

建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指 数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国国际金融股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末上市基金前十名持有人	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	建信 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	建信 MSCI (扩位简称: MSCIA 股 ETF 基金)
基金主代码	512180
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 19 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国国际金融股份有限公司
报告期末基金份额总额	86,048,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 21 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	中国国际金融股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinzipilu@ccbfund.cn
客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	010-65353060; 010-65351622
传真	010-66228001	010-65059873
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区建外门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区建外门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

邮政编码	100033	100004
法定代表人	生柳荣	陈亮

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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-4,303,340.00
本期利润	585,946.24
加权平均基金份额本期利润	0.0066
本期加权平均净值利润率	0.53%
本期基金份额净值增长率	0.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	20,866,436.23
期末可供分配基金份额利润	0.2425
期末基金资产净值	106,914,436.23
期末基金份额净值	1.2425
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	24.25%

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。

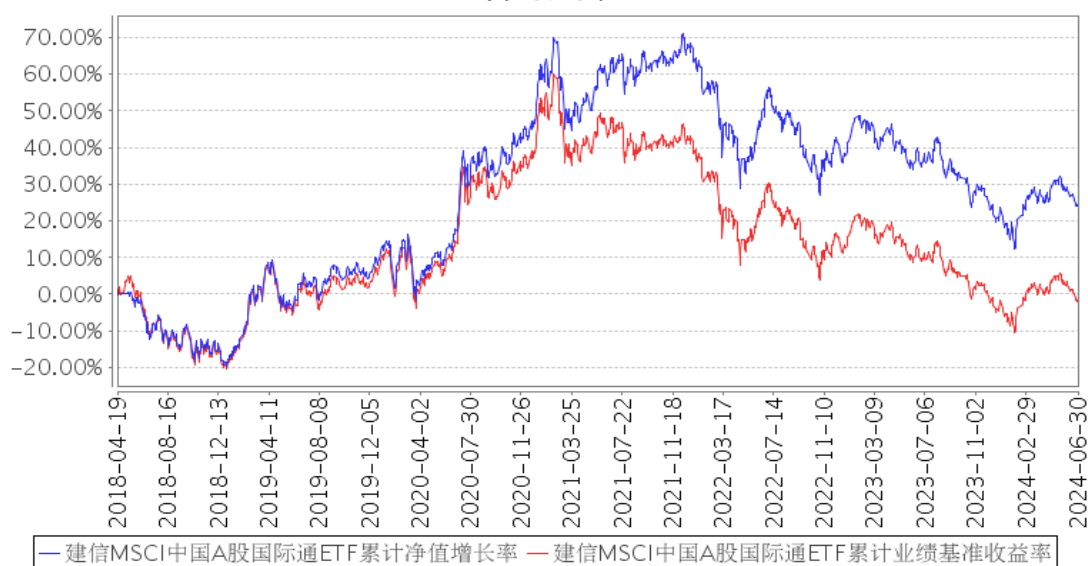
3.2 基金净值表现

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	-3.00%	0.50%	-3.88%	0.51%	0.88%	-0.01%
过去三个月	-1.62%	0.78%	-2.61%	0.79%	0.99%	-0.01%
过去六个月	0.43%	0.98%	0.00%	0.98%	0.43%	0.00%
过去一年	-8.83%	0.90%	-10.40%	0.91%	1.57%	-0.01%
过去三年	-24.48%	1.01%	-33.59%	1.04%	9.11%	-0.03%
自基金合同生效起至今	24.25%	1.17%	-1.65%	1.21%	25.90%	-0.04%

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

建信MSCI中国A股国际通ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，由中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团产融控股有限公司合

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、南京、武汉七家分公司，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 8000 万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至 2024 年 6 月 30 日，公司管理运作 166 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 1.12 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	2018 年 4 月 19 日	-	21	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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

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

规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在报告期内，一直保持高仓位运行，以满足上市运作以及紧密跟踪标的指数的要求。

在报告期内，基金标的指数的成分股进行了两次例行调整，偶有临时调整。管理人根据指数编制公司发布的信息，对申赎清单文件及基金投资组合作了相应的必要操作，较为有效地控制了组合的跟踪误差，并确保基金平稳运作。

由于四舍五入取整等原因，基金申赎清单中股票的权重结构与标的指数成分股权重之间存在一定差异，这会使基金组合在跟踪标的指数时产生一定误差。管理人对组合结构进行了适当调整，尽力降低这些不利影响，基金的跟踪误差和偏离度都保持在合理水平。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 0.43% 波动率 0.98% 业绩比较基准收益率 0.00% 波动率 0.98%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年中国宏观经济和 A 股市场，综合考虑国内外的经济政治因素，可以看到机遇和挑战并存的局面。

中国政府将继续推进全面深化改革，以应对复杂的国际国内形势。总体上，宏观政策将继续保持稳中求进的总基调，推动经济体制改革，促进社会公平和增进民生福祉。内需将成为经济增长的重要动力，同时外贸新动能也将加快培育。绿色低碳发展的扎实推进，脱贫攻坚成果的巩固拓展，对高技术产业的重点支持、新能源和基础设施的继续建设，都将对带动整体经济增长起到促进作用。

尽管经济发展中还面临着一些内外部的挑战，例如房地产市场如何保持平稳发展，债务压力如何化解，消费潜力如何得到充分释放等等，但我们相信，这些阶段性问题都可以得到妥善的处理。

对 A 股市场而言，政策的积极支持和经济的稳步增长将为投资者带来信心。特别是在科技创

新、绿色发展和消费升级等领域，政策的持续支持有望引导资本流入，推动相关板块的表现。在这一过程中，不排除一些扰动因素可能导致市场的短期波动，但从长期来看，随着中国经济结构的优化和市场机制的完善，A 股市场依旧会稳步发展，并继续表现出活力、充满机遇。

本管理人将根据基金合同，继续做好对指数的复制追踪，力争将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、风险与合规管理部、投资风险管理部门和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国国际金融股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的重大违规行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,040,820.42	1,810,125.53
结算备付金		6,435.58	11,965.80
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	104,090,563.31	112,414,251.42
其中：股票投资		104,090,563.31	112,414,251.42
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		107,137,819.31	114,236,342.75
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		44,700.58	48,081.41
应付托管费		8,940.12	9,616.29
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	169,742.38	298,130.55
负债合计		223,383.08	355,828.25
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	86,048,000.00	92,048,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	20,866,436.23	21,832,514.50
净资产合计		106,914,436.23	113,880,514.50
负债和净资产总计		107,137,819.31	114,236,342.75

