

# 建信丰融债券型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 2 月 27 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
4.9 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 .....	17
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	18
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	18
6.2 审计报告的基本内容 .....	18
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表 .....	20
7.2 利润表 .....	21
7.3 净资产变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	24

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	52
8.3 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 .....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	65
8.6 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 .....	66
8.7 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 .....	66
8.8 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 .....	66
8.9 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 .....	66
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	66
8.11 本报告期投资基金情况 .....	66
8.12 投资组合报告附注 .....	67
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
9.3 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 .....	68
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	68
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>68</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>69</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
11.2 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 .....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	69
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
11.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	70
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
11.9 其他重大事件 .....	72
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>73</b>
12.1 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 .....	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	73
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>73</b>
13.1 备查文件目录 .....	73
13.2 存放地点 .....	73
13.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信丰融债券型证券投资基金	
基金简称	建信丰融债券	
基金主代码	022657	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 2 月 27 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	286,451,660.60 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信丰融债券 A	建信丰融债券 C
下属分级基金的交易代码	022657	022658
报告期末下属分级基金的份额总额	197,201,114.94 份	89,250,545.66 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合，形成对大类资产的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定债券类资产、权益类资产、现金类资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，以规避市场风险，提高基金收益率。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+恒生指数收益率（经汇率调整）*2%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金的基金资产如投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	中国农业银行股份有限公司
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	95599
传真	010-66228001	010-68121816
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝	北京市东城区建国门内大街 69

	国际金融中心 16 层	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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	生柳荣	谷澍

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2025 年 2 月 27 日(基金合同生效日)-2025 年 12 月 31 日	
	建信丰融债券 A	建信丰融债券 C
本期已实现收益	20,664,311.16	9,367,308.61
本期利润	21,041,731.77	9,543,875.25
加权平均基金份额本期利润	0.0237	0.0161
本期加权平均净值利润率	2.35%	1.60%
本期基金份额净值增长率	3.09%	2.74%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
期末可供分配利润	6,093,718.39	2,449,742.58
期末可供分配基金份额利润	0.0309	0.0274
期末基金资产净值	203,294,833.33	91,700,288.24
期末基金份额净值	1.0309	1.0274
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
基金份额累计净值增长率	3.09%	2.74%

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。

4、本基金基金合同于 2025 年 2 月 27 日生效，截至报告期末未满一年。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信丰融债券 A

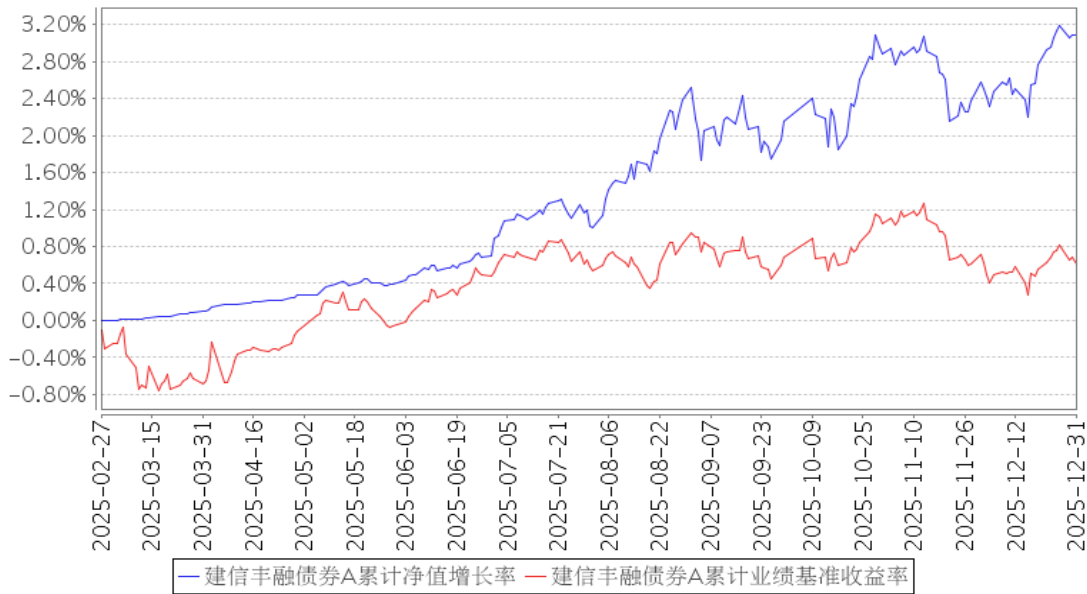
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.91%	0.16%	-0.07%	0.10%	0.98%	0.06%
过去六个月	2.37%	0.15%	0.14%	0.09%	2.23%	0.06%
自基金合同生效起至今	3.09%	0.12%	0.62%	0.10%	2.47%	0.02%

建信丰融债券 C

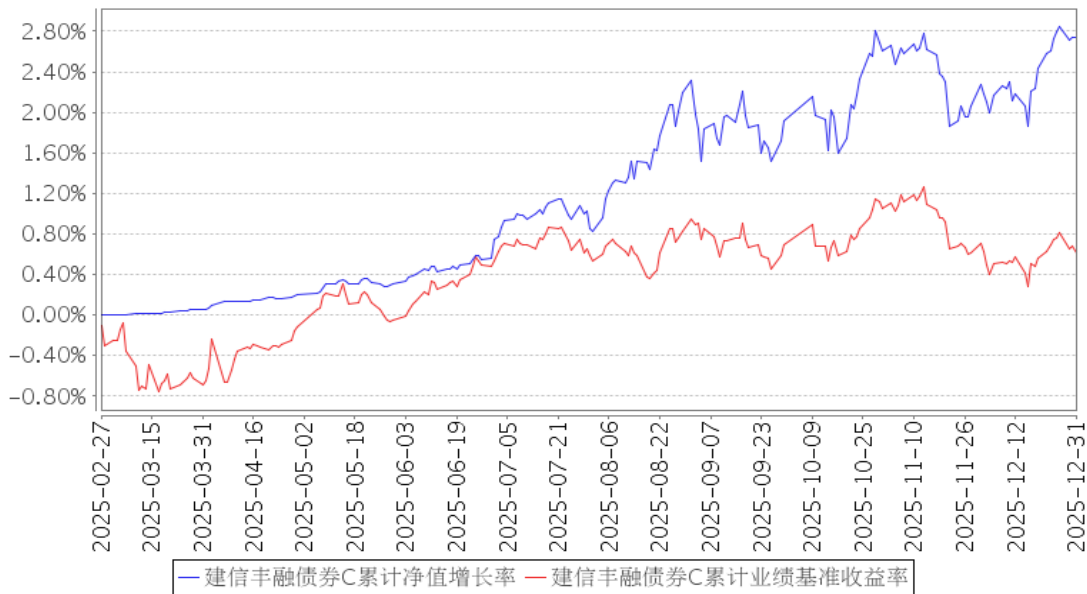
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.80%	0.16%	-0.07%	0.10%	0.87%	0.06%
过去六个月	2.17%	0.15%	0.14%	0.09%	2.03%	0.06%
自基金合同生效起至今	2.74%	0.12%	0.62%	0.10%	2.12%	0.02%

### 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

建信丰融债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



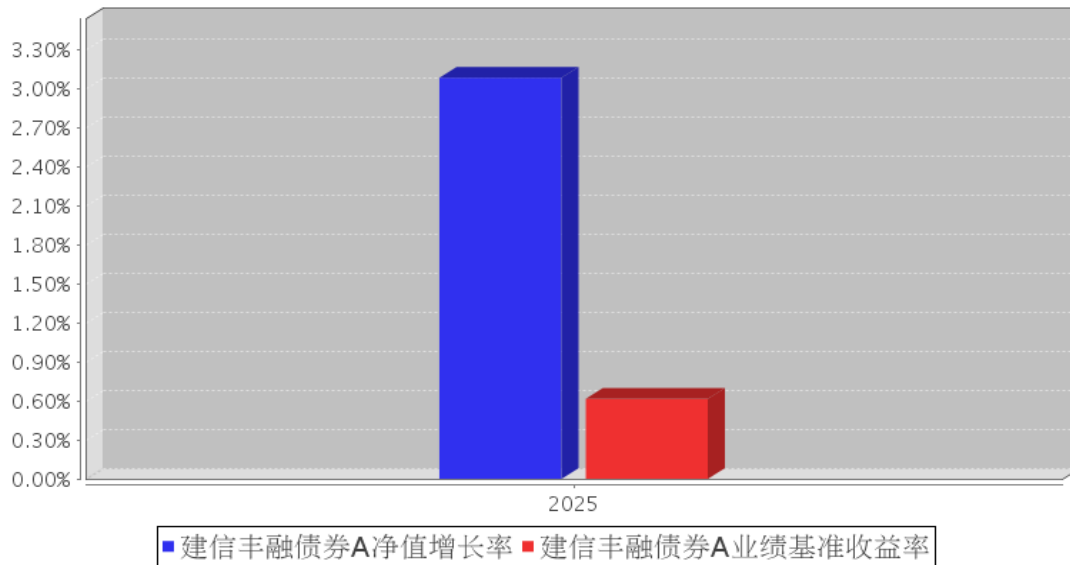
建信丰融债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



