

建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式 指数证券投资基金 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：中国国际金融股份有限公司

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。

资产托管人中国国际金融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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
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	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	建信 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	建信 MSCI（扩位简称：MSCIA 股 ETF 建信）
基金主代码	512180
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 19 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国国际金融股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,048,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 21 日

注：本基金管理人于 2026 年 1 月 22 日发布《建信基金管理有限责任公司关于旗下部分 ETF 变更扩位简称的公告》，经向上海证券交易所申请并获得同意，决定自 2026 年 1 月 22 日起变更旗下部分 ETF 的扩位简称。建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金扩位简称由“MSCIA 股 ETF 基金”变更为“MSCIA 股 ETF 建信”。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	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	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
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 MSCI 中国 A 股国际通指数(英文：MSCI China A Inclusion RMB Index)。
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，属于高风险/高收益的开放式基金。

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	中国国际金融股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	刘晴川
	联系电话	010-66228888	010-65051166
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	AC_Product@cicc.com.cn

客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	010-65353060; 010-65351622
传真	010-66228001	010-65059873
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
邮政编码	100033	100004
法定代表人	曲寅军	陈亮

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)
本期已实现收益	4,075,228.85
本期利润	7,362,681.06
加权平均基金份额本期利润	0.1440
本期加权平均净值利润率	8.29%
本期基金份额净值增长率	8.77%
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	40,123,377.53
期末可供分配基金份额利润	0.8351
期末基金资产净值	88,171,377.53
期末基金份额净值	1.8351
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	83.51%

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

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

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

低于所列数字。

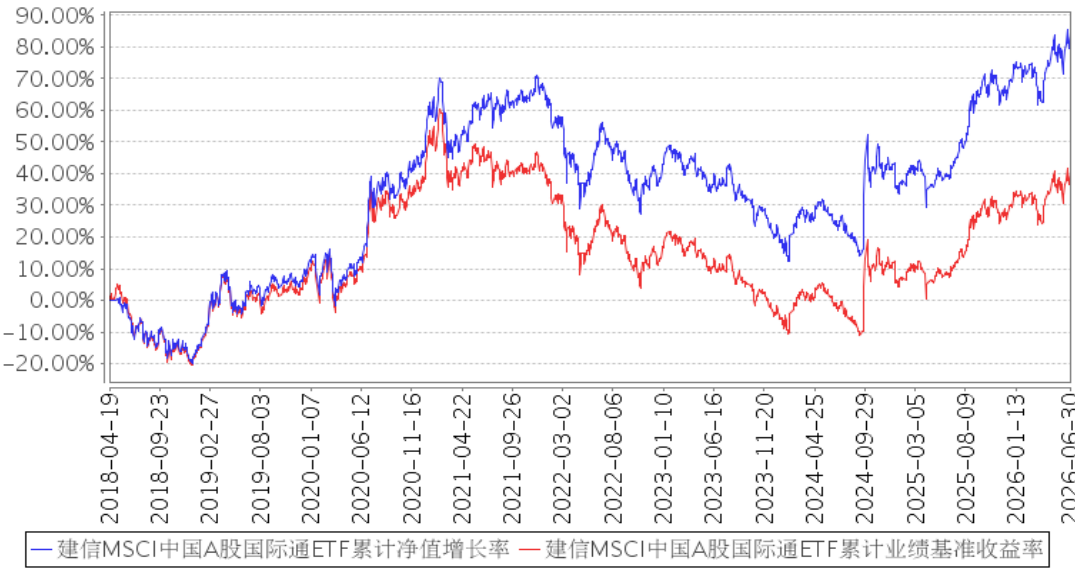
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率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	12.54%	1.27%	11.74%	1.30%	0.80%	-0.03%
过去六个月	8.77%	1.15%	7.81%	1.18%	0.96%	-0.03%
过去一年	29.18%	1.02%	26.95%	1.04%	2.23%	-0.02%
过去三年	34.66%	1.11%	27.14%	1.13%	7.52%	-0.02%
过去五年	11.54%	1.09%	-5.77%	1.12%	17.31%	-0.03%
过去七年	78.37%	1.14%	37.95%	1.17%	40.42%	-0.03%
自基金合同生效起至今	83.51%	1.18%	39.56%	1.21%	43.95%	-0.03%

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MSCI中国A股国际通ETF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		
梁洪昀	数量投资部高级基金经理，本基金的基金经理	2018 年 4 月 19 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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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，本基金始终保持较高仓位运行，力求紧密跟踪标的指数、控制跟踪误差，同时满足基金上市交易的运作需要。

报告期内标的指数先后进行了两次例行成分股调整。在指数编制机构发布相关信息后，管理人及时跟进，对投资组合和申购赎回清单作出相应调整，使跟踪误差与偏离度较好地控制在基金合同约定的范围之内，基金运作保持平稳。

受四舍五入等技术处理的影响，申赎清单中成分股权重与标的指数原始权重之间不可避免地存在一定出入，其中权重较低、排名靠后的股票差异更为明显，这也是跟踪误差的主要来源之一。针对上述情况，管理人对持仓结构进行了相应优化，在保障基金安全运作的前提下，尽量降低此类偏差带来的不利影响，效果基本符合预期。

从走势看，报告期前段标的指数总体较为均衡，一季度末波动明显放大，二季度初触底回升后转入震荡。管理人密切关注市场变化，在波动加大的交易日尤为关注盘面情况，全力维持了基金运作的平稳有序。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 8.77% 波动率 1.15% 业绩比较基准收益率 7.81% 波动率 1.18%

