

建信沪深 300 指数增强型证券投资基金
(LOF)
2026 年中期报告

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

资产托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 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	6
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	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）	
基金简称	建信沪深 300 指数增强（LOF）	
场内简称	沪深 300 增强	
基金主代码	165310	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 7 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	202,887,273.40 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所	
下属分级基金的基 金简称	建信沪深 300 指数增强（LOF）A	建信沪深 300 指数增强（LOF）C
下属分级基金的场 内简称	沪深 300 增强	—
下属分级基金的交 易代码	165310	009208
报告期末下属分级 基金的份额总额	185,471,022.55 份	17,416,250.85 份

注：本基金管理人于 2026 年 8 月 11 日发布《建信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金变更基金简称的公告》，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及相关基金基金合同等规定，决定自 2026 年 8 月 11 日起，将建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金简称由“建信沪深 300 指数增强”变更为“建信沪深 300 指数增强（LOF）”，下属分级基金的基金简称一并调整。详情请参见本基金管理人的相关公告。

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，以沪深 300 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 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	沪深 300 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。
--	-----------------

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	张姗
	联系电话	010-66228888	400-61-95555
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-81-95533; 010-66228000	400-61-95555
传真		010-66228001	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		曲寅军	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	建信沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	25,028,089.50	8,151,488.12
本期利润	29,133,949.44	10,002,981.89
加权平均基金份 额本期利润	0.1441	0.1431
本期加权平均净 值利润率	9.77%	10.01%
本期基金份额净	10.19%	9.96%

值增长率		
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	196,545,256.83	9,234,020.53
期末可供分配基金份额利润	1.0597	0.5302
期末基金资产净值	290,867,518.31	26,650,271.38
期末基金份额净值	1.5683	1.5302
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	56.83%	51.47%

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

建信沪深 300 指数增强（LOF）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	12.50%	1.16%	11.30%	1.19%	1.20%	-0.03%
过去六个月	10.19%	1.07%	7.20%	1.07%	2.99%	0.00%
过去一年	27.00%	0.94%	25.13%	0.97%	1.87%	-0.03%
过去三年	35.97%	1.04%	28.26%	1.06%	7.71%	-0.02%
过去五年	7.66%	1.04%	-4.02%	1.06%	11.68%	-0.02%
自基金合同生效起	56.83%	1.07%	25.75%	1.09%	31.08%	-0.02%

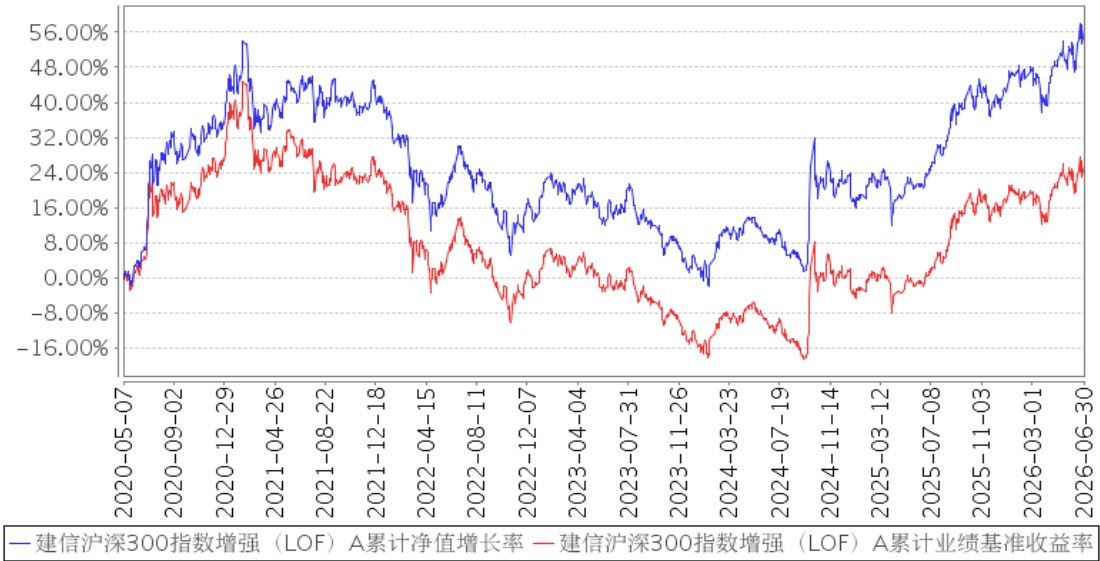
至今						
----	--	--	--	--	--	--

建信沪深 300 指数增强 C

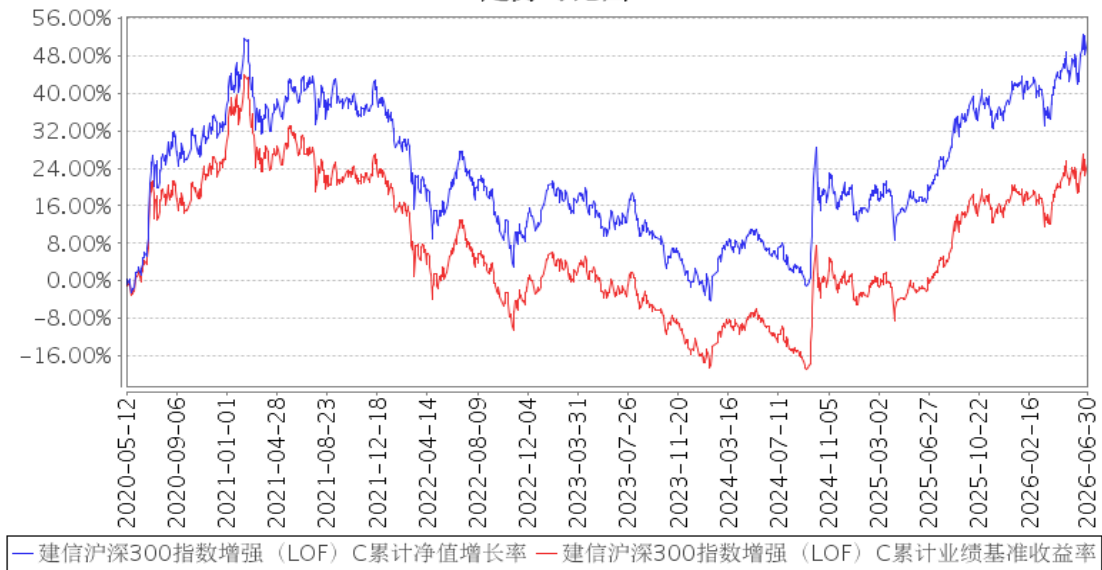
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.38%	1.16%	11.30%	1.19%	1.08%	-0.03%
过去六个月	9.96%	1.07%	7.20%	1.07%	2.76%	0.00%
过去一年	26.47%	0.94%	25.13%	0.97%	1.34%	-0.03%
过去三年	34.35%	1.04%	28.26%	1.06%	6.09%	-0.02%
过去五年	5.52%	1.04%	-4.02%	1.06%	9.54%	-0.02%
自基金合同生效起至今	51.47%	1.07%	25.03%	1.09%	26.44%	-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

