

建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

2025 年中期报告

2025 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	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遵规守信情况的说明	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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	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	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46

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	46
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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末上市基金前十名持有人	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	建信沪深 300 指数 (LOF)
场内简称	沪深 300LOF 建信
基金主代码	165309
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 11 月 5 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	214,431,164.45 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
上市日期	2009 年 11 月 30 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	(010) 66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund. cn
客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	95588
传真	010-66228001	(010) 66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100033	100140
法定代表人	生柳荣	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,009,176.67
本期利润	2,777,487.92
加权平均基金份额本期利润	0.0126
本期加权平均净值利润率	0.80%
本期基金份额净值增长率	0.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	132,062,310.43
期末可供分配基金份额利润	0.6159
期末基金资产净值	346,493,474.88
期末基金份额净值	1.6159
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	61.59%

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	3.02%	0.55%	2.37%	0.55%	0.65%	0.00%
过去三个月	2.01%	1.04%	1.21%	1.04%	0.80%	0.00%
过去六个月	0.85%	0.96%	0.07%	0.97%	0.78%	-0.01%
过去一年	14.78%	1.29%	13.12%	1.32%	1.66%	-0.03%
过去三年	-4.64%	1.03%	-11.43%	1.05%	6.79%	-0.02%
自基金合同生效起至今	61.59%	1.31%	15.53%	1.31%	46.06%	0.00%

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 (LOF) 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 9000 万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至 2025 年 6 月 30 日，公司管理运作 177 只公开募集证券投资基以及多个私募资产管理计划，资产管理规模 1.21 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	数量投资部高级基金经理，本基金的基金经理	2009 年 11 月 5 日	-	22	梁洪昀先生，数量投资部高级基金经理，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、投资管理部总监、金融工程及指数投资部总经理、数量投资部总经理等职务。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的基金经理；2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 日任建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；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的基金经理；2011 年 9 月 8 日至 2016 年 7 月 20 日任建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；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，该基金于 2020 年 5 月 7 日起转型为建信沪深 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 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; 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。
--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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，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 4 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

在报告期内，本基金严格依据基金合同的约定，对标的指数进行复制跟踪，并将年化跟踪误差与日均跟踪偏离度均控制在合同规定的范围内。

报告期内，标的指数中有部分成分股因受规定限制无法直接投资，本基金采用了其他股票进行替代，这是跟踪误差的一个重要来源。为尽量减少该不利影响，基金管理人通过量化分析，不断制定、执行并优化替代策略，使替代方案尽量合理。

报告期内，标的指数成分股进行了例行调整，管理人及时调整组合，力求在成分股调整过程中最大限度地降低跟踪误差和偏离度。

在遵守基金合同并确保平稳运作的前提下，本基金还适度参与新股申购，并在适当时机兑现，以期为投资组合增厚收益。

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 0.85% 波动率 0.96% 业绩比较基准收益率 0.07% 波动率 0.97%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济和市场在经历了上半年一系列事件的冲击后，逐渐恢复平稳。各个主要经济体更多地选择对话和协商，取代对抗与摩擦，这为矛盾与纷争的解决奠定了基础。

展望下半年，全球经济有望维持温和复苏态势。美国和欧元区在货币政策相继进入“观望期”后，将更加关注增长与通胀的平衡；新兴市场在外资回流和大宗商品价格企稳的支持下，将呈现出分化但总体向好的局面。贸易摩擦虽仍有不确定性，但随着对话机制重启，出现类似于上半年的事件剧烈冲击的可能性已经降低。

国内经济方面，尽管外部环境仍存在不确定性，国内经济结构调整亦面临压力，但我们认为中国经济有望延续稳定增长的态势。

上半年国民经济稳中有进，为实现全年目标打下了坚实基础。高质量发展的长期趋势正在巩固，经济结构持续优化。其中，服务业已成为经济增长的核心驱动力，其对 GDP 增长的贡献率超

过 60%。内需方面，消费作为经济“压舱石”的作用日益凸显，在上半年一系列促消费政策的带动下市场趋于活跃，预计在政策继续加力的情况下，消费将保持良好增势。消费升级、绿色消费及假日经济等新趋势将持续为市场注入活力。宏观政策将继续为经济稳定运行保驾护航。有关部门已明确将加快推出下半年支持性政策，并做好了丰富的政策储备，以应对市场变化，为经济增长托底。随着总需求持续扩张、扩内需政策效果显现以及基数效应减弱，通胀中枢有望企稳回升。

国内股票市场在经历了前期的波动与调整后，正逐步消化各类事件性冲击带来的影响，投资者的悲观情绪得到了显著修复。随着信心的企稳，市场整体估值已从历史低位反弹，回归至一个相对合理的区间。这标志着市场的主要矛盾，正从对系统性风险的过度担忧，转向对未来增长质量的重新审视。