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。

本基金将继续严格按照法律法规及基金合同的相关约定做好对标的指数的追踪，确保基金运行平稳。

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 and 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

本报告期内，中国国际金融股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的重大违规行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

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	1,903,131.87	1,661,620.16
结算备付金		13,039.63	44,256.75
存出保证金		6,691.60	12,142.64
交易性金融资产	6.4.7.2	86,342,616.34	89,605,366.98
其中：股票投资		86,342,616.34	89,605,366.98
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		88,265,479.44	91,323,386.53
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		35,218.96	38,279.01
应付托管费		7,043.78	7,655.81
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	51,839.17	95,338.98
负债合计		94,101.91	141,273.80
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	48,048,000.00	54,048,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	40,123,377.53	37,134,112.73
净资产合计		88,171,377.53	91,182,112.73
负债和净资产总计		88,265,479.44	91,323,386.53

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.8351 元，基金份额总额 48,048,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

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		7,672,807.39	827,447.25
1.利息收入		5,904.22	8,983.21
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,904.22	8,983.21
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,382,876.22	884,724.25
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,621,763.75	-258,918.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	761,112.47	1,143,643.02
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）	6.4.7.20	3,287,452.21	-70,571.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-3,425.26	4,311.40
减：二、营业总支出		310,126.33	368,076.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	220,419.57	232,825.70
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	44,083.90	46,565.12
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	45,622.86	88,685.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,362,681.06	459,371.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,362,681.06	459,371.04
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,362,681.06	459,371.04

6.3 净资产变动表

会计主体：建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

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	54,048,000.00	-	37,134,112.73	91,182,112.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	54,048,000.00	-	37,134,112.73	91,182,112.73

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,000,000.00	-	2,989,264.80	-3,010,735.20
(一)、综合收益总额	-	-	7,362,681.06	7,362,681.06
(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)	-6,000,000.00	-	-4,373,416.26	-10,373,416.26
其中：1.基金申购款	2,000,000.00	-	1,471,312.56	3,471,312.56
2.基金赎回款	-8,000,000.00	-	-5,844,728.82	-13,844,728.82
(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	48,048,000.00	-	40,123,377.53	88,171,377.53
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	70,048,000.00	-	28,838,218.74	98,886,218.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	70,048,000.00	-	28,838,218.74	98,886,218.74
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,000,000.00	-	-1,060,683.85	-5,060,683.85
(一)、综合收益总额	-	-	459,371.04	459,371.04
(二)、本期基金份额交易产生	-4,000,000.00	-	-1,520,054.89	-5,520,054.89

的净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1.基金申 购款	-	-	-	-
2.基金赎 回款	-4,000,000.00	-	-1,520,054.89	-5,520,054.89
(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	66,048,000.00	-	27,777,534.89	93,825,534.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谢海玉

莫红

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（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[2018]503 号《关于准予建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 2,046,048,000.00 元（含募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2018）第 0258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,046,048,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。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

为中国国际金融股份有限公司。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证自律监管决定书[2018]61 号审核同意，本基金于 2018 年 5 月 21 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（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、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、权证、股指期货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）。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数收益率。

本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司以本基金为目标 ETF 募集成立了建信 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（以下简称“建信 MSCI 联接基金”）。建信 MSCI 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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、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	1,903,131.87
等于：本金	1,902,771.52
加：应计利息	360.35
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	1,903,131.87

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	67,456,075.34	-	86,342,616.34	18,886,541.00
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	67,456,075.34	-	86,342,616.34	18,886,541.00

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,216.31
其中：交易所市场	6,216.31
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	45,622.86
合计	51,839.17

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,048,000.00	54,048,000.00
本期申购	2,000,000.00	2,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-8,000,000.00	-8,000,000.00
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	48,048,000.00	48,048,000.00

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。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	47,299,955.10	-10,165,842.37	37,134,112.73
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	47,299,955.10	-10,165,842.37	37,134,112.73
本期利润	4,075,228.85	3,287,452.21	7,362,681.06
本期基金份额交易产生的变动数	-5,479,782.57	1,106,366.31	-4,373,416.26
其中：基金申购款	1,780,887.55	-309,574.99	1,471,312.56
基金赎回款	-7,260,670.12	1,415,941.30	-5,844,728.82

本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,895,401.38	-5,772,023.85	40,123,377.53

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	5,852.26
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	33.82
其他	18.14
合计	5,904.22

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	2,473,637.23
股票投资收益——赎回差价收入	1,148,126.52
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	3,621,763.75

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	13,396,682.96
减：卖出股票成本总额	10,910,586.21
减：交易费用	12,459.52
买卖股票差价收入	2,473,637.23

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	13,844,728.82
减：现金支付赎回款总额	5,920,399.82
减：赎回股票成本总额	6,776,202.48
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,148,126.52

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 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

无。

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	761,112.47
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	761,112.47

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	3,287,452.21
股票投资	3,287,452.21
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	-
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	3,287,452.21

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	-
替代损益	-3,425.26
合计	-3,425.26

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	5,951.28
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	45,622.86

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
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	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
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（“建信 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中金公司	13,939,754.44	62.00	3,616,853.76	33.96

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中金公司	2,730.68	63.23	5,603.64	90.14
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 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中金公司	708.60	34.82	8,842.50	87.39

