

建信丰融债券型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

资产托管人中国农业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	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	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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56

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	57
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	57
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	57
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	57
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.11 本报告期投资基金情况	57
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	60
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
10.8 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	61
10.9 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信丰融债券型证券投资基金	
基金简称	建信丰融债券	
基金主代码	022657	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 2 月 27 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	150,206,393.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	建信丰融债券 A	建信丰融债券 C
下属分级基金的交 易代码	022657	022658
报告期末下属分级 基金的份额总额	95,553,699.09 份	54,652,694.49 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	任航
	联系电话	010-66228888	010-66060069
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-81-95533；010-66228000	95599
传真		010-66228001	010-68121816
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝	北京市东城区建国门内大街 69

	国际金融中心 16 层	号
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	曲寅军	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金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	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英 蓝国际金融中心 16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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)	
	建信丰融债券 A	建信丰融债券 C
本期已实现收益	2, 734, 144. 36	1, 227, 752. 29
本期利润	4, 179, 027. 97	1, 891, 069. 32
加权平均基金份 额本期利润	0. 0334	0. 0289
本期加权平均净 值利润率	3. 19%	2. 77%
本期基金份额净 值增长率	2. 84%	2. 64%
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	5, 619, 111. 04	2, 906, 066. 17
期末可供分配基 金份额利润	0. 0588	0. 0532
期末基金资产净 值	101, 301, 849. 04	57, 631, 146. 86
期末基金份额净	1. 0602	1. 0545

值		
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	6.02%	5.45%

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

建信丰融债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.16%	0.24%	1.32%	0.13%	0.84%	0.11%
过去六个月	2.84%	0.24%	1.17%	0.12%	1.67%	0.12%
过去一年	5.28%	0.20%	1.31%	0.10%	3.97%	0.10%
自基金合同生效起至今	6.02%	0.17%	1.79%	0.10%	4.23%	0.07%

建信丰融债券 C

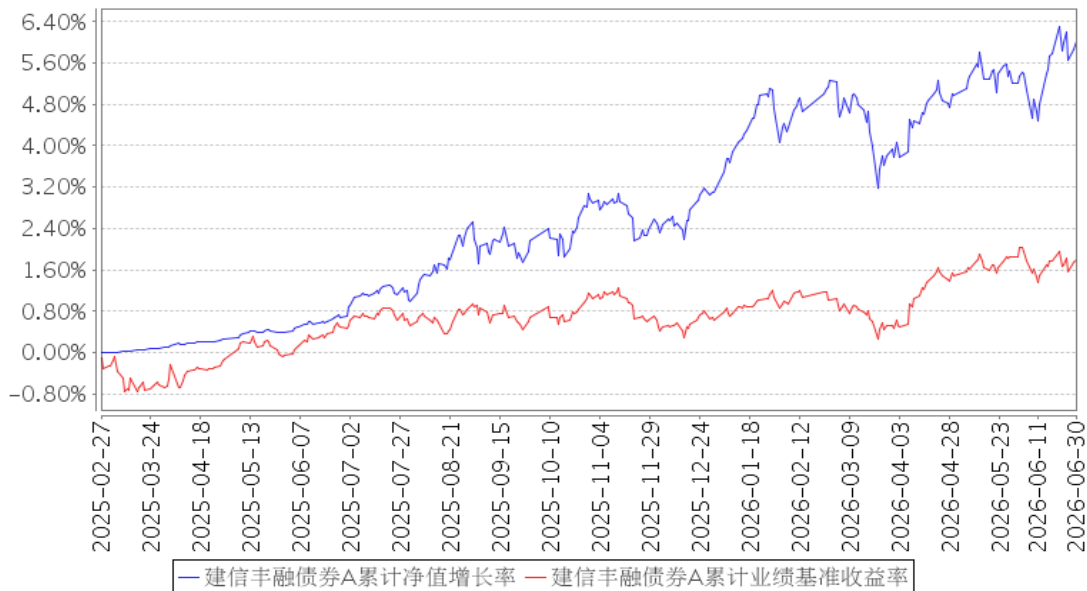
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.05%	0.24%	1.32%	0.13%	0.73%	0.11%
过去六个月	2.64%	0.24%	1.17%	0.12%	1.47%	0.12%
过去一年	4.86%	0.20%	1.31%	0.10%	3.55%	0.10%
自基金合同生效起至今	5.45%	0.17%	1.79%	0.10%	3.66%	0.07%