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.2425 元，基金份额总额 86,048,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		1,073,130.48	-927,142.06
1. 利息收入		7,605.85	11,739.77
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,605.85	11,739.77
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,828,477.38	1,770,381.38
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,140,377.92	276,295.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,311,900.54	1,494,086.37
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	4,889,286.24	-2,717,013.29
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	4,715.77	7,750.08
减：二、营业总支出		487,184.24	576,834.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	276,304.94	336,258.44
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	55,261.00	67,251.72
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	155,618.30	173,324.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		585,946.24	-1,503,976.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		585,946.24	-1,503,976.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		585,946.24	-1,503,976.79

6.3 净资产变动表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	92,048,000.00	-	21,832,514.50	113,880,514.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	92,048,000.00	-	21,832,514.50	113,880,514.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,000,000.00	-	-966,078.27	-6,966,078.27
（一）、综合收益总额	-	-	585,946.24	585,946.24
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-6,000,000.00	-	-1,552,024.51	-7,552,024.51
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-6,000,000.00	-	-1,552,024.51	-7,552,024.51
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	86,048,000.00	-	20,866,436.23	106,914,436.23
项目	上年度可比期间 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	98,048,000.00	-	37,254,346.78	135,302,346.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	98,048,000.00	-	37,254,346.78	135,302,346.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,000,000.00	-	-2,410,230.30	-4,410,230.30
(一)、综合收益总额	-	-	-1,503,976.79	-1,503,976.79
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-2,000,000.00	-	-906,253.51	-2,906,253.51
其中：1. 基金申购款	10,000,000.00	-	4,309,226.22	14,309,226.22
2. 基金赎回款	-12,000,000.00	-	-5,215,479.73	-17,215,479.73
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	96,048,000.00	-	34,844,116.48	130,892,116.48

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

基金管理人负责人

张力铮

主管会计工作负责人

丁颖

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]503号《关于准予建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,046,048,000.00 元（含募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2018）第 0258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,046,048,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。

本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司以本基金为目标 ETF，募集成立了建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“建信 MSCI 联接基金”）。建信 MSCI 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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%，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；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	3,040,820.42
等于：本金	3,040,240.27
加：应计利息	580.15
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	3,040,820.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	113,369,982.10	-	104,090,563.31	-9,279,418.79
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	113,369,982.10	-	104,090,563.31	-9,279,418.79

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	12,575.76
其中：交易所市场	12,575.76
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	37,603.50
预提费用	119,563.12
合计	169,742.38

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	92,048,000.00	92,048,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-6,000,000.00	-6,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	86,048,000.00	86,048,000.00

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

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	75,060,960.53	-53,228,446.03	21,832,514.50
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	75,060,960.53	-53,228,446.03	21,832,514.50
本期利润	-4,303,340.00	4,889,286.24	585,946.24
本期基金份额交易产生的变动数	-4,756,730.55	3,204,706.04	-1,552,024.51
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-4,756,730.55	3,204,706.04	-1,552,024.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	66,000,889.98	-45,134,453.75	20,866,436.23

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	7,505.03
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	100.82
其他	-
合计	7,605.85

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,983,379.06

股票投资收益——赎回差价收入	-156,998.86
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	-5,140,377.92

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	10,077,147.31
减：卖出股票成本总额	15,038,891.73
减：交易费用	21,634.64
买卖股票差价收入	-4,983,379.06

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	7,552,024.51
减：现金支付赎回款总额	2,900,624.51
减：赎回股票成本总额	4,808,398.86
减：交易费用	-
赎回差价收入	-156,998.86

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,311,900.54
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,311,900.54

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,889,286.24
股票投资	4,889,286.24
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	4,889,286.24

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	4,715.77
合计	4,715.77

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	417.64
指数使用费	75,637.54
合计	155,618.30

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东
建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“建信 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
中金公司	6,347,276.44	38.45	15,537,369.20	45.49

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	6,003.88	38.64	6,003.88	47.74
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
中金公司	14,470.13	45.71	77,347.77	76.57

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	276,304.94	336,258.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	30,077.24	38,905.80
应支付基金管理人的净管理费	246,227.70	297,352.64

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	55,261.00	67,251.72

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	47,491,200.00	55.19	47,491,200.00	51.59

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2024年6月30日，本基金因指数投资而持有关联方建设银行（证券代码：601939）的持仓数量为27,823.00股，占本基金总净值的比例为0.19%。持有关联方中金公司（证券代码：601995）的持仓数量为7,100.00股，占本基金总净值的比例为0.20%。（于2023年6月30日，本基金因指数投资而持有关联方建设银行（证券代码：601939）的持仓数量为30,923.00股，占本基金总净值的比例为0.15%。持有关联方中金公司（证券代码：601995）的持仓数量为6,300.00股，占

本基金总净值的比例为 0.17%。)

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024 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
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新发未上市	21.28	29.49	49	1,042.72	1,445.01	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新发未上市	18.65	18.65	511	9,530.15	9,530.15	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新发未上市	18.65	18.65	57	1,063.05	1,063.05	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新发未上市	29.02	25.36	43	1,247.86	1,090.48	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新发未上市	72.46	68.06	19	1,376.74	1,293.14	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新发未上市	26.00	37.49	62	1,612.00	2,324.38	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新发未上市	19.18	22.66	66	1,265.88	1,495.56	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新发未上市	20.56	20.56	511	10,506.16	10,506.16	-

		日								
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新发未上市	20.56	20.56	57	1,171.92	1,171.92	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新发未上市	19.86	42.51	132	2,621.52	5,611.32	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新发未上市	86.96	174.93	39	3,391.44	6,822.27	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新发未上市	22.43	31.55	112	2,512.16	3,533.60	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新发未上市	15.69	18.79	202	3,169.38	3,795.58	-
688717	艾罗能源	2023年12月26日	6个月	新发未上市	55.66	47.02	1,953	108,703.98	91,830.06	-