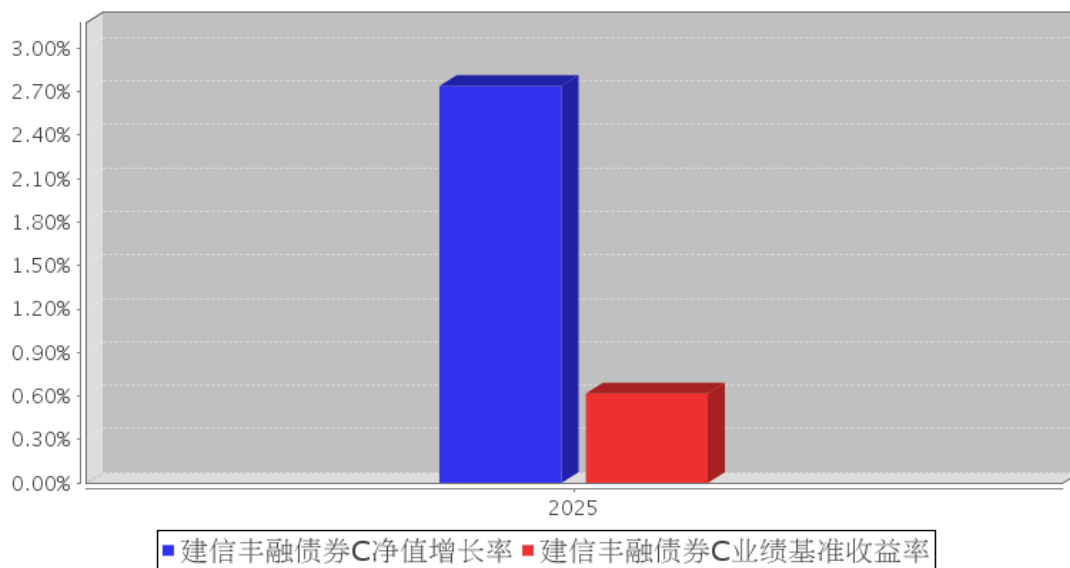
注：本基金基金合同于 2025 年 2 月 27 日生效，截至报告期末建仓结束未满一年。本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信丰融债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



建信丰融债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同自2025年2月27日起生效，自合同生效以来，本基金未实施利润分配。

## § 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 1.05 亿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 12 月 31 日，公司管理运作 186 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 1.29 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		
李峰	本基金的基金经理	2025 年 2 月 27 日	-	18	李峰先生，硕士。2007 年 5 月至 2012 年 9 月任华夏基金管理公司基金会计业务经理、风控高级经理，2012 年 9 月至 2015 年 6 月任建信基金管理公司交易员、交易主管，2015 年 7 月至 2016 年 6 月任银华基金管理公司询价研究主管。2016 年 6 月至今任建信基金管理公司基金经理助理、基金经理。2017 年 5 月 15 日起任建信信用增强债券型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 15 日起任建信稳定鑫利债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 2 日至 2020 年 3 月 17 日任建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2018 年 3 月 14 日起任建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 3 月 8 日起任建信短债纯债债券型证券投资基金的基金经

					理；2019 年 8 月 6 日至 2023 年 2 月 20 日任建信转债增强债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月 23 日至 2022 年 1 月 20 日任建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月 31 日起任建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2020 年 12 月 16 日起任建信利率债策略纯债债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 2 月 20 日起任建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 2 月 27 日起任建信丰融债券型证券投资基金的基金经理。
薛玲	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2025 年 2 月 27 日	-	12	薛玲女士，数量投资部副总经理，博士。2009 年 5 月至 2010 年 1 月任中国电力科学研究院农电与配电研究所工程师、2010 年 1 月至 2013 年 4 月任路孚特（中国）科技有限公司高级软件工程师、2013 年 4 月至 2015 年 9 月任中国中金财富证券有限公司研究员、投资经理，2015 年 9 月加入我公司，历任金融工程及指数投资部基金经理助理、基金经理、部门总经理助理、部门副总经理等职务。2016 年 7 月 4 日至 2025 年 11 月 17 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；2016 年 7 月 4 日至 2025 年 11 月 17 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；2017 年 5 月 27 日至 2018 年 4 月 25 日任建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 9 月 13 日至 2023 年 8 月 29 日任建信量化事件驱动股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 9 月 28 日起任建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2017 年 9 月 28 日起任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 20 日起任建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 22 日起任建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 3 月 5 日至 2021 年 5 月 31 日任建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 10 月 25 日起任建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联

					接基金的基金经理；2018年12月13日至2021年8月9日任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020年12月15日至2021年12月14日任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理；2022年9月21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；2023年1月5日至2024年1月29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；2024年1月29日起任建信沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理；2024年6月27日起任建信双债增强债券型证券投资基金的基金经理；2024年7月16日起任建信红利精选股票型发起式证券投资基金的基金经理；2025年2月27日起任建信丰融债券型证券投资基金的基金经理；2025年10月31日起任建信丰泽债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

#### 4.3.3 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

2025 年全年，受全球地缘政治波动加剧的冲击，国内政策的节奏以及预期的博弈对宏观经济走势的影响较为显著。上半年在经济“开门红”以及“抢出口”的影响下，经济增速高于全年既定目标。进入下半年，随着中美关税谈判的超预期以及政策方向转为结构调整，经济增长的动能有所下降，全年 GDP 增速录得 5% 的同比涨幅。投资方面，2025 年全国固定资产投资同比增速为 -3.8%，比上半年回落 6.6 个百分点。年内地产销售高开低走，二季度后地产投资维持负增长且跌幅持续走扩，全年增速 -17.2%，对于经济增长的拖累较为显著；基建投资层面，随着下半年稳增长诉求的下降而有所下滑，全年增速仅为 -2.2%；制造业投资层面，受到全球贸易摩擦的不确定性以及国内需求偏弱的拖累，全年累计增速仅为 0.6%，比上半年增速下滑 6.9 个百分点。消费方面，受到 2024 年下半年消费补贴政策带来的高基数效应影响，2025 年全年社会消费品零售总额同比增长 3.7%，增速相比于上半年增速回落 1.3 个百分点。进出口方面，2025 年全年进出口总额同比增长 3.2%，增速较上半年回升 1.5 个百分点。其中二季度中美直接贸易额波动较大，从季度初的“抢出口”到 5 月达成贸易协定后的大幅下降，受关税事件的冲击较为显著。进入四季度后，随着中美关系的缓和以及海外需求的回暖，出口表现再度好转。整体看，地缘政治的博弈对于国内政策、经济走势的影响较为显著。上半年经济增长的强劲以及对于未来不确定性的担忧，带来政策在下半年转向“反内卷”为代表的产业结构调整与资源的优化，以及对于经济高质量增长的诉求。

通胀方面，2025 年物价水平整体偏弱。年内消费者价格指数（CPI）先下后上，全年维持在

0-0.5%区间波动。食品项方面，年内猪肉价格虽有阶段性反弹，但总体依然维持下行趋势；非食品项方面，原油价格因地缘冲突影响的弱化以及 OPEC+增产等原因呈现中枢的下行，核心 CPI 表现出一定韧性但也回升有限。工业生产者出厂价格指数（PPI）层面，虽然全年同比下降 2.6%，但受到“反内卷”政策的带动，下半年 PPI 相比上半年回升 0.2 个百分点。年初大宗商品供需失衡且与价格下行预期形成负循环，叠加后续关税冲击，价格较为低迷。三季度后随着“反内卷”政策的出台，虽然商品价格在快速上涨后显著分化，但价格的负循环预期有所扭转，大宗价格整体企稳。进入四季度后，受益于美元走弱以及 AI 需求拉动，有色金属价格出现快速上涨，带动 PPI 整体回暖。

货币政策方面，年内人民银行整体维持稳健偏宽松的货币政策。除了一季度因减少公开市场投放，叠加商业银行融出不足导致资金利率中枢显著抬升外。在 4 月关税冲击后资金面开始转松，此后资金利率一直维持低位波动的特征。总量政策方面，央行在 5 月调降公开市场逆回购利率 10bp，以及 1 年期、5 年期 LPR 利率 10bp，并进行了一次 50BP 的降准操作，维持了社会融资成本的低位运行。汇率方面，受美国大幅降息以及国内权益市场强于美股带来资本流入等影响，全年人民币兑美元汇率显著升值。具体来看，即期汇率从年初的 7.2988 升值到年末的 6.9890，升值幅度为 4.24%。