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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	220,419.57	232,825.70

其中：应支付销售机构的客户维护费	30,660.82	25,676.59
应支付基金管理人的净管理费	189,758.75	207,149.11

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

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	44,083.90	46,565.12

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
-------	------------------------	--------------------------

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
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	23,747,600.00	49.42	27,093,100.00	50.13

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

无。

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

于 2026 年 6 月 30 日, 本基金持有 34,523 股中国建设银行的股票 估值总额为人民币 332,456.49 元, 占基金资产净值的比例为 0.38% (于 2025 年 12 月 31 日, 本基金持有 40,723 股中国建设银行的股票, 估值总额为人民币 377,909.44 元, 占基金资产净值的比例为 0.41%)。

于 2026 年 6 月 30 日, 本基金持有 4,800 股中金公司的股票, 估值总额为人民币 173,520.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.20% (于 2025 年 12 月 31 日, 本基金持有 5,700 股中金公司的股票, 估值总额为人民币 199,500.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.22%)。

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

无。

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	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	476	81,832.88	396,032.00	-

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。基金管理人对于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	1,903,131.87	-	-	-	1,903,131.87
结算备付金	13,039.63	-	-	-	13,039.63
存出保证金	6,691.60	-	-	-	6,691.60
交易性金融资产	-	-	-	86,342,616.34	86,342,616.34
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	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,922,863.10	-	-	86,342,616.34	88,265,479.44
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	35,218.96	35,218.96
应付托管费	-	-	-	7,043.78	7,043.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	51,839.17	51,839.17
负债总计	-	-	-	94,101.91	94,101.91
利率敏感度缺口	1,922,863.10	-	-	86,248,514.43	88,171,377.53
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	1,661,620.16	-	-	-	1,661,620.16
结算备付金	44,256.75	-	-	-	44,256.75
存出保证金	12,142.64	-	-	-	12,142.64
交易性金融资产	-	-	-	89,605,366.98	89,605,366.98
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	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,718,019.55	-	-	89,605,366.98	91,323,386.53
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	38,279.01	38,279.01
应付托管费	-	-	-	7,655.81	7,655.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	95,338.98	95,338.98
负债总计	-	-	-	141,273.80	141,273.80
利率敏感度缺口	1,718,019.55	-	-	89,464,093.18	91,182,112.73

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	86,342,616.34	97.93	89,605,366.98	98.27
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	86,342,616.34	97.93	89,605,366.98	98.27

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%	4,302,660.31	4,440,134.12

	业绩比较基准下降 5%	-4,302,660.31	-4,440,134.12
--	----------------	---------------	---------------

6.4.13.4 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	85,946,584.34	89,111,407.50
第二层次	396,032.00	486,936.80
第三层次	-	7,022.68
合计	86,342,616.34	89,605,366.98

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这

些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	86,342,616.34	97.82
	其中：股票	86,342,616.34	97.82
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	1,916,171.50	2.17
8	其他各项资产	6,691.60	0.01
9	合计	88,265,479.44	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	445,273.24	0.51
B	采矿业	3,898,859.74	4.42
C	制造业	54,929,014.67	62.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,572,983.48	2.92
E	建筑业	940,588.68	1.07
F	批发和零售业	472,010.12	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	2,057,454.18	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,620,638.81	5.24
J	金融业	14,430,764.97	16.37
K	房地产业	375,543.49	0.43
L	租赁和商务服务业	507,342.06	0.58

M	科学研究和技术服务业	594,730.26	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	51,369.20	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	125,089.44	0.14
R	文化、体育和娱乐业	53,232.00	0.06
S	综合	164,542.00	0.19
	合计	86,239,436.34	97.81

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	-	-
C	制造业	103,180.00	0.12
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	-	-
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	-	-
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	103,180.00	0.12

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	7,180	2,821,811.80	3.20
2	600519	贵州茅台	2,060	2,442,109.40	2.77
3	300308	中际旭创	1,820	2,311,400.00	2.62
4	688256	寒武纪	1,043	1,664,158.65	1.89
5	688041	海光信息	3,900	1,444,170.00	1.64
6	300502	新易盛	2,240	1,359,680.00	1.54
7	601138	工业富联	17,200	1,240,980.00	1.41
8	600036	招商银行	33,582	1,192,161.00	1.35
9	002371	北方华创	1,220	1,079,163.20	1.22
10	600900	长江电力	39,784	1,053,082.48	1.19
11	603986	兆易创新	1,088	886,720.00	1.01
12	601899	紫金矿业	33,538	843,145.32	0.96
13	601288	农业银行	138,600	841,302.00	0.95
14	002475	立讯精密	11,832	832,972.80	0.94
15	601318	中国平安	17,378	829,625.72	0.94
16	002384	东山精密	3,000	787,050.00	0.89
17	688012	中微公司	1,639	767,871.50	0.87
18	601398	工商银行	102,398	723,953.86	0.82
19	002594	比亚迪	8,836	704,229.20	0.80
20	600183	生益科技	4,000	693,600.00	0.79
21	688008	澜起科技	1,900	588,810.00	0.67
22	600030	中信证券	20,080	576,898.40	0.65
23	601166	兴业银行	34,466	570,756.96	0.65
24	601328	交通银行	86,875	558,606.25	0.63
25	688498	源杰科技	290	546,940.00	0.62
26	600276	恒瑞医药	10,356	538,926.24	0.61
27	300274	阳光电源	3,380	537,487.60	0.61
28	300394	天孚通信	1,747	528,781.96	0.60
29	002916	深南电路	1,152	527,500.80	0.60
30	300059	东方财富	25,715	524,071.70	0.59
31	300408	三环集团	3,100	517,390.00	0.59
32	000725	京东方 A	59,200	513,856.00	0.58
33	603993	洛阳钼业	28,400	498,420.00	0.57
34	603259	药明康德	3,976	495,051.76	0.56
35	301308	江波龙	700	492,660.00	0.56
36	002463	沪电股份	3,180	485,904.00	0.55
37	300476	胜宏科技	1,400	485,002.00	0.55
38	600176	中国巨石	6,488	472,845.44	0.54
39	000858	五 粮 液	6,307	466,718.00	0.53