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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,040,820.42	-	-	-	3,040,820.42
结算备付金	6,435.58	-	-	-	6,435.58
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	104,090,563.31	104,090,563.31
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	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,047,256.00	-	-	104,090,563.31	107,137,819.31
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	44,700.58	44,700.58
应付托管费	-	-	-	8,940.12	8,940.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	169,742.38	169,742.38
负债总计	-	-	-	223,383.08	223,383.08
利率敏感度缺口	3,047,256.00	-	-	103,867,180.23	106,914,436.23
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,810,125.53	-	-	-	1,810,125.53
结算备付金	11,965.80	-	-	-	11,965.80
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	112,414,251.42	112,414,251.42
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	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	1,822,091.33	-	-112,414,251.42	114,236,342.75
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	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	48,081.41	48,081.41
应付托管费	-	-	9,616.29	9,616.29
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	298,130.55	298,130.55
负债总计	-	-	355,828.25	355,828.25
利率敏感度缺口	1,822,091.33	-	-112,058,423.17	113,880,514.50

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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	104,090,563.31	97.36	112,414,251.42	98.71
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	104,090,563.31	97.36	112,414,251.42	98.71

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	5,257,922.19	5,547,021.17
	业绩比较基准下降5%	-5,257,922.19	-5,547,021.17

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	103,949,050.63	112,145,976.75
第二层次	22,271.28	155,235.74
第三层次	119,241.40	113,038.93
合计	104,090,563.31	112,414,251.42

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	104,090,563.31	97.16
	其中：股票	104,090,563.31	97.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,047,256.00	2.84
8	其他各项资产	-	-
9	合计	107,137,819.31	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,137,448.00	1.06
B	采矿业	6,870,917.29	6.43
C	制造业	55,502,894.48	51.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,484,649.28	5.13
E	建筑业	2,189,664.92	2.05
F	批发和零售业	693,186.16	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	4,383,096.77	4.10
H	住宿和餐饮业	62,046.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,682,109.34	3.44
J	金融业	20,866,612.72	19.52
K	房地产业	981,340.57	0.92
L	租赁和商务服务业	804,999.37	0.75
M	科学研究和技术服务业	423,348.44	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	101,871.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	317,160.08	0.30
R	文化、体育和娱乐业	347,751.49	0.33
S	综合	61,248.00	0.06
	合计	103,910,343.91	97.19

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	160,882.05	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,940.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,967.19	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,429.48	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	180,219.40	0.17

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	3,596	5,276,734.44	4.94
2	300750	宁德时代	12,780	2,300,783.40	2.15
3	600900	长江电力	70,984	2,052,857.28	1.92
4	600036	招商银行	59,882	2,047,365.58	1.91
5	000858	五粮液	11,307	1,447,748.28	1.35
6	002594	比亚迪	5,212	1,304,303.00	1.22

7	601318	中国平安	31,278	1,293,658.08	1.21
8	601288	农业银行	247,000	1,076,920.00	1.01
9	601166	兴业银行	60,266	1,061,886.92	0.99
10	601138	工业富联	38,400	1,052,160.00	0.98
11	601899	紫金矿业	59,738	1,049,596.66	0.98
12	601398	工商银行	182,598	1,040,808.60	0.97
13	300760	迈瑞医疗	3,500	1,018,185.00	0.95
14	601088	中国神华	19,191	851,504.67	0.80
15	601328	交通银行	113,875	850,646.25	0.80
16	002475	立讯精密	20,832	818,905.92	0.77
17	601816	京沪高铁	142,500	765,225.00	0.72
18	600809	山西汾酒	3,521	742,508.48	0.69
19	600309	万华化学	9,100	735,826.00	0.69
20	601225	陕西煤业	28,100	724,137.00	0.68
21	600276	恒瑞医药	18,556	713,663.76	0.67
22	600000	浦发银行	85,200	701,196.00	0.66
23	002714	牧原股份	15,816	689,577.60	0.64
24	000333	美的集团	10,100	651,450.00	0.61
25	600030	中信证券	35,580	648,623.40	0.61
26	601857	中国石油	62,700	647,064.00	0.61
27	601668	中国建筑	120,812	641,511.72	0.60
28	000568	泸州老窖	4,300	617,007.00	0.58
29	600028	中国石化	94,200	595,344.00	0.56
30	601985	中国核电	54,800	584,168.00	0.55
31	600406	国电南瑞	23,277	580,993.92	0.54
32	601919	中远海控	36,980	572,820.20	0.54
33	000001	平安银行	56,328	571,729.20	0.53
34	601601	中国太保	19,908	554,636.88	0.52
35	601766	中国中车	70,600	530,206.00	0.50
36	600150	中国船舶	13,000	529,230.00	0.50
37	600690	海尔智家	18,328	520,148.64	0.49
38	002352	顺丰控股	14,233	507,975.77	0.48
39	300059	东方财富	45,815	483,806.40	0.45
40	002371	北方华创	1,500	479,835.00	0.45
41	600887	伊利股份	18,488	477,729.92	0.45
42	688041	海光信息	6,700	471,144.00	0.44
43	601988	中国银行	101,962	471,064.44	0.44
44	603288	海天味业	13,412	462,311.64	0.43
45	300308	中际旭创	3,220	443,973.60	0.42
46	000725	京东方 A	107,300	438,857.00	0.41
47	603993	洛阳钼业	51,300	436,050.00	0.41
48	600050	中国联通	92,300	433,810.00	0.41
49	601658	邮储银行	84,400	427,908.00	0.40

