欣旺达	6,100	192,760.00	0.13
210	601901	方正证券	28,700	192,577.00	0.13
211	300033	同花顺	2,000	192,300.00	0.13
212	300390	天华超净	2,200	192,280.00	0.13
213	603606	东方电缆	2,500	191,500.00	0.13
214	300223	北京君正	1,800	191,250.00	0.13
215	000983	山西焦煤	14,260	190,941.40	0.13
216	600018	上港集团	32,400	188,892.00	0.12
217	002841	视源股份	2,500	188,300.00	0.12
218	300433	蓝思科技	17,000	188,190.00	0.12
219	601799	星宇股份	1,100	188,100.00	0.12
220	600009	上海机场	3,311	187,733.70	0.12
221	603737	三棵树	1,440	186,379.20	0.12
222	300919	中伟股份	1,500	185,850.00	0.12
223	000069	华侨城 A	28,607	185,659.43	0.12
224	688169	石头科技	300	185,010.00	0.12
225	603345	安井食品	1,100	184,657.00	0.12
226	600563	法拉电子	900	184,644.00	0.12
227	601727	上海电气	44,600	183,306.00	0.12
228	002916	深南电路	1,940	181,797.40	0.12
229	000723	美锦能源	14,900	181,780.00	0.12
230	688126	沪硅产业	7,800	179,244.00	0.12
231	601995	中金公司	4,000	177,960.00	0.12
232	002202	金风科技	11,893	176,016.40	0.12
233	601607	上海医药	9,700	175,376.00	0.11
234	002240	盛新锂能	2,900	175,044.00	0.11
235	600115	中国东航	31,700	174,033.00	0.11
236	603899	晨光股份	3,100	173,848.00	0.11
237	600039	四川路桥	16,500	173,745.00	0.11
238	002120	韵达股份	10,180	173,670.80	0.11

239	300073	当升科技	1,900	171,646.00	0.11
240	688363	华熙生物	1,200	170,616.00	0.11
241	300601	康泰生物	3,769	170,283.42	0.11
242	600584	长电科技	6,300	170,100.00	0.11
243	002236	大华股份	10,277	168,748.34	0.11
244	605358	立昂微	2,500	168,450.00	0.11
245	002013	中航机电	13,600	167,960.00	0.11
246	600141	兴发集团	3,800	167,162.00	0.11
247	603613	国联股份	1,885	167,011.00	0.11
248	600779	水井坊	1,800	166,572.00	0.11
249	688122	西部超导	1,800	165,960.00	0.11
250	601377	兴业证券	23,340	164,547.00	0.11
251	002601	龙佰集团	8,200	164,410.00	0.11
252	300450	先导智能	2,580	163,004.40	0.11
253	603198	迎驾贡酒	2,500	162,850.00	0.11
254	002555	三七互娱	7,600	161,348.00	0.11
255	300595	欧普康视	2,810	160,703.90	0.11
256	300347	泰格医药	1,400	160,230.00	0.10
257	600875	东方电气	9,701	159,581.45	0.10
258	002080	中材科技	5,700	156,750.00	0.10
259	300454	深信服	1,500	155,670.00	0.10
260	002791	坚朗五金	1,200	155,664.00	0.10
261	600918	中泰证券	20,300	155,295.00	0.10
262	600332	白云山	4,867	153,748.53	0.10
263	002192	融捷股份	1,000	153,700.00	0.10
264	601878	浙商证券	13,500	153,630.00	0.10
265	601699	潞安环能	10,500	153,510.00	0.10
266	600219	南山铝业	41,500	153,135.00	0.10
267	000157	中联重科	24,790	152,706.40	0.10
268	600803	新奥股份	8,200	152,438.00	0.10
269	603816	顾家家居	2,690	152,334.70	0.10
270	688099	晶晨股份	1,500	151,500.00	0.10
271	600885	宏发股份	3,620	151,497.00	0.10
272	600674	川投能源	12,700	151,384.00	0.10
273	002176	江特电机	6,000	150,240.00	0.10
274	603568	伟明环保	4,500	150,165.00	0.10
275	002340	格林美	16,500	150,150.00	0.10
276	002414	高德红外	11,574	148,957.38	0.10
277	000999	华润三九	3,300	148,500.00	0.10
278	000425	徐工机械	27,200	146,608.00	0.10
279	600486	扬农化工	1,100	146,608.00	0.10
280	002007	华兰生物	6,420	146,376.00	0.10

