

建信上证科创板 200 交易型开放式指数证
券投资基金
2026 年第 2 季度报告

2026 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 20 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信上证科创板 200ETF
场内简称	科 200F（扩位简称：科创 200ETF 建信）
基金主代码	589820
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 8 月 27 日
报告期末基金份额总额	126,720,166.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	（一）组合复制策略 本基金通过综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本、交易限制等因素，主要采取完全复制法构建基金的股票投资组合，以更好地实现跟踪标的指数的目的。 （二）替代性策略 在因特殊情形导致基金无法投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。 （三）衍生金融产品投资策略 本基金可参与国债期货、股指期货、股票期权交易、信用衍生品和投资其他经中国证监会允许的衍生金融产品。 （四）债券投资策略 本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券投资组合。 （五）资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比

	率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。 （六）融资及转融通证券出借策略 基金管理人遵守审慎经营原则运用基金财产参与转融通证券出借业务，加强转融通证券出借业务信用风险管理，分析市场情况、投资者类型与结构、历史申赎数据、出借证券流动性情况等因素，合理确定出借证券的范围、期限和比例，分散出借期限与借券证券公司的集中度。 （七）可转换债券投资策略 可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深度挖掘以明确该可转债的债底保护，防范信用风险，另一方面，还会进一步分析公司的盈利和成长能力以确定可转债中长期的上涨空间。 （八）存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 （九）未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，经履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，本基金的标的指数为上证科创板 200 指数。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采取完全复制法构建基金的股票投资组合，以更好地实现跟踪标的指数的目的。其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 本基金资产投资于科创板，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险等。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	42,437,576.46
2. 本期利润	81,461,215.68
3. 加权平均基金份额本期利润	0.5043
4. 期末基金资产净值	203,843,767.73
5. 期末基金份额净值	1.6086

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。

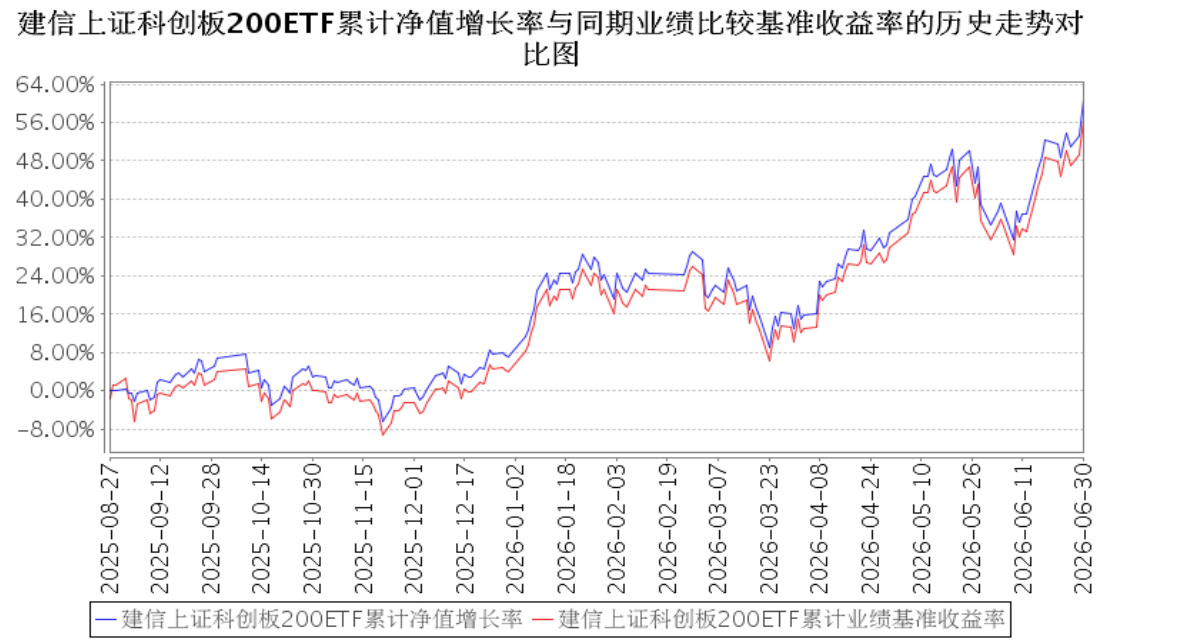
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	净值增长率 ①	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	42.53%	2.36%	42.43%	2.37%	0.10%	-0.01%
过去六个月	50.10%	2.36%	50.74%	2.38%	-0.64%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	60.86%	2.07%	56.86%	2.18%	4.00%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：本基金基金合同于 2025 年 8 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。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龚佳佳	本基金的基金经理	2025 年 8 月 27 日	-	13	龚佳佳先生，硕士。曾任诺安基金管理有限公司数量投资部研究员、基金经理助理；工银瑞信基金管理有限公司指数投资部量化研究员；华夏基金管理有限公司数量投资部研究员、投资经理。2018 年 5 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部基金经理助理、基金经理等职务。2019 年 2 月 22 日至 2023 年 2 月 1 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；2019 年 3 月 7 日至 2022 年 5 月 5 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2019 年 3 月 7 日至 2022 年 5 月 5 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2019 年 8 月 23 日至 2023 年 12 月 11 日任建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 3 月 6 日至 2023 年 1 月 5 日任建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 17 日至 2021 年 4 月 6 日任建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 6 月 29 日起任建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 2 月 18 日至 2022 年 9 月 29 日任建信中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 3 月 11 日起任建信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 5 月 27 日起任建信中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 6 月 3 日至 2022 年 5 月 11 日任建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 7 月 15 日至 2024 年 1 月 24 日任建信中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 7 月 29 日至 2021 年 12 月 27 日任建信中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的