50	601818	光大银行	134,700	426,999.00	0.40
51	600019	宝钢股份	64,200	426,930.00	0.40
52	002142	宁波银行	19,212	423,816.72	0.40
53	600031	三一重工	24,645	406,642.50	0.38
54	601127	赛力斯	4,400	400,928.00	0.37
55	600919	江苏银行	53,253	395,669.79	0.37
56	600886	国投电力	21,600	393,984.00	0.37
57	600016	民生银行	102,924	390,081.96	0.36
58	601390	中国中铁	59,600	388,592.00	0.36
59	300498	温氏股份	19,320	382,922.40	0.36
60	300274	阳光电源	6,020	373,420.60	0.35
61	600436	片仔癀	1,800	372,906.00	0.35
62	600989	宝丰能源	21,300	369,129.00	0.35
63	601006	大秦铁路	51,000	365,160.00	0.34
64	600905	三峡能源	83,100	362,316.00	0.34
65	601169	北京银行	61,392	358,529.28	0.34
66	601888	中国中免	5,686	355,318.14	0.33
67	002304	洋河股份	4,388	354,287.12	0.33
68	603501	韦尔股份	3,480	345,807.60	0.32
69	000063	中兴通讯	11,700	327,249.00	0.31
70	000625	长安汽车	24,052	323,018.36	0.30
71	000651	格力电器	8,200	321,604.00	0.30
72	000338	潍柴动力	19,700	319,928.00	0.30
73	601009	南京银行	30,000	311,700.00	0.29
74	600104	上汽集团	22,418	310,713.48	0.29
75	600795	国电电力	51,800	310,282.00	0.29
76	601012	隆基绿能	22,007	308,538.14	0.29
77	600048	保利发展	34,700	303,972.00	0.28
78	600999	招商证券	21,568	300,010.88	0.28
79	601229	上海银行	41,233	299,351.58	0.28
80	601211	国泰君安	21,800	295,390.00	0.28
81	601600	中国铝业	38,300	292,229.00	0.27
82	002230	科大讯飞	6,750	289,912.50	0.27
83	603259	药明康德	7,376	289,065.44	0.27
84	600547	山东黄金	10,452	286,175.76	0.27
85	688111	金山办公	1,254	285,285.00	0.27
86	600346	恒力石化	20,407	284,677.65	0.27
87	600893	航发动力	7,765	283,810.75	0.27
88	002493	荣盛石化	29,375	283,762.50	0.27
89	000166	申万宏源	65,442	282,055.02	0.26
90	601669	中国电建	50,000	279,500.00	0.26
91	300015	爱尔眼科	27,044	279,094.08	0.26
92	600660	福耀玻璃	5,800	277,820.00	0.26

93	000792	盐湖股份	15,800	275,710.00	0.26
94	600585	海螺水泥	11,641	274,611.19	0.26
95	000538	云南白药	5,246	268,332.90	0.25
96	002938	鹏鼎控股	6,700	266,392.00	0.25
97	300433	蓝思科技	14,500	264,625.00	0.25
98	600674	川投能源	14,100	264,375.00	0.25
99	601688	华泰证券	21,200	262,668.00	0.25
100	600011	华能国际	26,600	255,892.00	0.24
101	002027	分众传媒	41,900	253,914.00	0.24
102	000596	古井贡酒	1,200	253,284.00	0.24
103	688271	联影医疗	2,300	252,310.00	0.24
104	600188	兖矿能源	11,100	252,303.00	0.24
105	601628	中国人寿	8,044	249,766.20	0.23
106	601111	中国国航	33,800	249,444.00	0.23
107	600438	通威股份	13,026	248,926.86	0.23
108	688036	传音控股	3,220	246,458.80	0.23
109	600015	华夏银行	38,500	246,400.00	0.23
110	000425	徐工机械	34,300	245,245.00	0.23
111	601066	中信建投	12,600	242,424.00	0.23
112	688012	中微公司	1,700	240,142.00	0.22
113	600837	海通证券	28,000	239,680.00	0.22
114	000895	双汇发展	10,071	239,387.67	0.22
115	000100	TCL 科技	54,510	235,483.20	0.22
116	300014	亿纬锂能	5,896	235,368.32	0.22
117	001979	招商蛇口	26,263	230,851.77	0.22
118	600023	浙能电力	32,400	230,364.00	0.22
119	601881	中国银河	21,000	228,060.00	0.21
120	002311	海大集团	4,800	225,840.00	0.21
121	600926	杭州银行	17,240	224,982.00	0.21
122	300502	新易盛	2,100	221,655.00	0.21
123	688256	寒武纪	1,100	218,537.00	0.20
124	605499	东鹏饮料	1,000	215,750.00	0.20
125	003816	中国广核	45,700	211,591.00	0.20
126	601995	中金公司	7,100	210,231.00	0.20
127	000776	广发证券	17,200	209,324.00	0.20
128	600489	中金黄金	14,100	208,680.00	0.20
129	601939	建设银行	27,823	205,890.20	0.19
130	002463	沪电股份	5,580	203,670.00	0.19
131	600089	特变电工	14,617	202,737.79	0.19
132	600845	宝信软件	6,316	201,669.88	0.19
133	601868	中国能建	94,100	199,492.00	0.19
134	603392	万泰生物	3,028	199,484.64	0.19
135	601872	招商轮船	23,600	199,420.00	0.19

136	600115	中国东航	49,700	199,297.00	0.19
137	300124	汇川技术	3,848	197,402.40	0.18
138	000002	万 科 A	28,240	195,703.20	0.18
139	300122	智飞生物	6,900	193,407.00	0.18
140	002241	歌尔股份	9,900	193,149.00	0.18
141	600029	南方航空	32,565	191,807.85	0.18
142	603986	兆易创新	1,984	189,710.08	0.18
143	688008	澜起科技	3,300	188,628.00	0.18
144	600160	巨化股份	7,800	188,214.00	0.18
145	601825	沪农商行	28,000	188,160.00	0.18
146	601901	方正证券	23,900	184,747.00	0.17
147	000938	紫光股份	8,262	184,655.70	0.17
148	600010	包钢股份	131,800	184,520.00	0.17
149	601689	拓普集团	3,400	182,274.00	0.17
150	601633	长城汽车	7,200	182,160.00	0.17
151	601100	恒立液压	3,880	180,730.40	0.17
152	601336	新华保险	6,008	180,420.24	0.17
153	600111	北方稀土	10,450	179,740.00	0.17
154	002648	卫星化学	9,738	175,089.24	0.16
155	601916	浙商银行	62,500	172,500.00	0.16
156	002001	新 和 成	8,968	172,185.60	0.16
157	688223	晶科能源	24,200	171,820.00	0.16
158	600027	华电国际	24,700	171,418.00	0.16
159	600703	三安光电	14,500	169,940.00	0.16
160	000983	山西焦煤	16,460	169,702.60	0.16
161	601838	成都银行	11,100	168,609.00	0.16
162	600039	四川路桥	21,080	166,321.20	0.16
163	603369	今世缘	3,600	166,320.00	0.16
164	300033	同花顺	1,600	165,920.00	0.16
165	601788	光大证券	11,327	165,600.74	0.15
166	600066	宇通客车	6,400	165,120.00	0.15
167	600958	东方证券	21,700	164,920.00	0.15
168	600584	长电科技	5,200	164,892.00	0.15
168	688169	石头科技	420	164,892.00	0.15
169	300408	三环集团	5,600	163,464.00	0.15
170	600426	华鲁恒升	6,120	163,036.80	0.15
171	002736	国信证券	18,600	161,634.00	0.15
172	601618	中国中冶	51,800	160,580.00	0.15
173	000999	华润三九	3,770	160,526.60	0.15
174	601360	三六零	20,752	159,375.36	0.15
175	000157	中联重科	20,590	158,131.20	0.15
176	601699	潞安环能	8,700	157,731.00	0.15
177	601021	春秋航空	2,800	157,724.00	0.15