受此影响，全年债券收益率先下后上。年初因较强的降息预期，推动债券收益率持续下行创历史新低。随着资金面超预期收紧，带来一季度债券市场的调整。二季度初，受关税事件冲击，债市收益率快速下行后转为震荡回升。三季度“反内卷”政策提升市场风险偏好，权益市场的上涨引发债市资金流出以及债券收益率的上行，随后受基金销售新规的冲击，收益率再度上行。直至四季度央行恢复购买国债，债市情绪在 10 月小幅修复，随后在机构的预期博弈中维持震荡格局。整体看，2025 年末 10 年国开债收益率相比于 2024 年末上行 27BP 到 2.00%，而 1 年期国开债则上行 35BP，利率债期限利差利小幅收窄。但三季度以来受机构赎回债基的影响，中长期信用债因流动性较弱，信用利差的走阔较为显著。2025 年 A 股整体呈“科技驱动、结构分化”特征，上证指数时隔十年重返 4000 点，AI、机器人、新能源等硬科技领涨，电子信息产业市值首超银行，杠杆资金加速布局科技赛道。2026 年料延续“慢牛”，上市公司盈利修复成核心动力。预计科技（AI、算力、商业航天）仍为主线，消费复苏、高股息资产处于配置窗口。

回顾全年的基金管理工作，组合延续了中短久期信用债的票息策略，精选个券、积极操作。面对年内波动加剧的债券市场，债券组合维持偏灵活的操作思路。一季度降低杠杆水平以应对资金面的波动，进入二季度提升杠杆、久期参与突发事件下的交易行情。下半年在债市调整过程中再度降低组合的久期与杠杆以控制回撤，但由于三季度遭遇规模较大的赎回，在收益率震荡上行

过程中出现一定的净值波动。四季度后整体维持中性的杠杆水平并调整组合结构，在全年债券收益率的震荡过程中获取了一定的投资回报。股票组合方面，判断 3 月底资金面紧张，市场可能会出现调整，基金一直保持空仓状态，6 月底之后在市场行情的配合下，逐渐开始建仓，前期以红利风格为主，积累安全垫，后期适度配置成长风格追上市场涨幅。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 3.09%，波动率 0.12%，业绩比较基准收益率 0.62%，波动率 0.10%。本报告期本基金 C 净值增长率 2.74%，波动率 0.12%，业绩比较基准收益率 0.62%，波动率 0.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，在地缘摩擦升温的全球背景下，不论贸易维度亦或热战维度出现超预期事件的概率均在提升，这些不确定性将对各国政策以及资产价格产生较大的影响。海外方面，中东地缘冲突的走势以及美联储降息的节奏，将成为全球大宗商品价格以及风险偏好的重要影响因素。国内方面，政策的方向仍将以科技突破为核心，维持中国制造业在全球的领先地位。在产业升级、经济转型的大背景下，保持经济合理且高质量的增长。预计“反内卷”政策将持续推进，并有效改善工业产出的价格以及下游制造业企业的盈利。而适时推出的地产与消费刺激政策，将提振居民投资与消费意愿，成为经济转型格局下，对冲外部不确定性的重要抓手。在此背景下，经济的温和增长或维持货币政策的适度宽松，降准、降息等总量政策依然可以预期。因此，我们对 2026 债券市场持谨慎乐观态度。组合管理方面，在继续控制信用风险的前提下积极操作，择机调整组合久期与杠杆水平，密切跟踪宏微观数据边际变化带来的投资机会，并关注因风险事件、监管政策变化引发收益率波动所带来的交易性机会。股票市场方面，今年政策“反内卷”与“十五五”深化，叠加全球流动性宽松，或推动业绩驱动转型，多主线轮动可期。

本基金 2026 年将在严控各类风险的前提下，坚持风险适度原则，采取相对稳健与均衡的投资策略，精选个券，力求为持有人获得稳定的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2025 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司风险与合规管理部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总裁和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施：

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备定期监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由内控合规部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司年度监察稽核工作计划，实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发违法违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的原则，秉持“创新、诚信、专业、稳健、

共赢”的核心价值观，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—建信基金管理有限责任公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事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本基金的投资运作、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 托管人对本年度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的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2604104 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信丰融债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的建信丰融债券型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号—财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>

强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人建信基金管理有限责任公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持</p>

	<p>续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	龚凯	谢浩然
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2026 年 3 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：建信丰融债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	1,080,891.67
结算备付金		289,464.97
存出保证金		113,023.08
交易性金融资产	7.4.7.2	379,528,439.52
其中：股票投资		57,791,405.95
基金投资		-
债券投资		321,737,033.57
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-

应收清算款		2,585,581.72
应收股利		3,234.24
应收申购款		27,146.10
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		383,627,781.30
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年12月31日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		73,315,328.21
应付清算款		-
应付赎回款		14,789,470.57
应付管理人报酬		165,145.03
应付托管费		41,286.24
应付销售服务费		34,830.28
应付投资顾问费		-
应交税费		5,263.84
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	281,335.56
负债合计		88,632,659.73
<b>净资产:</b>		
实收基金	7.4.7.10	286,451,660.60
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	8,543,460.97
净资产合计		294,995,121.57
负债和净资产总计		383,627,781.30

注：本基金合同生效日为 2025 年 02 月 27 日，本报告期自基金合同生效日 2025 年 02 月 27 日起至 2025 年 12 月 31 日止。报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 286,451,660.60 份，其中建信丰融债券 A 基金份额总额 197,201,114.94 份，基金份额净值人民币 1.0309 元；建信丰融债券 C 基金份额总额 89,250,545.66 份，基金份额净值人民币 1.0274 元。

## 7.2 利润表

会计主体：建信丰融债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年2月27日（基金合同
----	-----	-----------------------

		生效日) 至 2025 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		42,665,542.57
1. 利息收入		8,715,236.20
其中：存款利息收入	7.4.7.13	410,207.22
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		8,305,028.98
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		33,149,158.32
其中：股票投资收益	7.4.7.14	16,262,656.97
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	13,981,439.33
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	2,905,062.02
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）	7.4.7.20	553,987.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	247,160.80
<b>减：二、营业总支出</b>		12,079,935.55
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,468,543.91
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,867,136.03
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,977,226.29
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		692,478.66
其中：卖出回购金融资产支出		692,478.66
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		18,503.58
8. 其他费用	7.4.7.23	56,047.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		30,585,607.02
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		30,585,607.02
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		30,585,607.02

### 7.3 净资产变动表

会计主体：建信丰融债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,132,091,235.00	-	-	4,132,091,235.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,845,639,574.40	-	8,543,460.97	-3,837,096,113.43
（一）、综合收益总额	-	-	30,585,607.02	30,585,607.02
（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）	-3,845,639,574.40	-	-22,042,146.05	-3,867,681,720.45
其中：1. 基金申购款	564,671,772.81	-	2,547,550.96	567,219,323.77
2. 基金赎回款	-4,410,311,347.21	-	-24,589,697.01	-4,434,901,044.22
（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	286,451,660.60	-	8,543,460.97	294,995,121.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

谢海玉

基金管理人负责人

莫红

主管会计工作负责人

丁颖

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

建信丰融债券型证券投资基金（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[2024]1544号《关于准予建信丰融债券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《建信丰融债券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人民币4,130,943,013.69元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第70071792\_A05号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信丰融债券型证券投资基金基金合同》于2025年2月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,132,091,235.00份基金份额，其中认购资金利息折合1,148,221.31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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用的，称为C类基金份额。由于基金费用的不同，本基金A类和C类基金份额将分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信丰融债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（仅包括全市场的股票型ETF及本基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金，不包括QDII基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资基金的基金、货币市场基金、非本基金管理人管理的基金（全市场的股票型ETF除外）、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款，定期存款以及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货、信用衍生品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）。法律法规或中国证监会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，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金对股票、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资比例合计不超过基金资产的 20%，其中，港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率（经汇率调整）×2%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### (2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变

化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，包括交易性金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重

新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（5）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（6）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（7）其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现

平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》，按如下方法估值：(a)对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；对于境内上市开放式基金(LOF)及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；对于境

内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益；对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。(b)如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值；如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 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。

#### 7.4.6.2 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。

根据财政部、国家税务总局[2025]4号公告《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 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。

#### 7.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

证券投资基金通过港股通买卖香港交易所股票的价差收入免征增值税；内地证券投资基金通过沪深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，一般由 H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税；投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国证券登记结算有限责任公司（“中国结算”）按照 20% 的税率代扣个人所得税。证券投资基金通过沪深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
活期存款	1,080,891.67
等于：本金	1,080,766.32
加：应计利息	125.35
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	1,080,891.67

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	56,069,042.64	-	57,791,405.95	1,722,363.31	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	49,997,827.94	596,352.88	50,723,352.88	129,172.06
	银行间市场	268,910,348.12	3,400,880.69	271,013,680.69	-1,297,548.12
	合计	318,908,176.06	3,997,233.57	321,737,033.57	-1,168,376.06
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	374,977,218.70	3,997,233.57	379,528,439.52	553,987.25

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	303.67
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	252,031.89
其中：交易所市场	238,258.40
银行间市场	13,773.49
应付利息	-
预提费用	29,000.00
合计	281,335.56

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 建信丰融债券 A

项目	本期 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,133,214,466.79	2,133,214,466.79
本期申购	17,754,340.66	17,754,340.66
本期赎回（以“-”号填列）	-1,953,767,692.51	-1,953,767,692.51
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	197,201,114.94	197,201,114.94