40	600000	浦发银行	54,200	466,662.00	0.53
41	600487	亨通光电	4,000	437,360.00	0.50
42	300433	蓝思科技	8,100	434,646.00	0.49
43	000333	美的集团	5,700	430,521.00	0.49
44	601211	国泰海通	22,989	418,399.80	0.47
45	600150	中国船舶	12,200	412,238.00	0.47
46	688072	拓荆科技	476	396,032.00	0.45
47	688525	佰维存储	800	395,784.00	0.45
48	001309	德明利	400	377,160.00	0.43
49	601988	中国银行	64,762	370,438.64	0.42
50	601816	京沪高铁	79,600	360,588.00	0.41
51	000657	中钨高新	3,700	354,164.00	0.40
52	601088	中国神华	8,991	351,008.64	0.40
53	601857	中国石油	40,400	350,672.00	0.40
54	600309	万华化学	5,100	348,891.00	0.40
55	300604	长川科技	1,000	341,420.00	0.39
56	600522	中天科技	5,600	339,808.00	0.39
57	002281	光迅科技	1,300	334,022.00	0.38
58	601939	建设银行	34,523	332,456.49	0.38
59	002938	鹏鼎控股	3,100	326,678.00	0.37
60	600919	江苏银行	29,853	321,815.34	0.36
61	601225	陕西煤业	15,800	321,530.00	0.36
62	002142	宁波银行	10,712	318,039.28	0.36
63	000001	平安银行	31,628	317,861.40	0.36
64	601601	中国太保	11,108	316,800.16	0.36
65	002714	牧原股份	8,916	311,970.84	0.35
66	601985	中国核电	33,500	302,505.00	0.34
67	600584	长电科技	2,900	300,295.00	0.34
68	000338	潍柴动力	11,000	299,750.00	0.34
69	600406	国电南瑞	13,041	297,986.85	0.34
70	688521	芯原股份	800	296,912.00	0.34
71	000988	华工科技	1,600	295,376.00	0.34
72	601668	中国建筑	67,212	291,700.08	0.33
73	300033	同花顺	1,200	289,200.00	0.33
74	600111	北方稀土	5,850	281,092.50	0.32
75	688120	华海清科	857	276,108.26	0.31
76	601869	长飞光纤	500	272,950.00	0.31
77	300760	迈瑞医疗	2,000	271,660.00	0.31
78	601919	中远海控	20,480	271,564.80	0.31
79	688347	华虹宏力	800	269,040.00	0.31
80	000792	盐湖股份	8,600	259,634.00	0.29
81	002353	杰瑞股份	1,700	259,250.00	0.29
82	688361	中科飞测	600	258,000.00	0.29

83	600999	招商证券	12,068	254,634.80	0.29
84	002080	中材科技	2,800	252,000.00	0.29
85	300857	协创数据	740	251,526.00	0.29
86	603288	海天味业	7,548	250,291.68	0.28
87	600887	伊利股份	10,288	246,500.48	0.28
88	601688	华泰证券	11,900	245,378.00	0.28
89	002352	顺丰控股	7,833	244,859.58	0.28
90	600989	宝丰能源	11,900	241,927.00	0.27
91	601658	邮储银行	48,900	241,077.00	0.27
92	300475	香农芯创	800	240,000.00	0.27
93	000063	中兴通讯	6,600	238,854.00	0.27
94	600031	三一重工	13,745	237,513.60	0.27
95	601100	恒立液压	2,180	234,480.80	0.27
96	600160	巨化股份	4,400	233,244.00	0.26
97	601872	招商轮船	13,100	230,167.00	0.26
98	000776	广发证券	9,600	224,640.00	0.25
99	688396	华润微	2,300	224,365.00	0.25
100	300442	润泽科技	2,700	224,289.00	0.25
101	600549	厦门钨业	2,600	221,520.00	0.25
102	605117	德业股份	2,086	221,491.48	0.25
103	600809	山西汾酒	2,021	221,036.77	0.25
104	300014	亿纬锂能	3,396	220,841.88	0.25
105	601818	光大银行	75,500	218,195.00	0.25
106	688082	盛美上海	500	216,000.00	0.24
107	688126	沪硅产业	5,300	211,417.00	0.24
108	600028	中国石化	47,400	211,404.00	0.24
109	600690	海尔智家	10,228	208,753.48	0.24
110	002600	领益智造	11,900	206,346.00	0.23
111	601766	中国中车	39,600	205,920.00	0.23
112	600050	中国联通	50,900	203,600.00	0.23
113	601066	中信建投	7,000	203,490.00	0.23
114	601336	新华保险	3,408	203,321.28	0.23
115	601229	上海银行	23,133	200,794.44	0.23
116	300223	北京君正	800	199,120.00	0.23
117	601009	南京银行	20,100	198,789.00	0.23
118	000100	TCL 科技	33,810	196,774.20	0.22
119	688249	晶合集成	3,300	194,799.00	0.22
120	600019	宝钢股份	35,500	192,765.00	0.22
121	300136	信维通信	1,600	190,800.00	0.22
122	002156	通富微电	2,500	189,675.00	0.22
123	603501	豪威集团	1,980	187,803.00	0.21
124	000568	泸州老窖	2,400	186,048.00	0.21
125	600016	民生银行	57,724	185,871.28	0.21