我们认为，市场下一阶段的驱动力，将更多地由估值修复转向盈利驱动和基本面驱动。在经济结构转型和高质量发展的大趋势下，市场的结构性机会将持续显现。投资者仍有必要密切关注国内外宏观环境的边际变化，以及潜在的政策调整。未来市场的机遇与挑战并存。

本基金将继续依据合同规定，对标的指数继续进行复制跟踪，控制跟踪误差与偏离度。在此基础上，适度参与新股申购等市场机会，以期在风险可控的前提下，为投资者进一步提升收益。

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、风险管理工作的，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，本基金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》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6. 4. 7. 1	24,643,718.98	29,819,588.66
结算备付金		-	-
存出保证金		3,064.55	20,839.30
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	323,176,002.53	336,291,082.71
其中：股票投资		323,176,002.53	336,291,082.71
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		76, 235. 65	66, 390. 84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		347, 899, 021. 71	366, 197, 901. 51
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1, 714, 146. 57
应付赎回款		690, 835. 07	698, 980. 13
应付管理人报酬		210, 463. 38	232, 731. 54
应付托管费		42, 092. 68	46, 546. 30
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	462, 155. 70	560, 793. 79
负债合计		1, 405, 546. 83	3, 253, 198. 33
净资产：			
实收基金	6. 4. 7. 10	214, 431, 164. 45	226, 510, 696. 28
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	132, 062, 310. 43	136, 434, 006. 90
净资产合计		346, 493, 474. 88	362, 944, 703. 18
负债和净资产总计		347, 899, 021. 71	366, 197, 901. 51

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.6159 元，基金份额总额

214, 431, 164. 45 份。

6.2 利润表

会计主体: 建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,421,309.74	7,783,367.24
1. 利息收入		41,929.65	51,699.30
其中: 存款利息收入	6.4.7.13	41,929.65	51,699.30
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)		-424,251.80	-421,404.87
其中: 股票投资收益	6.4.7.14	-4,650,933.23	-4,586,996.88
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.15	—	—
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	—	—
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	4,226,681.43	4,165,592.01
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	4,786,664.59	8,132,071.65
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	16,967.30	21,001.16
减: 二、营业总支出		1,643,821.82	1,759,098.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,294,723.13	1,391,152.65
其中: 暂估管理人报酬		—	—
2. 托管费	6.4.10.2.2	258,944.69	278,230.48
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	90,154.00	89,715.82
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,777,487.92	6,024,268.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,777,487.92	6,024,268.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,777,487.92	6,024,268.29

6.3 净资产变动表

会计主体：建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	226,510,696.28	-	136,434,006.90	362,944,703.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	226,510,696.28	-	136,434,006.90	362,944,703.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,079,531.83	-	-4,371,696.47	-16,451,228.30
(一)、综合收益总额	-	-	2,777,487.92	2,777,487.92
(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)	-12,079,531.83	-	-7,149,184.39	-19,228,716.22
其中：1. 基金申购款	10,566,315.76	-	5,990,322.74	16,556,638.50
2. 基金赎回	-22,645,847.59	-	-13,139,507.13	-35,785,354.72

回款				
(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	214,431,164.45	-	132,062,310.43	346,493,474.88
项目	上年度可比期间 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	257,058,909.46	-	99,581,215.86	356,640,125.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	257,058,909.46	-	99,581,215.86	356,640,125.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	11,985,277.94	-	10,140,811.79	22,126,089.73
(一)、综合收益总额	-	-	6,024,268.29	6,024,268.29
(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)	11,985,277.94	-	4,116,543.50	16,101,821.44
其中：1. 基金申购款	29,024,677.58	-	11,110,516.96	40,135,194.54
2. 基金赎回款	-17,039,399.64	-	-6,993,973.46	-24,033,373.10
(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	269,044,187.40	-	109,722,027.65	378,766,215.05

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：

谢海玉

莫红

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (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[2009]882 号《关于核准建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2009 年 9 月 21 日至 2009 年 10 月 30 日止。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,324,471,976.73 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字 (2009) 第 233 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2009 年 11 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,326,413,369.61 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,941,392.88 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 深证上[2009]157 号审核同意，本基金 59,552,590.00 份基金份额于 2009 年 11 月 30 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金对标的指数的跟踪目标：力争使得日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差

不超过 4%。本基金业绩比较基准为 $95\% \times \text{沪深 } 300 \text{ 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款利率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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《关于证券投资基金管理政策的通知》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 2025年6月30日
活期存款	24,643,718.98
等于： 本金	24,641,341.69
加： 应计利息	2,377.29
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	24,643,718.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	316,744,536.06	-	323,176,002.53	6,431,466.47
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	316,744,536.06	-	323,176,002.53	6,431,466.47

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

无。

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,497.37
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	376,815.17
其中：交易所市场	376,815.17
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	83,843.16
合计	462,155.70