281	002064	华峰化学	17,200	145,168.00	0.10
282	601881	中国银河	15,000	145,050.00	0.09
283	603456	九洲药业	2,800	144,760.00	0.09
284	002603	以岭药业	5,920	143,856.00	0.09
285	601216	君正集团	29,400	143,472.00	0.09
286	002850	科达利	900	143,100.00	0.09
287	000519	中兵红箭	4,900	142,835.00	0.09
288	603882	金域医学	1,700	140,335.00	0.09
289	600392	盛和资源	6,200	140,120.00	0.09
290	300144	宋城演艺	9,083	139,424.05	0.09
291	002252	上海莱士	23,500	139,355.00	0.09
292	600499	科达制造	6,700	138,288.00	0.09
293	002384	东山精密	6,000	137,580.00	0.09
294	600298	安琪酵母	2,800	136,500.00	0.09
295	600183	生益科技	8,000	135,920.00	0.09
296	300529	健帆生物	2,670	135,876.30	0.09
297	000977	浪潮信息	5,120	135,577.60	0.09
298	300373	扬杰科技	1,900	135,375.00	0.09
299	002372	伟星新材	5,600	134,624.00	0.09
300	000683	远兴能源	12,700	133,477.00	0.09
301	000703	恒逸石化	12,680	133,266.80	0.09
302	603517	绝味食品	2,300	132,986.00	0.09
303	603127	昭衍新药	1,160	132,008.00	0.09
304	601966	玲珑轮胎	5,200	131,924.00	0.09
305	601233	桐昆股份	8,300	131,804.00	0.09
306	600153	建发股份	10,011	130,843.77	0.09
307	002497	雅化集团	4,000	130,600.00	0.09
308	603077	和邦生物	30,600	130,356.00	0.09
309	300037	新宙邦	2,480	130,348.80	0.09
310	300146	汤臣倍健	6,000	129,900.00	0.09
311	000738	航发控制	4,600	129,260.00	0.08
312	601108	财通证券	16,400	129,068.00	0.08
313	601696	中银证券	9,700	129,010.00	0.08
314	002353	杰瑞股份	3,200	128,960.00	0.08
315	603589	口子窖	2,200	128,942.00	0.08
316	601555	东吴证券	18,577	128,738.61	0.08
317	600348	华阳股份	8,300	128,318.00	0.08
318	002625	光启技术	7,400	127,798.00	0.08
319	600655	豫园股份	13,500	127,440.00	0.08
320	600362	江西铜业	7,100	126,593.00	0.08
321	601319	中国人保	24,800	125,488.00	0.08
322	600985	淮北矿业	8,600	125,216.00	0.08