126	300757	罗博特科	300	185,700.00	0.21
127	600089	特变电工	8,217	184,882.50	0.21
128	000408	藏格矿业	2,600	180,232.00	0.20
129	601600	中国铝业	21,500	176,730.00	0.20
130	601995	中金公司	4,800	173,520.00	0.20
131	600905	三峡能源	46,500	172,515.00	0.20
132	000651	格力电器	4,600	172,500.00	0.20
133	600703	三安光电	8,100	171,882.00	0.19
134	601888	中国中免	3,186	171,120.06	0.19
135	600926	杭州银行	11,840	171,088.00	0.19
136	000977	浪潮信息	2,420	169,400.00	0.19
137	002602	世纪华通	12,000	169,200.00	0.19
138	002460	赣锋锂业	2,582	168,862.80	0.19
139	002709	天赐材料	3,280	168,690.40	0.19
140	601169	北京银行	34,392	168,520.80	0.19
141	600893	航发动力	4,365	167,354.10	0.19
142	600346	恒力石化	9,407	166,597.97	0.19
143	600660	福耀玻璃	3,300	166,452.00	0.19
144	601127	赛力斯	2,700	165,375.00	0.19
145	600673	东阳光	4,900	164,542.00	0.19
146	600010	宝钢股份	73,700	164,351.00	0.19
147	002837	英维克	2,050	163,098.00	0.18
148	688110	东芯股份	800	162,960.00	0.18
149	600105	永鼎股份	2,400	161,952.00	0.18
150	600498	烽火通信	2,200	161,920.00	0.18
151	601012	隆基绿能	12,327	161,730.24	0.18
152	000166	申万宏源	36,642	161,224.80	0.18
153	688111	金山办公	754	160,639.70	0.18
154	002493	荣盛石化	14,875	159,906.25	0.18
155	600188	兖矿能源	8,930	158,686.10	0.18
156	600886	国投电力	11,900	158,389.00	0.18
157	601689	拓普集团	2,795	157,693.90	0.18
158	688702	盛科通信	400	155,996.00	0.18
159	000425	徐工机械	19,100	154,519.00	0.18
160	002230	科大讯飞	3,750	153,150.00	0.17
161	601868	中国能建	56,900	151,923.00	0.17
162	300620	光库科技	400	151,280.00	0.17
163	601006	大秦铁路	32,800	151,208.00	0.17
164	688048	长光华芯	300	150,600.00	0.17
165	002851	麦格米特	900	150,462.00	0.17
166	688629	华丰科技	800	150,008.00	0.17
167	603799	华友钴业	3,103	149,750.78	0.17
168	300124	汇川技术	2,248	149,109.84	0.17

169	688777	中控技术	1,265	148,637.50	0.17
170	600460	士兰微	2,700	147,582.00	0.17
171	600362	江西铜业	3,400	147,220.00	0.17
172	002466	天齐锂业	2,400	147,168.00	0.17
173	300661	圣邦股份	1,023	146,780.04	0.17
174	688183	生益电子	1,100	145,640.00	0.17
175	688469	芯联集成	13,700	145,357.00	0.16
176	600875	东方电气	5,001	143,878.77	0.16
177	601727	上海电气	20,500	143,500.00	0.16
178	600489	中金黄金	7,900	142,595.00	0.16
179	001389	广合科技	600	142,350.00	0.16
180	688271	联影医疗	1,400	141,722.00	0.16
181	300751	迈为股份	500	141,230.00	0.16
182	002001	新 和 成	4,968	141,190.56	0.16
183	000538	云南白药	2,946	139,552.02	0.16
184	300548	长芯博创	500	139,000.00	0.16
185	601390	中国中铁	33,300	138,861.00	0.16
186	000630	铜陵有色	21,800	138,648.00	0.16
187	601998	中信银行	19,900	137,907.00	0.16
188	601881	中国银河	10,800	135,756.00	0.15
189	600015	华夏银行	21,200	135,468.00	0.15
190	600795	国电电力	29,000	135,430.00	0.15
191	603296	华勤技术	1,820	135,171.40	0.15
192	600547	山东黄金	5,852	135,122.68	0.15
193	601958	金钼股份	4,800	134,928.00	0.15
194	000938	紫光股份	4,662	134,545.32	0.15
195	002202	金风科技	5,593	133,672.70	0.15
196	300498	温氏股份	10,820	133,302.40	0.15
197	688019	安集科技	390	132,389.40	0.15
198	603893	瑞芯微	700	131,852.00	0.15
199	601669	中国电建	28,000	131,600.00	0.15
200	002050	三花智控	3,000	131,490.00	0.15
201	600104	上汽集团	13,418	130,959.68	0.15
202	605499	东鹏饮料	1,061	130,959.23	0.15
203	300390	天华新能	1,400	130,914.00	0.15
204	002241	歌尔股份	5,800	130,674.00	0.15
205	688313	仕佳光子	700	129,255.00	0.15
206	601628	中国人寿	3,644	128,815.40	0.15
207	002648	卫星化学	5,438	127,738.62	0.14
208	300316	晶盛机电	2,100	126,840.00	0.14
209	300015	爱尔眼科	15,144	125,089.44	0.14
210	000807	云铝股份	5,600	123,984.00	0.14
211	601179	中国西电	8,300	123,836.00	0.14