## 建信丰融债券 C

项目	本期 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,998,876,768.21	1,998,876,768.21
本期申购	546,917,432.15	546,917,432.15
本期赎回（以“-”号填列）	-2,456,543,654.70	-2,456,543,654.70
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	89,250,545.66	89,250,545.66

注：1、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。

2、本基金于 2025 年 2 月 5 日至 2025 年 2 月 25 日向社会公开募集。截至 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）止，建信丰融债券 A 类基金份额募集的扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 2,132,567,586.54 元，有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币 646,880.25 元；建信丰融债券 C 类基金份额募集的扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 1,998,375,427.15 元，有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币 501,341.06 元。建信丰融债券 A 类基金份额和 C 类基金份额实收基金合计为人民币 4,132,091,235.00 元，折合 4,132,091,235.00 份基金份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

建信丰融债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	20,664,311.16	377,420.61	21,041,731.77
本期基金份额交易产生的变动数	-12,920,662.94	-2,027,350.44	-14,948,013.38
其中：基金申购款	281,257.90	-7,362.45	273,895.45
基金赎回款	-13,201,920.84	-2,019,987.99	-15,221,908.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,743,648.22	-1,649,929.83	6,093,718.39

建信丰融债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	9,367,308.61	176,566.64	9,543,875.25
本期基金份额交易产生的变动数	-6,172,465.97	-921,666.70	-7,094,132.67
其中：基金申购款	1,761,264.56	512,390.95	2,273,655.51
基金赎回款	-7,933,730.53	-1,434,057.65	-9,367,788.18

本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,194,842.64	-745,100.06	2,449,742.58

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年2月27日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
活期存款利息收入		362,443.31
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		47,589.26
其他		174.65
合计		410,207.22

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年2月27日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		16,262,656.97
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		16,262,656.97

##### 7.4.7.14.2 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2月27日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
卖出股票成交总额		427,661,581.83
减：卖出股票成本总额		410,685,832.39
减：交易费用		713,092.47
买卖股票差价收入		16,262,656.97

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 基金投资收益

无。

## 7.4.7.16 债券投资收益

## 7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年2月27日（基金合同生效日）至2025年12月31日
债券投资收益——利息收入	17,503,367.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,521,928.52
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	13,981,439.33

## 7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年2月27日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,050,842,414.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,016,092,060.17
减：应计利息总额	38,232,678.46
减：交易费用	39,604.48
买卖债券差价收入	-3,521,928.52

## 7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.17 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 贵金属投资收益

## 7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.19 衍生工具收益

## 7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年2月27日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,905,062.02
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	2,905,062.02

## 7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年2月27日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1. 交易性金融资产	553,987.25
股票投资	1,722,363.31
债券投资	-1,168,376.06
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	553,987.25

#### 7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年2月27日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	247,156.82
基金转换费收入	3.98
合计	247,160.80

#### 7.4.7.23 持有基金产生的费用

无。

#### 7.4.7.24 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年2月27日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	20,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	7,673.93
银行间账户维护费	27,000.00
其他	1,000.00
证券组合费	364.74
存托服务费	8.41
合计	56,047.08

#### 7.4.7.26 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国华电集团产融控股有限公司	基金管理人的股东
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
建信资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 基金交易

无。

###### 7.4.10.1.5 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的管理费	7,468,543.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,446,543.23
应支付基金管理人的净管理费	4,022,000.68

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提，但基金财产中投资于本基金管理人管理的证券投资基金所对应的资产净值的部分不收取管理费。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值（除去本基金管理人管理的证券投资基金所对应的资产净值的部分；若为负数，则取 0）

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,867,136.03

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，但基金财产中投资于由本基金托管人所托管的证券投资基金所对应的资产净值的部分不收取托管费。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值（除去由本基金托管人所托管的证券投资基金所对应的资产净值的部分；若为负数，则取 0）

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信丰融债券 A	建信丰融债券 C	合计
建信基金	-	103.21	103.21
中国建设银行	-	612,403.88	612,403.88
中国农业银行	-	1,356,119.48	1,356,119.48

合计	-	1,968,626.57	1,968,626.57
----	---	--------------	--------------

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.4%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期	1,080,891.67	362,443.31

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用  
无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688012	中微公司	2025 年 12 月 19 日	重大事项	283.76	2026 年 1 月 5 日	278.00	1,200	348,665.40	340,512.00	-

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 73,315,328.21 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102580744	25 汇金 MTN002	2026 年 1 月 5 日	101.63	30,000	3,049,026.74
230202	23 国开 02	2026 年 1 月 5 日	102.56	80,000	8,204,723.29
232380066	23 中行二级资本债 03A	2026 年 1 月 5 日	104.76	200,000	20,951,249.32
250205	25 国开 05	2026 年 1 月 5 日	97.99	90,000	8,819,225.75
102580744	25 汇金 MTN002	2026 年 1 月 9 日	101.63	11,000	1,117,976.47
232380089	23 中信银行二级资本债 01A	2026 年 1 月 9 日	103.60	100,000	10,360,089.32
232480020	24 兴业银	2026 年 1 月 9 日	103.04	100,000	10,303,739.73

	行二级资本债 01	日			
232480035	24 平安银行二级资本债 01A	2026 年 1 月 9 日	101.88	200,000	20,376,955.62
合计				811,000	83,182,986.24

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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，

则本基金于本期末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年12月31日
AAA	145,136,518.93
AAA 以下	9,960,706.85
未评级	106,896,525.60
合计	261,993,751.38

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 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。基金管理人根据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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,080,891.67	-	-	-	1,080,891.67
结算备付金	289,464.97	-	-	-	289,464.97
存出保证金	113,023.08	-	-	-	113,023.08
交易性金融资产	30,625,043.84	222,064,840.69	69,047,149.04	57,791,405.95	379,528,439.52
应收清算款	-	-	-	2,585,581.72	2,585,581.72
应收股利	-	-	-	3,234.24	3,234.24
应收申购款	-	-	-	27,146.10	27,146.10
资产总计	32,108,423.56	222,064,840.69	69,047,149.04	60,407,368.01	383,627,781.30
负债					
卖出回购金融资产款	73,315,328.21	-	-	-	73,315,328.21
应付赎回款	-	-	-	14,789,470.57	14,789,470.57
应付管理人报酬	-	-	-	165,145.03	165,145.03

应付托管费	-	-	-	41,286.24	41,286.24
应付销售服务费	-	-	-	34,830.28	34,830.28
应交税费	-	-	-	5,263.84	5,263.84
其他负债	-	-	-	281,335.56	281,335.56
负债总计	73,315,328.21	-	-	15,317,331.52	88,632,659.73
利率敏感度缺口	-41,206,904.65	222,064,840.69	69,047,149.04	45,090,036.49	294,995,121.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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12月31日）
	市场利率下降25个基点	2,890,753.11
	市场利率上升25个基点	-2,841,681.02

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	57,791,405.95	19.59

交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	321,737,033.57	109.07
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	379,528,439.52	128.66

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。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例如附注 7.4.13.4.3.1 所示，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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12月31日
第一层次	57,450,893.95
第二层次	322,077,545.57
第三层次	-
合计	379,528,439.52

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。本基金本期持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。本财务报表已于 2026 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	57,791,405.95	15.06
	其中：股票	57,791,405.95	15.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	321,737,033.57	83.87
	其中：债券	321,737,033.57	83.87
	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	1,370,356.64	0.36
8	其他各项资产	2,728,985.14	0.71
9	合计	383,627,781.30	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	69,291.00	0.02
B	采矿业	3,888,862.00	1.32
C	制造业	29,383,043.35	9.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,070,436.00	0.36
E	建筑业	809,814.00	0.27
F	批发和零售业	908,066.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	1,550,848.00	0.53
H	住宿和餐饮业	102,002.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,577,161.60	0.87
J	金融业	15,164,328.00	5.14
K	房地产业	175,453.00	0.06
L	租赁和商务服务业	845,899.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	834,928.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	316,269.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	56,638.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	38,367.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	57,791,405.95	19.59

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601899	紫金矿业	30,400	1,047,888.00	0.36
2	601336	新华保险	11,000	766,700.00	0.26
3	300308	中际旭创	1,200	732,000.00	0.25
4	600000	浦发银行	53,200	661,808.00	0.22
5	300502	新易盛	1,500	646,320.00	0.22
6	603993	洛阳钼业	31,600	632,000.00	0.21
7	601138	工业富联	10,100	626,705.00	0.21
8	600919	江苏银行	59,800	621,920.00	0.21
9	600926	杭州银行	40,700	621,896.00	0.21