323	002602	世纪华通	25,840	124,548.80	0.08
324	002600	领益智造	24,700	123,994.00	0.08
325	600160	巨化股份	9,400	123,610.00	0.08
326	002405	四维图新	8,200	123,574.00	0.08
327	600026	中远海能	11,900	122,927.00	0.08
328	603939	益丰药房	2,326	122,882.58	0.08
329	000932	华菱钢铁	24,100	122,669.00	0.08
330	002407	多氟多	2,500	122,275.00	0.08
331	000066	中国长城	11,300	122,266.00	0.08
332	603267	鸿远电子	900	120,897.00	0.08
333	603707	健友股份	4,283	120,780.60	0.08
334	601058	赛轮轮胎	10,700	120,589.00	0.08
335	002268	卫士通	2,800	120,148.00	0.08
336	000009	中国宝安	8,900	120,061.00	0.08
337	000630	铜陵有色	36,600	119,316.00	0.08
338	300003	乐普医疗	6,400	118,848.00	0.08
339	601636	旗滨集团	9,300	118,575.00	0.08
340	600521	华海药业	5,190	117,813.00	0.08
341	600487	亨通光电	8,100	117,774.00	0.08
342	000807	云铝股份	11,900	117,572.00	0.08
343	000830	鲁西化工	6,800	117,572.00	0.08
344	600161	天坛生物	4,800	116,544.00	0.08
345	300724	捷佳伟创	1,300	116,155.00	0.08
346	600109	国金证券	12,900	116,100.00	0.08
347	000155	川能动力	5,200	115,180.00	0.08
348	002508	老板电器	3,195	115,115.85	0.08
349	300568	星源材质	3,945	114,562.80	0.08
350	002078	太阳纸业	9,300	114,483.00	0.07
351	000783	长江证券	19,300	114,449.00	0.07
352	000629	攀钢钒钛	30,000	114,000.00	0.07
353	688009	中国通号	25,100	113,703.00	0.07
354	601077	渝农商行	30,600	113,220.00	0.07
355	002032	苏泊尔	2,000	112,680.00	0.07
356	002385	大北农	14,400	112,464.00	0.07
357	688006	杭可科技	1,600	112,096.00	0.07
358	600848	上海临港	8,260	112,005.60	0.07
359	600027	华电国际	28,400	111,612.00	0.07
360	002738	中矿资源	1,200	111,132.00	0.07
361	601577	长沙银行	14,000	111,020.00	0.07
362	300699	光威复材	1,880	110,675.60	0.07
363	601666	平煤股份	8,000	108,720.00	0.07
364	300850	新强联	1,220	108,616.60	0.07

365	000825	太钢不锈	19,900	108,455.00	0.07
366	300832	新产业	2,400	108,264.00	0.07
367	002557	洽洽食品	1,900	108,167.00	0.07
368	600549	厦门钨业	5,000	108,100.00	0.07
369	300676	华大基因	1,500	107,550.00	0.07
370	600177	雅戈尔	16,200	107,406.00	0.07
371	600705	中航产融	30,900	106,914.00	0.07
372	002294	信立泰	3,788	106,442.80	0.07
373	600415	小商品城	19,100	106,387.00	0.07
374	002568	百润股份	3,536	106,221.44	0.07
375	601990	南京证券	12,720	106,084.80	0.07
376	002185	华天科技	11,300	105,994.00	0.07
377	688188	柏楚电子	480	105,619.20	0.07
378	002531	天顺风能	6,400	105,536.00	0.07
379	000027	深圳能源	16,460	105,508.60	0.07
380	601866	中远海发	34,600	103,800.00	0.07
381	002507	涪陵榨菜	3,000	103,560.00	0.07
382	002430	杭氧股份	3,300	103,158.00	0.07
383	000831	五矿稀土	3,300	103,125.00	0.07
384	000987	越秀金控	14,588	102,553.64	0.07
385	002673	西部证券	15,614	102,115.56	0.07
386	000800	一汽解放	10,900	101,806.00	0.07
387	601198	东兴证券	11,400	101,460.00	0.07
388	601456	国联证券	8,243	101,141.61	0.07
389	000933	神火股份	7,700	100,716.00	0.07
390	600516	方大炭素	13,190	100,244.00	0.07
391	002409	雅克科技	1,800	99,918.00	0.07
392	600038	中直股份	2,200	99,440.00	0.07
393	002624	完美世界	6,900	99,153.00	0.06
394	000960	锡业股份	5,900	98,943.00	0.06
395	300357	我武生物	1,900	98,857.00	0.06
396	603233	大参林	3,156	98,782.80	0.06
397	002153	石基信息	6,224	98,774.88	0.06
398	002463	沪电股份	6,680	98,596.80	0.06
399	300251	光线传媒	10,300	97,541.00	0.06
400	002128	电投能源	6,800	97,376.00	0.06
401	601168	西部矿业	8,200	97,006.00	0.06
402	000401	冀东水泥	9,200	96,784.00	0.06
403	600258	首旅酒店	3,900	96,720.00	0.06
404	603444	吉比特	247	95,836.00	0.06
405	002326	永太科技	2,900	95,497.00	0.06
406	603338	浙江鼎力	1,880	95,316.00	0.06