212	688002	睿创微纳	800	123,752.00	0.14
213	688047	龙芯中科	800	123,736.00	0.14
214	000301	东方盛虹	10,800	123,660.00	0.14
215	002049	紫光国微	1,380	122,475.00	0.14
216	601838	成都银行	6,900	122,130.00	0.14
217	600026	中远海能	6,800	121,992.00	0.14
218	002311	海大集团	2,700	120,447.00	0.14
219	300395	菲利华	900	120,357.00	0.14
220	688036	传音控股	2,020	119,079.00	0.14
221	601991	大唐发电	16,800	118,944.00	0.13
222	002185	华天科技	5,300	118,243.00	0.13
223	688506	百利天恒	400	117,612.00	0.13
224	601825	沪农商行	15,700	117,593.00	0.13
225	603228	景旺电子	1,600	115,856.00	0.13
226	000895	双汇发展	5,171	115,830.40	0.13
227	000960	锡业股份	2,700	115,263.00	0.13
228	600958	东方证券	12,200	115,168.00	0.13
229	002027	分众传媒	23,500	113,740.00	0.13
230	600674	川投能源	7,900	111,943.00	0.13
231	600585	海螺水泥	6,541	110,869.95	0.13
232	600436	片仔癀	1,000	109,280.00	0.12
233	688387	信科移动	5,500	109,120.00	0.12
234	600011	华能国际	14,300	108,537.00	0.12
235	301269	华大九天	900	107,478.00	0.12
236	002812	恩捷股份	1,600	107,056.00	0.12
237	301358	湖南裕能	1,400	106,218.00	0.12
238	002625	光启技术	3,500	106,120.00	0.12
239	601168	西部矿业	3,900	105,846.00	0.12
240	600115	中国东航	27,700	105,537.00	0.12
241	601319	中国人保	15,400	104,104.00	0.12
242	601231	环旭电子	3,200	103,680.00	0.12
243	000066	中国长城	5,300	100,965.00	0.11
244	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.11
245	603659	璞泰来	3,471	100,416.03	0.11
246	300782	卓胜微	916	100,375.28	0.11
247	002422	科伦药业	2,600	100,152.00	0.11
248	601111	中国国航	16,400	99,220.00	0.11
249	601360	三六零	11,352	98,648.88	0.11
250	600601	方正科技	7,000	96,880.00	0.11
251	600066	宇通客车	3,600	96,516.00	0.11
252	601901	方正证券	13,400	96,480.00	0.11
253	000625	长安汽车	13,452	96,450.84	0.11
254	000426	兴业银锡	2,900	95,584.00	0.11

255	600418	江淮汽车	3,700	95,571.00	0.11
256	002304	洋河股份	2,488	94,917.20	0.11
257	600029	南方航空	18,265	94,612.70	0.11
258	000831	中国稀土	1,700	94,333.00	0.11
259	001979	招商蛇口	14,663	94,283.09	0.11
260	600221	海航控股	69,700	94,095.00	0.11
261	002736	国信证券	9,400	93,906.00	0.11
262	600895	张江高科	2,500	93,125.00	0.11
263	002653	海思科	1,400	92,876.00	0.11
264	002414	高德红外	6,999	92,806.74	0.11
265	601916	浙商银行	35,100	92,313.00	0.10
266	300803	指南针	1,000	91,670.00	0.10
267	601788	光大证券	6,327	91,298.61	0.10
268	600096	云天化	3,000	91,200.00	0.10
269	688187	时代电气	1,326	91,043.16	0.10
270	300866	安克创新	870	90,915.00	0.10
271	600415	小商品城	8,900	90,424.00	0.10
272	600048	保利发展	19,500	90,285.00	0.10
273	600438	通威股份	7,326	88,717.86	0.10
274	002236	大华股份	5,377	88,666.73	0.10
275	600233	圆通速递	5,600	88,200.00	0.10
276	601077	渝农商行	14,400	87,984.00	0.10
277	002595	豪迈科技	1,885	87,841.00	0.10
278	000783	长江证券	9,000	87,750.00	0.10
279	601877	正泰电器	3,488	87,444.16	0.10
280	688578	艾力斯	800	87,360.00	0.10
281	002558	巨人网络	3,100	85,436.00	0.10
282	601377	兴业证券	14,100	85,164.00	0.10
283	000617	中油资本	12,700	83,693.00	0.09
284	002128	电投能源	3,600	83,232.00	0.09
285	600580	卧龙电驱	2,500	82,750.00	0.09
286	600039	四川路桥	10,580	82,735.60	0.09
287	002074	国轩高科	3,000	82,530.00	0.09
288	600023	浙能电力	15,600	82,056.00	0.09
289	600426	华鲁恒升	3,420	81,806.40	0.09
290	000963	华东医药	2,901	81,576.12	0.09
291	002920	德赛西威	1,000	81,500.00	0.09
292	000157	中联重科	11,590	80,782.30	0.09
293	300418	昆仑万维	2,000	80,720.00	0.09
294	002532	天山铝业	7,500	80,475.00	0.09
295	300058	蓝色光标	5,800	79,808.00	0.09
296	002129	TCL 中环	6,600	79,332.00	0.09
297	688223	晶科能源	16,700	79,325.00	0.09

