

建信中证 A500 指数增强型证券投资基金 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	建信中证 A500 指数增强
基金主代码	023303
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 6 月 3 日
报告期末基金份额总额	22,812,204.07 份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的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，以标的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 7.75%，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	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
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、债券型基金、混合型基金。本基金投资港股通标的股票的，需承担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。

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	
下属分级基金的基金简称	建信中证 A500 指数增强 A	建信中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	023303	023304
报告期末下属分级基金的份额总额	14, 202, 380. 98 份	8, 609, 823. 09 份

§ 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）	
	建信中证 A500 指数增强 A	建信中证 A500 指数增强 C
1. 本期已实现收益	795, 571. 46	522, 921. 34
2. 本期利润	2, 818, 749. 24	2, 017, 018. 45
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 2049	0. 2073
4. 期末基金资产净值	19, 466, 428. 82	11, 750, 343. 42
5. 期末基金份额净值	1. 3706	1. 3648

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

建信中证 A500 指数增强 A

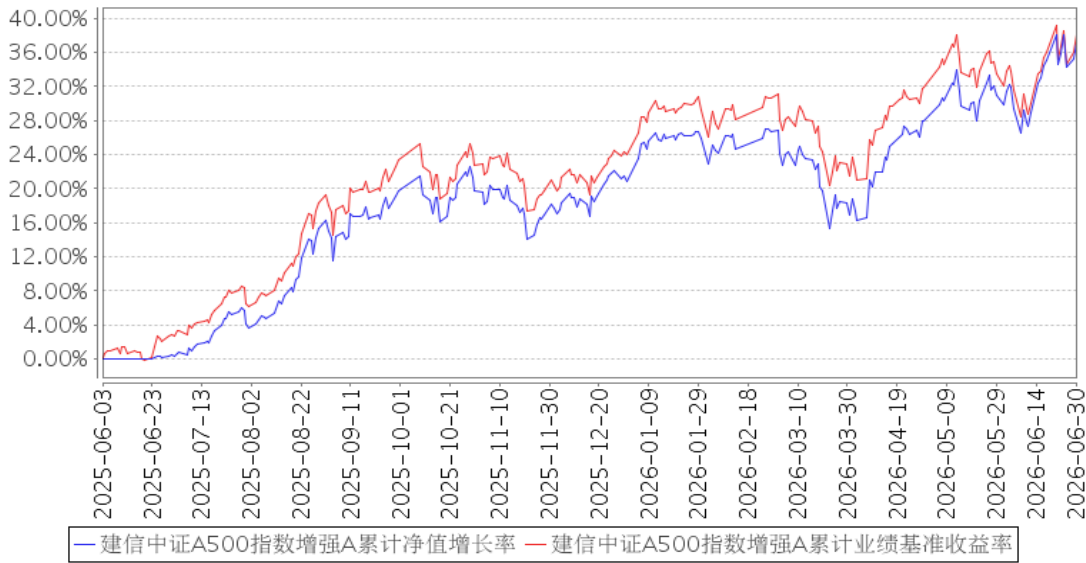
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	17. 29%	1. 31%	13. 54%	1. 34%	3. 75%	-0. 03%
过去六个月	13. 40%	1. 21%	11. 34%	1. 22%	2. 06%	-0. 01%
过去一年	36. 61%	1. 08%	34. 41%	1. 09%	2. 20%	-0. 01%
自基金合同生效起至今	37. 06%	1. 04%	38. 01%	1. 06%	-0. 95%	-0. 02%

建信中证 A500 指数增强 C

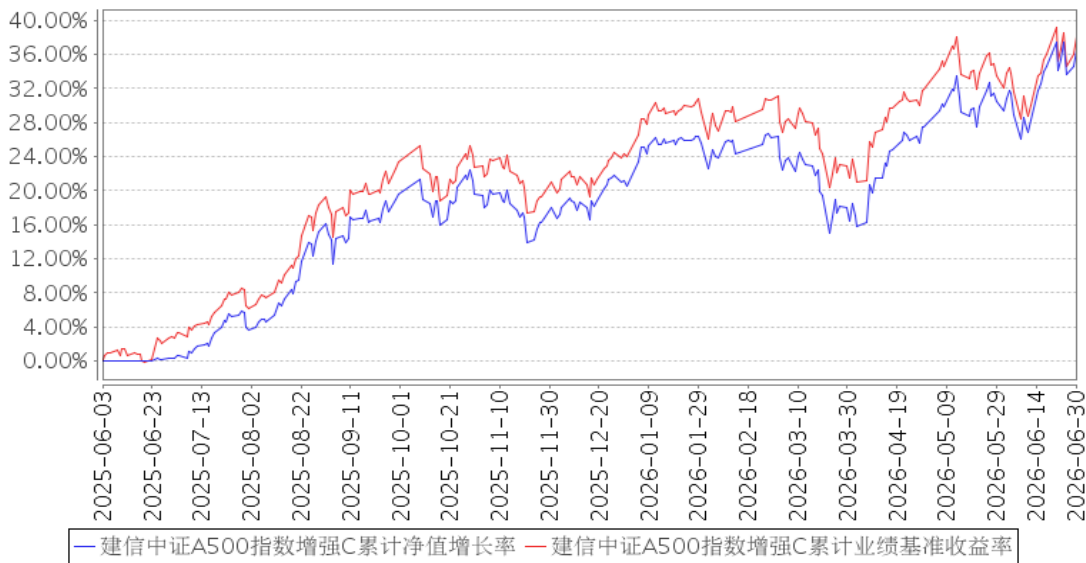
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	17.17%	1.31%	13.54%	1.34%	3.63%	-0.03%
过去六个月	13.19%	1.21%	11.34%	1.22%	1.85%	-0.01%
过去一年	36.07%	1.08%	34.41%	1.09%	1.66%	-0.01%
自基金合同生效起至今	36.48%	1.04%	38.01%	1.06%	-1.53%	-0.02%