建信沪深300指数增强（LOF）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



建信沪深300指数增强（LOF）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1.15万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至2026年6月30日，公司管理运作193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1.24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		
薛玲	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2024 年 1 月 29 日	-	13	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。
梁洪 昀	数量投资 部高级基 金经理， 本基金的 基金经理	2020 年 5 月 7 日	-	23	梁洪昀先生，数量投资部高级基金经理，博士。特许金融分析师 (CFA)。曾任大成基金管理有限公司金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005 年 8 月加入建信基金，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部总监、金融工程及指数投资部总经理、数量投资部总经理等职务。2009 年 11 月 5 日起任建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理；2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 日任建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2011 年 9 月 8 日至 2016 年 7 月 20 日任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2011 年 9 月 8 日至 2016 年 7 月 20 日任建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2012 年 3 月 16 日起任建信深证 100 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 3 月 25 日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理，该基金于 2020 年 5 月 7 日起转型为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)，梁洪昀继续担任该基金的基金经理；2015 年 7 月 31 日至 2018 年 7 月 31 日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 6 日至 2016 年 10 月 25 日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 6 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经

					理；2018 年 2 月 7 日至 2022 年 8 月 8 日任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 4 月 19 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 5 月 16 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2018 年 6 月 13 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内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 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

本报告期内，管理人以量化模型为核心工具，对本基金实施指数增强管理，并同步进行投资风险控制。在行业配置上，组合权重整体与业绩比较基准保持较高的一致性；在个股层面则作了适度的分散与均衡处理，力求在紧密贴合指数表现的基础上，平稳累积超额回报。总体而言，组合结构在控制偏离风险的同时，兼顾了收益增强的目标。

报告期末标的指数成分股按既定规则进行了常规调整，管理人对此保持密切关注，及时对投资组合作出相应调整，实现了平稳过渡。

管理人持续跟踪评估组合的超额收益情况，并结合市场环境变化及量化研究的最新进展，对模型中的各子策略进行调整优化，以增强其对不同市场环境的适应性。在此过程中，通过不断迭代参数设置与策略框架，力求在风险可控的前提下提升模型运行的稳定性与有效性。

从市场表现看，报告期前段标的指数整体运行较为平稳，一季度末波动明显加大；二季度以来指数先是快速反弹，触及高点后转入震荡，部分交易日波动较大。基金维持了适中的换手率水平，在有效控制交易成本的同时，兼顾了对收益因子的合理暴露。整体来看，基金跟踪误差处于中等偏低水平，较好地防范了组合表现相对基准出现大幅偏离的风险。

此外，基金在报告期内适度参与了新股申购，对于中签股份根据市场行情择机在二级市场予以兑现。整体而言，新股投资为组合收益带来了一定的正向贡献，但受新股发行数量及中签数量有限的影响，其对基金整体业绩的拉动作用相对有限。

管理人将持续跟踪、评估并迭代量化模型，结合市场结构的变化不断完善策略体系，力求在有效控制风险的基础上提升策略表现，为基金争取更为稳健、可持续的超额收益。

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 10.19%，波动率 1.07%，业绩比较基准收益率 7.20%，波动率 1.07%。本报告期本基金 C 净值增长率 9.96%，波动率 1.07%，业绩比较基准收益率 7.20%，波动率 1.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，我国经济总体平稳运行，国内生产总值同比增长约 4.7%，生产与出口保持较好增长，消费逐步修复，投资端仍有一定压力，整体呈现“总量稳、结构分化”的运行特征。

展望下半年，我们对中国经济持谨慎乐观的态度。今年是“十五五”规划开局之年，扩大内需、科技自立自强等中长期部署正陆续落地，政策方向较为清晰。总量层面，宏观调控仍有较充足的

空间与工具储备，逆周期调节力度有望视内外部环境适时加强，存量政策落地节奏也可能加快。内需层面，随着促消费政策接续推出和居民收入预期改善，消费有望在低基数上温和回升，服务消费等领域的边际变化值得关注；房地产仍处在调整与转型过程中，企稳需要时间，但对经济总量的拖累或逐步收敛。外需方面，上半年出口好于年初预期，下半年在基数抬升与外部环境变化下增速或有所放缓，市场多元化的进展将更为关键。物价有望保持温和。总体看，我们预计全年经济能够实现预期目标，但结构性分化可能延续。国际方面，主要经济体货币政策路径、地缘局势与全球人工智能投资周期均存在不确定性，可能通过外需、商品价格和风险偏好等渠道形成阶段性扰动。

上半年 A 股市场重心有所上移，结构性特征突出；部分时间受海外市场波动与阶段性流动性扰动影响，部分时间出现较回撤。

展望下半年，我们认为市场出现系统性大幅下行的风险相对可控。主要指数估值相对于无风险利率仍具吸引力；中长期资金入市机制持续完善，资本市场制度建设稳步推进，稳定市场的各类力量在关键时点发挥了积极作用。同时也应看到，部分方向交易较为拥挤、持仓集中度偏高，短期波动可能加大，市场或以震荡整固、结构轮动的方式演进，结构层面的机会或较指数层面更为丰富。节奏上，中报业绩验证、政策落地力度及外部市场变化，可能是影响阶段性走势的重要变量。