298	600741	华域汽车	5,100	79,152.00	0.09
299	000933	神火股份	3,700	78,440.00	0.09
300	688331	荣昌生物	600	78,156.00	0.09
301	000975	山金国际	4,540	77,180.00	0.09
302	002064	华峰化学	8,100	76,869.00	0.09
303	600196	复星医药	3,400	76,398.00	0.09
304	001965	招商公路	8,300	76,028.00	0.09
305	002850	科达利	400	75,720.00	0.09
306	601456	国联民生	8,543	75,520.12	0.09
307	001203	大中矿业	2,500	74,875.00	0.08
308	600219	南山铝业	18,700	74,613.00	0.08
309	688099	晶晨股份	715	73,573.50	0.08
310	688375	国博电子	700	73,010.00	0.08
311	601021	春秋航空	1,600	72,928.00	0.08
312	601117	中国化学	9,900	72,765.00	0.08
313	603806	福斯特	4,329	72,683.91	0.08
314	603260	合盛硅业	1,500	72,390.00	0.08
315	002379	宏桥控股	4,900	72,373.00	0.08
316	601198	东兴证券	5,300	72,027.00	0.08
317	600027	华电国际	16,100	71,645.00	0.08
318	600988	赤峰黄金	2,700	71,064.00	0.08
319	601618	中国中冶	29,100	71,004.00	0.08
320	300759	康龙化成	2,450	70,878.50	0.08
321	002738	中矿资源	1,200	70,788.00	0.08
322	601878	浙商证券	7,400	70,300.00	0.08
323	601699	潞安环能	4,900	69,972.00	0.08
324	600642	申能股份	8,000	69,840.00	0.08
325	000559	万向钱潮	5,400	69,822.00	0.08
326	600021	上海电力	4,600	69,322.00	0.08
327	601607	上海医药	4,500	69,300.00	0.08
328	300628	亿联网络	2,040	68,992.80	0.08
329	688188	柏楚电子	645	68,821.50	0.08
330	002555	三七互娱	3,600	67,932.00	0.08
331	301236	软通动力	1,600	67,920.00	0.08
332	300454	深信服	700	67,340.00	0.08
333	600143	金发科技	4,300	66,435.00	0.08
334	601108	财通证券	7,600	65,740.00	0.07
335	300919	中伟新材	1,500	65,625.00	0.07
336	600061	国投资本	10,000	65,500.00	0.07
337	688122	西部超导	1,040	65,322.40	0.07
338	000688	国城矿业	1,900	65,037.00	0.07
339	600570	恒生电子	3,043	64,481.17	0.07
340	002601	龙佰集团	3,900	64,272.00	0.07

341	600352	浙江龙盛	5,300	64,183.00	0.07
342	601555	东吴证券	8,077	63,969.84	0.07
343	688472	阿特斯	5,900	63,838.00	0.07
344	600918	中泰证券	11,800	62,776.00	0.07
345	601058	赛轮轮胎	5,400	62,262.00	0.07
346	600803	新奥股份	3,900	61,620.00	0.07
347	300115	长盈精密	2,200	61,468.00	0.07
348	000999	华润三九	2,731	61,420.19	0.07
349	600600	青岛啤酒	1,175	61,370.25	0.07
350	601216	君正集团	13,700	61,102.00	0.07
351	601777	千里科技	7,400	60,384.00	0.07
352	002195	岩山科技	9,200	60,168.00	0.07
353	300748	金力永磁	1,900	58,615.00	0.07
354	600845	宝信软件	3,516	58,471.08	0.07
355	002487	大金重工	1,000	57,970.00	0.07
356	600157	永泰能源	35,500	57,155.00	0.06
357	002294	信立泰	1,788	57,019.32	0.06
358	300207	欣旺达	3,000	56,970.00	0.06
359	601696	中银证券	4,500	56,925.00	0.06
360	002517	恺英网络	3,500	56,875.00	0.06
361	601577	长沙银行	6,500	56,615.00	0.06
362	002078	太阳纸业	4,500	56,205.00	0.06
363	601212	白银有色	11,000	55,880.00	0.06
364	000596	古井贡酒	700	55,860.00	0.06
365	688303	大全能源	3,200	55,776.00	0.06
366	603606	东方电缆	1,340	55,623.40	0.06
367	000708	中信特钢	4,400	55,528.00	0.06
368	601162	天风证券	16,400	55,268.00	0.06
369	002939	长城证券	6,600	55,044.00	0.06
370	002340	格林美	8,300	54,863.00	0.06
371	600711	盛屯矿业	5,000	54,850.00	0.06
372	300832	新产业	1,300	54,600.00	0.06
373	000983	山西焦煤	9,260	53,708.00	0.06
374	688599	天合光能	3,800	53,656.00	0.06
375	000728	国元证券	7,140	53,478.60	0.06
376	300251	光线传媒	4,800	53,232.00	0.06
377	688617	惠泰医疗	290	52,652.40	0.06
378	600839	四川长虹	7,500	52,350.00	0.06
379	002131	利欧股份	11,000	52,250.00	0.06
380	603568	伟明环保	3,340	51,369.20	0.06
381	002465	海格通信	4,000	51,080.00	0.06
382	600515	海南机场	18,600	50,964.00	0.06
383	600085	同仁堂	2,200	50,842.00	0.06