178	600026	中远海能	10,100	157,661.00	0.15
179	000977	浪潮信息	4,320	157,118.40	0.15
180	600522	中天科技	9,900	156,915.00	0.15
181	001965	招商公路	13,200	156,552.00	0.15
182	600233	圆通速递	10,000	156,500.00	0.15
183	600803	新奥股份	7,500	156,000.00	0.15
184	300832	新产业	2,300	155,112.00	0.15
185	601607	上海医药	8,100	154,791.00	0.14
186	000301	东方盛虹	19,200	153,024.00	0.14
187	600085	同仁堂	4,000	152,840.00	0.14
188	002916	深南电路	1,440	152,308.80	0.14
189	600600	青岛啤酒	2,075	150,997.75	0.14
190	002252	上海莱士	19,300	150,926.00	0.14
191	600875	东方电气	8,101	149,463.45	0.14
192	600741	华域汽车	9,100	149,058.00	0.14
193	002236	大华股份	9,577	148,060.42	0.14
194	002028	思源电气	2,200	147,180.00	0.14
195	601117	中国化学	17,700	145,848.00	0.14
196	603195	公牛集团	1,885	145,371.20	0.14
197	000786	北新建材	4,900	145,334.00	0.14
198	300896	爱美客	840	144,564.00	0.14
199	002600	领益智造	20,300	144,536.00	0.14
200	601567	三星医疗	4,100	143,500.00	0.13
201	600183	生益科技	6,800	143,208.00	0.13
202	600362	江西铜业	6,000	142,080.00	0.13
203	000963	华东医药	5,101	141,858.81	0.13
204	601319	中国人保	27,500	141,625.00	0.13
205	600161	天坛生物	5,760	140,544.00	0.13
206	300394	天孚通信	1,580	139,703.60	0.13
207	002422	科伦药业	4,600	139,518.00	0.13
208	002920	德赛西威	1,600	139,344.00	0.13
209	688396	华润微	3,700	138,528.00	0.13
210	600196	复星医药	6,200	137,268.00	0.13
211	002128	电投能源	6,500	137,150.00	0.13
212	000807	云铝股份	10,100	136,451.00	0.13
213	601727	上海电气	36,700	135,790.00	0.13
214	000617	中油资本	24,500	135,240.00	0.13
215	002460	赣锋锂业	4,682	134,139.30	0.13
216	300628	亿联网络	3,640	133,842.80	0.13
217	601058	赛轮轮胎	9,500	133,000.00	0.12
218	000708	中信特钢	9,800	132,986.00	0.12
219	000630	铜陵有色	36,800	132,848.00	0.12
220	000933	神火股份	6,500	131,495.00	0.12

221	605117	德业股份	1,764	131,135.76	0.12
222	000975	银泰黄金	8,040	130,971.60	0.12
223	600733	北汽蓝谷	16,200	130,896.00	0.12
224	600985	淮北矿业	7,800	130,572.00	0.12
225	002049	紫光国微	2,480	130,448.00	0.12
226	600219	南山铝业	34,000	129,540.00	0.12
227	601077	渝农商行	25,700	129,014.00	0.12
228	002466	天齐锂业	4,300	128,613.00	0.12
229	300999	金龙鱼	4,700	128,545.00	0.12
230	600398	海澜之家	13,900	128,436.00	0.12
231	002601	龙佰集团	6,900	128,133.00	0.12
232	600176	中国巨石	11,588	128,047.40	0.12
233	600256	广汇能源	19,100	127,970.00	0.12
234	600221	海航控股	125,400	127,908.00	0.12
235	601377	兴业证券	25,100	127,006.00	0.12
236	600642	申能股份	14,200	125,386.00	0.12
237	688009	中国通号	20,800	124,800.00	0.12
238	688188	柏楚电子	672	124,017.60	0.12
239	601168	西部矿业	6,900	123,855.00	0.12
240	601878	浙商证券	11,300	121,136.00	0.11
241	000876	新希望	13,200	120,648.00	0.11
242	000423	东阿阿胶	1,917	120,004.20	0.11
243	601179	中国西电	14,900	119,796.00	0.11
244	600332	白云山	4,067	119,285.11	0.11
245	600415	小商品城	15,900	117,978.00	0.11
246	601877	正泰电器	6,188	117,943.28	0.11
247	300782	卓胜微	1,516	117,853.84	0.11
248	600018	上港集团	20,300	117,334.00	0.11
249	600009	上海机场	3,611	116,454.75	0.11
250	300661	圣邦股份	1,395	115,478.10	0.11
251	600918	中泰证券	20,200	114,534.00	0.11
252	600487	亨通光电	7,200	113,544.00	0.11
253	002078	太阳纸业	8,100	112,995.00	0.11
254	300413	芒果超媒	5,400	112,860.00	0.11
255	300418	昆仑万维	3,500	112,840.00	0.11
256	601233	桐昆股份	7,000	111,720.00	0.10
257	300866	安克创新	1,560	111,087.60	0.10
258	000408	藏格矿业	4,600	110,722.00	0.10
259	601238	广汽集团	14,300	110,682.00	0.10
260	603806	福斯特	7,529	110,676.30	0.10
261	601865	福莱特	5,500	110,550.00	0.10
262	688126	沪硅产业	8,000	110,480.00	0.10
263	000661	长春高新	1,200	110,124.00	0.10