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	账面金额
上年度末	226,510,696.28	226,510,696.28
本期申购	10,566,315.76	10,566,315.76
本期赎回 (以“-”号填列)	-22,645,847.59	-22,645,847.59
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	214,431,164.45	214,431,164.45

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	309,749,817.87	-173,315,810.97	136,434,006.90
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	309,749,817.87	-173,315,810.97	136,434,006.90
本期利润	-2,009,176.67	4,786,664.59	2,777,487.92
本期基金份额交易产生的变动数	-16,491,775.69	9,342,591.30	-7,149,184.39
其中：基金申购款	14,413,123.29	-8,422,800.55	5,990,322.74
基金赎回款	-30,904,898.98	17,765,391.85	-13,139,507.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	291,248,865.51	-159,186,555.08	132,062,310.43

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		41,874.33
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		32.70
其他		22.62
合计		41,929.65

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,650,933.23
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	-4,650,933.23

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	21,478,637.53
减：卖出股票成本总额	26,113,116.36
减：交易费用	16,454.40
买卖股票差价收入	-4,650,933.23

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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,226,681.43
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	4,226,681.43

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,786,664.59
股票投资	4,786,664.59
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	4,786,664.59

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	16,024.92
基金转换费收入	942.38
合计	16,967.30

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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,810.84
银行间账户维护费	9,000.00
合计	90,154.00

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,294,723.13	1,391,152.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	424,067.85	411,021.63
应支付基金管理人的净管理费	870,655.28	980,131.02

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的托管费	258,944.69	278,230.48
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人的托管费为按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期	24,643,718.98	41,874.33	30,048,819.95	51,013.26

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 (2025 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
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新发未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新发未上市	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新发未上市	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新发未上市	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新发未上市	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新发未上市	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新发未上市	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-

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账户，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 2025 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	24,643,718.98	-	-	-	24,643,718.98
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	3,064.55	-	-	-	3,064.55
交易性金融资产	-	-	-	323,176,002.53	323,176,002.53
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	50.00	-	-	76,185.65	76,235.65
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,646,833.53	-	-	323,252,188.18	347,899,021.71
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	-	-	-	690,835.07	690,835.07
应付管理人报酬	-	-	-	210,463.38	210,463.38
应付托管费	-	-	-	42,092.68	42,092.68
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	-	-	-	462,155.70	462,155.70
负债总计	-	-	-	1,405,546.83	1,405,546.83
利率敏感度缺口	24,646,833.53	-	-	321,846,641.35	346,493,474.88

上年度末 2024 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	29,819,588.66	—	—	—	29,819,588.66
结算备付金	—	—	—	—	—
存出保证金	20,839.30	—	—	—	20,839.30
交易性金融资产	—	—	—336,291,082.71	336,291,082.71	—
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	—	—	—	66,390.84	66,390.84
其他资产	—	—	—	—	—
资产总计	29,840,427.96	—	—336,357,473.55	366,197,901.51	
负债					
卖出回购金融资产款	—	—	—	—	—
短期借款	—	—	—	—	—
交易性金融负债	—	—	—	—	—
衍生金融负债	—	—	—	—	—
应付清算款	—	—	—	1,714,146.57	1,714,146.57
应付赎回款	—	—	—	698,980.13	698,980.13
应付管理人报酬	—	—	—	232,731.54	232,731.54
应付托管费	—	—	—	46,546.30	46,546.30
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	—	—	—	560,793.79	560,793.79
负债总计	—	—	—3,253,198.33	3,253,198.33	
利率敏感度缺口	29,840,427.96	—	—333,104,275.22	362,944,703.18	

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 2025年6月30日		上年度末 2024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	323,176,002.53	93.27	336,291,082.71	92.66
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	323,176,002.53	93.27	336,291,082.71	92.66

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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 (2025年6月30日)	上年度末 (2024年12月 31日)
分析	业绩比较基准上升 5%	16,937,168.39	17,677,939.98
	业绩比较基准下降 5%	-16,937,168.39	-17,677,939.98

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	323,122,497.67	335,423,983.29
第二层次	15,385.54	650,377.60
第三层次	38,119.32	216,721.82
合计	323,176,002.53	336,291,082.71

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

项目		金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	323,176,002.53	92.89
	其中：股票	323,176,002.53	92.89
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	24,643,718.98	7.08
8	其他各项资产	79,300.20	0.02
9	合计	347,899,021.71	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	3,245,351.00	0.94
B	采矿业	16,465,376.27	4.75
C	制造业	164,331,002.12	47.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,895,705.00	3.43
E	建筑业	6,184,475.51	1.78
F	批发和零售业	794,598.40	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	12,486,962.56	3.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,572,776.14	4.49
J	金融业	82,726,438.37	23.88
K	房地产业	1,739,078.90	0.50
L	租赁和商务服务业	3,001,815.06	0.87
M	科学研究和技术服务业	3,527,297.86	1.02
N	水利、环境和公共	-	-

	设施管理业		
0	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	918,889.92	0.27
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	322,889,767.11	93.19

