

建信精工制造指数增强型证券投资基金

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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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）	13
6.1 资产负债表	13
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	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	37
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	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	47
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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	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	49
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
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	建信精工制造指数增强型证券投资基金
基金简称	建信精工制造指数增强
基金主代码	001397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 26 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	29,338,403.76 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对中证精工制造指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证精工制造指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	90%×中证精工制造指数收益率+10%×商业银行活期存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

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

法定代表人	生柳荣	方合英
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,173,609.83
本期利润	2,689,743.86
加权平均基金份额本期利润	0.0885
本期加权平均净值利润率	5.00%
本期基金份额净值增长率	5.17%
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	25,534,323.23
期末可供分配基金份额利润	0.8703
期末基金资产净值	54,872,726.99
期末基金份额净值	1.8703
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	87.03%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

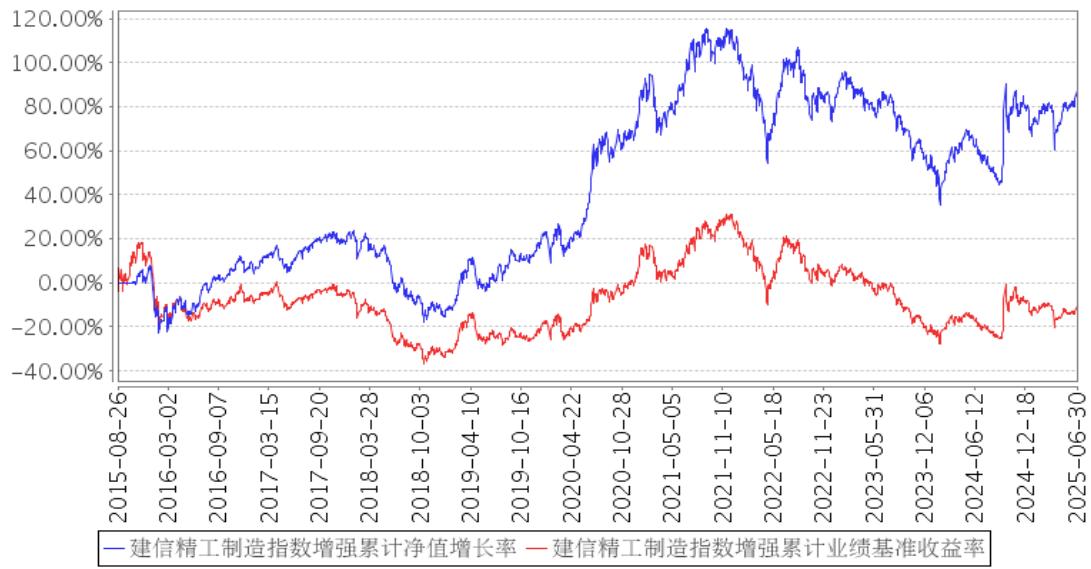
阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	--------	----------	-------	--------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	4.34%	0.63%	3.98%	0.62%	0.36%	0.01%
过去三个月	5.48%	1.39%	1.95%	1.32%	3.53%	0.07%
过去六个月	5.17%	1.21%	-1.67%	1.15%	6.84%	0.06%
过去一年	17.31%	1.48%	10.39%	1.51%	6.92%	-0.03%
过去三年	-5.80%	1.20%	-25.08%	1.23%	19.28%	-0.03%
自基金合同生效起至今	87.03%	1.27%	-10.74%	1.33%	97.77%	-0.06%

注：本基金业绩比较基准为 $90\% \times \text{中证精工制造指数收益率} + 10\% \times \text{商业银行活期存款利率}$ （税前）。本基金为指数增强型基金，持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。故在业绩比较基准中给予标的指数收益率 90% 的权重，相应将 10% 作为体现现金或到期日在一年以内的政府债券业绩表现的权重。中证精工制造指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，涵盖工业和通信设备行业，综合反映了这两个行业的上市公司的整体情况。

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

建信精工制造指数增强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金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		
刘明辉	本基金的 基金经理	2021年 10月27 日	-	9	刘明辉先生，硕士。2015年7月毕业于北京大学应用统计专业，同年7月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部助理研究员、研究员兼投资经理助理、投资经理、基金经理职务。2021年10月27日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2022年10月17日起任建信恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理；2022年12月23日起任建信中证500指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理。
叶乐天	数量投资 部副总经 理，本基 金的基金 经理	2015年8 月26日	-	17	叶乐天先生，数量投资部副总经理，博士。曾任中国国际金融有限公司市场风险管理分析员、量化分析经理。2011年9月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理。2012年3月21

