

建信沪深 300 指数增强型证券投资基金  
(LOF)  
2023 年中期报告

2023 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产 (基金净值) 变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	58
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	建信沪深 300 指数增强 (LOF)	
场内简称	沪深 300 增强	
基金主代码	165310	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 7 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	373,087,596.40 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
下属分级基金的基金简称	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	建信沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的场内简称	沪深 300 增强	-
下属分级基金的交易代码	165310	009208
报告期末下属分级基金的份额总额	356,457,029.27 份	16,630,567.13 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以沪深 300 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	招商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	吴曙明	张姗
	联系电话	010-66228888	0755-83077987
	电子邮箱	xinzipilu@ccbfund.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-81-95533; 010-66228000	95555
传真		010-66228001	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		刘军	缪建民

## 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	建信沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	16,934,829.87	741,640.81
本期利润	3,114,265.50	27,105.52
加权平均基金份 额本期利润	0.0087	0.0016
本期加权平均净 值利润率	0.74%	0.14%
本期基金份额净 值增长率	0.77%	0.56%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	期末可供分配利	229,845,668.74

润		
期末可供分配基金份额利润	0.6448	0.1390
期末基金资产净值	411,123,601.03	18,942,589.02
期末基金份额净值	1.1534	1.1390
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	15.34%	12.75%

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

建信沪深 300 指数增强 (LOF) A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.89%	0.85%	1.10%	0.83%	1.79%	0.02%
过去三个月	-4.12%	0.80%	-4.88%	0.79%	0.76%	0.01%
过去六个月	0.77%	0.79%	-0.69%	0.80%	1.46%	-0.01%
过去一年	-11.21%	0.92%	-13.60%	0.94%	2.39%	-0.02%
过去三年	6.67%	1.11%	-7.07%	1.14%	13.74%	-0.03%
自基金合同生效起至今	15.34%	1.10%	-1.96%	1.13%	17.30%	-0.03%

建信沪深 300 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

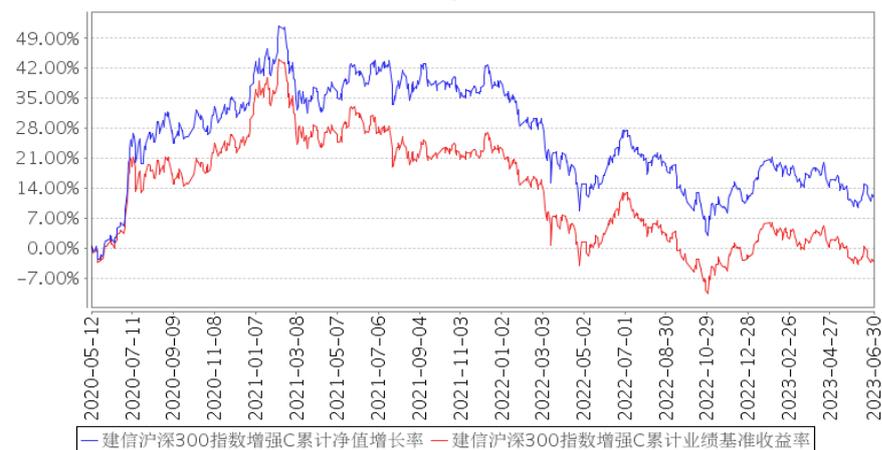
过去一个月	2.85%	0.85%	1.10%	0.83%	1.75%	0.02%
过去三个月	-4.22%	0.80%	-4.88%	0.79%	0.66%	0.01%
过去六个月	0.56%	0.79%	-0.69%	0.80%	1.25%	-0.01%
过去一年	-11.57%	0.92%	-13.60%	0.94%	2.03%	-0.02%
过去三年	5.38%	1.11%	-7.07%	1.14%	12.45%	-0.03%
自基金合同生效起 至今	12.75%	1.10%	-2.52%	1.13%	15.27%	-0.03%

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

建信沪深300指数增强 (LOF) A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信沪深300指数增强C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，由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合资设立，注册资本 2 亿元。

公司拥有公开募集证券投资基金、私募资产管理计划、QDII、保险资金受托等业务资格，总部设在北京，下设北京、上海、广州、成都、深圳五家分公司，并分别在上海和香港设立了子公司——建信资本管理有限责任公司、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”。

公司以持续优秀的管理能力、完善周到的服务，为超过 7000 万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至 2023 年 6 月 30 日，公司管理运作 161 只公开募集证券投资基金以及多个私募资产管理计划，资产管理规模 1.11 余万亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁洪昀	数量投资部总经理，本基金的基金经理	2020 年 5 月 7 日	-	20	梁洪昀先生，数量投资部总经理，博士。特许金融分析师（CFA）。曾任大成基金管理有限公司金融工程部研究员、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，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经理。2009 年 11 月 5 日起任建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理；2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2011 年 9 月 8 日至 2016 年 7 月 20 日任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金（ETF）及其联接基金的基金经理；2012 年 3 月 16 日起任建信深证 100 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 3