384	002966	苏州银行	7,300	50,808.00	0.06
385	600588	用友网络	5,521	50,682.78	0.06
386	600298	安琪酵母	1,400	50,680.00	0.06
387	000786	北新建材	2,800	50,652.00	0.06
388	600733	北汽蓝谷	10,400	50,648.00	0.06
389	300765	石药创新	1,860	50,647.80	0.06
390	688568	中科星图	1,200	49,764.00	0.06
391	300896	爱美客	540	47,088.00	0.05
392	000002	万 科 A	15,840	46,886.40	0.05
393	002252	上海莱士	10,800	46,872.00	0.05
394	000661	长春高新	700	46,620.00	0.05
395	600009	上海机场	2,011	46,454.10	0.05
396	000876	新 希 望	7,300	45,771.00	0.05
397	603486	科沃斯	900	45,675.00	0.05
398	300122	智飞生物	3,900	45,591.00	0.05
399	601799	星宇股份	500	45,310.00	0.05
400	300413	芒果超媒	3,000	43,890.00	0.05
401	600536	中国软件	1,560	43,867.20	0.05
402	002459	晶澳科技	5,384	43,610.40	0.05
403	601933	永辉超市	14,800	42,032.00	0.05
404	601238	广汽集团	7,800	39,624.00	0.04
405	000564	供销大集	29,400	39,102.00	0.04
406	000932	华菱钢铁	11,200	38,864.00	0.04
407	603392	万泰生物	1,428	38,513.16	0.04
408	300255	常山药业	1,500	35,130.00	0.04
409	601567	三星电气	2,300	34,362.00	0.04
410	300347	泰格医药	600	28,800.00	0.03

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	300285	国瓷材料	1,000	103,180.00	0.12

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	449,139.00	0.49
2	000657	中钨高新	265,937.00	0.29
3	002602	世纪华通	236,409.00	0.26
4	601869	长飞光纤	193,629.00	0.21
5	688498	源杰科技	180,022.00	0.20
6	002379	宏桥控股	172,287.00	0.19
7	688525	佰维存储	162,212.00	0.18

8	002371	北方华创	151,448.00	0.17
9	601231	环旭电子	147,902.00	0.16
10	688027	国盾量子	145,177.60	0.16
11	600498	烽火通信	137,526.00	0.15
12	600519	贵州茅台	135,296.00	0.15
13	601212	白银有色	133,466.00	0.15
14	300751	迈为股份	132,590.00	0.15
15	002851	麦格米特	128,824.00	0.14
16	300136	信维通信	127,597.00	0.14
17	300390	天华新能	120,998.00	0.13
18	300757	罗博特科	120,240.00	0.13
19	000960	锡业股份	120,231.00	0.13
20	301358	湖南裕能	120,083.00	0.13

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	948,312.00	1.04
2	601138	工业富联	403,459.00	0.44
3	300308	中际旭创	284,533.00	0.31
4	002371	北方华创	254,064.00	0.28
5	688256	寒武纪	229,176.00	0.25
6	002594	比亚迪	200,837.00	0.22
7	300502	新易盛	191,759.00	0.21
8	002714	牧原股份	164,061.00	0.18
9	300394	天孚通信	161,551.00	0.18
10	002475	立讯精密	153,929.00	0.17
11	002938	鹏鼎控股	153,229.00	0.17
12	000858	五粮液	149,258.00	0.16
13	600519	贵州茅台	140,454.00	0.15
14	300274	阳光电源	140,185.00	0.15
15	003816	中国广核	127,187.00	0.14
16	002353	杰瑞股份	126,996.00	0.14
17	300476	胜宏科技	123,354.00	0.14
18	300059	东方财富	122,148.00	0.13
19	000333	美的集团	109,986.00	0.12
20	601088	中国神华	109,213.00	0.12

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	9,085,322.84
卖出股票收入（成交）总额	13,396,682.96

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

无。

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	6,691.60
2	应收清算款	-
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	-
8	其他	-
9	合计	6,691.60

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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
937	51,278.55	25,441,300.00	52.95	22,606,700.00	47.05

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
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	23,747,600.00	49.42

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 4 月 19 日） 基金份额总额	2,046,048,000.00
本报告期期初基金份额总额	54,048,000.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	48,048,000.00

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。

§ 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，经基金托管人中国国际金融股份有限公司研究决定，聘任刘晴川同志为本公司资产托管部负责人，严格同志不再担任资产托管部负责人职务，公司另有任用。

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

经建信基金管理有限责任公司董事会审议通过，自 2026 年 8 月 14 日起，本基金改聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计服务。

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，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员没有受到调查或处罚。

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 (%)	
中金公司	4	13,939,754.44	62.00	2,730.68	63.23	-
长江证券	1	8,542,251.36	38.00	1,587.83	36.77	-
天风证券	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，并能为基础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(%)
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分 ETF 变更扩位简称的公告	指定报刊和/或公司网站	2026 年 1 月 22 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过 20%的时间区间					(%)
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	1	2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日	27,093,100.00	0.00	3,345,500.00	23,747,600.00	49.42

注：本基金本报告期申购、赎回份额中包含了买入、卖出份额。

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 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信 MSCI 中国 A 股国际通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。

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