					日至 2016 年 7 月 20 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；2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 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；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理，该基金于 2021 年 1 月 1 日起转型为建信央视财经 50 指数证券投资基金（LOF），叶乐天继续担任该基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 4 月 18 日至 2023 年 11 月 17 日任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 22 日至 2024 年 2 月 5 日任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 1 月 10 日至 2022 年 8 月 9 日任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 8 月 24 日至 2022 年 11 月 17 日任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日起任建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日起任建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 15 日起任建信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 12 月 23 日起任建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 3 月 25 日起任建信中证 A 股指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 6 月 3 日起任建信中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
叶乐天	公募基金	10	6,728,728,146.64	2012 年 3 月 21 日

私募资产管理计划	1	10,224,667.77	2025 年 2 月 12 日
其他组合	-	-	-
合计	11	6,738,952,814.41	-

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《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管理控制制度。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

本基金为指数增强型基金，基准指数为精工制造指数，其成分股主要由工业和通信业的股票构成。投资目标是在跟踪指数的同时，通过一定的投资策略获取超额收益，实现 Beta 收益与 Alpha 收益的叠加。报告期内，产品保持了较低的跟踪误差，获得了一定的超额收益。

在报告期内，管理人通过量化模型构建投资组合并进行风险管理。主要模型为多因子模型。

模型主要包括 Alpha 因子模型和风险模型。Alpha 模型部分，管理人充分利用现有各类数据，基于多种数学模型挖掘股票运行规律，构建出稳健的收益预测因子，同时基于行业指数的自身特点筛选最合适的因子，并进行加权合成最终信号，以识别出预期收益更高的股票，构建出多因子模型。管理人利用风险模型控制组合的风险指标、换手率、行业偏移、市场偏移等，保证组合较低的跟踪误差。

主模型外，管理人还利用深度学习策略、SmartBeta 策略、股指期货策略等卫星策略作为主模型的补充，以提高超额收益，增强超额稳定性。

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 5.17% 波动率 1.21% 业绩比较基准收益率-1.67% 波动率 1.15%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年精工制造指数整体呈现震荡行情，细分行业的表现差距较大。与 A 股市场呈现出的风格轮动、结构分化等特征一致。

红利风格在部分时段依然保持着一定的韧性，银行等高股息红利股稳步攀升，受到险资、社保等追求稳健收益的长线资金青睐，成为市场的“压舱石”。成长风格则在市场情绪以及产业政策的带动下，时而表现突出，时而陷入调整。

上半年市场出现多次显著波动。在某一阶段，受到宏观经济数据不及预期以及行业政策调整等因素影响，市场出现短期快速下跌。但随后在政策利好频出，如 5 月“一揽子货币政策”落地，新增结构性工具重点支持科技、消费等领域；新“国九条”强化分红监管等，以及资金入场的推动下迅速反弹。外部环境方面，中美关税联合声明虽暂缓贸易摩擦升级，但特朗普政策反复及持续的中东地缘冲突构成潜在风险，也加剧了市场的不确定性。不过，总体而言，国内政策积极发力托底经济、引导结构转型，在大盘下探时形成了有力支撑，使得 A 股市场展现出较强的韧性。

与宽基指数相比，精工指数有其自身的特点，行业相对集中，制造业占比相对较高，市值分布不均。我们会进一步针对精工指数筛选适合的选股因子和模型参数，争取获得更高的超额收益。

同时，我们会基于股指期货的基差和 Beta 等情况选择股指期货的投资品种和仓位，提高资金利用效率，争取获得更高的收益。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对建信精工制造指数增强型证券投资基金 2025 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

§ 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：建信精工制造指数增强型证券投资基金

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	7, 468, 570. 61	5, 176, 664. 61
结算备付金		937, 759. 66	995, 033. 71
存出保证金		655, 448. 28	165, 868. 75
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	45, 736, 303. 37	50, 196, 825. 37
其中：股票投资		45, 736, 303. 37	50, 196, 825. 37
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		879, 905. 41	—
应收股利		—	—
应收申购款		9, 338. 55	16, 238. 64
递延所得税资产		—	—
其他资产	6. 4. 7. 8	—	—
资产总计		55, 687, 325. 88	56, 550, 631. 08
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		-	233.08
应付赎回款		411,136.59	106,843.75
应付管理人报酬		44,271.89	48,336.87
应付托管费		8,854.37	9,667.38
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	350,336.04	511,289.15
负债合计		814,598.89	676,370.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	29,338,403.76	31,418,726.50
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	25,534,323.23	24,455,534.35
净资产合计		54,872,726.99	55,874,260.85
负债和净资产总计		55,687,325.88	56,550,631.08

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.8703 元 基金份额总额 29,338,403.76 份。

