

建信恒久价值混合型证券投资基金

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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信银行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	6
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	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
§ 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	14
§ 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	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60

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	60
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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
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	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信恒久价值混合型证券投资基金
基金简称	建信恒久价值混合
基金主代码	530001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 12 月 1 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	973,528,507.23 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	有效控制投资风险，追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	采用自上而下的资产配置和自下而上的股票选择相结合的投资策略，遵循以研究为基础的长期价值投资理念，重点投资于具有持续创造股东价值的能力、价值被低估且流动性较好的上市公司股票，从而为基金持有人提供持续、稳定的投资回报。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为：75%×MSCI 中国 A 股指数+20%×中债综合指数(全价)+5%×1 年定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	姜敏
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100033	100020
法定代表人		孙志晨	朱鹤新

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	《中国证券报》
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	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-86,452,372.00
本期利润	-171,378,997.39
加权平均基金份额本期利润	-0.1801
本期加权平均净值利润率	-14.36%
本期基金份额净值增长率	-12.77%
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	778,683,855.54
期末可供分配基金份额利润	0.7999
期末基金资产净值	1,292,644,537.27
期末基金份额净值	1.3278
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	923.03%

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

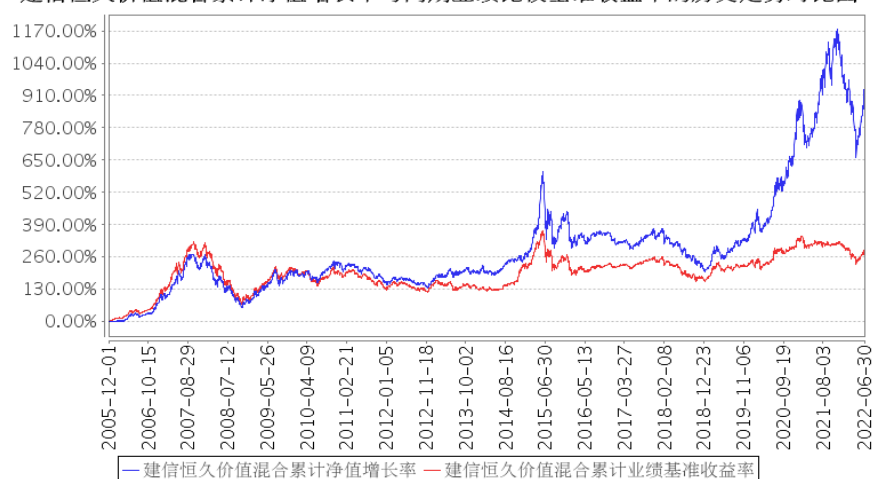
过去一个月	18.16%	1.57%	7.38%	0.83%	10.78%	0.74%
过去三个月	6.42%	1.87%	4.83%	1.15%	1.59%	0.72%
过去六个月	-12.77%	1.87%	-7.13%	1.13%	-5.64%	0.74%
过去一年	3.38%	1.94%	-8.70%	0.94%	12.08%	1.00%
过去三年	169.54%	1.70%	21.19%	0.96%	148.35%	0.74%
自基金合同生效起至今	923.03%	1.56%	285.18%	1.26%	637.85%	0.30%

注：本基金投资业绩比较基准为：75%×MSCI 中国 A 股指数+20%×中债综合指数(全价)+5%×1 年定期存款利率。其中：MSCI 中国 A 股指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准，中债综合指数(全价)指数收益率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准，1 年定期存款利率作为衡量现金或到期日在一年以内的政府债券部分的业绩基准。

MSCI 中国 A 股指数以自由流通市值为权重，包括了在上海和深圳证券交易所上市的 A 股股票。指数的编制是基于自下而上的取样方法，以达到 65%行业组代表性作为目标，目的在于体现商业活动的多样性，达到广泛而公正的市场代表性并具有反映 A 股市场变化的灵活性。指数设计还包括大盘股入选规则，以系统地体现大公司的特定风险，并通过最小规模标准和流动性筛选确保指数的可投资性。

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

建信恒久价值混合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		
陶灿	权益投资部执行总经理，本基金的基金经理	2017 年 3 月 22 日	-	14 年	陶灿先生，权益投资部执行总经理，硕士。2007 年 7 月加入本公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、权益投资部总经理助理兼研究部首席策略官、权益投资部执行总经理。2011 年 7 月 11 日至 2016 年 4 月 22 日任建信优化配置混合型证券投资基金的基金经理；2014 年 5 月 14 日起任建信改革红利股票型证券投资基金的基金经理；2016 年 2 月 23 日至 2021 年 9 月 29 日任建信现代服务业股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 2 月 9 日至 2019 年 1 月 21 日任建信回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 3 月 22 日起任建信恒久价值混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 10 月 27 日起任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于 2017 年 11 月 4 日起转型为建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金，陶灿继续担任该基金的基金经理；2020 年 1 月 21 日起任建信高股息股票型证券投资基金的基金经理；2020 年 6 月 17 日起任建信新能源行业股票型证券投资基金的基金经理；2021 年 3 月 26 日起任建信智能生活混合型证券投资基金的基金经理；2021 年 8 月 24 日起任建信兴润一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 1 月 19 日起任建信沃信一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。

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《建信恒久价值混合型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

2022 年一季度，国内 A 股市场整体走势较弱，沪深 300 指数下跌 14.5%，创业板指数下跌近 20%，上证 50 下跌 11.5%，科创 50 下跌近 22%。从风格上，价值蓝筹表现好于新兴成长，从行业来看，煤炭、房地产、建筑、银行等行业取得正收益，而电子、军工、汽车、家电、食品饮料则录得近 20% 的跌幅，总体上稳增长领域表现好于调结构领域，宏观经济变量主导了一季度市场表现，同时海外通胀处于不利局面，引发美联储流动性收紧预期，商品表现好于股票资产。