				月 25 日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理, 该基金自 2020 年 5 月 7 日转型为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF), 梁洪昀继续担任该基金的基金经理; 2015 年 7 月 31 日至 2018 年 7 月 31 日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理; 2015 年 8 月 6 日至 2016 年 10 月 25 日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理; 2018 年 2 月 6 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 2018 年 6 月 13 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理; 2018 年 2 月 7 日至 2022 年 8 月 8 日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《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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

报告期内，本基金根据量化模型，进行了指数增强管理。股票组合的行业配置贴近基准指数，持股上适度分散，使基金表现与业绩比较基准走势保持较高相关性，在此基础上，力求稳健地积累超额收益。

管理人对基金组合的超额收益表现保持持续跟踪，并根据需要对包括组合风格、持仓结构、组合调整频率等在内的具体投资策略进行适当调整，以应对市场风格和热点的变化。报告期前期，超额收益有所回撤，管理人观察到市场热点切换较快的特点，将换手水平适度降低，报告期后期，超额收益有所修复。基金跟踪误差一直保持在较低水平，从而降低了市场大幅波动时，基金表现过度偏离基准的风险。

在报告期内，标的指数进行了成分股例行调整，管理人据此对投资组合做了相应优化，尽量保证基金超额收益和跟踪误差的平稳。

在报告期内，基金适度参与了一级市场申购，并适时兑现，力求进一步增厚投资回报。

管理人将继续保持对量化模型的跟踪和改进，以期在未来继续稳定获取超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 0.77%，波动率 0.79%，业绩比较基准收益率-0.69%，波动率 0.80%。本报告期本基金 C 净值增长率 0.56%，波动率 0.79%，业绩比较基准收益率-0.69%，波动率 0.80%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济的角度来看，尽管面临全球贸易环境的不确定性和国内结构性问题的挑战，但政府的政策导向明确，即推动经济高质量发展，优化经济发展环境，以及积极推动科技创新。这些

都为中国经济的稳定增长提供了长期的支撑，特别是提升中国经济的内生增长动力和经济的抗风险能力。

下半年，中国经济有望继续保持增长，但同时我们需要密切关注全球经济环境的变化，以及国内经济结构调整的进展和货币、财政政策的走向。

从资本市场的角度来看，中国资本市场整体稳定，但存在一些波动。监管当局已经采取了一系列措施，包括提高市场透明度，优化上市公司质量，以维护市场稳定。同时，中国资本市场正在进一步开放，这将有助于吸引更多的外资进入，提升市场活力。我们需要密切关注全球资本市场的动态，以及国内资本市场改革的进展。预计科技创新类行业将继续保持良好势头。一些受全球经济环境变化影响的行业，如传统制造业、出口导向型行业等，需要关注外部环境对它们的影响。

管理人将继续优化和改进量化模型，力争在适当控制跟踪误差的基础上，持续获得相对于业绩比较基准的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本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 and 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

## 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	36,600,582.66	34,989,028.14
结算备付金		510,782.61	1,180,383.68
存出保证金		59,537.26	46,054.62
交易性金融资产	6.4.7.2	396,292,152.13	395,352,079.57
其中：股票投资		396,292,152.13	395,352,079.57
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		504,536.66	-
应收股利		-	-
应收申购款		125,321.14	267,472.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		434,092,912.46	431,835,018.11
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		166,523.76	144,486.30
应付管理人报酬		352,653.20	303,817.01
应付托管费		70,530.62	60,763.38
应付销售服务费		6,760.47	5,642.06
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	3,430,254.36	5,901,571.59
负债合计		4,026,722.41	6,416,280.34
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	197,908,499.42	196,910,370.15
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	232,157,690.63	228,508,367.62
净资产合计		430,066,190.05	425,418,737.77
负债和净资产总计		434,092,912.46	431,835,018.11

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 373,087,596.40 份，其中建信沪深 300 指数增强 (LOF) A 基金份额总额 356,457,029.27 份，基金份额净值 1.1534 元；建信沪深 300 指数增强 C 基金份额总额 16,630,567.13 份，基金份额净值 1.1390 元。

## 6.2 利润表

会计主体：建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		6,008,584.68	-22,366,544.75
1. 利息收入		70,181.89	55,844.69
其中：存款利息收入	6.4.7.13	70,181.89	55,844.69
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,463,183.35	-33,847,866.10
其中：股票投资收益	6.4.7.14	15,032,135.06	-37,078,983.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	68,024.75
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	5,431,048.29	3,163,092.61
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	-14,535,099.66	11,413,140.69
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	10,319.10	12,335.97
<b>减：二、营业总支出</b>		2,867,213.66	2,007,065.18
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,194,829.73	1,506,812.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	438,965.97	301,362.46
3. 销售服务费		39,343.72	51,074.98
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		-	0.03
8. 其他费用	6.4.7.23	194,074.24	147,815.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,141,371.02	-24,373,609.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,141,371.02	-24,373,609.93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,141,371.02	-24,373,609.93