264	002180	纳思达	4,158	109,854.36	0.10
265	603799	华友钴业	4,953	109,609.89	0.10
266	002532	天山铝业	13,500	109,485.00	0.10
267	002625	光启技术	6,300	109,305.00	0.10
268	603198	迎驾贡酒	1,900	109,250.00	0.10
269	300316	晶盛机电	3,800	109,174.00	0.10
270	002223	鱼跃医疗	2,900	109,040.00	0.10
271	601991	大唐发电	36,000	108,360.00	0.10
272	603260	合盛硅业	2,300	107,433.00	0.10
273	002459	晶澳科技	9,584	107,340.80	0.10
274	688599	天合光能	6,300	106,596.00	0.10
275	688303	大全能源	5,200	106,028.00	0.10
276	002353	杰瑞股份	3,000	105,240.00	0.10
277	688072	拓荆科技	876	105,216.36	0.10
278	600348	华阳股份	10,500	104,580.00	0.10
279	600515	海南机场	33,200	104,248.00	0.10
280	600061	国投资本	18,400	103,960.00	0.10
281	688187	时代电气	2,100	103,698.00	0.10
282	002384	东山精密	5,000	103,500.00	0.10
283	300765	新诺威	4,100	103,443.00	0.10
284	002064	华峰化学	14,400	103,248.00	0.10
285	002050	三花智控	5,400	103,032.00	0.10
286	600096	云天化	5,300	102,926.00	0.10
287	603568	伟明环保	4,950	101,871.00	0.10
288	600745	闻泰科技	3,600	101,700.00	0.10
289	002129	TCL 中环	11,700	101,205.00	0.09
290	300442	润泽科技	4,200	100,590.00	0.09
291	000027	深圳能源	13,760	100,448.00	0.09
292	600418	江淮汽车	6,300	99,792.00	0.09
293	002074	国轩高科	5,200	99,580.00	0.09
294	600588	用友网络	9,921	99,210.00	0.09
295	301236	软通动力	2,800	98,588.00	0.09
296	002156	通富微电	4,400	98,516.00	0.09
297	002709	天赐材料	5,580	97,984.80	0.09
298	600570	恒生电子	5,543	97,889.38	0.09
299	601958	金钼股份	9,400	97,854.00	0.09
300	603606	东方电缆	2,000	97,620.00	0.09
301	601577	长沙银行	11,700	95,706.00	0.09
302	600177	雅戈尔	13,400	95,408.00	0.09
303	002340	格林美	14,900	94,913.00	0.09
304	688120	华海清科	500	94,790.00	0.09
305	600060	海信视像	3,800	94,012.00	0.09
306	600970	中材国际	7,700	92,862.00	0.09

307	300751	迈为股份	764	91,282.72	0.09
308	603979	金诚信	1,800	90,954.00	0.09
309	601216	君正集团	24,500	90,405.00	0.08
310	601799	星宇股份	800	89,632.00	0.08
311	603338	浙江鼎力	1,480	89,421.60	0.08
312	603160	汇顶科技	1,300	89,375.00	0.08
313	601108	财通证券	13,500	89,235.00	0.08
314	600282	南钢股份	17,900	89,142.00	0.08
315	002812	恩捷股份	2,800	88,620.00	0.08
316	000932	华菱钢铁	20,000	88,600.00	0.08
317	002409	雅克科技	1,400	88,074.00	0.08
318	603659	璞泰来	6,231	88,044.03	0.08
319	002595	豪迈科技	2,300	87,791.00	0.08
320	603939	益丰药房	3,547	87,078.85	0.08
321	000921	海信家电	2,700	87,048.00	0.08
322	000988	华工科技	2,900	86,797.00	0.08
323	002444	巨星科技	3,500	86,450.00	0.08
324	600038	中直股份	2,100	86,331.00	0.08
325	002281	光迅科技	2,300	85,951.00	0.08
326	600566	济川药业	2,700	85,617.00	0.08
327	600873	梅花生物	8,500	85,170.00	0.08
328	601231	环旭电子	5,300	85,065.00	0.08
329	600132	重庆啤酒	1,400	84,980.00	0.08
330	002294	信立泰	3,188	84,896.44	0.08
331	601555	东吴证券	14,377	84,824.30	0.08
332	600546	山煤国际	5,800	84,796.00	0.08
333	301269	华大九天	1,100	84,755.00	0.08
334	603899	晨光股份	2,700	84,456.00	0.08
335	600460	士兰微	4,800	84,048.00	0.08
336	002007	华兰生物	5,320	84,002.80	0.08
337	300919	中伟股份	2,700	83,673.00	0.08
338	002555	三七互娱	6,400	83,520.00	0.08
339	600895	张江高科	4,500	83,160.00	0.08
340	600582	天地科技	12,000	82,680.00	0.08
341	000066	中国长城	9,400	82,250.00	0.08
342	601990	南京证券	10,700	82,176.00	0.08
343	002085	万丰奥威	6,200	82,088.00	0.08
344	300207	欣旺达	5,400	81,918.00	0.08
345	688777	中控技术	2,165	81,620.50	0.08
346	300003	乐普医疗	5,500	81,620.00	0.08
347	600109	国金证券	10,800	81,540.00	0.08
348	603833	欧派家居	1,516	81,196.96	0.08
349	600968	海油发展	19,700	81,164.00	0.08