本基金将持续密切跟踪宏观经济运行态势与市场变化，努力在跟踪标的指数的基础上争取超额收益。

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，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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	19,196,457.04	27,133,442.39

结算备付金		3,448,973.50	4,498,211.56
存出保证金		56,544.24	582,990.01
交易性金融资产	6.4.7.2	298,408,498.28	386,925,239.28
其中：股票投资		298,408,498.28	386,925,239.28
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,582,469.59	289,159.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		322,692,942.65	419,429,042.30
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025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		-	49.60
应付赎回款		3,639,634.66	2,031,105.14
应付管理人报酬		264,220.47	352,987.85
应付托管费		52,844.07	70,597.55
应付销售服务费		9,025.41	43,366.59
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	1,209,428.35	1,267,694.31
负债合计		5,175,152.96	3,765,801.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	111,738,512.33	194,000,728.87
其他综合收益	6.4.7.11	-	-

未分配利润	6.4.7.12	205,779,277.36	221,662,512.39
净资产合计		317,517,789.69	415,663,241.26
负债和净资产总计		322,692,942.65	419,429,042.30

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 202,887,273.40 份，其中建信沪深 300 指数增强（LOF）A 基金份额总额 185,471,022.55 份，基金份额净值人民币 1.5683 元；建信沪深 300 指数增强 C 基金份额总额 17,416,250.85 份，基金份额净值人民币 1.5302 元。

6.2 利润表

会计主体：建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		41,802,034.04	10,986,297.46
1. 利息收入		64,502.28	74,251.29
其中：存款利息收入	6.4.7.13	64,502.28	72,717.32
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		-	1,533.97
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		35,663,801.25	13,454,013.71
其中：股票投资收益	6.4.7.14	32,226,261.42	5,354,773.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	146,007.12
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	437,169.47	310,113.08
股利收益	6.4.7.19	3,000,370.36	7,643,120.39
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	5,957,353.71	-2,652,454.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.21	116,376.80	110,487.34

号填列)			
减：二、营业总支出		2,665,102.71	4,499,309.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,981,278.59	3,264,345.08
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	396,255.66	652,868.93
3. 销售服务费		201,580.30	442,770.12
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		1,579.38	1,314.64
8. 其他费用	6.4.7.23	84,408.78	138,010.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		39,136,931.33	6,486,987.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		39,136,931.33	6,486,987.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		39,136,931.33	6,486,987.75

6.3 净资产变动表

会计主体：建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	194,000,728.87	-	221,662,512.39	415,663,241.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	194,000,728.87	-	221,662,512.39	415,663,241.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-82,262,216.54	-	-15,883,235.03	-98,145,451.57
（一）、综合收益总额	-	-	39,136,931.33	39,136,931.33

(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)	-82,262,216.54	-	-55,020,166.36	-137,282,382.90
其中: 1. 基金申购款	47,303,892.26	-	75,036,654.67	122,340,546.93
2. 基金赎回款	-129,566,108.80	-	-130,056,821.03	-259,622,929.83
(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	111,738,512.33	-	205,779,277.36	317,517,789.69
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	382,885,584.29	-	302,365,626.17	685,251,210.46
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	382,885,584.29	-	302,365,626.17	685,251,210.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-21,704,939.55	-	-11,459,182.29	-33,164,121.84
(一)、综合收益总额	-	-	6,486,987.75	6,486,987.75
(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)	-21,704,939.55	-	-17,946,170.04	-39,651,109.59

其中：1. 基金申购款	35,813,562.48	-	38,382,591.30	74,196,153.78
2. 基金赎回款	-57,518,502.03	-	-56,328,761.34	-113,847,263.37
（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	361,180,644.74	-	290,906,443.88	652,087,088.62

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：

<u>谢海玉</u>	<u>莫红</u>	<u>丁颖</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）是由原建信双利策略主题分级股票型证券投资基金转型而来。根据原建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司发布的《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，转型日为 2020 年 5 月 7 日，基金名称相应变更为“建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）”，建信双利策略主题分级股票型证券投资基金份额转换为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）份额。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2020 年 5 月 7 日起《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》生效，原《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金托管协议》自同一起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，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、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额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。本基金不同基金份额类别之间可以互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券等）、货币市场工具（含同业存单）、银行存款、债券回购、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：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 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，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。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款税后利率 $\times$ 5%。

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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集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》和中国证监会、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 2026 年 6 月 30 日的财

务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 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；

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 11 号文《财政部 税务总局关于黄金有关税收政策的公告》的规定，会员单位或客户通过上海黄金交易所、上海期货交易所交易标准黄金，卖出方会员单位或客户销售标准黄金时，免征增值税；

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》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）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；

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。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	19,196,457.04
等于：本金	19,194,525.11
加：应计利息	1,931.93
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	19,196,457.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	269,115,415.08	-	298,408,498.28	29,293,083.20
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	269,115,415.08	-	298,408,498.28	29,293,083.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,185.98
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,128,326.13
其中：交易所市场	1,128,326.13
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,916.24
合计	1,209,428.35

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信沪深 300 指数增强 (LOF) A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	203,606,503.63	103,545,121.39
本期申购	72,882,384.55	37,064,757.71
本期赎回 (以“-”号填列)	-91,017,865.63	-46,287,617.62
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	185,471,022.55	94,322,261.48

建信沪深 300 指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	90,455,607.48	90,455,607.48
本期申购	10,239,134.55	10,239,134.55
本期赎回 (以“-”号填列)	-83,278,491.18	-83,278,491.18
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	17,416,250.85	17,416,250.85

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

建信沪深 300 指数增强 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	246,025,921.16	-59,781,794.94	186,244,126.22
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	246,025,921.16	-59,781,794.94	186,244,126.22
本期利润	25,028,089.50	4,105,859.94	29,133,949.44
本期基金份额交易产生的变动数	-23,869,187.77	5,036,368.94	-18,832,818.83
其中：基金申购款	92,801,019.56	-22,299,541.63	70,501,477.93
基金赎回款	-116,670,207.33	27,335,910.57	-89,334,296.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	247,184,822.89	-50,639,566.06	196,545,256.83