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	196,910,370.15	-	228,508,367.62	425,418,737.77
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）	196,910,370.15	-	228,508,367.62	425,418,737.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	998,129.27	-	3,649,323.01	4,647,452.28
（一）、综合收益总额	-	-	3,141,371.02	3,141,371.02
（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）	998,129.27	-	507,951.99	1,506,081.26
其中：1. 基金申购款	11,020,062.55	-	8,927,415.88	19,947,478.43
2. 基金赎回	-10,021,933.28	-	-8,419,463.89	-18,441,397.17

回款				
(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)	197,908,499.42	-	232,157,690.63	430,066,190.05
项目	上年度可比期间			
	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)	145,037,647.39	-	205,002,276.63	350,039,924.02
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)	145,037,647.39	-	205,002,276.63	350,039,924.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-17,117,966.19	-	-16,561,854.85	-33,679,821.04
(一)、综合收益总额	-	-	-24,373,609.93	-24,373,609.93
(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)	-17,117,966.19	-	7,811,755.08	-9,306,211.11
其中: 1. 基金申购款	41,541,467.92	-	41,546,906.43	83,088,374.35
2. 基金赎回款	-58,659,434.11	-	-33,735,151.35	-92,394,585.46
(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)	127,919,681.20	-	188,440,421.78	316,360,102.98

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：

<u>张军红</u>	<u>张力铮</u>	<u>丁颖</u>
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

建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)是由原建信双利策略主题分级股票型证券投资基金转型而来。根据原建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司发布的《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，转型日为 2020 年 5 月 7 日，基金名称相应变更为“建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)”，建信双利策略主题分级股票型证券投资基金份额转换为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 份额。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2020 年 5 月 7 日起《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 托管协议》生效，原《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金托管协议》自同一日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间可以互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券等）、货币市场工具（含同业存单）、银行存款、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款税后利率 $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	36,600,582.66
等于：本金	36,597,034.28
加：应计利息	3,548.38
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	36,600,582.66

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	421,425,282.98	-	396,292,152.13	-25,133,130.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	421,425,282.98	-	396,292,152.13	-25,133,130.85

### 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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	206.69
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,238,533.99
其中：交易所市场	3,238,533.99
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	141,513.68
合计	3,430,254.36

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 建信沪深 300 指数增强 (LOF) A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	355,924,361.32	181,007,046.28
本期申购	11,924,487.55	6,064,262.88
本期赎回(以“-”号填列)	-11,391,819.60	-5,793,376.87
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	356,457,029.27	181,277,932.29

## 建信沪深 300 指数增强 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	15,903,323.87	15,903,323.87
本期申购	4,955,799.67	4,955,799.67
本期赎回 (以“-”号填列)	-4,228,556.41	-4,228,556.41
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	16,630,567.13	16,630,567.13

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

##### 建信沪深 300 指数增强 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	347,608,229.61	-121,209,599.01	226,398,630.60
本期利润	16,934,829.87	-13,820,564.37	3,114,265.50
本期基金份额交易产生的变动数	506,413.95	-173,641.31	332,772.64
其中：基金申购款	11,986,373.70	-3,908,992.34	8,077,381.36
基金赎回款	-11,479,959.75	3,735,351.03	-7,744,608.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	365,049,473.43	-135,203,804.69	229,845,668.74

##### 建信沪深 300 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,514,617.05	-5,404,880.03	2,109,737.02
本期利润	741,640.81	-714,535.29	27,105.52
本期基金份额交易产生的变动数	343,917.35	-168,738.00	175,179.35
其中：基金申购款	2,470,746.52	-1,620,712.00	850,034.52
基金赎回款	-2,126,829.17	1,451,974.00	-674,855.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,600,175.21	-6,288,153.32	2,312,021.89

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	58,229.66
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	11,410.54
其他	541.69
合计	70,181.89

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,032,135.06
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	15,032,135.06

##### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	820,473,929.86
减：卖出股票成本总额	802,984,998.36
减：交易费用	2,456,796.44
买卖股票差价收入	15,032,135.06

##### 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

无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,431,048.29
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	5,431,048.29

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-14,535,099.66
股票投资	-14,535,099.66
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	-14,535,099.66

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,278.31
基金转换费收入	40.79
合计	10,319.10

## 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,251.38
指数使用费	100,000.00
银行间账户维护费	9,000.00
合计	194,074.24

## 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,194,829.73	1,506,812.58
其中：支付销售机构的客户维护费	353,385.06	246,034.62

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	438,965.97	301,362.46

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，

按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	建信沪深 300 指数增强 C	合计
建信基金	-	152.26	152.26
招商银行	-	57.84	57.84
中国建设银行	-	5,281.08	5,281.08
合计	-	5,491.18	5,491.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	建信沪深 300 指数增强 C	合计
建信基金	-	6,250.94	6,250.94
中国建设银行	-	3,482.55	3,482.55
合计	-	9,733.49	9,733.49