350	601928	凤凰传媒	7,400	81,104.00	0.08
351	600021	上海电力	8,200	81,098.00	0.08
352	300759	康龙化成	4,350	80,823.00	0.08
353	600352	浙江龙盛	9,400	80,746.00	0.08
354	600079	人福医药	4,700	80,699.00	0.08
355	601666	平煤股份	7,200	80,640.00	0.08
356	002673	西部证券	13,014	80,556.66	0.08
357	603486	科沃斯	1,700	80,206.00	0.08
358	002032	苏泊尔	1,600	80,160.00	0.07
359	002966	苏州银行	10,600	79,500.00	0.07
360	688363	华熙生物	1,400	79,198.00	0.07
361	600497	驰宏锌锗	14,800	79,032.00	0.07
362	601966	玲珑轮胎	4,300	78,991.00	0.07
363	603156	养元饮品	3,700	78,699.00	0.07
364	000831	中国稀土	3,100	78,585.00	0.07
365	600988	赤峰黄金	4,800	78,432.00	0.07
366	002939	长城证券	11,700	78,390.00	0.07
367	603658	安图生物	1,700	78,319.00	0.07
368	600153	建发股份	8,711	77,789.23	0.07
369	300223	北京君正	1,400	77,616.00	0.07
370	000783	长江证券	16,000	77,280.00	0.07
371	603816	顾家家居	2,390	77,173.10	0.07
372	000728	国元证券	12,640	76,598.40	0.07
373	688728	格科微	6,300	76,293.00	0.07
374	000738	航发控制	3,800	76,266.00	0.07
375	002739	万达电影	6,300	76,167.00	0.07
376	600157	永泰能源	64,500	76,110.00	0.07
377	002185	华天科技	9,300	75,795.00	0.07
378	000703	恒逸石化	10,680	75,721.20	0.07
379	600583	海油工程	12,800	75,648.00	0.07
380	002152	广电运通	7,200	75,312.00	0.07
381	601198	东兴证券	9,400	74,824.00	0.07
382	002465	海格通信	7,204	74,633.44	0.07
383	000683	远兴能源	10,800	74,628.00	0.07
384	002603	以岭药业	4,860	74,503.80	0.07
385	000960	锡业股份	4,800	74,352.00	0.07
386	002602	世纪华通	21,640	74,225.20	0.07
387	002456	欧菲光	9,500	74,195.00	0.07
388	601866	中远海发	28,700	74,046.00	0.07
389	600536	中国软件	2,460	73,603.20	0.07
390	601696	中银证券	8,100	73,548.00	0.07
391	600521	华海药业	4,290	73,144.50	0.07
392	002414	高德红外	12,399	73,030.11	0.07

393	688065	凯赛生物	1,600	72,624.00	0.07
394	000729	燕京啤酒	8,200	72,406.00	0.07
395	300251	光线传媒	8,500	71,485.00	0.07
396	600998	九州通	14,605	71,272.40	0.07
397	603893	瑞芯微	1,200	71,004.00	0.07
398	002372	伟星新材	4,600	70,932.00	0.07
399	600549	厦门钨业	4,100	70,725.00	0.07
400	688122	西部超导	1,840	70,508.80	0.07
401	000800	一汽解放	9,000	70,470.00	0.07
402	603885	吉祥航空	6,400	70,336.00	0.07
403	600298	安琪酵母	2,500	69,825.00	0.07
404	600369	西南证券	19,300	69,094.00	0.06
405	002831	裕同科技	2,700	69,093.00	0.06
406	000937	冀中能源	10,300	69,010.00	0.06
407	002262	恩华药业	2,900	68,846.00	0.06
408	603529	爱玛科技	2,500	68,325.00	0.06
409	600486	扬农化工	1,200	67,740.00	0.06
410	600511	国药股份	2,200	67,738.00	0.06
411	000629	钒钛股份	27,000	67,500.00	0.06
412	601880	辽港股份	54,600	67,158.00	0.06
413	002202	金风科技	9,993	67,152.96	0.06
414	000513	丽珠集团	1,800	66,978.00	0.06
415	601456	国联证券	6,943	66,930.52	0.06
416	603596	伯特利	1,720	66,908.00	0.06
417	603345	安井食品	900	66,879.00	0.06
418	603589	口子窖	1,700	66,623.00	0.06
419	000733	振华科技	1,600	66,448.00	0.06
420	300146	汤臣倍健	4,900	66,395.00	0.06
421	688538	和辉光电	33,500	66,330.00	0.06
422	688099	晶晨股份	1,115	66,141.80	0.06
423	600704	物产中大	15,100	65,534.00	0.06
424	600004	白云机场	6,900	65,412.00	0.06
425	600598	北大荒	5,200	64,948.00	0.06
426	002120	韵达股份	8,380	64,861.20	0.06
427	002430	杭氧股份	2,900	64,525.00	0.06
428	000009	中国宝安	7,500	64,500.00	0.06
429	603000	人民网	3,200	63,968.00	0.06
430	600378	昊华科技	2,200	63,580.00	0.06
431	600848	上海临港	6,960	63,405.60	0.06
432	002080	中材科技	4,900	63,210.00	0.06
433	002821	凯莱英	960	63,168.00	0.06
434	300037	新宙邦	2,180	62,260.80	0.06
435	002797	第一创业	12,200	62,098.00	0.06

436	600754	锦江酒店	2,700	62,046.00	0.06
437	002508	老板电器	2,795	61,769.50	0.06
438	600673	东阳光	8,700	61,248.00	0.06
439	002850	科达利	800	61,104.00	0.06
440	300144	宋城演艺	7,583	60,891.49	0.06
441	300699	光威复材	2,448	60,783.84	0.06
442	600699	均胜电子	4,100	60,762.00	0.06
443	300454	深信服	1,200	60,636.00	0.06
444	300487	蓝晓科技	1,450	60,552.00	0.06
445	600380	健康元	5,400	60,318.00	0.06
446	603290	斯达半导	700	60,277.00	0.06
447	600839	四川长虹	13,400	60,166.00	0.06
448	000723	美锦能源	12,600	59,976.00	0.06
449	000987	越秀资本	12,088	59,956.48	0.06
450	600637	东方明珠	9,800	59,584.00	0.06
451	600072	中船科技	4,400	59,488.00	0.06
452	300496	中科创达	1,300	59,267.00	0.06
453	002517	恺英网络	6,200	59,210.00	0.06
454	688082	盛美上海	700	59,157.00	0.06
455	002841	视源股份	2,000	59,060.00	0.06
456	002056	横店东磁	4,700	58,609.00	0.05
457	000709	河钢股份	30,000	58,200.00	0.05
458	600655	豫园股份	11,300	58,195.00	0.05
459	600977	中国电影	5,400	58,104.00	0.05
460	300957	贝泰妮	1,200	57,984.00	0.05
461	002738	中矿资源	2,140	57,352.00	0.05
462	688114	华大智造	1,200	56,892.00	0.05
463	600705	中航产融	25,600	56,832.00	0.05
464	600702	舍得酒业	1,000	56,670.00	0.05
465	000825	太钢不锈	16,600	56,108.00	0.05
466	600170	上海建工	25,800	55,470.00	0.05
467	601162	天风证券	25,100	54,718.00	0.05
468	002756	永兴材料	1,520	54,385.60	0.05
469	600884	杉杉股份	6,600	53,592.00	0.05
470	300142	沃森生物	4,700	53,486.00	0.05
471	300347	泰格医药	1,100	53,460.00	0.05
472	600563	法拉电子	700	53,326.00	0.05
473	600779	水井坊	1,400	52,682.00	0.05
474	600166	福田汽车	23,200	52,200.00	0.05
475	600872	中炬高新	2,300	52,187.00	0.05
476	300601	康泰生物	3,269	51,029.09	0.05
477	300763	锦浪科技	1,200	49,968.00	0.05
478	603728	鸣志电器	1,200	48,276.00	0.05