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	286,235.42	0.08
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	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	286,235.42	0.08

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	9,945	14,017,676.40	4.05
2	300750	宁德时代	41,760	10,532,707.20	3.04
3	601318	中国平安	169,932	9,427,827.36	2.72
4	600036	招商银行	195,380	8,977,711.00	2.59
5	601166	兴业银行	262,401	6,124,439.34	1.77
6	600900	长江电力	193,200	5,823,048.00	1.68
7	000333	美的集团	77,640	5,605,608.00	1.62
8	601899	紫金矿业	260,092	5,071,794.00	1.46
9	002594	比亚迪	14,300	4,746,313.00	1.37
10	300059	东方财富	199,601	4,616,771.13	1.33
11	600030	中信证券	154,098	4,256,186.76	1.23
12	600276	恒瑞医药	70,481	3,657,963.90	1.06
13	000858	五 粮 液	30,587	3,636,794.30	1.05
14	601211	国泰海通	178,378	3,417,722.48	0.99
15	000651	格力电器	70,712	3,176,383.04	0.92
16	601328	交通银行	371,820	2,974,560.00	0.86
17	601288	农业银行	504,199	2,964,690.12	0.86
18	600887	伊利股份	99,772	2,781,643.36	0.80
19	002475	立讯精密	80,000	2,775,200.00	0.80
20	688981	中芯国际	31,400	2,768,538.00	0.80
21	600919	江苏银行	231,800	2,767,692.00	0.80
22	603259	药明康德	39,466	2,744,860.30	0.79
23	601816	京沪高铁	463,300	2,663,975.00	0.77
24	600000	浦发银行	185,500	2,574,740.00	0.74
25	000725	京东方 A	580,019	2,314,275.81	0.67
26	002371	北方华创	5,100	2,255,271.00	0.65
27	300760	迈瑞医疗	9,600	2,157,600.00	0.62
28	601088	中国神华	52,100	2,112,134.00	0.61
29	688041	海光信息	14,700	2,076,963.00	0.60
30	300308	中际旭创	14,000	2,042,040.00	0.59
31	601601	中国太保	54,000	2,025,540.00	0.58
32	300502	新易盛	15,640	1,986,592.80	0.57
33	688256	寒武纪	3,300	1,984,950.00	0.57
34	300124	汇川技术	29,797	1,923,992.29	0.56
35	601728	中国电信	245,000	1,898,750.00	0.55
36	601668	中国建筑	326,250	1,882,462.50	0.54
37	600016	民生银行	391,900	1,861,525.00	0.54
38	002352	顺丰控股	38,000	1,852,880.00	0.53
39	000001	平安银行	153,079	1,847,663.53	0.53

40	002714	牧原股份	43,100	1,810,631.00	0.52
41	002230	科大讯飞	36,500	1,747,620.00	0.50
42	601127	赛力斯	12,900	1,732,728.00	0.50
43	603501	豪威集团	13,415	1,712,424.75	0.49
44	600031	三一重工	93,700	1,681,915.00	0.49
45	601229	上海银行	157,153	1,667,393.33	0.48
46	000063	中兴通讯	50,900	1,653,741.00	0.48
47	603019	中科曙光	23,080	1,624,832.00	0.47
48	002415	海康威视	58,308	1,616,880.84	0.47
49	600309	万华化学	29,718	1,612,498.68	0.47
50	600941	中国移动	14,200	1,598,210.00	0.46
51	601169	北京银行	233,600	1,595,488.00	0.46
52	300274	阳光电源	22,940	1,554,643.80	0.45
53	601857	中国石油	178,900	1,529,595.00	0.44
54	601919	中远海控	99,580	1,497,683.20	0.43
55	688008	澜起科技	18,030	1,478,460.00	0.43
56	600690	海尔智家	59,240	1,467,967.20	0.42
57	600660	福耀玻璃	25,300	1,442,353.00	0.42
58	601688	华泰证券	80,724	1,437,694.44	0.41
59	601012	隆基绿能	95,624	1,436,272.48	0.41
60	300498	温氏股份	84,000	1,434,720.00	0.41
61	002142	宁波银行	52,054	1,424,197.44	0.41
62	600406	国电南瑞	63,362	1,419,942.42	0.41
63	600809	山西汾酒	7,689	1,356,262.71	0.39
64	601766	中国中车	191,926	1,351,159.04	0.39
65	601138	工业富联	62,800	1,342,664.00	0.39
66	603986	兆易创新	10,528	1,332,107.84	0.38
67	000338	潍柴动力	85,604	1,316,589.52	0.38
68	600050	中国联通	246,500	1,316,310.00	0.38
69	000568	泸州老窖	11,600	1,315,440.00	0.38
70	600028	中国石化	230,500	1,300,020.00	0.38
71	000100	TCL 科技	296,100	1,282,113.00	0.37
72	601006	大秦铁路	190,700	1,258,620.00	0.36
73	688012	中微公司	6,900	1,257,870.00	0.36
74	600926	杭州银行	72,600	1,221,132.00	0.35
75	601818	光大银行	292,642	1,214,464.30	0.35
76	601985	中国核电	129,700	1,208,804.00	0.35
77	601225	陕西煤业	61,283	1,179,084.92	0.34
78	600104	上汽集团	73,137	1,173,848.85	0.34
79	002027	分众传媒	159,772	1,166,335.60	0.34
80	600150	中国船舶	35,300	1,148,662.00	0.33
81	601988	中国银行	199,771	1,122,713.02	0.32
82	601628	中国人寿	26,274	1,082,226.06	0.31