2022 年二季度，国内 A 股市场先抑后扬，沪深 300 指数上涨 6.2%，创业板上涨 5.7%，上证 50 上涨 5.5%，科创 50 上涨 1.3%。从风格上看，相比一季度出现较大切换，从稳增长逐步过渡到调结构领域，其中消费者服务、汽车、食品饮料、电力设备与新能源、家电涨幅靠前，而综合金融、房地产、传媒跌幅靠前。在二季度，权益市场经历了较为严格的疫情管控、物流限制冲击，随着 5 月疫情环节、管控放松、物流恢复，以汽车为代表的制造业生产经营活动、以消费者服务为代表的线下消费逐步恢复正常，股票市场也跟随反映了这一事实。

经历了上半年经济活动的波折，让我们愈发清晰地看到，产业升级与消费升级是经济可持续发展的必由之路。

恒久基金在一季度，依然聚焦于行业三因素与公司三因素的分析，在宏观稳增长因素占据阶段称为市场主要矛盾时，适当地均衡了组合布局，增加了以地产、基建、煤炭、建材为代表的传统价值蓝筹，但组合整体依然是调结构领域为主，因此一季度基金表现较弱，但对于下半年，当稳增长落地，市场投资机会亦将重回调结构领域。

恒久基金在二季度，依然聚焦调结构领域的主力配置，部分参与了稳增长领域配置，期间净值波动调整较大，但我们使用“等待期”方法检验持仓个股，在基本面恢复阶段，前期调整的个股亦在较短的“等待期”之后出现反弹。

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-12.77%，波动率 1.87%，业绩比较基准收益率-7.13%，波动率 1.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从国内经济增长角度看，下半年好于上半年，特别是从二季度低位向三季度爬升过程中，面临经济小周期的复苏，当然海外经济开始面临成本与货币政策压制下的衰退预期。整体上，下半年国内经济优于海外，其次从政策角度看，国内积极财政政策，较为宽松的货币政策预计将持续，除非碰到通胀超预期的掣肘。从市场风格看，下半年调结构领域优于稳增长领域，成长风格好于价值风格。从跨年度看，产业升级、消费升级、供给受限的周期行业是中长期结构性机会所在，相关产业实体回报预期超出社会平均水平，相关产业实体的股票表现亦将超越市场平均表现。

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

根据法律法规及本基金基金合同中关于收益分配相关条款的规定，本基金于 2022 年 1 月 13 日向基金份额持有人每 10 份基金份额分配 2.6 元，共发放红利人民币 210,440,420.24 元（包含现金和红利再投资形式），达到基金合同约定的利润分配要求。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对建信恒久价值混合型证券投资基金 2022 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司在建信恒久价值混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的建信恒久价值混合型

证券投资基金 2022 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信恒久价值混合型证券投资基金

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	96,971,189.24	78,808,133.68
结算备付金		1,232,702.72	1,568,305.38
存出保证金		407,655.58	413,116.66
交易性金融资产	6.4.7.2	1,221,326,883.51	1,381,740,776.36
其中：股票投资		1,221,114,278.95	1,371,457,235.36
基金投资		—	—
债券投资		212,604.56	10,283,541.00
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		—	5,877,278.10
应收股利		—	—
应收申购款		1,941,571.26	566,593.03
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	39,440.90
资产总计		1,321,880,002.31	1,469,013,644.11
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		19,301,147.28	5,809,252.56
应付赎回款		2,523,412.90	1,145,873.83
应付管理人报酬		1,512,553.46	1,880,114.10
应付托管费		252,092.25	313,352.37
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.01	0.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	5,646,258.14	5,211,328.97
负债合计		29,235,465.04	14,359,922.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	513,960,681.73	426,257,284.82
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	778,683,855.54	1,028,396,436.85
净资产合计		1,292,644,537.27	1,454,653,721.67
负债和净资产总计		1,321,880,002.31	1,469,013,644.11

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3278 元，基金份额总额 973,528,507.23 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：建信恒久价值混合型证券投资基金

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 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
一、营业总收入		-160,880,644.16	149,003,262.74
1. 利息收入		434,764.82	1,600,965.08
其中：存款利息收入	6.4.7.13	434,764.82	779,221.66
债券利息收入		-	612,342.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		-	209,400.46

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）		-76,542,706.39	294,325,717.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-83,541,984.43	289,205,829.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	987,891.99	101,929.23
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	6,011,386.05	5,017,959.10
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	-84,926,625.39	-147,073,873.13
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	153,922.80	150,453.38
减：二、营业总支出		10,498,353.23	14,279,613.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,891,681.43	8,436,238.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,481,946.92	1,406,039.67
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		144.47	1,664.14
8. 其他费用	6.4.7.23	124,580.41	4,435,671.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-171,378,997.39	134,723,648.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-171,378,997.39	134,723,648.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-171,378,997.39	134,723,648.91

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：建信恒久价值混合型证券投资基金

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)	426,257,284.82	—	1,028,396,436.85	1,454,653,721.67
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)	426,257,284.82	—	1,028,396,436.85	1,454,653,721.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	87,703,396.91	—	-249,712,581.31	-162,009,184.40
(一)、综合收益总额	—	—	-171,378,997.39	-171,378,997.39
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	87,703,396.91	—	132,106,836.32	219,810,233.23