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费的计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022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
招商银行-活期	36,600,582.66	58,229.66	25,655,396.97	43,455.63

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

无。

#### 6.4.12 期末（2023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
001286	陕西	2023年3	6个月	新发未上	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-

	能源	月 31 日		市						
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新发未上市	11.88	21.02	568	6,747.84	11,939.36	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新发未上市	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新发未上市	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新发未上市	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新发未上市	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新发未上市	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新发未上市	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新发未上市	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新发未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新发未上市	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰	2023 年 3 月	6 个月	新发未上市	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-

	环 保	月 28 日		市							
301210	金 杨 股 份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发 未上 市	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-	
301225	恒 勃 股 份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新发 未上 市	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-	
301232	飞 沃 科 技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新发 未上 市	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-	
301246	宏 源 药 业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新发 未上 市	50.00	30.71	515	25,750.00	15,815.65	-	
301260	格 力 博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新发 未上 市	30.85	23.63	844	26,037.40	19,943.72	-	
301261	恒 工 精 密	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内(含)	新发 未上 市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-	
301261	恒 工 精 密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新发 未上 市	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-	
301262	海 看 股 份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新发 未上 市	30.22	25.50	577	17,436.94	14,713.50	-	
301291	明 阳 电 气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发 未上 市	38.13	31.03	559	21,314.67	17,345.77	-	
301293	三 博 脑 科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新发 未上 市	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-	
301301	川 宁	2022 年 12	6 个月	新发 未上	5.00	8.96	2,636	13,180.00	23,618.56	-	

	生物	月 20 日		市							
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新发未上市	26.80	22.32	809	21,681.20	18,056.88	-	
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新发未上市	32.34	31.86	536	17,334.24	17,076.96	-	
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新发未上市	67.28	65.43	352	23,682.56	23,031.36	-	
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新发未上市	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-	
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新发未上市	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-	
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新发未上市	87.41	53.24	216	18,879.84	11,499.84	-	
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新发未上市	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-	
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新发未上市	14.81	13.73	946	14,010.26	12,988.58	-	
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新发未上市	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-	
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新发未上市	73.45	46.64	166	12,192.70	7,742.24	-	
301355	南王	2023 年 6 月	6 个月	新发未上市	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-	

	科技	月 2 日		市						
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新发未上市	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新发未上市	23.77	42.89	538	12,788.26	23,074.82	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新发未上市	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新发未上市	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新发未上市	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新发未上市	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新发未上市	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新发未上市	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月内(含)	新发未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301397	溯联	2023 年 6 月	6 个月	新发未上市	53.27	40.20	319	16,993.13	12,823.80	-

	股份	月 15 日		市							
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新发未上市	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-	
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新发未上市	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-	
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新发未上市	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-	
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新发未上市	19.99	16.90	563	11,254.37	9,514.70	-	
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新发未上市	6.58	7.58	1,373	9,034.34	10,407.34	-	
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新发未上市	10.36	11.84	482	4,993.52	5,706.88	-	
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新发未上市	11.66	12.26	432	5,037.12	5,296.32	-	
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新发未上市	25.98	24.53	155	4,026.90	3,802.15	-	
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新发未上市	17.80	17.89	460	8,188.00	8,229.40	-	
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新发未上市	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-	
603172	万丰	2023 年 4 月	6 个月	新发未上市	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-	

	股份	月 28 日		市						
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新发未上市	36.15	38.13	466	16,845.90	17,768.58	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新发未上市	12.10	12.07	1,338	16,189.80	16,149.66	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新发未上市	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新发未上市	26.66	31.50	406	10,823.96	12,789.00	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新发未上市	37.88	29.49	824	31,213.12	24,299.76	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新发未上市	75.00	90.76	181	13,575.00	16,427.56	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新发未上市	5.69	5.41	4,913	27,954.97	26,579.33	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新发未上市	11.10	17.04	1,746	19,380.60	29,751.84	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新发未上市	33.99	29.49	310	10,536.90	9,141.90	-
688502	茂莱光学	2023 年 2 月 28 日	6 个月	新发未上市	69.72	178.59	1,509	105,207.48	269,492.31	-
688507	索辰	2023 年 4 月	6 个月	新发未上市	166.55	122.11	115	19,153.68	14,042.65	-

	科技	月 10 日		市							
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新发未上市	20.92	19.16	667	13,953.64	12,779.72	-	
688522	纳睿雷达	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新发未上市	46.68	51.50	2,943	137,379.24	151,564.50	-	
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新发未上市	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-	
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新发未上市	43.67	53.05	304	13,275.68	16,127.20	-	
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新发未上市	21.17	23.50	601	12,723.17	14,123.50	-	
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新发未上市	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-	
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新发未上市	30.26	25.33	485	14,676.10	12,285.05	-	
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新发未上市	125.80	118.03	110	13,838.00	12,983.30	-	
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	26.74	40.68	464	12,407.36	18,875.52	-	
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新发未上市	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-	
688603	天承	2023 年 6 月	1 个月内(含)	新发未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-	