479	600732	爱旭股份	5,280	47,784.00	0.04
480	603233	大参林	3,267	46,718.10	0.04
481	603688	石英股份	1,550	45,895.50	0.04
482	002271	东方雨虹	3,650	45,041.00	0.04
483	603077	和邦生物	25,600	42,240.00	0.04
484	603882	金域医学	1,400	38,066.00	0.04

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	688717	艾罗能源	1,953	91,830.06	0.09
2	300285	国瓷材料	1,000	17,850.00	0.02
3	603350	安乃达	568	11,678.08	0.01
4	603285	键邦股份	568	10,593.20	0.01
5	688692	达梦数据	39	6,822.27	0.01
6	688691	灿芯股份	132	5,611.32	0.01
7	688720	艾森股份	105	4,256.70	0.00
8	688709	成都华微	202	3,795.58	0.00
9	601096	宏盛华源	921	3,766.89	0.00
10	688652	京仪装备	96	3,752.64	0.00
11	688653	康希通信	289	3,722.32	0.00
12	688695	中创股份	112	3,533.60	0.00
13	603341	龙旗科技	62	2,324.38	0.00
14	601083	锦江航运	203	1,940.68	0.00
15	603344	星德胜	66	1,495.56	0.00
16	603082	北自科技	49	1,445.01	0.00
17	603373	安邦护卫	52	1,429.48	0.00
18	603325	博隆技术	19	1,293.14	0.00
19	603312	西典新能	43	1,090.48	0.00
20	603004	鼎龙科技	63	1,067.85	0.00
21	603231	索宝蛋白	54	920.16	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	000333	美的集团	669,074.00	0.59
2	002714	牧原股份	425,858.02	0.37
3	600519	贵州茅台	168,389.00	0.15
4	001965	招商公路	148,241.00	0.13
5	000708	中信特钢	143,412.00	0.13
6	688041	海光信息	118,065.07	0.10
7	601567	三星医疗	113,901.00	0.10

8	000921	海信家电	109,326.00	0.10
9	603979	金诚信	100,314.00	0.09
10	601881	中国银河	99,741.00	0.09
11	300896	爱美客	95,982.00	0.08
12	002085	万丰奥威	93,858.00	0.08
13	601666	平煤股份	92,928.00	0.08
14	600282	南钢股份	91,859.00	0.08
15	600582	天地科技	85,547.00	0.08
16	600968	海油发展	83,374.00	0.07
17	688114	华大智造	82,922.47	0.07
18	600900	长江电力	63,079.00	0.06
19	601006	大秦铁路	59,379.00	0.05
20	000858	五粮液	57,906.00	0.05

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	002714	牧原股份	393,269.20	0.35
2	300750	宁德时代	170,085.00	0.15
3	688212	澳华内镜	142,137.60	0.12
4	000858	五粮液	130,171.00	0.11
5	688692	达梦数据	90,128.00	0.08
6	601059	信达证券	89,547.20	0.08
7	300760	迈瑞医疗	88,533.00	0.08
8	002594	比亚迪	82,613.00	0.07
9	688717	艾罗能源	80,523.52	0.07
10	002244	滨江集团	78,656.00	0.07
11	688787	海天瑞声	76,976.88	0.07
12	688032	禾迈股份	72,437.84	0.06
13	688301	奕瑞科技	72,413.40	0.06
14	603737	三棵树	71,156.16	0.06
15	002568	百润股份	70,521.04	0.06
16	601155	新城控股	70,059.00	0.06
17	601933	永辉超市	68,640.00	0.06
18	601615	明阳智能	66,588.00	0.06
19	000069	华侨城 A	66,180.48	0.06
20	688180	君实生物	65,940.54	0.06

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	6,634,316.24
--------------	--------------

卖出股票收入（成交）总额	10,077,147.31
--------------	---------------

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

无。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688717	艾罗能源	91,830.06	0.09	新发未上市
2	603350	安乃达	11,678.08	0.01	新发未上市
3	603285	键邦股份	10,593.20	0.01	新发未上市
4	688692	达梦数据	6,822.27	0.01	新发未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,400	61,462.86	49,200,800.00	57.18	36,847,200.00	42.82

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国国际金融股份有限公司-建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	47,491,200.00	55.19

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中信证券股份有限公司	1,709,600.00	1.99
2	刘海涛	1,500,000.00	1.74
3	王锦华	1,020,000.00	1.19
4	张建军	1,000,000.00	1.16
5	高为	580,000.00	0.67

6	任泽红	445,000.00	0.52
7	郭少华	395,900.00	0.46
8	王桂霞	350,000.00	0.41
9	常翼	349,900.00	0.41
10	陈连福	333,400.00	0.39
11	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	47,491,200.00	55.19

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年4月19日） 基金份额总额	2,046,048,000.00
本报告期期初基金份额总额	92,048,000.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	86,048,000.00

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2024 年 3 月 30 日发布公告，自 2024 年 3 月 28 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司首席信息官。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，不涉及基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金财产、基金管理业务的诉讼事项。

本报告期无涉及基金托管业务的重大诉讼。

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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	建信基金管理有限责任公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 1 月 18 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	信息披露不及时
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改
其他	无

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，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中金公司	4	6,347,276.44	38.45	6,003.88	38.64	-
中信证券	1	4,351,235.70	26.36	4,072.38	26.21	-
长江证券	1	3,480,736.99	21.08	3,257.62	20.97	-
天风证券	1	2,329,468.13	14.11	2,203.43	14.18	-

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

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

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

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

(4) 佣金费率合理。

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

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	关于新增国联证券股份有限公司为建信 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销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2024 年 3 月 21 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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日	47,491,200.00	-	-	47,491,200.00	55.19

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2024 年 8 月 29 日