“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	140,786,276.15	-	205,913,176.58	346,699,452.73
2. 基金赎回款	-53,082,879.24	-	-73,806,340.26	-126,889,219.50
(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)	-	-	-210,440,420.24	-210,440,420.24
(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)	513,960,681.73	-	778,683,855.54	1,292,644,537.27
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)	406,023,516.15	-	819,283,600.50	1,225,307,116.65
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)	406,023,516.15	-	819,283,600.50	1,225,307,116.65
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少 以“-” 号 填 列)	14,424,958.89	-	-29,062,367.50	-14,637,408.61
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	134,723,648.91	134,723,648.91
(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)	14,424,958.89	-	27,858,725.10	42,283,683.99
其中:1. 基 金 申 购 款	90,360,245.81	-	161,287,923.01	251,648,168.82
2 . 基 金 赎 回 款	-75,935,286.92	-	-133,429,197.91	-209,364,484.83
(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)	-	-	-191,644,741.51	-191,644,741.51
(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)	420,448,475.04	-	790,221,233.00	1,210,669,708.04

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

建信恒久价值混合型证券投资基金(原名为建信恒久价值股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]第 178 号《关于同意建信恒久价值股票型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信恒久价值股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 6,198,114,265.92 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第 176 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信恒久价值股票型证券投资基金基金合同》于 2005 年 12 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 6,201,862,692.93 份基金份额,其中认购资金利息折合 3,748,427.01 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《建信恒久价值股票型证券投资基金基金合同》和《建信恒久价值股票型证券投资基金基金份额拆分的公告》的有关规定,本基金于 2007 年 4 月 2 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1.894180534,并于 2007 年 4 月 3 日进行了变更登记。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,建信恒久价值股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 8 日公告后更名为建信恒久价值混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信恒久价值混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市 的股票(包含存托凭证)、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。在正常市场情况下,基金投资组合中股票资产占基金

资产的 60%—95%，现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%—40%，其中，基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计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。根据《关于建信恒久价值混合型证券投资基金变更基金业绩比较基准并修改基金合同的公告》，自 2015 年 10 月 1 日起，本基金的业绩比较基准由 MSCI 中国 A 股指数×75%+中信全债指数×20%+一年定期存款利率×5%，变更为 75%×MSCI 中国 A 股指数+20%×中债综合指数（全价）+5%×1 年定期存款利率。

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 78,808,133.68 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 27,129.31 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 78,835,262.99 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 1,568,305.38 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 776.27 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 1,569,081.65 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 413,116.66 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 204.49 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 413,321.15 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 39,440.90 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 27,129.31 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 776.27 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 204.49 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 11,330.83 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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 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 1,381,740,776.36 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 11,330.83 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 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 1,381,752,107.19 元。

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	96,971,189.24
等于：本金	96,948,755.09
加：应计利息	22,434.15
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	96,971,189.24

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		953,138,800.34	-	1,221,114,278.95	267,975,478.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	169,998.88	223.56	212,604.56	42,382.12
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	169,998.88	223.56	212,604.56	42,382.12
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		953,308,799.22	223.56	1,221,326,883.51	268,017,860.73

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	6,684.40
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,936,435.39
其中：交易所市场	4,936,035.39
银行间市场	400.00
应付利息	-
预提费用	203,138.35
其他应付款	500,000.00
合计	5,646,258.14

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	807,401,417.21	426,257,284.82
本期申购	266,673,577.30	140,786,276.15
本期赎回（以“-”号填列）	-100,546,487.28	-53,082,879.24
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	973,528,507.23	513,960,681.73

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	969,330,049.54	59,066,387.31	1,028,396,436.85
本期利润	-86,452,372.00	-84,926,625.39	-171,378,997.39
本期基金份额交易产生的变动数	161,620,735.39	-29,513,899.07	132,106,836.32
其中：基金申购款	253,056,214.91	-47,143,038.33	205,913,176.58
基金赎回款	-91,435,479.52	17,629,139.26	-73,806,340.26
本期已分配利润	-210,440,420.24	-	-210,440,420.24
本期末	834,057,992.69	-55,374,137.15	778,683,855.54

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	419,575.70
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	11,416.89
其他	3,772.23
合计	434,764.82

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	-83,541,984.43
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	-83,541,984.43

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	927,434,606.98
减：卖出股票成本总额	1,008,126,170.39
减：交易费用	2,850,421.02
买卖股票差价收入	-83,541,984.43

6.4.7.14.3 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	325,127.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	662,764.21
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	987,891.99
----	------------

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	63,901,770.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	62,898,514.98
减：应计利息总额	339,562.27
减：交易费用	928.56
买卖债券差价收入	662,764.21

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	6,011,386.05
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	6,011,386.05

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	-84,926,625.39
股票投资	-84,855,465.39

债券投资	-71,160.00
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	-84,926,625.39

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	150,343.78
基金转换费收入	3,579.02
合计	153,922.80

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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,842.06
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	124,580.41

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、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	8,891,681.43	8,436,238.35
其中：支付销售机构的客户维护费	534,942.60	336,466.07

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/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	1,481,946.92	1,406,039.67

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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×0.25%/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

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行-活期	96,971,189.24	419,575.70	163,395,031.12	740,468.34

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配合 计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 1 月 13 日	-	2022 年 1 月 13 日	2.6000	98,209,002.90	112,231,417.34	210,440,420.24	-
合计	-	-	-	2.6000	98,209,002.90	112,231,417.34	210,440,420.24	-

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	635	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022 年 3 月 25 日	6 个月	新发未 上市	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新发未 上市	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-

301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新发未上市	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	-
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新发未上市	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新发未上市	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新发未上市	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301125	腾亚精工	2022年5月27日	6个月	新发未上市	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新发未上市	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新发未上市	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新发未上市	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新发未上市	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新发未上市	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新发未上市	108.91	82.76	404	43,997.64	33,435.04	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新发未上市	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新发未上市	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301163	宏德股份	2022年4月	6个月	新发未上市	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-