	科技	月 30 日		市						
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新发未上市	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新发未上市	125.88	86.79	123	15,483.24	10,675.17	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新发未上市	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新发未上市	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

#### 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**

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

在资产端,本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则,主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对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 2023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	36,600,582.66	-	-	-	36,600,582.66
结算备付金	510,782.61	-	-	-	510,782.61
存出保证金	59,537.26	-	-	-	59,537.26
交易性金融资产	-	-	-	396,292,152.13	396,292,152.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	504,536.66	504,536.66
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	500.00	-	-	124,821.14	125,321.14
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,171,402.53	-	-	396,921,509.93	434,092,912.46
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	166,523.76	166,523.76
应付管理人报酬	-	-	-	352,653.20	352,653.20
应付托管费	-	-	-	70,530.62	70,530.62
应付销售服务费	-	-	-	6,760.47	6,760.47
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,430,254.36	3,430,254.36
负债总计	-	-	-	4,026,722.41	4,026,722.41

利率敏感度缺口	37,171,402.53	-	-	-392,894,787.52	430,066,190.05
上年度末 2022 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	34,989,028.14	-	-	-	34,989,028.14
结算备付金	1,180,383.68	-	-	-	1,180,383.68
存出保证金	46,054.62	-	-	-	46,054.62
交易性金融资产	-	-	-	-395,352,079.57	395,352,079.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	200.00	-	-	267,272.10	267,472.10
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	36,215,666.44	-	-	-395,619,351.67	431,835,018.11
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	144,486.30	144,486.30
应付管理人报酬	-	-	-	303,817.01	303,817.01
应付托管费	-	-	-	60,763.38	60,763.38
应付销售服务费	-	-	-	5,642.06	5,642.06
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,901,571.59	5,901,571.59
负债总计	-	-	-	6,416,280.34	6,416,280.34
利率敏感度缺口	36,215,666.44	-	-	-389,203,071.33	425,418,737.77

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的股票、基金和衍生工具，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。

本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	396,292,152.13	92.15	395,352,079.57	92.93
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	396,292,152.13	92.15	395,352,079.57	92.93

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%		20,502,801.40
业绩比较基准下降		-20,502,801.40	-20,144,893.45

	5%		
--	----	--	--

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	394,583,035.64	393,741,660.75
第二层次	366,947.18	325,224.90
第三层次	1,342,169.31	1,285,193.92
合计	396,292,152.13	395,352,079.57

###### 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	396,292,152.13	91.29
	其中：股票	396,292,152.13	91.29
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	37,111,365.27	8.55
8	其他各项资产	689,395.06	0.16
9	合计	434,092,912.46	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	-	-
B	采矿业	14,861,124.00	3.46
C	制造业	201,213,343.77	46.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,689,991.00	2.02
E	建筑业	7,691,721.80	1.79
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	11,373,774.00	2.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,528,309.00	5.01
J	金融业	85,609,535.02	19.91
K	房地产业	165,715.00	0.04

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,009,212.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	352,142,725.59	81.88

### 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	1,497,531.00	0.35
C	制造业	39,628,520.72	9.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	7,671.83	0.00
F	批发和零售业	31,800.90	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,196,592.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,106,523.11	0.26
J	金融业	590,969.00	0.14
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	22,847.65	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	44,149,426.54	10.27

### 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	14,893	25,184,063.00	5.86
2	601318	中国平安	393,411	18,254,270.40	4.24
3	000858	五粮液	91,373	14,945,881.61	3.48
4	601138	工业富联	486,489	12,259,522.80	2.85
5	603288	海天味业	235,634	11,039,452.90	2.57
6	000708	中信特钢	688,967	10,913,237.28	2.54
7	601066	中信建投	428,900	10,379,380.00	2.41
8	601012	隆基绿能	360,662	10,340,179.54	2.40
9	601998	中信银行	1,613,200	9,646,936.00	2.24
10	000063	中兴通讯	210,000	9,563,400.00	2.22
11	600029	南方航空	1,496,100	9,021,483.00	2.10
12	603833	欧派家居	77,200	7,395,760.00	1.72
13	603899	晨光股份	160,415	7,160,925.60	1.67
14	601668	中国建筑	1,190,000	6,830,600.00	1.59
15	601225	陕西煤业	370,000	6,730,300.00	1.56
16	600015	华夏银行	1,236,944	6,691,867.04	1.56
17	002415	海康威视	200,200	6,628,622.00	1.54
18	002736	国信证券	750,700	6,553,611.00	1.52
19	600309	万华化学	73,800	6,482,592.00	1.51
20	600989	宝丰能源	511,200	6,446,232.00	1.50
21	000538	云南白药	115,240	6,047,795.20	1.41
22	603993	洛阳钼业	1,082,000	5,767,060.00	1.34
23	603806	福斯特	152,936	5,687,689.84	1.32
24	600436	片仔癀	19,700	5,641,292.00	1.31
25	600999	招商证券	414,290	5,621,915.30	1.31
26	601328	交通银行	965,500	5,599,900.00	1.30
27	000001	平安银行	493,496	5,541,960.08	1.29
28	300750	宁德时代	21,340	4,882,378.60	1.14
29	600050	中国联通	984,950	4,727,760.00	1.10
30	000938	紫光股份	142,300	4,532,255.00	1.05
31	601818	光大银行	1,456,100	4,470,227.00	1.04
32	000301	东方盛虹	361,300	4,270,566.00	0.99