建信沪深 300 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,010,842.65	-26,592,456.48	35,418,386.17
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	62,010,842.65	-26,592,456.48	35,418,386.17
本期利润	8,151,488.12	1,851,493.77	10,002,981.89
本期基金份额交易产生的变动数	-56,157,506.73	19,970,159.20	-36,187,347.53
其中：基金申购款	7,695,677.67	-3,160,500.93	4,535,176.74
基金赎回款	-63,853,184.40	23,130,660.13	-40,722,524.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,004,824.04	-4,770,803.51	9,234,020.53

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	48,440.75
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	15,975.84
其他	85.69
合计	64,502.28

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	32,226,261.42
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	32,226,261.42

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	1,047,389,635.66
减：卖出股票成本总额	1,014,140,646.96
减：交易费用	1,022,727.28
买卖股票差价收入	32,226,261.42

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	437,169.47

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,000,370.36
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	3,000,370.36

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,975,913.71
股票投资	5,975,913.71

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	-18,560.00
权证投资	-
期货投资	-18,560.00
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	5,957,353.71

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	110,860.43
基金转换费收入	5,516.37
合计	116,376.80

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	10,908.87
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,992.54
银行间账户维护费	9,000.00
合计	84,408.78

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、关联关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,981,278.59	3,264,345.08
其中：应支付销售机构的客户维护费	871,344.72	1,134,842.77
应支付基金管理人的净管理费	1,109,933.87	2,129,502.31

注：支付基金管理人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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	396,255.66	652,868.93

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信沪深 300 指数增强（LOF）A	建信沪深 300 指数增强（LOF）C	合计
建信基金	-	128.87	128.87
招商银行	-	314.36	314.36
中国建设银行	-	41,773.63	41,773.63
合计	-	42,216.86	42,216.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信沪深 300 指数增强（LOF）A	建信沪深 300 指数增强（LOF）C	合计
建信基金	-	247.51	247.51
招商银行	-	1,261.94	1,261.94
中国建设银行	-	40,446.98	40,446.98
合计	-	41,956.43	41,956.43

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
招商银行-活期	19,196,457.04	48,440.75	34,610,989.22	49,387.69

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（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券	成功认购	受限期	流通受限	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	日		类型		单价	位： 股)			
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新发未上市	53.26	58.74	189	10,066.14	11,101.86	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新发未上市	10.11	10.11	10,990	111,108.90	111,108.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新发未上市	10.11	10.11	4,709	47,607.99	47,607.99	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新发未上市	10.12	27.73	1,752	17,730.24	48,582.96	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新发未上市	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新发未上市	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新发未上市	46.08	463.33	671	30,919.68	310,894.43	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新发未上市	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新发未上市	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新发未上市	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新发未上市	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新发未上市	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新发未上市	17.70	84.32	292	5,168.40	24,621.44	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新发未上市	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新发未上市	44.56	468.67	131	5,837.36	61,395.77	-

6.4.12.2 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
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	300	246,262.68	263,859.00	-

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。基金管理人会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 2026 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	19,196,457.04	-	-	-	19,196,457.04
结算备付金	3,448,973.50	-	-	-	3,448,973.50
存出保证金	56,544.24	-	-	-	56,544.24
交易性金融资产	-	-	-	298,408,498.28	298,408,498.28
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	-	-	-	1,582,469.59	1,582,469.59
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,701,974.78	-	-	299,990,967.87	322,692,942.65
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	-	-	-	3,639,634.66	3,639,634.66
应付管理人报酬	-	-	-	264,220.47	264,220.47
应付托管费	-	-	-	52,844.07	52,844.07
应付销售服务费	-	-	-	9,025.41	9,025.41
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,209,428.35	1,209,428.35
负债总计	-	-	-	5,175,152.96	5,175,152.96
利率敏感度缺口	22,701,974.78	-	-	-294,815,814.91	317,517,789.69
上年度末 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	27,133,442.39	-	-	-	27,133,442.39
结算备付金	4,498,211.56	-	-	-	4,498,211.56
存出保证金	582,990.01	-	-	-	582,990.01
交易性金融资产	-	-	-	386,925,239.28	386,925,239.28
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	100.00	-	-	289,059.06	289,159.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,214,743.96	-	-	387,214,298.34	419,429,042.30
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	-	-	-	49.60	49.60
应付赎回款	-	-	-	2,031,105.14	2,031,105.14
应付管理人报酬	-	-	-	352,987.85	352,987.85
应付托管费	-	-	-	70,597.55	70,597.55
应付销售服务费	-	-	-	43,366.59	43,366.59
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,267,694.31	1,267,694.31
负债总计	-	-	-	3,765,801.04	3,765,801.04
利率敏感度缺口	32,214,743.96	-	-	-383,448,497.30	415,663,241.26

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	298,408,498.28	93.98	386,925,239.28	93.09
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	298,408,498.28	93.98	386,925,239.28	93.09

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	15,270,354.95	20,195,501.09
	业绩比较基准下降 5%	-15,270,354.95	-20,195,501.09

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	297,416,272.71	382,276,791.46
第二层次	422,575.89	4,079,650.00
第三层次	569,649.68	568,797.82
合计	298,408,498.28	386,925,239.28

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	298,408,498.28	92.47
	其中：股票	298,408,498.28	92.47
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	22,645,430.54	7.02
8	其他各项资产	1,639,013.83	0.51
9	合计	322,692,942.65	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	1,399.60	-
B	采矿业	11,853,689.00	3.73
C	制造业	143,064,504.52	45.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,185,536.00	3.21
E	建筑业	180,684.00	0.06
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,087,373.00	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,796,334.10	4.03
J	金融业	51,251,658.16	16.14
K	房地产业	1,151,414.00	0.36
L	租赁和商务服务业	2,883,414.00	0.91
M	科学研究和技术服务业	2,913,534.00	0.92
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	239,369,540.38	75.39

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	1,053,891.00	0.33
C	制造业	47,036,030.22	14.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	766,723.89	0.24
E	建筑业	187,710.00	0.06
F	批发和零售业	3,568,289.00	1.12
G	交通运输、仓储和邮政业	489,891.00	0.15
H	住宿和餐饮业	239,267.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,776,060.79	0.56
J	金融业	1,454,065.00	0.46
K	房地产业	1,826.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,022,960.00	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	442,244.00	0.14
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	59,038,957.90	18.59