407	688202	美迪西	280	95,090.80	0.06
408	000728	国元证券	15,270	94,979.40	0.06
409	002797	第一创业	14,700	94,227.00	0.06
410	600988	赤峰黄金	5,900	94,105.00	0.06
411	000975	银泰黄金	9,640	93,893.60	0.06
412	600170	上海建工	30,900	93,627.00	0.06
413	002422	科伦药业	5,000	93,500.00	0.06
414	600598	北大荒	6,300	92,988.00	0.06
415	601880	辽港股份	54,500	92,650.00	0.06
416	603605	珀莱雅	560	92,500.80	0.06
417	600704	物产中大	18,000	92,340.00	0.06
418	300726	宏达电子	1,500	91,755.00	0.06
419	600369	西南证券	23,100	91,707.00	0.06
420	600801	华新水泥	4,700	91,697.00	0.06
421	002939	长城证券	9,000	91,440.00	0.06
422	300558	贝达药业	1,500	91,200.00	0.06
423	600079	人福医药	5,700	91,200.00	0.06
424	000937	冀中能源	12,200	91,012.00	0.06
425	600872	中炬高新	2,600	89,986.00	0.06
426	002266	浙富控股	18,700	89,573.00	0.06
427	000423	东阿阿胶	2,417	89,308.15	0.06
428	002028	思源电气	2,500	89,150.00	0.06
429	600338	西藏珠峰	3,100	88,970.00	0.06
430	002532	天山铝业	13,500	88,155.00	0.06
431	000591	太阳能	10,500	87,675.00	0.06
432	002223	鱼跃医疗	3,400	87,244.00	0.06
433	000893	亚钾国际	2,500	86,025.00	0.06
434	000050	深天马 A	8,501	84,754.97	0.06
435	600143	金发科技	8,900	84,728.00	0.06
436	000739	普洛药业	4,100	84,624.00	0.06
437	600380	健康元	6,800	83,980.00	0.05
438	300308	中际旭创	2,700	83,835.00	0.05
439	603218	日月股份	3,300	83,820.00	0.05
440	601016	节能风电	17,400	83,520.00	0.05
441	002030	达安基因	4,852	83,405.88	0.05
442	000709	河钢股份	36,900	83,394.00	0.05
443	000513	丽珠集团	2,300	83,283.00	0.05
444	002299	圣农发展	4,300	82,474.00	0.05
445	603712	七一二	2,600	81,900.00	0.05
446	600688	上海石化	25,654	81,579.72	0.05
447	601992	金隅集团	29,100	80,607.00	0.05
448	002408	齐翔腾达	9,900	80,289.00	0.05

449	002152	广电运通	8,600	79,722.00	0.05
450	688185	康希诺	400	79,632.00	0.05
451	600808	马钢股份	20,900	79,211.00	0.05
452	600056	中国医药	5,340	79,138.80	0.05
453	000988	华工科技	3,400	78,778.00	0.05
454	600998	九州通	6,589	78,474.99	0.05
455	002456	欧菲光	11,496	77,138.16	0.05
456	002541	鸿路钢构	2,300	76,820.00	0.05
457	603866	桃李面包	4,640	76,792.00	0.05
458	603858	步长制药	3,895	76,770.45	0.05
459	000998	隆平高科	4,600	76,636.00	0.05
460	002506	协鑫集成	20,500	76,260.00	0.05
461	002044	美年健康	13,575	75,612.75	0.05
462	600699	均胜电子	4,800	75,408.00	0.05
463	600711	盛屯矿业	9,600	74,496.00	0.05
464	002145	中核钛白	10,420	74,294.60	0.05
465	002138	顺络电子	2,700	73,575.00	0.05
466	600295	鄂尔多斯	4,040	72,922.00	0.05
467	002465	海格通信	7,904	71,847.36	0.05
468	002065	东华软件	11,300	71,416.00	0.05
469	002926	华西证券	9,100	71,344.00	0.05
470	002156	通富微电	4,600	70,840.00	0.05
471	002500	山西证券	12,340	70,831.60	0.05
472	002010	传化智联	10,800	69,444.00	0.05
473	002092	中泰化学	8,900	69,064.00	0.05
474	000750	国海证券	18,960	68,824.80	0.05
475	600895	张江高科	5,400	67,230.00	0.04
476	300383	光环新网	6,400	66,688.00	0.04
477	002157	正邦科技	11,000	66,660.00	0.04
478	300418	昆仑万维	4,100	65,600.00	0.04
479	300070	碧水源	12,500	65,125.00	0.04
480	300253	卫宁健康	7,390	64,884.20	0.04
481	002958	青农商行	19,400	64,408.00	0.04
482	000860	顺鑫农业	2,400	64,368.00	0.04
483	600583	海油工程	15,500	64,325.00	0.04
484	688298	东方生物	560	63,924.00	0.04
485	688002	睿创微纳	1,600	63,552.00	0.04
486	300677	英科医疗	2,460	62,385.60	0.04
487	002558	巨人网络	6,780	62,037.00	0.04
488	601598	中国外运	15,326	59,464.88	0.04
489	600498	烽火通信	4,100	59,368.00	0.04
490	000686	东北证券	8,100	56,619.00	0.04