10	601077	渝农商行	96,200	621,452.00	0.21
11	601169	北京银行	112,800	618,144.00	0.21
12	600016	民生银行	156,500	599,395.00	0.20
13	688256	寒武纪	400	542,220.00	0.18
14	300394	天孚通信	2,500	507,575.00	0.17
15	601628	中国人寿	11,100	505,050.00	0.17
16	300033	同花顺	1,500	483,270.00	0.16
17	000408	藏格矿业	5,700	481,080.00	0.16
18	601601	中国太保	11,300	473,583.00	0.16
19	002916	深南电路	1,900	441,351.00	0.15
20	603259	药明康德	4,800	435,072.00	0.15
21	600183	生益科技	6,000	428,460.00	0.15
22	601225	陕西煤业	19,900	424,268.00	0.14
23	601319	中国人保	47,000	420,650.00	0.14
24	002463	沪电股份	5,600	409,192.00	0.14
25	300750	宁德时代	1,100	403,986.00	0.14
26	600690	海尔智家	15,400	401,786.00	0.14
27	600415	小商品城	24,800	395,560.00	0.13
28	002027	分众传媒	51,600	380,292.00	0.13
29	600066	宇通客车	11,500	376,050.00	0.13
30	605499	东鹏饮料	1,400	374,346.00	0.13
31	300628	亿联网络	10,400	370,760.00	0.13
32	600362	江西铜业	6,600	362,472.00	0.12
33	601100	恒立液压	3,200	351,712.00	0.12
34	601318	中国平安	5,100	348,840.00	0.12
35	300442	润泽科技	6,600	348,480.00	0.12
36	688012	中微公司	1,200	340,512.00	0.12
37	002028	思源电气	2,200	340,098.00	0.12
38	600875	东方电气	13,900	337,492.00	0.11
39	000157	中联重科	39,000	336,570.00	0.11
40	600219	南山铝业	62,300	335,174.00	0.11
41	601688	华泰证券	14,200	334,978.00	0.11
42	601211	国泰海通	16,300	334,965.00	0.11
43	600039	四川路桥	33,600	334,320.00	0.11
44	600160	巨化股份	8,700	334,254.00	0.11
45	600104	上汽集团	21,800	331,796.00	0.11
46	600061	国投资本	43,000	328,950.00	0.11
47	002938	鹏鼎控股	6,500	328,770.00	0.11
48	603501	豪威集团	2,600	327,340.00	0.11
49	600346	恒力石化	14,500	326,685.00	0.11
50	600028	中国石化	52,800	326,304.00	0.11
51	600958	东方证券	29,900	325,910.00	0.11
52	601916	浙商银行	106,100	322,544.00	0.11

53	600741	华域汽车	16,100	322,000.00	0.11
54	600030	中信证券	11,200	321,552.00	0.11
55	000708	中信特钢	19,600	320,852.00	0.11
56	600036	招商银行	7,600	319,960.00	0.11
57	600999	招商证券	19,200	319,488.00	0.11
58	600015	华夏银行	46,400	318,768.00	0.11
59	601857	中国石油	30,600	318,546.00	0.11
60	600019	宝钢股份	42,700	318,115.00	0.11
61	688008	澜起科技	2,700	318,060.00	0.11
62	603296	华勤技术	3,500	317,590.00	0.11
63	002142	宁波银行	11,300	317,417.00	0.11
64	000001	平安银行	27,700	316,057.00	0.11
65	601398	工商银行	39,800	315,614.00	0.11
66	601229	上海银行	31,200	315,120.00	0.11
67	601825	沪农商行	33,900	314,931.00	0.11
68	600887	伊利股份	11,000	314,600.00	0.11
69	002352	顺丰控股	8,200	314,224.00	0.11
70	601998	中信银行	40,800	314,160.00	0.11
71	688271	联影医疗	2,500	313,750.00	0.11
72	000776	广发证券	14,200	312,684.00	0.11
73	601088	中国神华	7,700	311,850.00	0.11
74	601009	南京银行	27,200	310,896.00	0.11
75	601117	中国化学	41,200	310,236.00	0.11
76	601838	成都银行	19,200	309,504.00	0.10
77	601818	光大银行	88,600	309,214.00	0.10
78	601808	中海油服	22,000	308,880.00	0.10
79	600011	华能国际	41,300	308,098.00	0.10
80	600009	上海机场	9,400	307,944.00	0.10
81	601166	兴业银行	14,600	307,476.00	0.10
82	601658	邮储银行	56,100	305,745.00	0.10
83	600111	北方稀土	6,600	304,392.00	0.10
84	601988	中国银行	53,100	304,263.00	0.10
85	601328	交通银行	41,700	302,325.00	0.10
86	002074	国轩高科	7,700	301,147.00	0.10
87	601995	中金公司	8,300	290,500.00	0.10
88	600050	中国联通	56,700	289,737.00	0.10
89	603799	华友钴业	4,200	286,692.00	0.10
90	300014	亿纬锂能	4,300	282,768.00	0.10
91	601728	中国电信	44,000	277,200.00	0.09
92	000333	美的集团	3,300	257,895.00	0.09
93	000858	五粮液	2,000	211,880.00	0.07
94	600885	宏发股份	6,500	197,600.00	0.07
95	002371	北方华创	400	183,632.00	0.06

96	000988	华工科技	2,200	174,526.00	0.06
97	603129	春风动力	600	167,208.00	0.06
98	002517	恺英网络	7,500	164,025.00	0.06
99	002595	豪迈科技	1,900	160,569.00	0.05
100	300760	迈瑞医疗	800	152,360.00	0.05
101	002532	天山铝业	9,300	150,474.00	0.05
102	002353	杰瑞股份	2,100	148,743.00	0.05
103	600519	贵州茅台	100	137,718.00	0.05
104	601555	东吴证券	15,200	137,712.00	0.05
105	300274	阳光电源	800	136,832.00	0.05
106	688608	恒玄科技	600	136,164.00	0.05
107	603939	益丰药房	6,100	132,492.00	0.04
108	300771	智莱科技	8,200	127,100.00	0.04
109	688617	惠泰医疗	500	121,635.00	0.04
110	600809	山西汾酒	700	120,190.00	0.04
111	603979	金诚信	1,500	114,225.00	0.04
112	002273	水晶光电	4,500	113,040.00	0.04
113	300932	三友联众	9,400	112,706.00	0.04
114	688199	久日新材	4,700	110,779.00	0.04
115	002850	科达利	700	110,502.00	0.04
116	688259	创耀科技	2,642	110,435.60	0.04
117	600838	上海九百	9,700	104,954.00	0.04
118	603486	科沃斯	1,300	104,884.00	0.04
119	000568	泸州老窖	900	104,598.00	0.04
120	600406	国电南瑞	4,600	103,408.00	0.04
121	603569	长久物流	13,400	102,510.00	0.03
122	000933	神火股份	3,700	101,639.00	0.03
122	001319	铭科精技	3,700	101,639.00	0.03
123	603949	雪龙集团	5,400	101,358.00	0.03
124	000783	长江证券	12,300	100,245.00	0.03
125	300566	激智科技	5,400	99,090.00	0.03
126	301258	富士莱	3,000	97,500.00	0.03
127	601126	四方股份	3,200	96,256.00	0.03
128	603288	海天味业	2,600	96,252.00	0.03
129	002138	顺络电子	2,700	95,931.00	0.03
130	002222	福晶科技	1,700	95,778.00	0.03
131	300724	捷佳伟创	1,000	95,600.00	0.03
132	600900	长江电力	3,500	95,165.00	0.03
133	002050	三花智控	1,700	94,027.00	0.03
134	002043	兔宝宝	6,500	93,665.00	0.03
135	002372	伟星新材	8,900	92,827.00	0.03
136	688401	路维光电	1,900	92,739.00	0.03
137	002946	新乳业	5,000	92,650.00	0.03

138	002690	美亚光电	4,500	92,565.00	0.03
139	688612	威迈斯	2,800	92,316.00	0.03
140	301015	百洋医药	3,900	92,040.00	0.03
141	600873	梅花生物	9,000	91,170.00	0.03
142	002475	立讯精密	1,600	90,736.00	0.03
143	002155	湖南黄金	4,300	90,687.00	0.03
144	601600	中国铝业	7,400	90,428.00	0.03
145	600989	宝丰能源	4,600	90,298.00	0.03
146	300054	鼎龙股份	2,400	90,240.00	0.03
147	603233	大参林	5,100	89,862.00	0.03
148	601665	齐鲁银行	15,600	89,544.00	0.03
149	002668	TCL 智家	8,600	89,268.00	0.03
150	605099	共创草坪	2,500	89,225.00	0.03
151	001337	四川黄金	3,200	89,152.00	0.03
152	600210	紫江企业	12,100	88,935.00	0.03
153	603699	纽威股份	1,700	88,349.00	0.03
154	300693	盛弘股份	2,300	88,044.00	0.03
155	600298	安琪酵母	2,000	87,480.00	0.03
156	002130	沃尔核材	3,300	86,856.00	0.03
157	603816	顾家家居	2,800	86,072.00	0.03
158	002612	朗姿股份	4,200	85,848.00	0.03
159	000792	盐湖股份	3,000	84,480.00	0.03
160	000551	创元科技	5,700	83,790.00	0.03
161	600096	云天化	2,500	83,525.00	0.03
162	002078	太阳纸业	5,300	83,475.00	0.03
163	688188	柏楚电子	600	81,534.00	0.03
164	300207	欣旺达	3,100	81,065.00	0.03
165	600650	锦江在线	5,300	80,560.00	0.03
166	300470	中密控股	2,100	78,960.00	0.03
167	601128	常熟银行	11,200	78,848.00	0.03
168	301282	金禄电子	2,700	78,462.00	0.03
169	002879	长缆科技	4,200	77,994.00	0.03
170	002438	江苏神通	4,900	77,910.00	0.03
171	688336	三生国健	1,300	77,441.00	0.03
172	000936	华西股份	9,400	77,362.00	0.03
173	688080	映翰通	1,527	77,113.50	0.03
174	300349	金卡智能	4,900	76,587.00	0.03
175	603136	天目湖	6,500	76,570.00	0.03
176	688183	生益电子	800	76,552.00	0.03
177	301175	中科环保	12,900	76,239.00	0.03
178	600742	富维股份	7,600	76,000.00	0.03
179	002472	双环传动	1,600	75,856.00	0.03
180	301345	涛涛车业	300	75,396.00	0.03