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	300308	中际旭创	14,300	18,161,000.00	5.72
2	300750	宁德时代	34,742	13,653,953.42	4.30
3	600519	贵州茅台	8,612	10,209,439.88	3.22
4	300502	新易盛	12,424	7,541,368.00	2.38
5	603986	兆易创新	8,600	7,009,000.00	2.21
6	601398	工商银行	850,500	6,013,035.00	1.89
7	002384	东山精密	20,000	5,247,000.00	1.65
8	000166	申万宏源	1,162,900	5,116,760.00	1.61
9	600030	中信证券	156,700	4,501,991.00	1.42
10	600028	中国石化	1,001,800	4,468,028.00	1.41
11	601988	中国银行	699,300	3,999,996.00	1.26
12	002916	深南电路	8,100	3,708,990.00	1.17
13	601899	紫金矿业	146,000	3,670,440.00	1.16
14	601288	农业银行	601,100	3,648,677.00	1.15
15	003816	中国广核	918,200	3,590,162.00	1.13
16	601318	中国平安	75,113	3,585,894.62	1.13
17	600941	中国移动	41,600	3,583,008.00	1.13
18	600183	生益科技	20,600	3,572,040.00	1.12
19	002463	沪电股份	23,100	3,529,680.00	1.11
20	600919	江苏银行	302,600	3,262,028.00	1.03
21	688256	寒武纪	1,982	3,162,380.10	1.00
22	601995	中金公司	86,000	3,108,900.00	0.98
23	600176	中国巨石	40,900	2,980,792.00	0.94
24	603259	药明康德	23,400	2,913,534.00	0.92
25	601766	中国中车	550,700	2,863,640.00	0.90
26	000338	潍柴动力	102,400	2,790,400.00	0.88
27	600900	长江电力	101,500	2,686,705.00	0.85
28	002475	立讯精密	38,000	2,675,200.00	0.84
29	002415	海康威视	77,800	2,660,760.00	0.84
30	002027	分众传媒	544,700	2,636,348.00	0.83
31	300408	三环集团	15,700	2,620,330.00	0.83
32	300661	圣邦股份	18,000	2,582,640.00	0.81
33	000858	五粮液	33,509	2,479,666.00	0.78
34	601211	国泰海通	135,000	2,457,000.00	0.77
35	601006	大秦铁路	490,900	2,263,049.00	0.71
36	688008	澜起科技	7,200	2,231,280.00	0.70
37	601138	工业富联	29,589	2,134,846.35	0.67
38	688506	百利天恒	7,200	2,117,016.00	0.67
39	600276	恒瑞医药	39,490	2,055,059.60	0.65

40	600346	恒力石化	115,400	2,043,734.00	0.64
41	600886	国投电力	149,900	1,995,169.00	0.63
42	688981	中芯国际	12,174	1,933,474.68	0.61
43	300394	天孚通信	6,300	1,906,884.00	0.60
44	000792	盐湖股份	61,100	1,844,609.00	0.58
45	000333	美的集团	23,800	1,797,614.00	0.57
46	000657	中钨高新	18,600	1,780,392.00	0.56
47	688111	金山办公	8,300	1,768,315.00	0.56
48	000651	格力电器	46,500	1,743,750.00	0.55
49	601328	交通银行	262,600	1,688,518.00	0.53
50	000001	平安银行	160,200	1,610,010.00	0.51
51	600000	浦发银行	186,637	1,606,944.57	0.51
52	300014	亿纬锂能	24,500	1,593,235.00	0.50
53	600025	华能水电	173,900	1,545,971.00	0.49
54	601658	邮储银行	286,600	1,412,938.00	0.44
55	601009	南京银行	141,200	1,396,468.00	0.44
56	601998	中信银行	199,000	1,379,070.00	0.43
57	688041	海光信息	3,600	1,333,080.00	0.42
58	600690	海尔智家	64,890	1,324,404.90	0.42
59	600372	中航机载	120,900	1,311,765.00	0.41
60	601360	三六零	148,500	1,290,465.00	0.41
61	688396	华润微	12,500	1,219,375.00	0.38
62	000725	京东方 A	139,000	1,206,520.00	0.38
63	300059	东方财富	58,934	1,201,074.92	0.38
64	603893	瑞芯微	6,300	1,186,668.00	0.37
65	688521	芯原股份	3,100	1,150,534.00	0.36
66	002558	巨人网络	41,100	1,132,716.00	0.36
67	000776	广发证券	48,000	1,123,200.00	0.35
68	300033	同花顺	4,540	1,094,140.00	0.34
69	002422	科伦药业	26,300	1,013,076.00	0.32
70	600048	保利发展	218,800	1,013,044.00	0.32
71	600999	招商证券	47,500	1,002,250.00	0.32
72	600489	中金黄金	55,500	1,001,775.00	0.32
73	301308	江波龙	1,400	985,320.00	0.31
74	600887	伊利股份	38,800	929,648.00	0.29
75	600309	万华化学	13,500	923,535.00	0.29
76	600150	中国船舶	26,781	904,929.99	0.29
77	002493	荣盛石化	82,300	884,725.00	0.28
78	002311	海大集团	18,800	838,668.00	0.26
79	603993	洛阳钼业	47,400	831,870.00	0.26
80	600019	宝钢股份	139,800	759,114.00	0.24
81	600893	航发动力	19,500	747,630.00	0.24
82	688036	传音控股	12,100	713,295.00	0.22