83	688111	金山办公	3,700	1,036,185.00	0.30
84	605499	东鹏饮料	3,290	1,033,224.50	0.30
85	600999	招商证券	58,600	1,030,774.00	0.30
86	603288	海天味业	26,357	1,025,550.87	0.30
87	600377	宁沪高速	66,700	1,023,178.00	0.30
88	600760	中航沈飞	17,400	1,019,988.00	0.29
89	601009	南京银行	87,500	1,016,750.00	0.29
90	000425	徐工机械	130,046	1,010,457.42	0.29
91	000625	长安汽车	78,273	998,763.48	0.29
92	000792	盐湖股份	58,400	997,472.00	0.29
93	688271	联影医疗	7,800	996,372.00	0.29
94	600111	北方稀土	39,976	995,402.40	0.29
95	600938	中国海油	37,800	986,958.00	0.28
96	600905	三峡能源	226,000	962,760.00	0.28
97	600436	片仔癀	4,800	960,048.00	0.28
98	601658	邮储银行	175,400	959,438.00	0.28
99	600089	特变电工	79,750	951,417.50	0.27
100	601888	中国中免	15,418	940,035.46	0.27
101	603993	洛阳钼业	110,800	932,936.00	0.27
102	002050	三花智控	35,300	931,214.00	0.27
103	300033	同花顺	3,400	928,234.00	0.27
104	600048	保利发展	113,600	920,160.00	0.27
105	300015	爱尔眼科	73,629	918,889.92	0.27
106	600019	宝钢股份	138,444	912,345.96	0.26
107	601390	中国中铁	162,318	910,603.98	0.26
108	600547	山东黄金	28,475	909,206.75	0.26
109	002463	沪电股份	21,300	906,954.00	0.26
110	002241	歌尔股份	38,550	898,986.00	0.26
111	600415	小商品城	43,300	895,444.00	0.26
112	300014	亿纬锂能	19,400	888,714.00	0.26
113	601825	沪农商行	91,400	886,580.00	0.26
114	601600	中国铝业	125,100	880,704.00	0.25
115	601989	中国重工	180,300	836,592.00	0.24
116	000977	浪潮信息	16,200	824,256.00	0.24
117	600585	海螺水泥	37,974	815,301.78	0.24
118	600893	航发动力	21,086	812,654.44	0.23
119	002179	中航光电	20,058	809,540.88	0.23
120	601916	浙商银行	238,400	808,176.00	0.23
121	601838	成都银行	40,200	808,020.00	0.23
122	600570	恒生电子	23,908	801,874.32	0.23
123	600958	东方证券	82,400	797,632.00	0.23
124	600015	华夏银行	100,500	794,955.00	0.23
125	603799	华友钴业	21,467	794,708.34	0.23

126	000538	云南白药	14,120	787,754.80	0.23
127	000776	广发证券	46,600	783,346.00	0.23
128	601336	新华保险	13,200	772,200.00	0.22
129	002311	海大集团	13,100	767,529.00	0.22
130	600584	长电科技	22,600	761,394.00	0.22
131	000938	紫光股份	31,600	758,084.00	0.22
132	600438	通威股份	42,700	715,225.00	0.21
133	002028	思源电气	9,800	714,518.00	0.21
134	000166	申万宏源	142,209	713,889.18	0.21
135	601998	中信银行	83,500	709,750.00	0.20
136	300408	三环集团	21,200	708,080.00	0.20
137	002049	紫光国微	10,720	706,019.20	0.20
138	300433	蓝思科技	31,500	702,450.00	0.20
139	601077	渝农商行	97,800	698,292.00	0.20
140	600795	国电电力	140,800	681,472.00	0.20
141	601377	兴业证券	109,000	674,710.00	0.19
142	600489	中金黄金	45,800	670,054.00	0.19
143	601669	中国电建	136,200	663,294.00	0.19
144	601995	中金公司	18,500	654,160.00	0.19
145	601689	拓普集团	13,650	644,962.50	0.19
146	600010	包钢股份	357,900	640,641.00	0.18
147	002422	科伦药业	17,600	632,192.00	0.18
148	600009	上海机场	19,600	622,692.00	0.18
149	002304	洋河股份	9,500	613,225.00	0.18
150	601100	恒立液压	8,500	612,000.00	0.18
151	600160	巨化股份	21,300	610,884.00	0.18
152	000768	中航西飞	22,000	601,480.00	0.17
153	002460	赣锋锂业	17,810	601,443.70	0.17
154	300394	天孚通信	7,420	592,412.80	0.17
155	601881	中国银河	34,300	588,245.00	0.17
156	601186	中国铁建	72,803	583,152.03	0.17
157	600183	生益科技	19,200	578,880.00	0.17
158	002252	上海莱士	83,780	575,568.60	0.17
159	688036	传音控股	7,180	572,246.00	0.17
160	000157	中联重科	78,285	566,000.55	0.16
161	601360	三六零	55,200	563,040.00	0.16
162	600886	国投电力	38,000	560,120.00	0.16
163	600989	宝丰能源	34,700	560,058.00	0.16
164	000963	华东医药	13,840	558,582.40	0.16
165	002074	国轩高科	17,100	555,066.00	0.16
166	601788	光大证券	30,800	553,784.00	0.16
167	600115	中国东航	135,200	544,856.00	0.16
168	300442	润泽科技	10,900	539,877.00	0.16