6.2 利润表

会计主体：建信精工制造指数增强型证券投资基金

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		3,103,815.89	912,889.24
1. 利息收入		6,321.82	10,272.38
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,321.82	10,272.38
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）		3,569,728.78	-1,184,828.43
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,892,187.88	-1,777,633.84
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	246, 630. 08	-97, 998. 50
股利收益	6. 4. 7. 19	430, 910. 82	690, 803. 91
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	-483, 865. 97	2, 074, 470. 63
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	11, 631. 26	12, 974. 66
减：二、营业总支出		414, 072. 03	469, 618. 94
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	266, 352. 64	257, 660. 89
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	53, 270. 48	51, 532. 21
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		1, 107. 67	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	93, 341. 24	160, 425. 84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2, 689, 743. 86	443, 270. 30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2, 689, 743. 86	443, 270. 30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2, 689, 743. 86	443, 270. 30

6.3 净资产变动表

会计主体：建信精工制造指数增强型证券投资基金

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	31, 418, 726. 50	-	24, 455, 534. 35	55, 874, 260. 85

资产				
加: 会计政策变更	—	—	—	—
前期差错更正	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
二、本期期初净资产	31,418,726.50	—	24,455,534.35	55,874,260.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,080,322.74	—	1,078,788.88	-1,001,533.86
(一)、综合收益总额	—	—	2,689,743.86	2,689,743.86
(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)	-2,080,322.74	—	-1,610,954.98	-3,691,277.72
其中: 1. 基金申购款	1,678,492.46	—	1,267,222.03	2,945,714.49
2. 基金赎回款	-3,758,815.20	—	-2,878,177.01	-6,636,992.21
(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	29,338,403.76	—	25,534,323.23	54,872,726.99
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	33,318,908.00	—	19,242,975.87	52,561,883.87
加: 会计政策变更	—	—	—	—
前期差错更正	—	—	—	—
其他	—	—	—	—

二、本期期初净资产	33,318,908.00	-	19,242,975.87	52,561,883.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-524,268.97	-	246,699.73	-277,569.24
(一)、综合收益总额	-	-	443,270.30	443,270.30
(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)	-524,268.97	-	-196,570.57	-720,839.54
其中：1. 基金申购款	3,028,673.46	-	1,772,227.75	4,800,901.21
2. 基金赎回款	-3,552,942.43	-	-1,968,798.32	-5,521,740.75
(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	32,794,639.03	-	19,489,675.60	52,284,314.63

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

建信精工制造指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]285 号《关于准予建信精工制造指数增强型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《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，

存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 241,071,727.57 元，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（2015）第 972 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 26 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 241,172,123.23 份基金份额，其中认购资金利息折合 100,395.66 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、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、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货以套期保值为目的，股指期货、权证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 90%×中证精工制造指数收益率+10%×商业银行活期存款利率（税前）。

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	7,468,570.61
等于： 本金	7,468,463.09
加： 应计利息	107.52
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	7,468,570.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	44,634,968.15	—	45,736,303.37	1,101,335.22
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	44,634,968.15	-	45,736,303.37	1,101,335.22

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,746,960.00	-	-	-
其中：股指期货投资	4,746,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,746,960.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	1.00	1,173,480.00	38,960.00
IM2507	IM2507	3.00	3,773,640.00	161,200.00
合计				200,160.00
减：可抵销期货暂收款				200,160.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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	327.98
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	301,409.56

其中：交易所市场	301,409.56
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	48,598.50
合计	350,336.04

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	31,418,726.50	31,418,726.50
本期申购	1,678,492.46	1,678,492.46
本期赎回(以“-”号填列)	-3,758,815.20	-3,758,815.20
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	29,338,403.76	29,338,403.76

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	29,438,562.23	-4,983,027.88	24,455,534.35
加：会计政策变更	—	—	—
前期差错更正	—	—	—
其他	—	—	—
本期期初	29,438,562.23	-4,983,027.88	24,455,534.35
本期利润	3,173,609.83	-483,865.97	2,689,743.86
本期基金份额交易产生的变动数	-2,040,144.87	429,189.89	-1,610,954.98
其中：基金申购款	1,634,726.84	-367,504.81	1,267,222.03
基金赎回款	-3,674,871.71	796,694.70	-2,878,177.01
本期已分配利润	—	—	—
本期末	30,572,027.19	-5,037,703.96	25,534,323.23

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	2,939.21
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	3,356.31
其他	26.30
合计	6,321.82

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	2,892,187.88
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	2,892,187.88

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	158,812,550.34
减： 卖出股票成本总额	155,761,809.24
减： 交易费用	158,553.22
买卖股票差价收入	2,892,187.88

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**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	246,630.08

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	430,910.82
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	430,910.82
----	------------

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	-683,985.97
股票投资	-683,985.97
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	200,120.00
权证投资	-
期货投资	200,120.00
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	-483,865.97

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	11,245.91
基金转换费收入	385.35
合计	11,631.26