		11 日								
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新发未上市	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新发未上市	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新发未上市	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新发未上市	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新发未上市	76.56	51.92	840	64,310.40	43,612.80	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新发未上市	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301212	联盛化学	2022 年 4 月 7 日	6 个月	新发未上市	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新发未上市	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新发未上市	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新发未上市	96.66	87.82	360	34,796.00	31,615.20	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新发未上市	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301228	实朴检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新发未上市	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新发未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新发未上市	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301236	软通	2022	6 个月	新发未	48.59	31.38	1,557	75,649.44	48,858.66	-

	动力	年 3 月 8 日		上市						
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新发未 上市	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月 内(含)	新发未 上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新发未 上市	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新发未 上市	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新发未 上市	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022 年 4 月 18 日	6 个月	新发未 上市	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新发未 上市	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301266	宇邦新材	2022 年 5 月 30 日	6 个月	新发未 上市	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新发未 上市	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301279	金道科技	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新发未 上市	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301286	侨源股份	2022 年 6 月 6 日	6 个月	新发未 上市	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新发未 上市	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新发未 上市	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新发未 上市	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-

600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	新发未上市	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688102	斯瑞新材	2022年3月9日	6个月	新发未上市	10.48	12.23	6,030	63,194.40	73,746.90	-
688119	中钢洛耐	2022年5月27日	6个月	新发未上市	5.06	7.01	33,327	168,634.62	233,622.27	-
688209	英集芯	2022年4月12日	6个月	新发未上市	24.23	27.58	6,822	165,297.06	188,150.76	-
688220	翱捷科技	2022年1月6日	6个月	新发未上市	164.54	68.59	6,947	1,143,059.38	476,494.73	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新发未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

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	212,604.56	10,283,541.00
未评级	-	-
合计	212,604.56	10,283,541.00

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	96,971,189.24	-	-	-	96,971,189.24
结算备付金	1,232,702.72	-	-	-	1,232,702.72
存出保证金	407,655.58	-	-	-	407,655.58
交易性金融资产	-	-	212,604.56	1,221,114,278.95	1,221,326,883.51
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	-	-	-	1,941,571.26	1,941,571.26
其他资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	98,611,547.54	-	212,604.56	1,223,055,850.21	1,321,880,002.31
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	-	-	-	19,301,147.28	19,301,147.28
应付赎回款	-	-	-	2,523,412.90	2,523,412.90
应付管理人报酬	-	-	-	1,512,553.46	1,512,553.46

应付托管费	-	-	-	252,092.25	252,092.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.01	1.01
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,646,258.14	5,646,258.14
负债总计	-	-	-	29,235,465.04	29,235,465.04
利率敏感度缺口	98,611,547.54	-	212,604.56	1,193,820,385.17	1,292,644,537.27
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	78,808,133.68	-	-	-	78,808,133.68
结算备付金	1,568,305.38	-	-	-	1,568,305.38
存出保证金	413,116.66	-	-	-	413,116.66
交易性金融资产	-	10,046,000.00	237,541.00	1,371,457,235.36	1,381,740,776.36
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,877,278.10	5,877,278.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	566,593.03	566,593.03
其他资产	-	-	-	39,440.90	39,440.90
资产总计	80,789,555.72	10,046,000.00	237,541.00	1,377,940,547.39	1,469,013,644.11
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	5,809,252.56	5,809,252.56
应付赎回款	-	-	-	1,145,873.83	1,145,873.83
应付管理人报酬	-	-	-	1,880,114.10	1,880,114.10
应付托管费	-	-	-	313,352.37	313,352.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.61	0.61
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,211,328.97	5,211,328.97
负债总计	-	-	-	14,359,922.44	14,359,922.44
利率敏感度缺口	80,789,555.72	10,046,000.00	237,541.00	1,363,580,624.95	1,454,653,721.67

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

	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的
--	----------	----------------

	动	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	市场利率上升 25 个基点	-	-109,511.80
	市场利率下降 25 个基点	-	111,047.28

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。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具投资比例为基金资产的 5%-40%，其中，基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	1,221,114,278.95	94.47	1,371,457,235.36	94.28
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	212,604.56	0.02	10,283,541.00	0.71
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	1,221,326,883.51	94.48	1,381,740,776.36	94.99

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%	93,004,525.95	109,813,679.09
	业绩比较基准下降 5%	-93,004,525.95	-109,813,679.09

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	1, 217, 306, 941. 00	1, 366, 557, 179. 85
第二层次	1, 006, 994. 84	11, 293, 735. 06
第三层次	3, 012, 947. 67	3, 889, 861. 45
合计	1, 221, 326, 883. 51	1, 381, 740, 776. 36

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	1, 221, 114, 278. 95	92. 38
	其中：股票	1, 221, 114, 278. 95	92. 38
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	212, 604. 56	0. 02
	其中：债券	212, 604. 56	0. 02
	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	98,203,891.96	7.43
8	其他各项资产	2,349,226.84	0.18
9	合计	1,321,880,002.31	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	126.07	0.00
B	采矿业	23,598,981.03	1.83
C	制造业	1,128,246,482.30	87.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,683.74	0.00
E	建筑业	2,421.91	0.00
F	批发和零售业	14,349,119.32	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	682,865.18	0.05
H	住宿和餐饮业	24,130.32	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,003,359.96	0.23
J	金融业	2,142,430.43	0.17
K	房地产业	47,447,386.56	3.67
L	租赁和商务服务业	810,030.54	0.06
M	科学研究和技术服务业	234,642.14	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	351,253.03	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	212,309.55	0.02
R	文化、体育和娱乐业	2,950.69	0.00
S	综合	1,106.18	0.00
	合计	1,221,114,278.95	94.47

7.2.2 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

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	300316	晶盛机电	1,356,907	91,713,344.13	7.10
2	603799	华友钴业	745,371	71,272,375.02	5.51