169	000408	藏格矿业	12,400	529,108.00	0.15
170	002736	国信证券	45,500	524,160.00	0.15
171	000807	云铝股份	32,800	524,144.00	0.15
172	002466	天齐锂业	16,300	522,252.00	0.15
173	600066	宇通客车	21,000	522,060.00	0.15
174	002001	新和成	24,248	515,754.96	0.15
175	000661	长春高新	5,200	515,736.00	0.15
176	601901	方正证券	64,900	513,359.00	0.15
177	600426	华鲁恒升	23,500	509,245.00	0.15
178	600196	复星医药	20,063	503,380.67	0.15
179	001979	招商蛇口	57,170	501,380.90	0.14
180	600029	南方航空	84,900	500,910.00	0.14
181	300661	圣邦股份	6,877	500,439.29	0.14
182	601800	中国交建	56,100	498,729.00	0.14
183	000975	山金国际	26,300	498,122.00	0.14
184	002236	大华股份	31,300	497,044.00	0.14
185	600011	华能国际	69,300	494,802.00	0.14
186	600674	川投能源	30,800	494,032.00	0.14
187	601066	中信建投	20,500	493,025.00	0.14
188	301236	软通动力	9,000	491,760.00	0.14
189	688126	沪硅产业	26,100	488,592.00	0.14
190	688169	石头科技	3,080	482,174.00	0.14
191	600346	恒力石化	33,280	474,572.80	0.14
192	601878	浙商证券	43,400	473,494.00	0.14
193	300418	昆仑万维	13,900	467,457.00	0.13
194	601111	中国国航	59,200	467,088.00	0.13
195	002648	卫星化学	26,520	459,591.60	0.13
196	600372	中航机载	38,100	459,486.00	0.13
197	603369	今世缘	11,800	459,374.00	0.13
198	601868	中国能建	205,200	457,596.00	0.13
199	002916	深南电路	4,242	457,330.02	0.13
200	600460	士兰微	18,400	456,688.00	0.13
201	003816	中国广核	124,200	452,088.00	0.13
202	002920	德赛西威	4,400	449,372.00	0.13
203	601117	中国化学	57,800	443,326.00	0.13
204	601319	中国人保	50,400	438,984.00	0.13
205	600741	华域汽车	24,813	437,949.45	0.13
206	300347	泰格医药	8,208	437,650.56	0.13
207	600176	中国巨石	38,048	433,747.20	0.13
208	600588	用友网络	32,300	431,851.00	0.12
209	601021	春秋航空	7,700	428,505.00	0.12
210	002601	龙佰集团	26,300	426,323.00	0.12
211	000786	北新建材	15,972	422,938.56	0.12