181	301215	中汽股份	11,000	75,350.00	0.03
182	600694	大商股份	4,200	75,306.00	0.03
183	001328	登康口腔	1,900	75,012.00	0.03
184	300373	扬杰科技	1,100	74,800.00	0.03
185	301188	力诺药包	4,200	73,920.00	0.03
186	000026	飞亚达	4,500	73,710.00	0.02
187	600563	法拉电子	700	73,465.00	0.02
188	688255	凯尔达	2,000	73,260.00	0.02
189	301439	泓淋电力	4,900	73,059.00	0.02
190	603313	梦百合	8,200	72,980.00	0.02
191	603266	天龙股份	3,200	72,832.00	0.02
192	001338	永顺泰	6,000	72,660.00	0.02
193	688580	伟思医疗	1,500	72,600.00	0.02
194	000651	格力电器	1,800	72,396.00	0.02
195	603238	诺邦股份	4,100	72,242.00	0.02
196	600021	上海电力	3,600	72,072.00	0.02
197	601007	金陵饭店	9,200	71,852.00	0.02
198	600273	嘉化能源	8,200	71,668.00	0.02
199	600660	福耀玻璃	1,100	71,247.00	0.02
200	002962	五方光电	4,800	71,136.00	0.02
201	002997	瑞鹤模具	1,900	71,060.00	0.02
202	301299	卓创资讯	1,300	70,694.00	0.02
203	002730	电光科技	4,700	70,688.00	0.02
204	003000	劲仔食品	6,200	70,618.00	0.02
205	603995	甬金股份	3,900	70,512.00	0.02
206	001914	招商积余	6,600	70,488.00	0.02
207	301101	明月镜片	1,700	70,431.00	0.02
208	000404	长虹华意	10,400	70,408.00	0.02
209	688315	诺禾致源	5,300	70,384.00	0.02
210	688722	同益中	3,600	70,380.00	0.02
211	600495	晋西车轴	14,700	70,266.00	0.02
212	002206	海利得	12,000	70,200.00	0.02
212	600017	日照港	23,400	70,200.00	0.02
213	603128	华贸物流	11,500	70,150.00	0.02
214	601860	紫金银行	25,400	70,104.00	0.02
215	300925	法本信息	3,300	70,092.00	0.02
216	001227	兰州银行	30,200	70,064.00	0.02
217	301132	满坤科技	2,100	69,930.00	0.02
218	002283	天润工业	11,200	69,888.00	0.02
219	600502	安徽建工	14,900	69,881.00	0.02
220	300627	华测导航	2,000	69,820.00	0.02
221	600368	五洲交通	17,800	69,776.00	0.02
222	601188	龙江交通	19,700	69,738.00	0.02

223	603368	柳药集团	3,900	69,498.00	0.02
224	601008	连云港	13,000	69,160.00	0.02
225	605080	浙江自然	3,000	69,000.00	0.02
226	601528	瑞丰银行	12,100	68,970.00	0.02
227	301591	肯特股份	1,700	68,918.00	0.02
228	003037	三和管桩	8,500	68,850.00	0.02
229	600717	天津港	15,400	68,838.00	0.02
230	601022	宁波远洋	7,500	68,775.00	0.02
231	000690	宝新能源	16,400	68,716.00	0.02
232	002376	新北洋	8,900	68,708.00	0.02
233	688133	泰坦科技	3,100	68,634.00	0.02
234	603788	宁波高发	4,200	68,628.00	0.02
235	002746	仙坛股份	11,300	68,591.00	0.02
236	603611	诺力股份	2,800	68,460.00	0.02
237	601789	宁波建工	13,700	68,363.00	0.02
238	605018	长华集团	5,900	68,322.00	0.02
239	000021	深科技	2,700	68,256.00	0.02
240	300873	海晨股份	3,100	68,107.00	0.02
241	603339	四方科技	5,300	67,999.00	0.02
242	300817	双飞集团	3,200	67,872.00	0.02
243	002101	广东鸿图	5,500	67,760.00	0.02
244	000419	通程控股	10,600	67,734.00	0.02
245	605011	杭州热电	3,300	67,452.00	0.02
246	603866	桃李面包	12,800	67,328.00	0.02
247	688687	凯因科技	2,700	67,284.00	0.02
248	000722	湖南发展	5,700	67,260.00	0.02
249	002876	三利谱	2,800	67,032.00	0.02
250	300787	海能实业	5,700	66,975.00	0.02
251	002449	国星光电	7,900	66,834.00	0.02
252	603379	三美股份	1,100	66,792.00	0.02
253	000096	广聚能源	6,500	66,755.00	0.02
254	301328	维峰电子	1,400	66,598.00	0.02
255	000153	丰原药业	10,600	66,462.00	0.02
256	300012	华测检测	4,900	66,395.00	0.02
257	301335	天元宠物	2,300	66,332.00	0.02
258	301022	海泰科	2,000	66,180.00	0.02
259	688072	拓荆科技	200	66,000.00	0.02
260	301151	冠龙节能	3,500	65,800.00	0.02
261	603228	景旺电子	900	65,781.00	0.02
262	002666	德联集团	11,900	65,569.00	0.02
263	002616	长青集团	12,000	65,520.00	0.02
263	300987	川网传媒	3,900	65,520.00	0.02
264	600560	金自天正	3,900	63,726.00	0.02

265	300002	神州泰岳	5,500	63,360.00	0.02
266	600060	海信视像	2,600	63,128.00	0.02
267	600699	均胜电子	2,000	62,720.00	0.02
268	603596	伯特利	1,200	61,524.00	0.02
269	688111	金山办公	200	61,414.00	0.02
270	000423	东阿阿胶	1,200	58,896.00	0.02
271	000895	双汇发展	2,200	58,234.00	0.02
272	002318	久立特材	2,000	57,900.00	0.02
273	002444	巨星科技	1,700	57,834.00	0.02
274	000728	国元证券	6,800	56,780.00	0.02
275	301529	福赛科技	500	56,550.00	0.02
276	601717	中创智领	2,300	56,465.00	0.02
277	601577	长沙银行	5,600	54,320.00	0.02
278	001696	宗申动力	2,500	54,225.00	0.02
279	300015	爱尔眼科	4,900	53,802.00	0.02
280	688235	百济神州	200	53,720.00	0.02
281	000528	柳工	4,500	53,415.00	0.02
282	600312	平高电气	3,000	52,050.00	0.02
283	605117	德业股份	600	51,720.00	0.02
284	603179	新泉股份	700	51,716.00	0.02
285	002223	鱼跃医疗	1,300	49,673.00	0.02
286	300487	蓝晓科技	800	49,400.00	0.02
287	603585	苏利股份	2,600	49,036.00	0.02
288	601958	金钼股份	3,100	48,298.00	0.02
289	000513	丽珠集团	1,400	48,244.00	0.02
290	603605	珀莱雅	700	47,936.00	0.02
291	002001	新和成	1,900	47,861.00	0.02
292	600998	九州通	9,300	47,616.00	0.02
293	688059	华锐精密	600	47,220.00	0.02
294	688636	智明达	1,100	47,124.00	0.02
295	601991	大唐发电	13,500	47,115.00	0.02
296	002939	长城证券	4,600	46,920.00	0.02
297	300445	康斯特	1,800	46,908.00	0.02
298	002262	恩华药业	1,900	45,847.00	0.02
299	300866	安克创新	400	45,756.00	0.02
300	603338	浙江鼎力	800	45,312.00	0.02
301	002034	旺能环境	2,800	44,520.00	0.02
302	600483	福能股份	4,600	43,562.00	0.01
303	000779	甘咨询	5,300	43,513.00	0.01
304	600863	内蒙华电	9,600	43,008.00	0.01
305	002299	圣农发展	2,600	43,004.00	0.01
306	300557	理工光科	1,200	42,348.00	0.01
307	603566	普莱柯	3,400	42,262.00	0.01