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

建信中证A500指数增强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



建信中证A500指数增强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 6 月 3 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		
叶乐天	数量投资部副总经理（主持工作），本基金的基金经理	2025 年 6 月 3 日	-	18	叶乐天先生，数量投资部副总经理（主持工作），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 日至 2025 年 11 月 14 日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；2026 年 6 月 9 日起任建信丰汇债券型证券投资基金的基金经理。
郭志腾	本基金的基金经理	2025 年 6 月 3 日	—	8	郭志腾先生，硕士。2017 年 7 月毕业于北京大学金融专业，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、基金经理助理、数量投资部投资经理等职务。2023 年 12 月 7 日起任建信沪深 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；2023 年 12 月 7 日起任建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2023 年 12 月 7 日起任建信灵活配置混合型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。

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《建信中证 A500 指数增强型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

本基金是以量化模型管理的指数增强基金，管理人利用多因子量化模型进行日常的组合调仓和风险管理。通过严格控制与标的指数的行业偏离程度和风格偏离程度，以将跟踪误差控制在合适的水平；通过在个股权重上进行一定的主动暴露，以争取获取较稳定的超额收益。此外，基金管理人采用股指期货部分替代现货的方法，提高资金使用效率，以尽可能降低日常申赎带来的额外交易成本。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 17.29%，波动率 1.31%，业绩比较基准收益率 13.54%，波动率 1.34%。本报告期本基金 C 净值增长率 17.17%，波动率 1.31%，业绩比较基准收益率 13.54%，波动率 1.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，自 2026 年 4 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日，本基金基金资产净值存在连续 20 个工作日低于 5000 万元的情形。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》（2014 年 8 月 8 日生效）第四十一条的要求，现将该情况在本次报告中予以披露。

§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	27,530,615.47	86.08
	其中：股票	27,530,615.47	86.08
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	3,784,131.67	11.83
8	其他资产	666,118.50	2.08
9	合计	31,980,865.64	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	936,166.00	3.00
C	制造业	16,171,994.89	51.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	891,728.00	2.86
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	30,000.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	711,677.00	2.28
H	住宿和餐饮业	25,186.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	816,253.92	2.61
J	金融业	2,999,886.00	9.61
K	房地产业	288,252.00	0.92

L	租赁和商务服务业	259,908.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	161,863.00	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	99,176.00	0.32
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	25,564.00	0.08
S	综合	40,296.00	0.13
	合计	23,457,950.81	75.15

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

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	203,694.00	0.65
C	制造业	2,998,606.82	9.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	109,509.00	0.35
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	174,112.84	0.56
J	金融业	476,026.00	1.52
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	110,716.00	0.35
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	4,072,664.66	13.05

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	300308	中际旭创	1,000	1,270,000.00	4.07
2	300750	宁德时代	2,700	1,061,127.00	3.40
3	300502	新易盛	1,260	764,820.00	2.45
4	600030	中信证券	22,500	646,425.00	2.07
5	603986	兆易创新	700	570,500.00	1.83
6	601328	交通银行	79,200	509,256.00	1.63
7	002371	北方华创	555	490,930.80	1.57
8	601288	农业银行	77,700	471,639.00	1.51
9	601988	中国银行	82,400	471,328.00	1.51
10	000651	格力电器	12,400	465,000.00	1.49

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

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	603235	天新药业	11,900	264,775.00	0.85
2	000776	广发证券	8,400	196,560.00	0.63
3	601699	潞安环能	12,500	178,500.00	0.57
4	002653	海思科	2,400	159,216.00	0.51
5	601009	南京银行	15,400	152,306.00	0.49

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动	风险说明
----	----	----------	---------	--------	------

				(元)	
IC2609	IC2609	1	1,752,280.00	310,760.00	-
公允价值变动总额合计(元)					310,760.00
股指期货投资本期收益(元)					-50,560.70
股指期货投资本期公允价值变动(元)					463,400.00

5.9.2 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、与标的指数相关性高的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,同时兼顾基差的变化,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。

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	219,887.17
2	应收证券清算款	375,404.55

3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	42,560.01
6	其他应收款	28,266.77
7	其他	—
8	合计	666,118.50

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

项目	建信中证 A500 指数增强 A	建信中证 A500 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	13,686,743.15	11,107,979.75
报告期期间基金总申购份额	2,324,715.51	1,720,332.47
减：报告期期间基金总赎回份额	1,809,077.68	4,218,489.13
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	14,202,380.98	8,609,823.09

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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2026 年 6 月 17 日发布了《关于建信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》，基金管理人于前期以通讯方式组织召集并召开了建信中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金份额持有人大会，审议《关于建信中证 A500 指数增强型证券投资基金持续运作的议案》。根据计票结果，本次大会本人直接出具书面表决意见或授权他人代表出具书面表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额未达到权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一），未达到《中华人民共和国证券投资基金法》规定和《基金合同》约定的本次基金份额持有人大会召开条件，未能成功召集。详情请参见基金管理人相关公告。

§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中证 A500 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 A500 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。

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