3	300750	宁德时代	126,700	67,657,800.00	5.23
4	000519	中兵红箭	2,286,000	66,636,900.00	5.16
5	300260	新莱应材	1,118,900	56,918,443.00	4.40
6	300390	天华超净	623,000	54,450,200.00	4.21
7	600519	贵州茅台	25,500	52,147,500.00	4.03
8	002738	中矿资源	481,740	44,613,941.40	3.45
9	000733	振华科技	318,362	43,287,681.14	3.35
10	002129	TCL 中环	640,300	37,707,267.00	2.92
11	600522	中天科技	1,486,400	34,335,840.00	2.66
12	600884	杉杉股份	1,137,256	33,799,248.32	2.61
13	600048	保利发展	1,906,000	33,278,760.00	2.57
14	688005	容百科技	240,793	31,168,245.92	2.41
15	601717	郑煤机	2,143,681	30,890,443.21	2.39
16	002466	天齐锂业	227,100	28,342,080.00	2.19
17	000568	泸州老窖	112,205	27,663,020.70	2.14
18	300507	苏奥传感	3,525,816	27,466,106.64	2.12
19	600487	亨通光电	1,819,746	26,459,106.84	2.05
20	002271	东方雨虹	490,600	25,251,182.00	1.95
21	002531	天顺风能	1,296,200	21,374,338.00	1.65
22	002897	意华股份	438,200	19,324,620.00	1.49
23	600123	兰花科创	950,400	15,634,080.00	1.21
24	601012	隆基绿能	214,500	14,292,135.00	1.11
25	600206	有研新材	734,700	14,209,098.00	1.10
26	001979	招商蛇口	1,054,800	14,165,964.00	1.10
27	300447	全信股份	695,290	14,163,057.30	1.10
28	600600	青岛啤酒	135,200	14,049,984.00	1.09
29	002709	天赐材料	219,026	13,592,753.56	1.05
30	002508	老板电器	366,500	13,204,995.00	1.02
31	600976	健民集团	258,100	13,201,815.00	1.02
32	688636	智明达	112,590	12,766,580.10	0.99
33	688196	卓越新能	159,770	12,302,290.00	0.95
34	300122	智飞生物	109,900	12,199,999.00	0.94
35	600933	爱柯迪	744,500	12,194,910.00	0.94
36	300035	中科电气	377,400	10,548,330.00	0.82
37	002507	涪陵榨菜	294,060	10,150,951.20	0.79
38	603019	中科曙光	274,300	7,960,186.00	0.62
39	688349	三一重能	170,476	6,946,897.00	0.54
40	000983	山西焦煤	495,200	6,630,728.00	0.51
41	603077	和邦生物	1,553,700	6,618,762.00	0.51
42	300026	红日药业	858,400	6,609,680.00	0.51
43	600096	云天化	204,000	6,421,920.00	0.50
44	600557	康缘药业	435,700	6,400,433.00	0.50

45	300990	同飞股份	103,440	6,175,368.00	0.48
46	688348	昱能科技	5,644	2,754,272.00	0.21
47	600919	江苏银行	300,000	2,136,000.00	0.17
48	300529	健帆生物	34,900	1,776,061.00	0.14
49	300627	华测导航	49,000	1,685,110.00	0.13
50	300696	爱乐达	37,920	1,666,584.00	0.13
51	688596	正帆科技	77,000	1,526,140.00	0.12
52	603380	易德龙	39,000	1,517,100.00	0.12
53	002884	凌霄泵业	71,000	1,454,790.00	0.11
54	603995	甬金股份	42,920	1,444,687.20	0.11
55	002929	润建股份	40,000	1,436,000.00	0.11
56	600938	中国海油	84,005	1,332,320.89	0.10
57	688166	博瑞医药	52,000	1,255,800.00	0.10
58	688665	四方光电	7,500	1,110,000.00	0.09
59	605399	晨光新材	26,000	1,106,300.00	0.09
60	002158	汉钟精机	45,000	1,046,250.00	0.08
61	601615	明阳智能	30,000	1,014,000.00	0.08
62	688308	欧科亿	14,000	931,840.00	0.07
63	002706	良信股份	55,000	909,150.00	0.07
64	002262	恩华药业	65,000	884,000.00	0.07
65	002677	浙江美大	60,000	880,200.00	0.07
66	300662	科锐国际	15,000	778,350.00	0.06
67	300573	兴齐眼药	5,000	766,600.00	0.06
68	688538	和辉光电	285,793	765,925.24	0.06
69	002049	紫光国微	4,000	758,880.00	0.06
70	002833	弘亚数控	42,000	700,560.00	0.05
71	300873	海晨股份	24,000	678,480.00	0.05
72	300171	东富龙	18,000	610,380.00	0.05
73	688396	华润微	10,000	590,700.00	0.05
74	002727	一心堂	25,000	573,250.00	0.04
75	002777	久远银海	39,000	560,820.00	0.04
76	002832	比音勒芬	22,000	554,400.00	0.04
77	688295	中复神鹰	13,998	524,785.02	0.04
78	688233	神工股份	9,000	505,800.00	0.04
79	002371	北方华创	1,800	498,816.00	0.04
80	688220	翱捷科技	6,947	476,494.73	0.04
81	300755	华致酒行	10,100	442,885.00	0.03
82	300852	四会富仕	12,000	441,600.00	0.03
83	002559	亚威股份	60,000	441,000.00	0.03
84	300738	奥飞数据	34,704	397,360.80	0.03
85	688122	西部超导	4,000	368,800.00	0.03
86	601636	旗滨集团	26,800	341,700.00	0.03