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	8,926.92
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	853.50
指数使用费	43,889.24
合计	93,341.24

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

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	266,352.64	257,660.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	82,072.93	81,521.40
应支付基金管理人的净管理费	184,279.71	176,139.49

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/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	53,270.48	51,532.21

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2015年8月26日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	7,399,613.90	7,399,613.90
报告期内申购/买入总份额	—	—
报告期内因拆分变动份额	—	—
减：报告期内赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	7,399,613.90	7,399,613.90
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	25.22%	22.56%

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
中信银行-活期	7,468,570.61	2,939.21	5,298,933.96	4,413.12

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

无。

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	7,468,570.61	-	-	-	7,468,570.61
结算备付金	937,759.66	-	-	-	937,759.66
存出保证金	655,448.28	-	-	-	655,448.28
交易性金融资产	-	-	-	45,736,303.37	45,736,303.37
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	879,905.41	879,905.41
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	9,338.55	9,338.55
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,061,778.55	-	-	46,625,547.33	55,687,325.88
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	-	-	-	411,136.59	411,136.59
应付管理人报酬	-	-	-	44,271.89	44,271.89
应付托管费	-	-	-	8,854.37	8,854.37
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	-	-	-	350,336.04	350,336.04
负债总计	-	-	-	814,598.89	814,598.89
利率敏感度缺口	9,061,778.55	-	-	45,810,948.44	54,872,726.99

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	5,176,664.61	—	—	—	5,176,664.61
结算备付金	995,033.71	—	—	—	995,033.71
存出保证金	165,868.75	—	—	—	165,868.75
交易性金融资产	—	—	—	50,196,825.37	50,196,825.37
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	—	—	—	16,238.64	16,238.64
其他资产	—	—	—	—	—
资产总计	6,337,567.07	—	—	50,213,064.01	56,550,631.08
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	—	—	—	233.08	233.08
应付赎回款	—	—	—	106,843.75	106,843.75
应付管理人报酬	—	—	—	48,336.87	48,336.87
应付托管费	—	—	—	9,667.38	9,667.38
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	—	—	—	511,289.15	511,289.15
负债总计	—	—	—	676,370.23	676,370.23
利率敏感度缺口	6,337,567.07	—	—	49,536,693.78	55,874,260.85

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	45,736,303.37	83.35	50,196,825.37	89.84
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	45,736,303.37	83.35	50,196,825.37	89.84

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）
业绩比较基准上升 5%	业绩比较基准上升 5%	2,638,686.33	2,615,839.51
	业绩比较基准下降 5%	-2,638,686.33	-2,615,839.51

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	45,736,303.37	50,196,825.37
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	45,736,303.37	50,196,825.37

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	45,736,303.37	82.13
	其中：股票	45,736,303.37	82.13
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	8,406,330.27	15.10
8	其他各项资产	1,544,692.24	2.77
9	合计	55,687,325.88	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	21,047,094.30	38.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	2,873,028.00	5.24
F	批发和零售业	320,416.00	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	6,702,216.00	12.21
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	444,839.00	0.81
J	金融业	299,370.00	0.55
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	129,482.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	31,816,445.30	57.98

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	780,250.10	1.42
C	制造业	9,235,737.97	16.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	123,063.00	0.22
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	221,336.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	252,617.00	0.46
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,343,459.00	2.45
J	金融业	1,425,970.00	2.60
K	房地产业	129,519.00	0.24
L	租赁和商务服务业	138,992.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	161,436.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	78,750.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	28,728.00	0.05
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	13,919,858.07	25.37