308	301552	科力装备	1,100	41,239.00	0.01
309	002767	先锋电子	1,800	41,238.00	0.01
310	301499	维科精密	1,400	41,202.00	0.01
311	300644	南京聚隆	1,100	40,601.00	0.01
312	000923	河钢资源	1,900	40,223.00	0.01
313	688557	兰剑智能	1,100	40,073.00	0.01
314	688162	巨一科技	1,300	40,040.00	0.01
315	300095	华伍股份	3,300	39,996.00	0.01
316	603681	永冠新材	2,100	39,858.00	0.01
317	688312	燕麦科技	1,200	39,816.00	0.01
318	600901	江苏金租	6,500	39,780.00	0.01
319	603345	安井食品	500	39,640.00	0.01
320	600521	华海药业	2,300	39,031.00	0.01
321	002773	康弘药业	1,300	38,961.00	0.01
322	688677	海泰新光	900	38,844.00	0.01
323	301138	华研精机	1,000	38,800.00	0.01
324	001218	丽臣实业	1,700	38,726.00	0.01
325	688077	大地熊	1,251	38,218.05	0.01
326	600230	沧州大化	2,500	38,150.00	0.01
327	002380	科远智慧	1,400	38,080.00	0.01
328	002258	利尔化学	2,900	37,845.00	0.01
329	000559	万向钱潮	2,200	37,840.00	0.01
330	603214	爱婴室	2,200	37,752.00	0.01
331	000600	建投能源	4,400	37,532.00	0.01
332	002029	七匹狼	3,400	37,502.00	0.01
333	300515	三德科技	1,900	37,354.00	0.01
334	600582	天地科技	6,400	37,312.00	0.01
335	603629	利通电子	1,400	37,310.00	0.01
336	002244	滨江集团	3,700	37,185.00	0.01
337	000887	中鼎股份	1,600	37,136.00	0.01
338	002831	裕同科技	1,300	37,063.00	0.01
339	603331	百达精工	2,600	37,050.00	0.01
340	603310	巍华新材	2,200	36,982.00	0.01
341	301555	惠柏新材	1,100	36,773.00	0.01
342	603700	宁水集团	2,700	36,693.00	0.01
343	000975	山金国际	1,500	36,495.00	0.01
344	002772	众兴菌业	2,500	36,475.00	0.01
345	300802	矩子科技	1,900	36,366.00	0.01
346	600106	重庆路桥	5,800	36,308.00	0.01
347	601019	山东出版	4,200	36,288.00	0.01
348	601005	重庆钢铁	24,800	36,208.00	0.01
349	603856	东宏股份	2,900	36,163.00	0.01
350	002658	雪迪龙	4,000	36,120.00	0.01

351	300190	维尔利	8,400	36,036.00	0.01
352	003025	思进智能	2,500	35,925.00	0.01
353	000035	中国天楹	6,500	35,880.00	0.01
354	003016	欣贺股份	3,700	35,853.00	0.01
355	603776	永安行	2,000	35,760.00	0.01
356	603529	爱玛科技	1,200	35,640.00	0.01
357	600267	海正药业	3,600	35,604.00	0.01
358	002010	传化智联	6,100	35,441.00	0.01
359	603028	赛福天	3,800	35,416.00	0.01
360	301580	爱迪特	800	35,360.00	0.01
361	600179	安通控股	6,400	35,328.00	0.01
362	603922	金鸿顺	1,700	35,292.00	0.01
363	301051	信濠光电	1,800	35,280.00	0.01
364	000531	穗恒运 A	5,500	35,255.00	0.01
365	300358	楚天科技	3,600	35,244.00	0.01
366	688082	盛美上海	200	35,210.00	0.01
367	605567	春雪食品	3,200	35,200.00	0.01
368	603787	新日股份	2,500	35,150.00	0.01
369	600963	岳阳林纸	7,500	35,025.00	0.01
370	601636	旗滨集团	5,900	34,987.00	0.01
371	300040	九洲集团	5,800	34,916.00	0.01
372	300616	尚品宅配	2,500	34,825.00	0.01
373	601456	国联民生	3,400	34,578.00	0.01
374	002042	华孚时尚	8,100	34,425.00	0.01
375	603987	康德莱	4,000	34,400.00	0.01
376	003030	祖名股份	1,700	34,323.00	0.01
377	001239	永达股份	2,100	34,272.00	0.01
378	601512	中新集团	3,800	34,200.00	0.01
379	002373	千方科技	2,900	34,133.00	0.01
380	603817	海峡环保	4,800	34,032.00	0.01
381	002038	双鹭药业	4,600	33,902.00	0.01
382	002637	赞宇科技	3,300	33,825.00	0.01
383	301131	聚赛龙	700	33,789.00	0.01
384	600436	片仔癀	200	33,756.00	0.01
385	688179	阿拉丁	2,700	33,723.00	0.01
386	301205	联特科技	200	33,702.00	0.01
387	301032	新柴股份	2,800	33,684.00	0.01
388	600075	新疆天业	6,800	33,660.00	0.01
389	000560	我爱我家	11,500	33,580.00	0.01
390	603500	祥和实业	2,800	33,544.00	0.01
391	600676	交运股份	5,700	33,516.00	0.01
392	000598	兴蓉环境	4,600	32,982.00	0.01
393	002824	和胜股份	1,700	32,980.00	0.01

394	300861	美畅股份	2,200	32,846.00	0.01
395	300639	凯普生物	6,100	32,818.00	0.01
396	300970	华绿生物	1,600	32,816.00	0.01
397	600596	新安股份	2,860	32,804.20	0.01
398	300823	建科智能	2,100	32,802.00	0.01
399	002030	达安基因	5,500	32,780.00	0.01
400	600004	白云机场	3,400	32,164.00	0.01
401	002555	三七互娱	1,300	30,680.00	0.01
402	601061	中信金属	2,100	30,240.00	0.01
403	600258	首旅酒店	1,800	30,150.00	0.01
404	002507	涪陵榨菜	2,300	29,693.00	0.01
405	600583	海油工程	5,400	29,646.00	0.01
406	300805	电声股份	2,800	29,540.00	0.01
407	300620	光库科技	200	29,410.00	0.01
408	688025	杰普特	200	28,314.00	0.01
409	002120	韵达股份	4,100	27,634.00	0.01
410	600968	海油发展	7,100	27,264.00	0.01
411	600970	中材国际	2,600	27,014.00	0.01
412	301498	乖宝宠物	400	26,060.00	0.01
413	000429	粤高速 A	2,200	25,916.00	0.01
414	600062	华润双鹤	1,400	25,606.00	0.01
415	600988	赤峰黄金	800	24,992.00	0.01
416	002920	德赛西威	200	24,060.00	0.01
417	000543	皖能电力	2,900	23,055.00	0.01
418	600845	宝信软件	1,100	22,781.00	0.01
419	301031	中熔电气	200	22,438.00	0.01
420	688372	伟测科技	200	21,818.00	0.01
421	000739	普洛药业	1,300	21,151.00	0.01
422	603369	今世缘	600	20,868.00	0.01
423	603195	公牛集团	500	20,415.00	0.01
424	603568	伟明环保	800	20,304.00	0.01
425	600941	中国移动	200	20,210.00	0.01
426	300972	万辰集团	100	20,107.00	0.01
427	688698	伟创电气	200	19,776.00	0.01
428	688100	威胜信息	500	19,650.00	0.01
429	600871	石化油服	8,400	18,144.00	0.01
430	301165	锐捷网络	200	17,760.00	0.01
431	300832	新产业	300	16,875.00	0.01
432	688084	晶品特装	200	16,560.00	0.01
433	688789	宏华数科	200	16,314.00	0.01
434	600098	广州发展	2,400	15,696.00	0.01
435	300624	万兴科技	200	14,130.00	0.00
436	300573	兴齐眼药	200	14,058.00	0.00

437	688531	日联科技	200	13,206.00	0.00
438	605376	博迁新材	200	13,080.00	0.00
439	301292	海科新源	200	12,882.00	0.00
440	688185	康希诺	200	12,570.00	0.00
441	301070	开勒股份	200	12,310.00	0.00
442	301536	星辰科技	200	11,982.00	0.00
443	301080	百普赛斯	200	10,800.00	0.00
444	300913	兆龙互连	200	10,526.00	0.00
445	688023	安恒信息	200	10,282.00	0.00
446	603236	移远通信	100	9,541.00	0.00
447	301137	哈焊华通	200	9,402.00	0.00
448	300613	富瀚微	200	9,212.00	0.00
449	300895	铜牛信息	200	8,830.00	0.00
450	301510	固高科技	200	7,490.00	0.00
451	002895	川恒股份	200	7,332.00	0.00
452	603203	快克智能	200	7,322.00	0.00
453	003010	若羽臣	200	6,994.00	0.00
454	301035	润丰股份	100	6,801.00	0.00
455	000977	浪潮信息	100	6,660.00	0.00
456	301110	青木科技	100	6,618.00	0.00
457	002048	宁波华翔	200	6,292.00	0.00
458	301508	中机认检	200	6,252.00	0.00
459	003026	中晶科技	200	6,176.00	0.00
460	603950	长源东谷	200	5,790.00	0.00
461	600323	瀚蓝环境	200	5,720.00	0.00
462	300357	我武生物	200	5,670.00	0.00
463	300731	科创新源	100	5,622.00	0.00
464	002311	海大集团	100	5,538.00	0.00
465	688150	莱特光电	200	5,406.00	0.00
466	301029	怡合达	200	5,304.00	0.00
467	603833	欧派家居	100	5,209.00	0.00
468	603867	新化股份	200	5,080.00	0.00
469	300662	科锐国际	200	5,066.00	0.00
470	000880	潍柴重机	180	4,917.60	0.00
471	002368	太极股份	200	4,898.00	0.00
472	688518	联赢激光	200	4,858.00	0.00
473	301302	华如科技	200	4,574.00	0.00
474	600315	上海家化	200	4,504.00	0.00
475	002032	苏泊尔	100	4,408.00	0.00
476	600071	凤凰光学	200	4,300.00	0.00
477	300596	利安隆	100	4,221.00	0.00
478	600285	羚锐制药	200	4,142.00	0.00
479	600482	中国动力	200	4,140.00	0.00