87	301219	腾远钴业	3,600	331,250.40	0.03
88	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.02
89	688700	东威科技	3,049	254,103.66	0.02
90	688733	壹石通	3,409	250,186.51	0.02
91	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.02
92	688119	中钢洛耐	33,327	233,622.27	0.02
93	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02
94	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.02
95	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
96	688209	英集芯	6,822	188,150.76	0.01
97	688667	菱电电控	1,191	172,016.13	0.01
98	688621	阳光诺和	1,485	162,459.00	0.01
99	301179	泽宇智能	2,941	120,022.21	0.01
100	688682	霍莱沃	1,324	109,931.72	0.01
101	301155	海力风电	1,133	103,103.00	0.01
102	688121	卓然股份	3,681	89,485.11	0.01
103	688697	纽威数控	5,837	88,372.18	0.01
104	688456	有研粉材	3,396	82,217.16	0.01
105	300919	中伟股份	610	75,579.00	0.01
106	688102	斯瑞新材	6,030	73,746.90	0.01
107	688768	容知日新	907	68,551.06	0.01
108	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
109	301177	迪阿股份	820	60,844.00	0.00
110	688296	和达科技	2,173	57,041.25	0.00
111	301236	软通动力	1,609	50,572.06	0.00
112	301200	大族数控	895	46,582.80	0.00
113	301087	可孚医疗	1,031	43,961.84	0.00
114	301029	怡合达	462	37,653.00	0.00
115	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
116	301216	万凯新材	1,195	35,787.05	0.00
117	301150	中一科技	426	35,454.42	0.00
118	688367	工大高科	1,717	34,391.51	0.00
119	300896	爱美客	57	34,200.57	0.00
120	688272	富吉瑞	1,263	33,545.28	0.00
121	301207	华兰疫苗	587	33,172.36	0.00
122	301302	华如科技	551	31,505.62	0.00
123	301215	中汽股份	4,821	30,849.09	0.00
124	301109	军信股份	1,876	30,316.26	0.00
125	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.00
126	688701	卓锦股份	2,340	27,658.80	0.00
127	301058	中粮工科	1,460	25,389.40	0.00
128	301268	铭利达	707	24,886.07	0.00

129	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
130	301073	君亭酒店	348	24,130.32	0.00
131	301263	泰恩康	713	22,478.72	0.00
132	300870	欧陆通	478	22,064.48	0.00
133	301153	中科江南	473	21,268.29	0.00
134	300834	星辉环材	649	19,492.69	0.00
135	301127	天源环保	1,743	19,399.59	0.00
136	301166	优宁维	328	19,306.08	0.00
137	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
138	301256	华融化学	1,881	18,996.48	0.00
139	301120	新特电气	1,111	17,402.94	0.00
140	301168	通灵股份	381	17,175.48	0.00
141	301286	侨源股份	839	16,772.11	0.00
142	301103	何氏眼科	515	16,506.62	0.00
143	300994	久祺股份	495	16,240.95	0.00
144	301151	冠龙节能	725	15,597.22	0.00
145	301212	联盛化学	458	15,433.76	0.00
146	301258	富士莱	342	14,430.81	0.00
147	301097	天益医疗	286	13,863.27	0.00
148	601888	中国中免	59	13,742.87	0.00
149	301116	益客食品	664	13,615.02	0.00
150	603836	海程邦达	733	13,443.22	0.00
151	301259	艾布鲁	528	13,369.02	0.00
152	301298	东利机械	640	13,358.92	0.00
153	301148	嘉戎技术	553	13,298.10	0.00
154	301199	迈赫股份	414	13,264.56	0.00
155	301237	和顺科技	310	13,120.66	0.00
156	301100	风光股份	599	12,926.42	0.00
157	300957	贝泰妮	58	12,616.74	0.00
158	301089	拓新药业	98	12,310.76	0.00
159	301126	达嘉维康	715	12,247.95	0.00
160	301163	宏德股份	364	12,210.08	0.00
161	301222	浙江恒威	415	12,169.46	0.00
162	301188	力诺特玻	670	11,926.00	0.00
163	301108	洁雅股份	300	11,871.00	0.00
164	301137	哈焊华通	731	11,822.67	0.00
165	301196	唯科科技	305	11,455.16	0.00
166	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
167	301015	百洋医药	514	11,092.12	0.00
168	301138	华研精机	349	10,731.75	0.00
169	605117	德业股份	38	10,635.82	0.00
170	301288	清研环境	516	10,587.44	0.00

171	301111	粤万年青	383	10,501.86	0.00
172	301130	西点药业	270	10,254.90	0.00
173	301193	家联科技	370	10,045.50	0.00
174	301135	瑞德智能	376	9,966.48	0.00
175	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
176	300861	美畅股份	95	8,805.55	0.00
177	301228	实朴检测	421	8,579.46	0.00
178	301279	金道科技	356	8,265.56	0.00
179	301181	标榜股份	264	8,086.40	0.00
180	301030	仕净科技	317	7,392.44	0.00
181	603051	鹿山新材	72	5,688.00	0.00
182	605499	东鹏饮料	32	5,467.52	0.00
183	001215	千味央厨	95	5,347.55	0.00
184	605080	浙江自然	74	4,727.86	0.00
185	001228	永泰运	83	4,494.45	0.00
186	301012	扬电科技	91	3,731.91	0.00
187	301035	润丰股份	44	3,627.80	0.00
188	600298	安琪酵母	70	3,412.50	0.00
189	300979	华利集团	46	3,361.68	0.00
190	300986	志特新材	90	3,312.00	0.00
191	301033	迈普医学	76	3,200.36	0.00
192	301046	能辉科技	91	3,149.51	0.00
193	301093	华兰股份	88	2,982.32	0.00
194	600955	维远股份	94	2,710.96	0.00
195	300917	特发服务	86	2,662.56	0.00
196	300966	共同药业	86	2,567.10	0.00
197	603985	恒润股份	91	2,560.74	0.00
198	605090	九丰能源	126	2,554.02	0.00
199	301060	兰卫医学	69	2,416.38	0.00
200	301079	邵阳液压	96	2,380.80	0.00
201	601995	中金公司	51	2,268.99	0.00
202	300993	玉马遮阳	175	2,236.50	0.00
203	300033	同花顺	23	2,211.45	0.00
204	300922	天秦装备	122	2,191.12	0.00
205	603209	兴通股份	95	2,158.40	0.00
206	001219	青岛食品	94	2,147.90	0.00
207	001205	盛航股份	108	2,138.40	0.00
208	300992	泰福泵业	98	2,088.38	0.00
209	605555	德昌股份	77	1,961.19	0.00
210	001308	康冠科技	67	1,954.39	0.00
211	301010	晶雪节能	72	1,825.20	0.00
212	603097	江苏华辰	77	1,817.20	0.00