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	300750	宁德时代	15,800	3,985,076.00	7.26
2	002352	顺丰控股	21,500	1,048,340.00	1.91
3	601186	中国铁建	128,500	1,029,285.00	1.88
4	600372	中航机载	82,200	991,332.00	1.81
5	601816	京沪高铁	168,100	966,575.00	1.76
6	300124	汇川技术	13,400	865,238.00	1.58
7	002595	豪迈科技	14,600	864,612.00	1.58
8	600018	上港集团	148,300	846,793.00	1.54
9	600004	白云机场	90,700	825,370.00	1.50
10	601766	中国中车	112,900	794,816.00	1.45
11	002625	光启技术	19,100	763,618.00	1.39
12	688387	信科移动	129,000	728,850.00	1.33
13	300502	新易盛	5,160	655,423.20	1.19
14	300274	阳光电源	9,660	654,658.20	1.19
15	000063	中兴通讯	19,300	627,057.00	1.14
16	600418	江淮汽车	13,600	545,224.00	0.99
17	601006	大秦铁路	80,900	533,940.00	0.97
18	601668	中国建筑	92,100	531,417.00	0.97
19	002129	TCL 中环	69,000	529,920.00	0.97
20	000738	航发控制	24,900	516,675.00	0.94
21	601012	隆基绿能	34,235	514,209.70	0.94
22	001965	招商公路	41,400	496,800.00	0.91
23	300308	中际旭创	3,240	472,586.40	0.86
24	001872	招商港口	23,200	460,752.00	0.84
25	002028	思源电气	6,300	459,333.00	0.84
26	601298	青岛港	46,300	402,347.00	0.73
27	600406	国电南瑞	17,500	392,175.00	0.71
28	600875	东方电气	21,300	356,562.00	0.65
29	300014	亿纬锂能	7,700	352,737.00	0.64
30	601919	中远海控	21,800	327,872.00	0.60
31	601989	中国重工	69,400	322,016.00	0.59
32	600704	物产中大	60,800	320,416.00	0.58
33	600517	国网英大	58,700	299,370.00	0.55
34	600760	中航沈飞	5,000	293,100.00	0.53
35	300001	特锐德	11,800	282,846.00	0.52
36	002202	金风科技	26,500	271,625.00	0.50
37	600893	航发动力	7,000	269,780.00	0.49
38	601117	中国化学	34,900	267,683.00	0.49
39	600862	中航高科	10,000	260,800.00	0.48

40	601615	明阳智能	22,400	257,376.00	0.47
41	000425	徐工机械	31,700	246,309.00	0.45
42	600031	三一重工	13,700	245,915.00	0.45
43	601669	中国电建	50,200	244,474.00	0.45
44	002025	航天电器	4,700	241,627.00	0.44
45	601390	中国中铁	41,300	231,693.00	0.42
46	601800	中国交建	26,000	231,140.00	0.42
47	601727	上海电气	30,800	227,612.00	0.41
48	688819	天能股份	7,600	210,976.00	0.38
49	600885	宏发股份	9,380	209,267.80	0.38
50	600438	通威股份	12,100	202,675.00	0.37
51	600377	宁沪高速	12,700	194,818.00	0.36
52	601618	中国中冶	63,700	189,826.00	0.35
53	600482	中国动力	8,000	184,560.00	0.34
54	300628	亿联网络	5,200	180,752.00	0.33
55	600522	中天科技	12,500	180,750.00	0.33
56	002056	横店东磁	12,600	178,290.00	0.32
57	300207	欣旺达	8,500	170,510.00	0.31
58	601598	中国外运	34,100	168,113.00	0.31
59	000429	粤高速 A	12,300	163,959.00	0.30
60	688009	中国通号	29,400	151,116.00	0.28
61	600039	四川路桥	14,900	147,510.00	0.27
62	300140	节能环保	23,600	145,612.00	0.27
63	300627	华测导航	4,000	140,000.00	0.26
64	601100	恒立液压	1,900	136,800.00	0.25
65	000338	潍柴动力	8,700	133,806.00	0.24
66	000800	一汽解放	19,000	130,340.00	0.24
67	600312	平高电气	8,400	129,276.00	0.24
68	600582	天地科技	20,700	123,993.00	0.23
69	601717	郑煤机	6,700	111,354.00	0.20
70	603298	杭叉集团	5,300	111,035.00	0.20
71	603659	璞泰来	5,400	101,412.00	0.18
72	000157	中联重科	13,500	97,605.00	0.18
73	000951	中国重汽	5,500	96,690.00	0.18
74	600166	福田汽车	30,200	81,842.00	0.15
75	600350	山东高速	7,400	78,884.00	0.14
76	600029	南方航空	13,000	76,700.00	0.14
77	600765	中航重机	4,200	70,896.00	0.13
78	600415	小商品城	3,400	70,312.00	0.13
79	688472	阿特斯	7,200	65,880.00	0.12
80	603885	吉祥航空	4,600	61,962.00	0.11
81	000785	居然智家	19,400	59,170.00	0.11
82	688188	柏楚电子	400	52,664.00	0.10