480	688428	诺诚健华	200	4,104.00	0.00
481	002126	银轮股份	100	3,780.00	0.00
482	301382	蜂助手	100	3,544.00	0.00
483	301509	金凯生科	100	3,378.00	0.00
484	603185	弘元绿能	100	3,050.00	0.00
485	002396	星网锐捷	100	3,030.00	0.00
486	301230	泓博医药	100	2,987.00	0.00
487	603882	金城医学	100	2,836.00	0.00
488	300415	伊之密	100	2,606.00	0.00
489	600389	江山股份	100	2,528.00	0.00
490	603697	有友食品	200	2,450.00	0.00
491	603733	仙鹤股份	100	2,417.00	0.00
492	001222	源飞宠物	100	2,366.00	0.00
493	600817	宇通重工	200	2,274.00	0.00
494	002017	东信和平	100	2,230.00	0.00
495	300528	幸福蓝海	100	2,079.00	0.00
496	603115	海星股份	100	1,871.00	0.00
497	002826	易明医药	100	1,838.00	0.00
498	603206	嘉环科技	100	1,729.00	0.00
499	301180	万祥科技	100	1,670.00	0.00
500	603739	蔚蓝生物	100	1,415.00	0.00
501	605208	永茂泰	100	1,358.00	0.00
502	603390	通达电气	100	1,307.00	0.00
503	002695	煌上煌	100	1,174.00	0.00
504	603086	先达股份	100	822.00	0.00
505	601187	厦门银行	100	734.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	4,059,842.00	1.38
2	600519	贵州茅台	3,575,394.00	1.21
3	300308	中际旭创	2,953,226.00	1.00
4	601169	北京银行	2,908,617.00	0.99
5	601211	国泰海通	2,739,903.00	0.93
6	601899	紫金矿业	2,547,952.00	0.86
7	601328	交通银行	2,489,719.00	0.84
8	601077	渝农商行	2,475,766.00	0.84
9	000333	美的集团	2,469,881.00	0.84
10	605499	东鹏饮料	2,380,924.00	0.81
11	300502	新易盛	2,257,726.00	0.77
12	600900	长江电力	2,251,244.00	0.76
13	601229	上海银行	2,245,445.00	0.76

14	601857	中国石油	2,233,430.00	0.76
15	600919	江苏银行	2,216,461.00	0.75
16	601919	中远海控	2,203,321.00	0.75
17	601818	光大银行	2,188,584.00	0.74
18	601166	兴业银行	2,130,849.00	0.72
19	603259	药明康德	2,107,752.00	0.71
20	09988	阿里巴巴-W	2,056,754.63	0.70

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	3,694,065.00	1.25
2	600000	浦发银行	3,593,057.00	1.22
3	600519	贵州茅台	3,125,796.00	1.06
4	300308	中际旭创	2,608,623.00	0.88
5	601211	国泰海通	2,503,616.00	0.85
6	601169	北京银行	2,304,775.00	0.78
7	09988	阿里巴巴-W	2,270,792.31	0.77
8	00700	腾讯控股	2,194,551.34	0.74
9	000333	美的集团	2,189,032.00	0.74
10	601919	中远海控	2,174,542.00	0.74
11	601328	交通银行	2,145,557.00	0.73
12	603259	药明康德	2,098,916.10	0.71
13	688008	澜起科技	2,079,050.32	0.70
14	600900	长江电力	2,076,766.00	0.70
15	601857	中国石油	2,054,222.00	0.70
16	605499	东鹏饮料	1,919,287.00	0.65
17	600031	三一重工	1,910,325.00	0.65
18	601166	兴业银行	1,896,518.00	0.64
19	601229	上海银行	1,885,706.00	0.64
20	601318	中国平安	1,875,079.00	0.64

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 8.4.3 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	466,754,875.03
卖出股票收入（成交）总额	427,661,581.83

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	214,840,507.97	72.83
	其中：政策性金融债	59,743,282.19	20.25
4	企业债券	20,296,224.66	6.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	86,600,300.94	29.36
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	321,737,033.57	109.07

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	102580744	25 汇金 MTN002	300,000	30,490,267.40	10.34
2	232580006	25 民生银行二级资本债 01	300,000	30,441,846.58	10.32
3	102581808	25 电网 MTN019	300,000	29,815,675.07	10.11
4	250205	25 国开 05	300,000	29,397,419.18	9.97
5	1928007	19 工商银行二级 02	200,000	22,275,510.14	7.55

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.10.2 本期国债期货投资评价

无。

### 8.11 本报告期投资基金情况

#### 8.11.1 投资政策及风险说明

无。

**8.11.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细**

无。

**8.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产证券投资基金情况**

无。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 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。

**8.12.2 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。

**8.12.3 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	113,023.08
2	应收清算款	2,585,581.72
3	应收股利	3,234.24
4	应收利息	-
5	应收申购款	27,146.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,728,985.14

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**8.12.6 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。

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
建信丰融债券 A	1,615	122,105.95	50,686.52	0.03	197,150,428.42	99.97
建信丰融债券 C	1,128	79,122.82	259,033.70	0.29	88,991,511.96	99.71
合计	2,743	104,430.06	309,720.22	0.11	286,141,940.38	99.89

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信丰融债券 A	59,636.22	0.03
	建信丰融债券 C	5,023.55	0.01
	合计	64,659.77	0.02

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

### 9.3 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

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。

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信丰融债券 A	建信丰融债券 C
基金合同生效日 (2025 年 2 月 27 日) 基金份额总额	2,133,214,466.79	1,998,876,768.21
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申	17,754,340.66	546,917,432.15

购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,953,767,692.51	2,456,543,654.70
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	197,201,114.94	89,250,545.66

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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；基金管理人于 2025 年 7 月 26 日发布公告，自 2025 年 7 月 24 日起宫永媛女士不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁、财务负责人、首席信息官；基金管理人于 2025 年 8 月 13 日发布公告，自 2025 年 8 月 12 日起聘任刘大超先生担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2025 年 11 月 28 日发布公告，自 2025 年 11 月 26 日起聘任张铮先生担任建信基金管理有限责任公司财务负责人。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，2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。2025 年 9 月，中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

## 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）更换为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 20,000.00 元人民币。本基金本报告期内选聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

## 11.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

### 11.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 11.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

### 11.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

## 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.8.1 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 (%)	
华福证券	1	412,297,353.50	46.10	179,712.15	45.32	-
华创证券	2	326,472,515.19	36.50	145,576.41	36.71	-
广发证券	1	94,274,803.47	10.54	41,093.35	10.36	-
银河证券	1	54,900,536.70	6.14	27,376.87	6.90	-
国泰海通证券	1	6,471,248.00	0.72	2,820.09	0.71	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-

中信证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

## 11.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
华福证券	101,288,	37.44	280,587,	0.92	-	-	-	-

	621.18		000.00					
华创证券	71,188,0 14.81	26.31	-	-	-	-	-	-
广发证券	17,777,9 16.13	6.57	-	-	-	-	-	-
银河证券	132,083. 01	0.05	-	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	80,171,0 47.32	29.63	30,202,5 39,000.0 0	99.08	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.9 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	关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	指定报刊和/或公司网站	2025年12月27日
2	关于新增广发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9月2日
3	关于新增万联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7月28日
4	关于新增中信证券股份有限公司等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6月25日
5	关于新增平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6月11日
6	关于新增华西证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025年4月18日
7	建信丰融债券型证券投资基金基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	指定报刊和/或公司网站	2025年4月16日
8	建信丰融债券型证券投资基金基金合同生效公告	指定报刊和/或公司网站	2025年2月28日
9	关于新增华宝证券股份有限公司为建信丰融债券型证券投资基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025年2月18日
10	建信丰融债券型证券投资基金基金份	指定报刊和/或公司网	2025年1月24日

额发售公告	站	
-------	---	--

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信丰融债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信丰融债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信丰融债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信丰融债券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。

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 13.3 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

2026 年 3 月 30 日