33	600011	华能国际	458,100	4,242,006.00	0.99
34	300059	东方财富	288,596	4,098,063.20	0.95
35	002129	TCL 中环	123,375	4,096,050.00	0.95
36	603986	兆易创新	35,300	3,750,625.00	0.87
37	600406	国电南瑞	144,000	3,326,400.00	0.77
38	601728	中国电信	571,600	3,218,108.00	0.75
39	000977	浪潮信息	65,300	3,167,050.00	0.74
40	300316	晶盛机电	44,500	3,155,050.00	0.73
41	002466	天齐锂业	43,500	3,041,085.00	0.71
42	603260	合盛硅业	41,900	2,933,838.00	0.68
43	601288	农业银行	814,900	2,876,597.00	0.67
44	600104	上汽集团	183,700	2,603,029.00	0.61
45	600845	宝信软件	51,000	2,591,310.00	0.60
46	601865	福莱特	66,600	2,564,766.00	0.60
47	601808	中海油服	170,300	2,363,764.00	0.55
48	688111	金山办公	5,000	2,361,100.00	0.55
49	003816	中国广核	739,000	2,298,290.00	0.53
50	002555	三七互娱	62,000	2,162,560.00	0.50
51	600025	华能水电	301,500	2,149,695.00	0.50
52	300033	同花顺	12,000	2,103,360.00	0.49
53	002475	立讯精密	59,600	1,934,020.00	0.45
54	300274	阳光电源	16,400	1,912,732.00	0.44
55	603195	公牛集团	19,240	1,848,194.40	0.43
56	601872	招商轮船	300,400	1,739,316.00	0.40
57	601633	长城汽车	65,500	1,648,635.00	0.38
58	600570	恒生电子	35,100	1,554,579.00	0.36
59	600000	浦发银行	214,500	1,552,980.00	0.36
60	600219	南山铝业	508,600	1,535,972.00	0.36
61	601009	南京银行	186,700	1,493,600.00	0.35
62	002230	科大讯飞	20,600	1,399,976.00	0.33
63	600276	恒瑞医药	28,900	1,384,310.00	0.32
64	002841	视源股份	16,800	1,122,912.00	0.26
65	601238	广汽集团	90,400	941,968.00	0.22
66	600039	四川路桥	87,780	861,121.80	0.20
67	603259	药明康德	13,400	834,954.00	0.19
68	688599	天合光能	17,600	749,936.00	0.17
69	601006	大秦铁路	82,500	612,975.00	0.14
70	600426	华鲁恒升	19,600	600,348.00	0.14
71	601100	恒立液压	8,500	546,805.00	0.13
72	002050	三花智控	17,900	541,654.00	0.13
73	601988	中国银行	129,800	507,518.00	0.12
74	688012	中微公司	3,200	500,640.00	0.12
75	000786	北新建材	16,900	414,219.00	0.10

76	300122	智飞生物	7,500	331,500.00	0.08
77	000157	中联重科	36,000	243,000.00	0.06
78	601229	上海银行	37,800	217,350.00	0.05
79	688561	奇安信	3,600	186,516.00	0.04
80	300347	泰格医药	2,700	174,258.00	0.04
81	601155	新城控股	11,500	165,715.00	0.04
82	300433	蓝思科技	11,200	131,712.00	0.03
83	688008	澜起科技	1,400	80,388.00	0.02
84	601877	正泰电器	400	11,060.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600779	水井坊	67,600	3,987,724.00	0.93
2	002032	苏泊尔	79,010	3,950,500.00	0.92
3	603866	桃李面包	361,100	3,654,332.00	0.85
4	002372	伟星新材	145,000	2,978,300.00	0.69
5	603658	安图生物	47,100	2,436,483.00	0.57
6	603737	三棵树	31,220	2,042,412.40	0.47
7	603816	顾家家居	52,200	1,991,430.00	0.46
8	002508	老板电器	63,182	1,597,872.78	0.37
9	600378	昊华科技	42,400	1,595,936.00	0.37
10	603338	浙江鼎力	26,600	1,489,866.00	0.35
11	603997	继峰股份	90,900	1,299,870.00	0.30
12	603056	德邦股份	77,600	1,196,592.00	0.28
13	601958	金钼股份	93,200	1,039,180.00	0.24
14	002238	天威视讯	145,800	1,010,394.00	0.23
15	002101	广东鸿图	50,300	984,874.00	0.23
16	000739	普洛药业	51,651	916,288.74	0.21
17	603915	国茂股份	43,100	912,858.00	0.21
18	002600	领益智造	129,900	897,609.00	0.21
19	688567	孚能科技	39,100	844,169.00	0.20
20	000935	四川双马	49,500	833,580.00	0.19
21	002043	兔宝宝	63,600	693,876.00	0.16
22	002223	鱼跃医疗	18,000	647,820.00	0.15
23	600705	中航产融	154,300	590,969.00	0.14
24	300428	立中集团	23,600	544,216.00	0.13
25	002918	蒙娜丽莎	32,500	501,800.00	0.12
26	600968	海油发展	149,300	458,351.00	0.11
27	002790	瑞尔特	45,100	432,960.00	0.10
28	603676	卫信康	29,500	407,690.00	0.09
29	600353	旭光电子	45,360	371,952.00	0.09
30	600537	亿晶光电	47,600	363,664.00	0.08
31	002162	悦心健康	80,100	359,649.00	0.08