213	300999	金龙鱼	33	1,782.66	0.00
214	301057	汇隆新材	73	1,777.55	0.00
215	301016	雷尔伟	94	1,753.10	0.00
216	605339	南侨食品	64	1,623.68	0.00
217	300963	中洲特材	83	1,608.54	0.00
218	000422	湖北宜化	79	1,604.49	0.00
219	603215	比依股份	75	1,580.25	0.00
220	603070	万控智造	75	1,567.50	0.00
221	300814	中富电路	80	1,464.00	0.00
222	301136	招标股份	72	1,436.40	0.00
223	301091	深城交	52	1,419.60	0.00
224	001207	联科科技	82	1,394.82	0.00
225	300926	博俊科技	59	1,377.65	0.00
226	301059	金三江	81	1,360.80	0.00
227	301027	华蓝集团	56	1,359.68	0.00
228	300943	春晖智控	83	1,303.93	0.00
229	301049	超越科技	54	1,280.34	0.00
230	300961	深水海纳	94	1,274.64	0.00
231	603048	浙江黎明	64	1,272.32	0.00
232	605287	德才股份	49	1,235.29	0.00
233	603122	合富中国	98	1,220.10	0.00
234	300945	曼卡龙	74	1,189.92	0.00
235	601699	潞安环能	80	1,169.60	0.00
236	300962	中金辐照	76	1,147.60	0.00
237	603191	望变电气	49	1,117.20	0.00
238	300971	博亚精工	45	1,109.25	0.00
239	000009	中国宝安	82	1,106.18	0.00
240	301036	双乐股份	47	1,056.56	0.00
241	300997	欢乐家	79	1,055.44	0.00
242	300894	火星人	28	1,046.92	0.00
243	001319	铭科精技	36	1,039.32	0.00
244	603171	税友股份	37	1,035.26	0.00
245	301053	远信工业	44	1,027.84	0.00
246	605577	龙版传媒	88	1,003.20	0.00
247	001216	华瓷股份	78	1,002.30	0.00
248	301026	浩通科技	27	995.76	0.00
249	300942	易瑞生物	43	993.30	0.00
250	301041	金百泽	50	985.50	0.00
251	301006	迈拓股份	51	958.80	0.00
252	605598	上海港湾	53	957.18	0.00
253	603272	联翔股份	43	943.85	0.00
254	301092	争光股份	30	943.80	0.00

255	605319	无锡振华	64	930.56	0.00
256	001318	阳光乳业	42	928.62	0.00
257	003041	真爱美家	59	919.81	0.00
258	600906	财达证券	97	872.03	0.00
259	605599	菜百股份	80	870.40	0.00
260	301068	大地海洋	36	869.40	0.00
261	301083	百胜智能	60	837.60	0.00
262	605566	福莱蒾特	35	798.70	0.00
263	300930	屹通新材	22	790.24	0.00
264	301078	孩子王	51	747.66	0.00
265	605580	恒盛能源	54	727.92	0.00
266	300913	兆龙互连	45	714.15	0.00
267	300884	狄耐克	69	713.46	0.00
268	301066	万事利	50	713.00	0.00
269	300774	倍杰特	35	705.60	0.00
270	605162	新中港	77	696.85	0.00
271	001206	依依股份	21	696.15	0.00
272	300952	恒辉安防	40	696.00	0.00
273	301088	戎美股份	36	671.76	0.00
274	001208	华菱线缆	54	670.68	0.00
275	301063	海锅股份	24	668.64	0.00
276	301052	果麦文化	20	658.60	0.00
277	001288	运机集团	37	577.57	0.00
278	603219	富佳股份	28	557.76	0.00
279	000739	普洛药业	27	557.28	0.00
280	300931	通用电梯	72	556.56	0.00
281	603132	金徽股份	42	542.22	0.00
282	300918	南山智尚	63	538.65	0.00
283	605033	美邦股份	23	533.37	0.00
284	001217	华尔泰	39	528.06	0.00
285	300854	中兰环保	26	516.88	0.00
286	603230	内蒙新华	41	512.91	0.00
287	301028	东亚机械	47	508.54	0.00
288	601825	沪农商行	80	501.60	0.00
289	605056	咸亨国际	33	500.61	0.00
290	301048	金鹰重工	43	473.43	0.00
291	300950	德固特	29	472.70	0.00
292	003042	中农联合	26	466.18	0.00
293	001209	洪兴股份	30	456.60	0.00
294	001212	中旗新材	10	421.30	0.00
295	601921	浙版传媒	54	420.12	0.00
296	605011	杭州热电	25	406.00	0.00