212	600219	南山铝业	110,300	422,449.00	0.12
213	301269	华大九天	3,400	421,192.00	0.12
214	601633	长城汽车	19,600	421,008.00	0.12
215	300782	卓胜微	5,860	418,228.20	0.12
216	302132	中航成飞	4,700	413,318.00	0.12
217	600482	中国动力	17,800	410,646.00	0.12
218	300896	爱美客	2,340	409,055.40	0.12
219	600039	四川路桥	41,300	408,870.00	0.12
220	000630	铜陵有色	121,500	405,810.00	0.12
221	000895	双汇发展	16,329	398,590.89	0.12
222	002493	荣盛石化	47,850	396,198.00	0.11
223	688396	华润微	8,400	396,144.00	0.11
224	002129	TCL 中环	50,950	391,296.00	0.11
225	600085	同仁堂	10,800	389,448.00	0.11
226	600600	青岛啤酒	5,600	388,976.00	0.11
227	001965	招商公路	32,400	388,800.00	0.11
228	603296	华勤技术	4,800	387,264.00	0.11
229	688506	百利天恒	1,300	384,956.00	0.11
230	601877	正泰电器	16,950	384,256.50	0.11
231	002709	天赐材料	21,100	382,332.00	0.11
232	600362	江西铜业	16,299	381,885.57	0.11
233	002600	领益智造	44,100	378,819.00	0.11
234	300122	智飞生物	18,850	369,271.50	0.11
235	603392	万泰生物	6,038	368,318.00	0.11
236	002180	纳思达	15,700	360,158.00	0.10
237	600161	天坛生物	18,740	359,620.60	0.10
238	300832	新产业	6,200	351,664.00	0.10
239	600233	圆通速递	27,100	349,319.00	0.10
240	002938	鹏鼎控股	10,900	349,127.00	0.10
241	000301	东方盛虹	41,900	349,027.00	0.10
242	000596	古井贡酒	2,600	346,190.00	0.10
243	300759	康龙化成	14,050	344,787.00	0.10
244	600188	兖矿能源	28,280	344,167.60	0.10
245	600023	浙能电力	63,500	336,550.00	0.10
246	601618	中国中冶	112,900	336,442.00	0.10
247	000876	新希望	35,600	333,928.00	0.10
248	688047	龙芯中科	2,500	333,475.00	0.10
249	000999	华润三九	10,638	332,756.64	0.10
250	688223	晶科能源	63,100	327,489.00	0.09
251	600845	宝信软件	13,700	323,594.00	0.09
252	600875	东方电气	19,300	323,082.00	0.09
253	601872	招商轮船	51,200	320,512.00	0.09
254	600515	海南机场	89,700	317,538.00	0.09

255	601898	中煤能源	28,900	316,166.00	0.09
256	002459	晶澳科技	31,428	313,651.44	0.09
257	600061	国投资本	40,244	302,634.88	0.09
258	688599	天合光能	20,652	300,073.56	0.09
259	605117	德业股份	5,663	298,213.58	0.09
260	600027	华电国际	53,600	293,192.00	0.08
261	600332	白云山	11,100	292,596.00	0.08
262	000617	中油资本	40,000	292,000.00	0.08
263	000983	山西焦煤	44,800	286,720.00	0.08
264	600918	中泰证券	44,300	284,849.00	0.08
265	300316	晶盛机电	10,300	279,645.00	0.08
266	300628	亿联网络	8,000	278,080.00	0.08
267	600803	新奥股份	14,700	277,830.00	0.08
268	300999	金龙鱼	9,400	277,582.00	0.08
269	601799	星宇股份	2,200	275,000.00	0.08
270	601698	中国卫通	13,300	272,251.00	0.08
271	600025	华能水电	28,500	272,175.00	0.08
272	603260	合盛硅业	5,600	265,440.00	0.08
273	601238	广汽集团	35,140	263,198.60	0.08
274	601059	信达证券	15,300	261,630.00	0.08
275	300413	芒果超媒	11,820	257,912.40	0.07
276	600018	上港集团	43,816	250,189.36	0.07
277	601607	上海医药	13,200	236,016.00	0.07
278	600026	中远海能	21,900	226,227.00	0.07
279	688303	大全能源	10,178	216,994.96	0.06
280	688472	阿特斯	23,500	215,025.00	0.06
281	603806	福斯特	16,460	213,321.60	0.06
282	688009	中国通号	40,600	208,684.00	0.06
283	603195	公牛集团	4,236	204,387.00	0.06
284	601699	潞安环能	19,000	200,450.00	0.06
285	000708	中信特钢	16,000	188,160.00	0.05
286	601236	红塔证券	22,200	188,034.00	0.05
287	601865	福莱特	12,000	182,520.00	0.05
288	688187	时代电气	4,100	174,865.00	0.05
289	601136	首创证券	8,700	172,956.00	0.05
290	603833	欧派家居	2,900	163,705.00	0.05
291	688082	盛美上海	1,300	148,122.00	0.04
292	601808	中海油服	9,300	127,968.00	0.04
293	300979	华利集团	2,400	126,168.00	0.04
294	000800	一汽解放	15,700	107,702.00	0.03
295	001391	国货航	13,600	91,528.00	0.03
296	001289	龙源电力	2,400	38,832.00	0.01

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	301678	新恒汇	3,817	220,366.28	0.06
2	603400	华之杰	569	31,875.73	0.01
3	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
4	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
5	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
6	603382	海阳科技	105	2,350.95	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	601825	沪农商行	914,318.00	0.25
2	601166	兴业银行	727,543.00	0.20
3	601077	渝农商行	710,232.00	0.20
4	301236	软通动力	485,288.00	0.13
5	302132	中航成飞	414,541.00	0.11
6	002600	领益智造	360,998.00	0.10
7	002230	科大讯飞	335,891.00	0.09
8	688047	龙芯中科	302,557.88	0.08
9	601006	大秦铁路	288,576.00	0.08
10	600519	贵州茅台	284,182.00	0.08
11	600926	杭州银行	239,256.00	0.07
12	601211	国泰海通	198,202.00	0.05
13	601998	中信银行	168,768.00	0.05
14	601689	拓普集团	129,477.00	0.04
15	688271	联影医疗	127,477.87	0.04
16	600938	中国海油	116,764.00	0.03
17	601127	赛力斯	104,756.00	0.03
18	001391	国货航	93,160.00	0.03
19	600377	宁沪高速	87,818.00	0.02
20	301590	优优绿能	65,318.40	0.02