491	002925	盈趣科技	2,590	55,736.80	0.04
492	002563	森马服饰	9,400	55,648.00	0.04
493	000656	金科股份	18,600	53,196.00	0.03

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	002050	三花智控	6,800	186,864.00	0.12
2	688297	中无人机	3,054	162,411.72	0.11
3	688045	必易微	1,891	127,037.38	0.08
4	688212	澳华内镜	2,692	125,985.60	0.08
5	688772	珠海冠宇	3,657	112,269.90	0.07
6	301136	招标股份	5,246	103,556.04	0.07
7	688767	博拓生物	1,462	90,146.92	0.06
8	300285	国瓷材料	2,200	79,024.00	0.05
9	688207	格灵深瞳	2,976	78,506.88	0.05
10	688209	英集芯	2,729	75,265.82	0.05
11	688262	国芯科技	1,482	70,765.50	0.05
12	688206	概伦电子	2,200	66,880.00	0.04
13	688237	超卓航科	1,512	62,400.24	0.04
14	688722	同益中	3,687	61,720.38	0.04
15	688234	天岳先进	918	59,844.42	0.04
16	688296	和达科技	2,173	57,041.25	0.04
17	688787	海天瑞声	817	56,658.95	0.04
18	688049	炬芯科技	1,376	52,370.56	0.03
19	688265	南模生物	792	50,711.76	0.03
20	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
21	688565	力源科技	3,450	33,534.00	0.02
22	301215	中汽股份	2,013	12,863.07	0.01
23	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
24	301116	益客食品	505	10,332.30	0.01
25	301120	新特电气	660	10,223.40	0.01
26	301259	艾布鲁	353	8,803.82	0.01
27	301263	泰恩康	269	8,441.22	0.01
28	301130	西点药业	217	8,180.90	0.01
29	301163	宏德股份	249	8,050.17	0.01
30	301288	清研环境	396	7,912.08	0.01
31	301256	华融化学	761	7,670.88	0.01
32	301097	天益医疗	140	6,696.20	0.00
33	301228	实朴检测	323	6,569.82	0.00
34	301268	铭利达	188	6,555.56	0.00
35	301137	哈焊华通	391	6,252.09	0.00

36	301236	软通动力	198	6,213.24	0.00
37	301207	华兰疫苗	109	6,149.78	0.00
38	301109	军信股份	378	6,100.92	0.00
39	300958	建工修复	300	5,934.00	0.00
40	301248	杰创智能	195	5,824.65	0.00
41	301200	大族数控	109	5,659.28	0.00
42	301103	何氏眼科	166	5,315.32	0.00
43	301135	瑞德智能	195	5,120.70	0.00
44	301222	浙江恒威	176	5,096.96	0.00
45	301148	嘉戎技术	200	4,780.00	0.00
46	301237	和顺科技	105	4,395.30	0.00
47	301181	标榜股份	143	4,374.37	0.00
48	301258	富士莱	103	4,293.04	0.00
49	300992	泰福泵业	200	4,262.00	0.00
50	301151	冠龙节能	192	4,120.32	0.00
51	301279	金道科技	174	3,968.94	0.00
52	301219	腾远钴业	43	3,776.26	0.00
53	300834	星辉环材	106	3,183.18	0.00
54	600760	中航沈飞	51	3,082.95	0.00
55	002271	东方雨虹	50	2,573.50	0.00
56	301196	唯科科技	65	2,438.80	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	688599	天合光能	612,780.31	0.34
2	000651	格力电器	437,240.00	0.25
3	601006	大秦铁路	392,539.00	0.22
4	300750	宁德时代	363,597.00	0.20
5	601868	中国能建	342,448.00	0.19
6	601238	广汽集团	288,920.00	0.16
7	600958	东方证券	262,918.00	0.15
8	601555	东吴证券	258,712.00	0.15
9	688005	容百科技	248,404.48	0.14
10	688396	华润微	247,038.20	0.14
11	600884	杉杉股份	242,453.00	0.14
12	300919	中伟股份	209,358.00	0.12
13	300957	贝泰妮	192,803.00	0.11
14	000858	五粮液	186,230.00	0.10
15	600519	贵州茅台	183,939.00	0.10
16	300769	德方纳米	177,293.00	0.10