297	001313	粤海饲料	32	392.32	0.00
298	300978	东箭科技	30	391.50	0.00
299	301198	喜悦智行	17	383.35	0.00
300	301081	严牌股份	24	361.92	0.00
301	301025	读客文化	27	355.86	0.00
302	301004	嘉益股份	15	354.90	0.00
303	001227	兰州银行	68	334.56	0.00
304	301007	德迈仕	22	331.54	0.00
305	605028	世茂能源	15	298.95	0.00
306	605138	盛泰集团	23	287.04	0.00
307	601728	中国电信	73	272.29	0.00
308	601528	瑞丰银行	30	241.80	0.00
309	603678	火炬电子	5	234.05	0.00
310	603176	汇通集团	24	229.44	0.00
311	301032	新柴股份	24	223.20	0.00
312	603206	嘉环科技	10	193.00	0.00
313	300995	奇德新材	9	192.60	0.00
314	002701	奥瑞金	36	187.20	0.00
315	600395	盘江股份	16	140.32	0.00
316	301056	森赫股份	16	138.56	0.00
317	300967	晓鸣股份	7	126.07	0.00
318	605069	正和生态	8	122.72	0.00
319	001213	中铁特货	18	88.38	0.00
320	301013	利和兴	6	71.94	0.00
321	301072	中捷精工	2	64.06	0.00
322	300998	宁波方正	1	30.25	0.00
323	601279	英利汽车	4	27.32	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	000519	中兵红箭	49,604,865.07	3.41
2	600519	贵州茅台	45,319,256.20	3.12
3	603799	华友钴业	38,850,948.50	2.67
4	600048	保利发展	33,179,630.00	2.28
5	001979	招商蛇口	30,912,396.33	2.13
6	600522	中天科技	29,651,939.00	2.04
7	002738	中矿资源	28,548,341.00	1.96
8	002129	TCL 中环	27,820,227.00	1.91
9	002271	东方雨虹	24,749,651.50	1.70
10	300398	飞凯材料	24,078,529.84	1.66

11	000568	泸州老窖	22,666,198.78	1.56
12	600487	亨通光电	22,628,459.59	1.56
13	601666	平煤股份	19,084,059.02	1.31
14	002897	意华股份	19,056,679.00	1.31
15	603606	东方电缆	19,036,249.90	1.31
16	300750	宁德时代	18,808,002.00	1.29
17	000002	万科 A	18,231,958.68	1.25
18	601800	中国交建	18,129,133.82	1.25
19	600123	兰花科创	17,960,638.00	1.23
20	600566	济川药业	17,664,829.00	1.21

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	300035	中科电气	43,207,015.60	2.97
2	688518	联赢激光	38,210,464.06	2.63
3	603799	华友钴业	35,433,169.83	2.44
4	002434	万里扬	33,565,832.99	2.31
5	002756	永兴材料	31,584,089.11	2.17
6	600110	诺德股份	30,292,424.88	2.08
7	600884	杉杉股份	28,882,862.50	1.99
8	000002	万科 A	27,324,347.96	1.88
9	600600	青岛啤酒	27,310,791.50	1.88
10	002466	天齐锂业	26,908,270.09	1.85
11	002531	天顺风能	24,009,373.90	1.65
12	002371	北方华创	22,295,410.00	1.53
13	603507	振江股份	21,050,765.00	1.45
14	002709	天赐材料	20,337,196.50	1.40
15	601666	平煤股份	19,603,813.00	1.35
16	603985	恒润股份	19,261,650.00	1.32
17	600566	济川药业	18,274,043.37	1.26
18	300398	飞凯材料	17,929,886.05	1.23
19	603606	东方电缆	17,524,290.00	1.20
20	002028	思源电气	17,055,538.09	1.17

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	942,638,679.37
卖出股票收入（成交）总额	927,434,606.98

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	212,604.56	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	212,604.56	0.02

注：1、中国证监会批准建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

2、《建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

5、基金管理人业务资格批件和营业执照；

6、基金托管人业务资格批件和营业执照；

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113636	甬金转债	1,700	212,604.56	0.02

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	407,655.58
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,941,571.26
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,349,226.84

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113636	甬金转债	212,604.56	0.02

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
58,379	16,676.01	59,508,419.91	6.11	914,020,087.32	93.89

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	173,676.39	0.02

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2005 年 12 月 1 日) 基金份额总额	6,201,862,692.93
本报告期期初基金份额总额	807,401,417.21
本报告期基金总申购份额	266,673,577.30
减：本报告期基金总赎回份额	100,546,487.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	973,528,507.23

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 and 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

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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

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 (%)	
中信建投	1	607,261,673.88	32.85	554,020.19	32.48	-
国盛证券	1	424,795,944.52	22.98	395,613.62	23.19	-
上海证券	1	184,112,986.30	9.96	169,622.54	9.94	-
信达证券	2	158,736,790.42	8.59	147,832.43	8.67	-
中金公司	2	157,719,088.22	8.53	146,283.70	8.57	-
国信证券	2	111,621,579.05	6.04	103,953.23	6.09	-
东方财富	2	109,381,093.	5.92	101,866.21	5.97	-

证券		36				
兴业证券	2	66,201,405.18	3.58	60,330.01	3.54	-
安信证券	2	28,696,949.20	1.55	26,438.09	1.55	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	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、本基金本报告期内剔除中信华南一个交易单元。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 (%)
中信建投	6,504,891.80	100.00	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增东吴证券股份有限公司为建信旗下部分产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 03 月 14 日
2	关于新增国金证券股份有限公司为建信旗下部分开放式基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 03 月 08 日
3	关于新增华宝证券股份有限公司为建信旗下部分产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 01 月 26 日
4	关于新增天风证券股份有限公司为建信旗下部分公募基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 01 月 24 日
5	建信恒久价值混合型证券投资基金分红公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 01 月 13 日
6	建信恒久价值混合型证券投资基金暂停及恢复大额申购、转换转入和定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2022 年 01 月 12 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

无。

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恒久价值混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信恒久价值混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信恒久价值混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信恒久价值混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

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