32	603868	飞科电器	5,200	328,068.00	0.08
33	603378	亚士创能	35,100	319,761.00	0.07
34	688502	茂莱光学	1,509	269,492.31	0.06
35	688147	微导纳米	4,866	256,827.48	0.06
36	002997	瑞鹄模具	5,900	175,407.00	0.04
37	688522	纳睿雷达	2,943	151,564.50	0.04
38	688068	热景生物	3,500	148,435.00	0.03
39	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.03
40	603801	志邦家居	2,500	82,550.00	0.02
41	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
42	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
43	603556	海兴电力	2,900	73,196.00	0.02
44	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
45	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
46	688472	阿特斯	1,746	29,751.84	0.01
47	688469	中芯集成	4,913	26,579.33	0.01
48	688443	智翔金泰	824	24,299.76	0.01
49	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
50	301301	川宁生物	2,636	23,618.56	0.01
51	301358	湖南裕能	538	23,074.82	0.01
52	301310	鑫宏业	352	23,031.36	0.01
53	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
54	301260	格力博	844	19,943.72	0.00
55	688582	芯动联科	464	18,875.52	0.00
56	301303	真兰仪表	809	18,056.88	0.00
57	688146	中船特气	466	17,768.58	0.00
58	301291	明阳电气	559	17,345.77	0.00
59	301307	美利信	536	17,076.96	0.00
60	688458	美芯晟	181	16,427.56	0.00
61	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
62	688352	颀中科技	1,338	16,149.66	0.00
63	688543	国科军工	304	16,127.20	0.00
64	301246	宏源药业	515	15,815.65	0.00
65	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
66	301262	海看股份	577	14,713.50	0.00
67	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
68	688552	航天南湖	601	14,123.50	0.00
69	688507	索辰科技	115	14,042.65	0.00
70	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
71	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
72	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
73	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
74	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00

75	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
76	301332	德尔玛	946	12,988.58	0.00
77	688581	安杰思	110	12,983.30	0.00
78	301397	溯联股份	319	12,823.80	0.00
79	688433	华曙高科	406	12,789.00	0.00
80	688512	慧智微	667	12,779.72	0.00
81	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
82	688570	天玛智控	485	12,285.05	0.00
83	001287	中电港	568	11,939.36	0.00
84	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
85	301322	绿通科技	216	11,499.84	0.00
86	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
87	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
88	688623	二元科技	123	10,675.17	0.00
89	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
90	601061	中信金属	1,373	10,407.34	0.00
91	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
92	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
93	301439	泓淋电力	563	9,514.70	0.00
94	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
95	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
96	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
97	688479	友车科技	310	9,141.90	0.00
98	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
99	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
100	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
101	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
102	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
103	603135	中重科技	460	8,229.40	0.00
104	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
105	301345	涛涛车业	166	7,742.24	0.00
106	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
107	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
108	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
109	601065	江盐集团	482	5,706.88	0.00
110	601133	柏诚股份	432	5,296.32	0.00
111	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
112	603125	常青科技	155	3,802.15	0.00
113	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
114	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
115	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
116	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
117	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	601668	中国建筑	15,985,073.00	3.76
2	600015	华夏银行	15,459,500.56	3.63
3	603288	海天味业	15,283,945.46	3.59
4	000001	平安银行	13,852,824.20	3.26
5	601318	中国平安	13,553,011.00	3.19
6	600999	招商证券	13,519,051.00	3.18
7	600029	南方航空	12,003,007.00	2.82
8	603833	欧派家居	11,645,713.00	2.74
9	601998	中信银行	11,500,174.00	2.70
10	000858	五粮液	11,427,093.00	2.69
11	601009	南京银行	11,394,931.64	2.68
12	601881	中国银河	11,249,328.00	2.64
13	601225	陕西煤业	10,900,661.00	2.56
14	601336	新华保险	10,756,497.21	2.53
15	000538	云南白药	10,236,286.47	2.41
16	601066	中信建投	9,863,412.00	2.32
17	600989	宝丰能源	9,647,367.00	2.27
18	601818	光大银行	8,954,025.00	2.10
19	600030	中信证券	8,919,061.07	2.10
20	601728	中国电信	8,750,340.00	2.06
21	002142	宁波银行	8,538,624.10	2.01