					基金经理；2021 年 8 月 19 日起任建信中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 8 日至 2023 年 12 月 11 日任建信沪深 300 红利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；2021 年 9 月 9 日至 2024 年 9 月 9 日任建信中证全指证券公司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；2021 年 11 月 25 日至 2023 年 10 月 17 日任建信中证饮料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2022 年 1 月 7 日起任建信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2022 年 7 月 21 日起任建信中证农牧主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 8 月 27 日起任建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 9 月 25 日起任建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2026 年 5 月 19 日起任建信国证新能源车电池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。
--	--	--	--	--	--

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，

系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或间接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 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金为被动指数基金，跟踪的标的指数为上证科创板 200 指数（000699.SH）。科创 200 指数是从上交所科创板中选取市值偏小且流动性较好的 200 只证券作为指数的成分股，以反映科创板中市值偏小的公司的整体表现。

报告期内，沪深 300 指数上涨 11.90%，中证 500 指数上涨 18.56%，创业板指上涨 36.35%，科创 200 指数上涨 42.43%。整体而言，标的指数在市场主流宽基指数中表现较为靠前。由于近年来 AI 的快速发展，海外科技巨头在持续提升资本开支规模，国内的光模块、CPO、芯片等相关产业链的公司订单大增，景气度持续向好。在此背景下，AI 硬件相关的上市公司在二季度获得了较多的资金流入，带动标的指数出现了大幅的上涨。本基金一直保持较高仓位运作，实现了对标的指数的紧密跟踪。报告期内，标的指数进行了成分股定期调整，管理人相应调整了组合的持仓结构。

基金在构建组合时主要采用完全复制法，即以标的指数中各成分股的权重为主要依据确定组合的持仓结构，并根据成分股权重的动态变化对组合进行微调。基金在报告期内的跟踪误差主要来源于成分股分红、申购赎回以及四舍五入导致的股数差异等。后续管理人将采用定性和定量相结合的方法，严格遵守基金合同，力争将跟踪偏离度和跟踪误差控制在较低的水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 42.53%，波动率 2.36%，业绩比较基准收益率 42.43%，波动率 2.37%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	203,223,248.93	99.64
	其中：股票	203,223,248.93	99.64
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	674,939.77	0.33
8	其他资产	63,085.24	0.03
9	合计	203,961,273.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	164,878,617.79	80.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,296,217.51	12.90
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	12,048,413.63	5.91
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	203,223,248.93	99.70

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	688403	汇成股份	105,591	4,191,962.70	2.06
2	688025	杰普特	8,848	4,158,560.00	2.04
3	688668	鼎通科技	10,983	4,099,953.90	2.01
4	688388	嘉元科技	87,932	3,869,008.00	1.90
5	688362	甬矽电子	38,311	3,693,180.40	1.81
6	688503	聚和材料	25,996	3,449,669.20	1.69
7	688257	新锐股份	33,100	3,372,890.00	1.65
8	688372	伟测科技	17,898	3,329,028.00	1.63
9	688545	兴福电子	24,000	3,193,440.00	1.57
10	688300	联瑞新材	12,846	3,139,562.40	1.54

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	63,085.24
8	其他	—

9	合计	63,085.24
---	----	-----------

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	201,720,166.00
报告期期间基金总申购份额	6,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	81,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	126,720,166.00

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

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	期初	申购	赎回	持有份额	份额

		金份额 比例达 到或者 超过 20% 的时间 区间	份额	份额	份额		占比 (%)
建信上证 科创板 200 交易 型开放式 指数证券 投资基金 联接基金	1	2026 年 04 月 01 日-2026 年 06 月 30 日	168,901,100.00	1,800,000.00	70,350,200.00	100,350,900.00	79.19

注：本基金本报告期申购、赎回份额中包含了买入、卖出份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 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 7 月 20 日