83	600487	亨通光电	2,900	44,370.00	0.08
84	600233	圆通速递	3,400	43,826.00	0.08
85	300763	锦浪科技	700	40,173.00	0.07
86	002179	中航光电	500	20,180.00	0.04
87	600026	中远海能	500	5,165.00	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	688636	智明达	10,384	350,875.36	0.64
2	000001	平安银行	25,900	312,613.00	0.57
3	301119	正强股份	6,400	226,304.00	0.41
4	688588	凌志软件	15,400	224,378.00	0.41
5	601005	重庆钢铁	167,400	212,598.00	0.39
6	603969	银龙股份	28,800	211,104.00	0.38
7	688597	煜邦电力	23,240	181,969.20	0.33
8	688255	凯尔达	5,000	168,450.00	0.31
9	601898	中煤能源	14,900	163,006.00	0.30
10	300241	瑞丰光电	28,400	161,880.00	0.30
11	688168	安博通	2,200	155,914.00	0.28
12	301045	天禄科技	6,700	153,430.00	0.28
13	301031	中熔电气	1,924	153,246.60	0.28
14	300371	汇中股份	13,100	151,960.00	0.28
15	603893	瑞芯微	1,000	151,860.00	0.28
16	600883	博闻科技	19,000	149,150.00	0.27
17	002516	旷达科技	28,600	147,290.00	0.27
18	603040	新坐标	3,600	144,612.00	0.26
19	600662	外服控股	27,200	138,992.00	0.25
20	000893	亚钾国际	4,600	138,644.00	0.25
21	300923	研奥股份	5,500	136,950.00	0.25
22	002394	联发股份	16,100	132,503.00	0.24
23	688058	宝兰德	4,600	131,882.00	0.24
24	601518	吉林高速	48,000	131,520.00	0.24
25	603278	大业股份	14,200	129,220.00	0.24
26	603877	太平鸟	8,800	127,600.00	0.23
27	600528	中铁工业	16,900	124,722.00	0.23
28	600897	厦门空港	8,300	121,097.00	0.22
29	688395	正弦电气	5,307	120,362.76	0.22
30	688256	寒武纪	200	120,300.00	0.22
31	300320	海达股份	12,000	119,280.00	0.22
32	688195	腾景科技	2,600	117,000.00	0.21
33	688118	普元信息	5,200	116,220.00	0.21
34	603010	万盛股份	11,400	113,316.00	0.21
35	605086	龙高股份	4,200	111,804.00	0.20

36	002275	桂林三金	7,700	110,187.00	0.20
37	688432	有研硅	9,800	108,192.00	0.20
38	001336	楚环科技	4,900	104,223.00	0.19
39	301276	嘉曼服饰	5,700	103,683.00	0.19
40	300567	精测电子	1,700	103,037.00	0.19
41	688260	昀冢科技	6,200	102,176.00	0.19
42	001339	智微智能	2,100	101,493.00	0.18
43	000066	中国长城	6,700	99,160.00	0.18
44	001287	中电港	5,400	98,874.00	0.18
45	301163	宏德股份	3,900	97,500.00	0.18
46	002396	星网锐捷	4,300	96,535.00	0.18
47	603558	健盛集团	10,400	94,744.00	0.17
48	003012	东鹏控股	16,400	93,808.00	0.17
49	301278	快可电子	2,800	93,324.00	0.17
50	000404	长虹华意	13,100	93,010.00	0.17
51	001283	豪鹏科技	1,700	92,565.00	0.17
52	600596	新安股份	11,400	92,340.00	0.17
53	301503	智迪科技	2,400	91,320.00	0.17
54	603053	成都燃气	9,500	91,295.00	0.17
55	688283	坤恒顺维	3,297	90,502.65	0.16
56	002833	弘亚数控	5,500	89,980.00	0.16
57	002765	蓝黛科技	6,700	89,713.00	0.16
58	688238	和元生物	14,400	89,280.00	0.16
59	002606	大连电瓷	9,900	88,308.00	0.16
60	000983	山西焦煤	13,600	87,040.00	0.16
61	301181	标榜股份	3,500	86,730.00	0.16
62	000823	超声电子	7,300	86,505.00	0.16
63	300879	大叶股份	2,200	86,416.00	0.16
64	300369	绿盟科技	11,100	86,247.00	0.16
65	603987	康德莱	11,200	86,240.00	0.16
66	000011	深物业 A	10,200	86,190.00	0.16
67	301528	多浦乐	1,600	86,112.00	0.16
68	301232	飞沃科技	2,800	86,044.00	0.16
69	601699	潞安环能	8,100	85,455.00	0.16
70	688458	美芯晟	1,800	84,888.00	0.15
71	301157	华塑科技	1,800	84,852.00	0.15
72	603698	航天工程	4,800	84,576.00	0.15
73	300112	万讯自控	9,300	84,165.00	0.15
74	300445	康斯特	4,900	83,545.00	0.15
75	688358	祥生医疗	2,800	83,020.00	0.15
76	603408	建霖家居	7,500	82,275.00	0.15
77	002957	科瑞技术	5,000	82,200.00	0.15
78	600833	第一医药	6,400	81,280.00	0.15