83	601066	中信建投	24,400	709,308.00	0.22
84	000100	TCL 科技	119,900	697,818.00	0.22
85	600989	宝丰能源	33,100	672,923.00	0.21
86	600938	中国海油	21,100	572,865.00	0.18
87	600188	兖矿能源	32,100	570,417.00	0.18
88	002371	北方华创	600	530,736.00	0.17
89	000425	徐工机械	65,000	525,850.00	0.17
90	002028	思源电气	3,000	519,000.00	0.16
91	600660	福耀玻璃	10,000	504,400.00	0.16
92	600104	上汽集团	51,500	502,640.00	0.16
93	002142	宁波银行	16,430	487,806.70	0.15
94	600426	华鲁恒升	19,100	456,872.00	0.14
95	605117	德业股份	4,200	445,956.00	0.14
96	601058	赛轮轮胎	37,700	434,681.00	0.14
97	688012	中微公司	925	433,362.50	0.14
98	600584	长电科技	3,800	393,490.00	0.12
99	600115	中国东航	102,200	389,382.00	0.12
100	601728	中国电信	74,700	387,693.00	0.12
101	601600	中国铝业	46,800	384,696.00	0.12
102	600795	国电电力	78,700	367,529.00	0.12
103	601898	中煤能源	28,300	344,694.00	0.11
104	601225	陕西煤业	16,000	325,600.00	0.10
105	000708	中信特钢	24,500	309,190.00	0.10
106	000408	藏格矿业	4,400	305,008.00	0.10
107	688072	拓荆科技	300	263,859.00	0.08
108	601888	中国中免	4,600	247,066.00	0.08
109	300476	胜宏科技	600	207,858.00	0.07
110	300628	亿联网络	5,900	199,538.00	0.06
111	601688	华泰证券	8,600	177,332.00	0.06
112	600845	宝信软件	9,600	159,648.00	0.05
113	688126	沪硅产业	3,500	139,615.00	0.04
114	600515	海南机场	50,500	138,370.00	0.04
115	688082	盛美上海	300	129,600.00	0.04
116	600522	中天科技	2,100	127,428.00	0.04
117	002532	天山铝业	10,400	111,592.00	0.04
118	688183	生益电子	800	105,920.00	0.03
119	601117	中国化学	13,600	99,960.00	0.03
120	603392	万泰生物	3,600	97,092.00	0.03
121	601816	京沪高铁	21,400	96,942.00	0.03
122	000538	云南白药	2,000	94,740.00	0.03
123	002648	卫星化学	3,900	91,611.00	0.03
124	601872	招商轮船	5,200	91,364.00	0.03
125	600741	华域汽车	5,800	90,016.00	0.03

126	601628	中国人寿	2,501	88,410.35	0.03
127	600809	山西汾酒	800	87,496.00	0.03
128	601021	春秋航空	1,900	86,602.00	0.03
129	300124	汇川技术	1,300	86,229.00	0.03
130	600015	华夏银行	13,400	85,626.00	0.03
131	600482	中国动力	2,600	85,280.00	0.03
132	600926	杭州银行	5,900	85,255.00	0.03
133	601166	兴业银行	5,100	84,456.00	0.03
134	600029	南方航空	16,300	84,434.00	0.03
135	601059	信达证券	5,200	84,188.00	0.03
136	601818	光大银行	28,900	83,521.00	0.03
137	600050	中国联通	20,400	81,600.00	0.03
138	601668	中国建筑	18,600	80,724.00	0.03
139	600406	国电南瑞	3,500	79,975.00	0.03
140	600016	民生银行	24,800	79,856.00	0.03
141	601727	上海电气	11,100	77,700.00	0.02
142	601601	中国太保	2,700	77,004.00	0.02
143	600233	圆通速递	4,800	75,600.00	0.02
144	000807	云铝股份	3,200	70,848.00	0.02
145	000975	山金国际	4,000	68,000.00	0.02
146	601100	恒立液压	500	53,780.00	0.02
147	002938	鹏鼎控股	200	21,076.00	0.01
148	000568	泸州老窖	200	15,504.00	0.00
149	600111	北方稀土	300	14,415.00	0.00
150	600362	江西铜业	200	8,660.00	0.00
151	000977	浪潮信息	100	7,000.00	0.00
152	002460	赣锋锂业	100	6,540.00	0.00
153	605499	东鹏饮料	40	4,937.20	0.00
154	002714	牧原股份	40	1,399.60	0.00

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	688220	翱捷科技	33,100	4,114,992.00	1.30
2	003031	中瓷电子	10,900	1,965,270.00	0.62
3	001287	中电港	55,400	1,725,710.00	0.54
4	688372	伟测科技	8,600	1,599,600.00	0.50
5	688385	复旦微电	21,700	1,546,993.00	0.49
6	601108	财通证券	168,100	1,454,065.00	0.46
7	600885	宏发股份	41,700	1,438,233.00	0.45
8	300842	帝科股份	15,800	1,408,886.00	0.44
9	301086	鸿富瀚	6,440	1,347,763.20	0.42
10	688235	百济神州	5,200	1,323,972.00	0.42
11	688001	华兴源创	14,200	1,216,940.00	0.38

12	601869	长飞光纤	2,200	1,200,980.00	0.38
13	002379	宏桥控股	80,500	1,188,985.00	0.37
14	002497	雅化集团	54,700	1,114,239.00	0.35
15	000581	威孚高科	57,600	980,352.00	0.31
16	300223	北京君正	3,900	970,710.00	0.31
17	603195	公牛集团	23,600	923,940.00	0.29
18	600487	亨通光电	8,200	896,588.00	0.28
19	301510	固高科技	27,900	890,847.00	0.28
20	688469	芯联集成	82,900	879,569.00	0.28
21	601061	中信金属	81,300	875,601.00	0.28
22	300373	扬杰科技	5,300	833,319.00	0.26
23	603198	迎驾贡酒	27,100	802,160.00	0.25
24	002156	通富微电	10,200	773,874.00	0.24
25	002281	光迅科技	3,000	770,820.00	0.24
26	601168	西部矿业	24,600	667,644.00	0.21
27	688279	峰岬科技	2,800	628,432.00	0.20
28	688257	新锐股份	6,160	627,704.00	0.20
29	001289	龙源电力	38,900	608,007.00	0.19
30	601968	宝钢包装	150,100	588,392.00	0.19
31	301536	星辰科技	4,400	566,324.00	0.18
32	001309	德明利	600	565,740.00	0.18
33	000034	神州数码	19,600	543,900.00	0.17
34	301629	矽电股份	1,200	516,480.00	0.16
35	600801	华新建材	32,000	499,200.00	0.16
36	688307	中润光学	5,900	471,705.00	0.15
37	300001	特锐德	12,200	461,526.00	0.15
38	688052	纳芯微	1,569	452,358.39	0.14
39	603992	松霖科技	13,900	450,360.00	0.14
40	688226	威腾电气	10,400	445,432.00	0.14
41	002266	浙富控股	87,400	442,244.00	0.14
42	300953	震裕科技	3,300	441,210.00	0.14
43	688710	益诺思	6,300	423,360.00	0.13
44	000683	博源化工	73,400	422,784.00	0.13
45	600787	中储股份	98,100	410,058.00	0.13
46	688503	聚和材料	3,000	398,100.00	0.13
47	000822	山东海化	95,900	385,518.00	0.12
48	688011	新光光电	5,500	384,285.00	0.12
49	301626	苏州天脉	1,000	383,960.00	0.12
50	300969	恒帅股份	4,080	382,540.80	0.12
51	603606	东方电缆	9,100	377,741.00	0.12
52	000703	恒逸石化	27,700	375,889.00	0.12
53	300818	耐普矿机	19,870	375,543.00	0.12
54	002409	雅克科技	1,600	359,200.00	0.11