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	601668	中国建筑	15,562,734.60	3.66
2	000568	泸州老窖	13,165,955.00	3.09
3	002938	鹏鼎控股	13,120,775.10	3.08
4	300750	宁德时代	13,061,254.00	3.07
5	601318	中国平安	13,006,200.00	3.06
6	601009	南京银行	12,511,148.00	2.94
7	601336	新华保险	12,447,397.02	2.93
8	002142	宁波银行	11,661,087.90	2.74
9	601881	中国银河	11,364,144.00	2.67
10	601138	工业富联	10,505,885.00	2.47
11	601066	中信建投	10,055,203.00	2.36

12	600015	华夏银行	9,859,568.00	2.32
13	601698	中国卫通	9,783,636.29	2.30
14	002600	领益智造	9,574,714.00	2.25
15	600276	恒瑞医药	9,267,515.00	2.18
16	002466	天齐锂业	9,004,703.78	2.12
17	601288	农业银行	8,876,510.00	2.09
18	000002	万 科 A	8,835,840.00	2.08
19	600030	中信证券	8,611,085.00	2.02
20	000333	美的集团	8,476,666.21	1.99

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	818,460,170.58
卖出股票收入（成交）总额	820,473,929.86

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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是否超出基金合同规定的备选股票库

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	59,537.26
2	应收清算款	504,536.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	125,321.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	689,395.06

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	102,894	3,464.31	217,405,775.50	60.99	139,051,253.77	39.01
建信沪深 300 指数增强 C	4,251	3,912.15	4,630,167.05	27.84	12,000,400.08	72.16
合计	107,145	3,482.08	222,035,942.55	59.51	151,051,653.85	40.49

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

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

建信沪深 300 指数增强 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	纪嘉伦	416,067.00	15.11
2	高其铭	312,477.00	11.35
3	官文举	194,296.00	7.06
4	刘新	143,000.00	5.19
5	张中芬	127,209.00	4.62
6	黄崇安	124,820.00	4.53
7	冀更其	78,012.00	2.83
8	甘遵义	59,385.00	2.16
9	丁一宁	58,345.00	2.12
10	杜惠玲	58,332.00	2.12

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
----	------	------------	--------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	46,144.50	0.01
	建信沪深 300 指数增强 C	88.71	0.00
	合计	46,233.21	0.01

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

#### 8.4 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

项目	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	建信沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日 (2020 年 5 月 7 日) 基金份额总额	113,430,363.29	-
本报告期期初基金份额总额	355,924,361.32	15,903,323.87
本报告期基金总申购份额	11,924,487.55	4,955,799.67
减：本报告期基金总赎回份额	11,391,819.60	4,228,556.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	356,457,029.27	16,630,567.13

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

本报告期内，基金管理人于 2023 年 1 月 19 日发布公告，自 2023 年 1 月 17 日起吴灵玲女士不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自

2023 年 2 月 17 日起刘军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；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 3 月 18 日发布公告，自 2023 年 3 月 17 日起聘任张力铮先生担任建信基金管理有限责任公司副总裁，张威威先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁、首席信息官。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。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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财产、基金管理业务、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

#### 10.6.1 管理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。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 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 (%)	
中信证券	1	594,920,570.08	36.52	548,107.05	36.38	-
国泰君安证券	1	284,515,639.13	17.47	264,970.93	17.59	-
银河证券	1	193,360,069.	11.87	178,141.13	11.82	-

		63				
广发证券	2	162,947,043.77	10.00	151,754.69	10.07	-
中信建投	1	158,381,394.04	9.72	145,911.49	9.69	-
中金财富证券	1	134,984,393.34	8.29	125,712.02	8.34	-
招商证券	1	99,803,025.10	6.13	91,949.94	6.10	-
九州证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	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(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-

银河证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
九州证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增华西证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 05 月 29 日
2	关于新增中国工商银行为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 05 月 18 日
3	关于增加上海陆享基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 03 月 01 日
4	关于增加博时财富基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 24 日
5	关于新增深圳前海微众银行股份有限公司为建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金等代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 24 日
6	关于更新建信基金旗下公募基金产品适当性风险等级评定结果的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 15 日
7	关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 02 月 07 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		间区间					
机构	1	2023 年 01 月 01 日-2023 年 06 月 30 日	103,264,1 14.46	-	-	103,264,114.4 6	27.68
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20% 的情况,可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险,敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制,持续做好基金流动性风险的管控工作,审慎评估大额申赎对基金运作的影响,采取有效措施切实保护持有人合法权益。							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 设立的文件;
- 2、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- 3、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》;
- 4、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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

2023 年 8 月 30 日