79	300897	山科智能	3,800	79,800.00	0.15
80	603270	金帝股份	3,100	79,639.00	0.15
81	001332	锡装股份	2,200	78,848.00	0.14
82	300774	倍杰特	9,000	78,750.00	0.14
83	002942	新农股份	4,500	78,210.00	0.14
84	301090	华润材料	10,300	77,559.00	0.14
85	600469	风神股份	13,700	77,405.00	0.14
86	605222	起帆电缆	5,100	77,214.00	0.14
87	601088	中国神华	1,900	77,026.00	0.14
88	688657	浩辰软件	1,800	76,446.00	0.14
89	603073	彩蝶实业	4,500	75,825.00	0.14
90	600527	江南高纤	36,600	75,762.00	0.14
91	688602	康鹏科技	9,000	75,420.00	0.14
92	601225	陕西煤业	3,900	75,036.00	0.14
93	688450	光格科技	2,800	73,976.00	0.13
94	688334	西高院	4,200	72,156.00	0.13
95	600028	中国石化	12,600	71,064.00	0.13
96	601328	交通银行	8,800	70,400.00	0.13
97	600919	江苏银行	5,700	68,058.00	0.12
98	000651	格力电器	1,500	67,380.00	0.12
99	688685	迈信林	1,200	67,020.00	0.12
100	688429	时创能源	4,600	66,884.00	0.12
101	601988	中国银行	11,800	66,316.00	0.12
102	600550	保变电气	7,500	64,500.00	0.12
103	601169	北京银行	9,400	64,202.00	0.12
104	600188	兖矿能源	5,230	63,649.10	0.12
105	301133	金钟股份	2,800	63,504.00	0.12
106	600015	华夏银行	8,000	63,280.00	0.12
107	605259	绿田机械	3,200	62,752.00	0.11
108	601398	工商银行	8,200	62,238.00	0.11
109	601288	农业银行	10,500	61,740.00	0.11
110	601229	上海银行	5,800	61,538.00	0.11
111	688229	博睿数据	1,200	61,140.00	0.11
112	300170	汉得信息	3,500	60,235.00	0.11
113	688512	慧智微	5,400	58,914.00	0.11
114	000682	东方电子	5,700	58,368.00	0.11
115	600016	民生银行	12,100	57,475.00	0.10
116	601818	光大银行	13,800	57,270.00	0.10
117	600000	浦发银行	4,100	56,908.00	0.10
118	688286	敏芯股份	800	56,552.00	0.10
119	601166	兴业银行	2,400	56,016.00	0.10
120	601838	成都银行	2,700	54,270.00	0.10
121	601009	南京银行	4,400	51,128.00	0.09

122	600036	招商银行	1, 100	50, 545. 00	0. 09
123	603009	北特科技	1, 200	50, 040. 00	0. 09
124	601318	中国平安	900	49, 932. 00	0. 09
125	301248	杰创智能	2, 000	49, 760. 00	0. 09
126	002601	龙佰集团	3, 000	48, 630. 00	0. 09
127	002322	理工能科	4, 000	48, 400. 00	0. 09
128	600019	宝钢股份	7, 300	48, 107. 00	0. 09
129	300432	富临精工	3, 640	47, 574. 80	0. 09
130	601857	中国石油	5, 400	46, 170. 00	0. 08
131	605376	博迁新材	1, 200	45, 996. 00	0. 08
132	603926	铁流股份	4, 000	45, 440. 00	0. 08
133	601658	邮储银行	8, 200	44, 854. 00	0. 08
134	000895	双汇发展	1, 800	43, 938. 00	0. 08
135	002999	天禾股份	5, 900	41, 182. 00	0. 08
136	600741	华域汽车	2, 200	38, 830. 00	0. 07
137	600585	海螺水泥	1, 800	38, 646. 00	0. 07
138	300134	大富科技	3, 100	37, 913. 00	0. 07
139	601601	中国太保	1, 000	37, 510. 00	0. 07
140	603699	纽威股份	1, 200	37, 404. 00	0. 07
141	000333	美的集团	516	37, 255. 20	0. 07
142	000708	中信特钢	3, 000	35, 280. 00	0. 06
143	601728	中国电信	4, 500	34, 875. 00	0. 06
144	601211	国泰海通	1, 800	34, 488. 00	0. 06
145	600941	中国移动	300	33, 765. 00	0. 06
146	688182	灿勤科技	1, 200	33, 072. 00	0. 06
147	600048	保利发展	4, 000	32, 400. 00	0. 06
148	002736	国信证券	2, 800	32, 256. 00	0. 06
149	000537	中绿电	3, 800	31, 768. 00	0. 06
150	688171	纬德信息	1, 000	30, 760. 00	0. 06
151	688071	华依科技	800	29, 160. 00	0. 05
152	002659	凯文教育	5, 700	28, 728. 00	0. 05
153	300168	万达信息	3, 700	28, 379. 00	0. 05
154	605080	浙江自然	1, 000	27, 800. 00	0. 05
155	300489	光智科技	600	26, 496. 00	0. 05
156	688369	致远互联	1, 000	26, 390. 00	0. 05
157	002364	中恒电气	1, 700	26, 078. 00	0. 05
158	002847	盐津铺子	300	24, 120. 00	0. 04
159	002706	良信股份	2, 700	24, 057. 00	0. 04
160	300329	海伦钢琴	2, 200	16, 676. 00	0. 03
161	688070	纵横股份	200	9, 660. 00	0. 02
162	688496	清越科技	1, 000	9, 300. 00	0. 02
163	688720	艾森股份	200	8, 558. 00	0. 02
164	301367	瑞迈特	100	8, 410. 00	0. 02