55	603225	新凤鸣	17,700	347,805.00	0.11
56	688208	道通科技	13,400	337,546.00	0.11
57	688107	安路科技	7,300	332,880.00	0.10
58	000717	中南股份	156,500	314,565.00	0.10
59	301666	大普微	671	310,894.43	0.10
60	688678	福立旺	12,800	309,376.00	0.10
61	600655	豫园股份	72,400	297,564.00	0.09
62	603256	宏和科技	1,100	291,863.00	0.09
63	601233	桐昆股份	12,500	270,625.00	0.09
64	001389	广合科技	1,100	260,975.00	0.08
65	600711	盛屯矿业	22,100	242,437.00	0.08
66	600754	锦江酒店	13,300	239,267.00	0.08
67	688766	普冉股份	300	229,980.00	0.07
68	000933	神火股份	9,700	205,640.00	0.06
69	688411	海博思创	700	203,840.00	0.06
70	688233	神工股份	900	192,978.00	0.06
71	300072	海新能科	55,200	187,680.00	0.06
72	688239	航宇科技	3,100	185,473.00	0.06
73	688347	华虹宏力	500	168,150.00	0.05
74	600409	三友化工	26,400	161,304.00	0.05
75	001248	华润新能源	15,699	158,716.89	0.05
76	688409	富创精密	500	153,125.00	0.05
77	688486	龙迅股份	2,380	151,320.40	0.05
78	688173	希荻微	7,900	151,206.00	0.05
79	688048	长光华芯	300	150,600.00	0.05
80	688166	博瑞医药	4,200	147,042.00	0.05
81	300677	英科医疗	3,700	144,929.00	0.05
82	688150	莱特光电	2,100	144,102.00	0.05
83	300751	迈为股份	500	141,230.00	0.04
84	300919	中伟新材	3,200	140,000.00	0.04
85	301326	捷邦科技	1,000	139,370.00	0.04
86	300604	长川科技	400	136,568.00	0.04
87	300857	协创数据	400	135,960.00	0.04
88	605358	立昂微	1,700	131,920.00	0.04
89	688322	奥比中光	1,000	130,550.00	0.04
90	600285	羚锐制药	6,700	129,846.00	0.04
91	688213	思特威	1,200	128,484.00	0.04
92	603083	剑桥科技	500	127,435.00	0.04
93	300458	全志科技	3,200	126,272.00	0.04
94	688172	燕东微	1,500	125,490.00	0.04
95	688262	国芯科技	2,900	125,367.00	0.04
96	688378	奥来德	2,000	124,000.00	0.04
97	688717	艾罗能源	1,500	123,855.00	0.04

98	688582	芯动联科	1,900	123,500.00	0.04
99	688599	天合光能	8,700	122,844.00	0.04
100	002436	兴森科技	2,400	122,280.00	0.04
101	600105	永鼎股份	1,800	121,464.00	0.04
102	300475	香农芯创	400	120,000.00	0.04
103	603025	大豪科技	8,700	118,668.00	0.04
104	300672	国科微	400	118,000.00	0.04
105	688777	中控技术	1,000	117,500.00	0.04
106	301217	铜冠铜箔	700	115,549.00	0.04
107	688195	腾景科技	600	115,548.00	0.04
108	002484	江海股份	1,100	115,500.00	0.04
109	603958	哈森股份	6,800	115,192.00	0.04
110	603124	江南新材	600	112,188.00	0.04
111	300548	长芯博创	400	111,200.00	0.04
112	688349	三一重能	7,280	110,510.40	0.03
113	600498	烽火通信	1,500	110,400.00	0.03
114	600606	绿地控股	90,000	108,900.00	0.03
115	605376	博迁新材	400	108,520.00	0.03
116	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.03
117	603327	福蓉科技	11,400	96,672.00	0.03
118	688180	君实生物	2,800	94,696.00	0.03
119	300765	石药创新	3,400	92,582.00	0.03
120	301345	涛涛车业	400	92,400.00	0.03
121	000623	吉林敖东	5,100	90,423.00	0.03
122	002008	大族激光	600	90,066.00	0.03
123	000800	一汽解放	14,600	86,870.00	0.03
124	002017	东信和平	5,800	84,854.00	0.03
125	600535	天士力	6,400	84,672.00	0.03
126	603268	松发股份	600	83,568.00	0.03
127	688809	强一股份	130	80,990.00	0.03
128	603868	飞科电器	2,600	80,080.00	0.03
129	688059	华锐精密	400	79,884.00	0.03
130	600377	宁沪高速	6,900	79,833.00	0.03
131	600170	上海建工	35,500	78,810.00	0.02
132	300620	光库科技	200	75,640.00	0.02
133	002922	伊戈尔	2,300	75,440.00	0.02
134	600577	精达股份	7,600	74,328.00	0.02
135	603305	旭升集团	6,100	73,932.00	0.02
136	600546	山煤国际	6,600	72,138.00	0.02
137	301200	大族数控	200	72,130.00	0.02
138	002128	电投能源	3,100	71,672.00	0.02
139	601777	千里科技	8,600	70,176.00	0.02
140	688388	嘉元科技	1,450	63,800.00	0.02