17	688363	华熙生物	175,375.92	0.10
18	688099	晶晨股份	158,684.00	0.09
19	605358	立昂微	152,573.00	0.09
20	603606	东方电缆	142,510.00	0.08

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	300750	宁德时代	752,287.00	0.42
2	000858	五粮液	398,325.00	0.22
3	002594	比亚迪	265,921.00	0.15
4	600958	东方证券	216,400.10	0.12
5	300760	迈瑞医疗	214,191.00	0.12
6	301215	中汽股份	202,888.00	0.11
7	688348	昱能科技	190,820.00	0.11
8	603019	中科曙光	181,440.00	0.10
9	000568	泸州老窖	178,913.00	0.10
10	688119	中钢洛耐	169,818.88	0.10
11	301116	益客食品	168,850.80	0.09
12	002812	恩捷股份	165,904.00	0.09
13	002714	牧原股份	164,001.00	0.09
14	300059	东方财富	161,285.00	0.09
15	002142	宁波银行	156,633.00	0.09
16	000001	平安银行	155,395.00	0.09
17	688223	晶科能源	154,422.16	0.09
18	002352	顺丰控股	153,001.00	0.09
19	600061	国投资本	151,493.32	0.08
20	688305	科德数控	146,789.60	0.08

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	17,207,180.06
卖出股票收入（成交）总额	18,627,488.35

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 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 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	21,523.43
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,523.43

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

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 (%)
1,734	56,544.41	49,589,500.00	50.58	48,458,500.00	49.42

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 (%)
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	45,673,700.00	46.58

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	方正证券股份有限公司	2,101,200.00	2.14

2	刘海涛	1,500,000.00	1.53
3	中信证券股份有限公司	1,456,900.00	1.49
4	郭少华	1,096,000.00	1.12
5	蒲巴甲	1,000,000.00	1.02
5	王锦华	1,000,000.00	1.02
5	张建军	1,000,000.00	1.02
8	李林晖	710,000.00	0.72
9	高为	580,000.00	0.59
10	黄郭明娥	540,000.00	0.55
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	45,673,700.00	46.58

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	106,048,000.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	14,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	98,048,000.00

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

经本基金管理人建信基金管理有限责任公司 2022 年第一次临时股东会和第六届董事会第

五次会议审议通过，自 2022 年 5 月 11 日起，孙志晨先生不再担任建信基金管理有限责任公司董事长，暂由总裁张军红先生代为履行董事长职务。经本基金管理人建信基金管理有限责任公司第六届董事会第五次会议审议通过，自 2022 年 5 月 11 日起，马勇先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁。上述事项均已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案并于 2022 年 5 月 13 日公告。

本报告期内，不涉及基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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	15,585,460.62	49.26	14,514.94	49.57	-
中信证券	1	12,326,056.83	38.96	11,296.18	38.58	-
天风证券	1	3,725,831.99	11.78	3,469.98	11.85	-
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	65,731.40	100.00	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	建信基金管理有限责任公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 06 月 20 日

§ 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

别	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	2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日	44,002,400.00	4,364,100.00	2,692,800.00	45,673,700.00	46.58

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

2022 年 8 月 30 日