165	000728	国元证券	1,000	7,890.00	0.01
166	600159	大龙地产	2,800	7,700.00	0.01
167	002461	珠江啤酒	600	6,774.00	0.01
168	601968	宝钢包装	1,300	6,201.00	0.01
169	603912	佳力图	588	5,115.60	0.01
170	000776	广发证券	300	5,043.00	0.01
171	688603	天承科技	114	5,038.80	0.01
172	603855	华荣股份	200	4,426.00	0.01
173	600887	伊利股份	100	2,788.00	0.01
174	600173	卧龙新能	400	2,352.00	0.00
175	688609	九联科技	200	2,094.00	0.00
176	001979	招商蛇口	100	877.00	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	300750	宁德时代	1,465,101.00	2.62
2	600004	白云机场	1,032,527.00	1.85
3	002352	顺丰控股	963,450.00	1.72
4	603486	科沃斯	956,406.00	1.71
5	600499	科达制造	888,314.00	1.59
6	601816	京沪高铁	879,995.00	1.57
7	300059	东方财富	871,136.00	1.56
8	300251	光线传媒	767,439.00	1.37
9	002595	豪迈科技	726,830.00	1.30
10	000039	中集集团	706,569.00	1.26
11	688387	信科移动	704,383.78	1.26
12	600704	物产中大	700,102.00	1.25
13	000063	中兴通讯	661,333.00	1.18
14	000906	浙商中拓	649,932.00	1.16
15	601005	重庆钢铁	643,886.00	1.15
16	601186	中国铁建	625,681.00	1.12
17	600372	中航机载	613,253.00	1.10
18	002129	TCL 中环	583,505.00	1.04
19	601006	大秦铁路	574,106.00	1.03
20	001965	招商公路	570,274.00	1.02

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	300750	宁德时代	2,107,847.00	3.77
2	603486	科沃斯	1,261,383.00	2.26
3	300059	东方财富	1,180,959.00	2.11
4	600499	科达制造	1,060,383.00	1.90
5	601668	中国建筑	938,833.00	1.68
6	601919	中远海控	825,877.00	1.48
7	000039	中集集团	818,833.00	1.47
8	601877	正泰电器	797,414.00	1.43
9	300251	光线传媒	739,306.00	1.32
10	000526	学大教育	700,973.00	1.25
11	000906	浙商中拓	658,534.00	1.18
12	605098	行动教育	648,769.00	1.16
13	600153	建发股份	638,051.00	1.14
14	688252	天德钰	602,408.03	1.08
15	002984	森麒麟	601,409.00	1.08
16	688223	晶科能源	594,730.42	1.06
17	300502	新易盛	579,361.00	1.04
18	003016	欣贺股份	575,056.00	1.03
19	600704	物产中大	569,244.00	1.02
20	688233	神工股份	560,969.20	1.00

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	151,985,273.21
卖出股票收入（成交）总额	158,812,550.34

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位交易频率，降低交易成本，提高资金使用效率，降低跟踪误差，同时利用基差进行增强，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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	655,448.28
2	应收清算款	879,905.41
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	9,338.55
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,544,692.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
13,193	2,223.79	7,399,613.90	25.22	21,938,789.86	74.78

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	7,708.04	0.03

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015 年 8 月 26 日) 基金份额总额	241,172,123.23
本报告期期初基金份额总额	31,418,726.50
本报告期基金总申购份额	1,678,492.46
减：本报告期基金总赎回份额	3,758,815.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	29,338,403.76

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未受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	2	152,575,123.19	49.09	28,361.08	47.90	-
浙商证券	1	103,357,172.61	33.26	20,249.24	34.20	-

民生证券	1	33,362,538.20	10.73	6,536.53	11.04	-
广发证券	2	21,502,989.55	6.92	4,060.50	6.86	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
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、本基金本报告期内新增浙商证券 1 个交易单元，剔除方正证券 1 个交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
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
2	关于新增国泰君安证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 3 月 26 日
3	关于建信基金管理有限责任公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 3 月 19 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 (%)
机构	1	2025 年 01 月 01 日-2025 年 06 月 30 日	7,399,613 .90	-	-	7,399,613.90	25.22
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信精工制造指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信精工制造指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信精工制造指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2025 年 8 月 29 日