141	002064	华峰化学	6,700	63,583.00	0.02
142	300855	图南股份	2,000	62,520.00	0.02
143	688658	悦康药业	4,800	61,728.00	0.02
144	688797	臻宝科技	131	61,395.77	0.02
145	001399	惠科股份	1,752	48,582.96	0.02
146	301219	腾远钴业	780	42,744.00	0.01
147	688607	康众医疗	792	40,392.00	0.01
148	603516	淳中科技	300	40,383.00	0.01
149	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
150	002850	科达利	200	37,860.00	0.01
151	301285	鸿日达	300	33,099.00	0.01
152	001311	多利科技	1,550	25,001.50	0.01
153	603459	红板科技	292	24,621.44	0.01
154	688318	财富趋势	300	21,393.00	0.01
155	688375	国博电子	200	20,860.00	0.01
156	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.01
157	688676	金盘科技	200	16,928.00	0.01
158	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
159	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
160	001237	惠康科技	189	11,101.86	0.00
161	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
162	001369	双欣材料	707	9,558.64	0.00
163	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
164	603160	汇顶科技	100	6,171.00	0.00
165	301177	迪阿股份	200	5,514.00	0.00
166	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
167	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
168	000014	沙河股份	200	1,826.00	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	600150	中国船舶	8,696,921.19	2.09
2	000001	平安银行	8,585,596.00	2.07
3	601398	工商银行	8,234,529.00	1.98
4	000338	潍柴动力	7,937,946.00	1.91
5	600519	贵州茅台	7,765,370.00	1.87
6	002916	深南电路	7,668,150.00	1.84
7	300308	中际旭创	7,604,455.00	1.83
8	601766	中国中车	7,592,172.00	1.83
9	600941	中国移动	7,566,771.00	1.82
10	600900	长江电力	7,464,181.00	1.80
11	601988	中国银行	7,441,520.00	1.79

12	601138	工业富联	7,399,053.00	1.78
13	601318	中国平安	7,247,185.00	1.74
14	000858	五粮液	7,214,100.22	1.74
15	600028	中国石化	7,075,474.00	1.70
16	601658	邮储银行	6,964,334.00	1.68
17	300750	宁德时代	6,885,411.00	1.66
18	601166	兴业银行	6,753,140.00	1.62
19	600030	中信证券	6,691,433.00	1.61
20	601288	农业银行	6,569,729.00	1.58

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	601899	紫金矿业	16,659,937.20	4.01
2	600519	贵州茅台	13,596,011.00	3.27
3	601166	兴业银行	13,049,358.00	3.14
4	000333	美的集团	12,795,760.18	3.08
5	300750	宁德时代	12,598,624.94	3.03
6	300308	中际旭创	12,145,347.00	2.92
7	002475	立讯精密	11,617,907.00	2.80
8	000001	平安银行	11,410,878.00	2.75
9	002415	海康威视	10,525,505.16	2.53
10	601138	工业富联	10,404,564.00	2.50
11	601318	中国平安	10,281,221.00	2.47
12	603993	洛阳钼业	10,089,273.00	2.43
13	601728	中国电信	9,593,574.00	2.31
14	600011	华能国际	9,456,053.00	2.27
15	600999	招商证券	9,173,131.08	2.21
16	300274	阳光电源	8,736,336.80	2.10
17	600150	中国船舶	8,672,651.70	2.09
18	601857	中国石油	8,603,614.50	2.07
19	600030	中信证券	8,520,222.58	2.05
20	600919	江苏银行	8,390,882.00	2.02
21	601211	国泰海通	8,330,092.00	2.00

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。

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	919,647,992.25
卖出股票收入（成交）总额	1,047,389,635.66

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。

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系根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑基差成本、流动性等因素选择合适的合约。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。

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	56,544.24
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	1, 582, 469. 59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1, 639, 013. 83

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

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 (%)
建信沪深 300 指数 增 强 (LOF) A	79, 901	2, 321. 26	41. 60	0. 00	185, 470, 980. 95	100. 00
建信沪深 300 指数 增 强 (LOF) C	3, 966	4, 391. 39	0. 00	0. 00	17, 416, 250. 85	100. 00
合计	83, 867	2, 419. 16	41. 60	0. 00	202, 887, 231. 80	100. 00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占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）。

8.2 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	建信沪深 300 指数增强（LOF）A	28,569.66	0.02
	建信沪深 300 指数增强 C	1,504.82	0.01
	合计	30,074.48	0.01

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）。

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	份额级别	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	建信沪深 300 指数增强（LOF）A	—
	建信沪深 300 指数增强 C	—
	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	建信沪深 300 指数增强（LOF）A	0~10
	建信沪深 300 指数增强 C	—
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信沪深 300 指数增强（LOF）A	建信沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日（2020 年 5 月 7 日）基金份额总额	113,430,363.29	—
本报告期期初基金份额总额	203,606,503.63	90,455,607.48
本报告期基金总申购份额	72,882,384.55	10,239,134.55
减：本报告期基金总赎回份额	91,017,865.63	83,278,491.18
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	185,471,022.55	17,416,250.85

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 2026 年 1 月 17 日发布公告，自 2026 年 1 月 16 日起聘任安晔先生担任建信基金管理有限责任公司首席信息官；基金管理人于 2026 年 5 月 27 日发布公告，自 2026 年 5 月 25 日起聘任曲寅军先生担任建信基金管理有限责任公司董事长，生柳荣先生不再担任建信基金管理有限责任公司董事长。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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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毕马威华振会计师事务所（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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
中信证券	1	1,224,883,795.91	62.29	227,701.71	61.05	-
国泰海通证券	1	456,180,081.14	23.20	89,368.08	23.96	-
广发证券	2	285,272,033.85	14.51	55,885.08	14.98	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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	关于新增华创证券有限责任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	2026 年 1 月 21 日
2	关于新增易方达财富管理基金销售 (广州) 有限公司为建信消费升级混合型证券投资基金等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2026 年 1 月 7 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	2026 年 01 月	70,000,00	0.00	70,000,00	0.00	0.00

		01 日-2026 年 05 月 12 日	0.00		0.00		
--	--	--------------------------	------	--	------	--	--

注：本基金本报告期末不存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 2、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司
2026 年 8 月 28 日