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	600519	贵州茅台	1,135,657.00	0.31
2	601988	中国银行	787,319.00	0.22

3	000002	万科 A	759,362.80	0.21
4	600745	闻泰科技	449,158.00	0.12
5	300750	宁德时代	431,852.00	0.12
6	300450	先导智能	404,223.00	0.11
7	002555	三七互娱	394,484.00	0.11
8	300124	汇川技术	381,833.00	0.11
9	601318	中国平安	371,675.00	0.10
10	600036	招商银行	359,124.00	0.10
11	002271	东方雨虹	339,451.00	0.09
12	002007	华兰生物	291,846.82	0.08
13	002594	比亚迪	288,757.00	0.08
14	603659	璞泰来	283,735.70	0.08
15	002812	恩捷股份	254,160.53	0.07
16	601985	中国核电	239,920.00	0.07
17	600900	长江电力	229,728.00	0.06
18	000858	五粮液	214,846.00	0.06
19	000333	美的集团	205,564.00	0.06
20	601899	紫金矿业	189,091.00	0.05

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交量），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	8,211,371.59
卖出股票收入（成交）总额	21,478,637.53

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	3,064.55
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	76,235.65
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	79,300.20

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	301678	新恒汇	17,014.28	0.00	新发未上市
2	001388	信通电子	15,385.54	0.00	新发未上市

3	301590	优优绿能	10,182.04	0.00	新发未上市
4	301636	泽润新能	6,074.88	0.00	新发未上市
5	603400	华之杰	2,497.17	0.00	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

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 (%)
17,190	12,474.18	372,457.05	0.17	214,058,707.40	99.83

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	何剑虹	315,676.00	15.46
2	邱桂芳	203,561.00	9.97
3	李晓年	197,689.00	9.68
4	郭念发	120,054.00	5.88
5	杨利萍	53,800.00	2.63
6	刘冬梅	46,905.00	2.30
7	高树峰	42,700.00	2.09
8	张枫林	40,000.00	1.96
9	林世基	39,620.00	1.94
10	郑双双	30,254.00	1.48

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	28,020.22	0.01

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 (2009 年 11 月 5 日)	5, 326, 413, 369. 61
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	226, 510, 696. 28
本报告期基金总申购份额	10, 566, 315. 76
减: 本报告期基金总赎回份额	22, 645, 847. 59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	214, 431, 164. 45

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 2025 年 1 月 25 日发布公告, 自 2025 年 1 月 24 日起聘任张铮先生担任建信基金管理有限责任公司副总裁。上述事项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, 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无其他涉及本基金管理业务、基金财产、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

本报告期内, 本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
国泰海通 证券	3	16,031,112.6 7	61.71	2,980.45	60.47	-
浙商证券	1	9,945,350.87	38.29	1,948.36	39.53	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注: 1、公司选择证券公司的标准

- (1) 实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 10 亿元人民币;
- (2) 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定;
- (3) 经营行为规范, 研究业务线最近两年未因发生重大违规行为而受到中国证监会处罚;
- (4) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作的要求;
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合证券交易的需要, 并能为基金提供全面的信息服务;

(6) 能及时为公司提供高质量的研究服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走势分析、个股分析报告及其他专门报告。

2、证券公司服务评价程序

(1) 证券公司服务的评价包括定期的证券公司评价打分以及对证券公司投研支持服务的定额激励。

(2) 公司对证券公司实行“核心名单”管理。在所有公司合作机构中筛选部分机构进入“核心名单”。公司的评价打分仅针对进入“核心名单”的机构，“核心名单”定期调整、动态优化。

(3) 定期的证券公司评价打分：根据证券公司服务记录，投研人员定期在投研系统平台对核心名单的证券公司服务进行评价打分。

(4) 证券公司服务的定额激励：根据证券公司服务记录，投研各部门可提出定额激励作为对证券公司投研支持服务的补充激励。证券公司投研支持服务的范围包括但不限于：重点推荐、定向路演邀请、投研课题委托、产业链调研、数据模型及支持等服务内容。

(5) 证券公司服务评价、交易佣金分配建议等证券公司服务的定期考核评价结果，由研究部进行汇总，提交公司投资决策委员会授权的投研部门总经理联席会议审议。

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(%)
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

国元证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	关于新增邮储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	2025 年 5 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

2025 年 8 月 29 日