注：本基金业绩比较基准为中债综合全价(总值)指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+恒生指

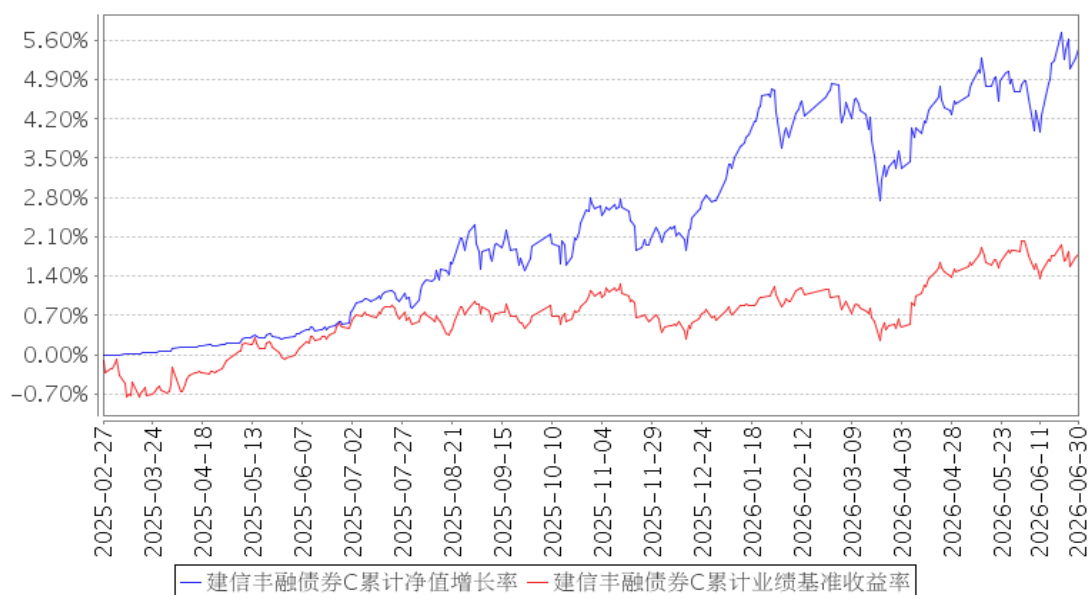
数收益率(经汇率调整)*2%。中债综合全价(总值)指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券涵盖的范围全面,具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势,适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。沪深 300 指数由中证指数有限公司编制,由上海和深圳证券交易所中市值大、流动性好的 300 只股票组成,综合反映中国 A 股市场上股票价格的整体表现。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制,以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股市价格趋势最有影响的一种股价指数,能够反映港股市场的表现,市场代表性良好。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信丰融债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信丰融债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.3 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		
李峰	本基金的基金经理	2025 年 2 月 27 日	—	19	李峰先生，硕士。2007 年 5 月至 2012 年 9 月任华夏基金管理公司基金会计业务经理、风控高级经理，2012 年 9 月至 2015 年 6 月任建信基金管理公司交易员、交易主管，2015 年 7 月至 2016 年 6 月任银华基金管理公司询价研究主管。2016 年 6 月至今任建信基金管理公司基金经理助理、基金经理。2017 年 5 月 15 日起任建信信用增强债券型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 15 日起任建信稳定鑫利债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 2 日至 2020 年 3 月 17 日任建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2018 年 3 月 14 日起任建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 3 月 8 日起任建信短债纯债债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 8 月 6 日至 2023 年 2 月 20 日任建信转债增强债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月 23 日至 2022 年 1 月 20 日任建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月 31 日至 2026 年 4 月 28 日任建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2020 年 12 月 16 日至 2026 年 4 月 28 日任建信利率债策略纯债债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 2 月 20 日起任建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 2 月 27 日起任建信丰融债券型证券投资基金的基金经理。
薛玲	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2025 年 2 月 27 日	—	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。
--	--	--	--	--	--

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《建信丰融债券型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

2026 年上半年，一季度宏观经济运行良好，进入二季度后受中东地缘冲突的拖累较为显著，但在出口超预期的拉动下，经济增长保持了一定的韧性，上半年国内生产总值 (GDP) 同比增长 4.7%，实现了年初的政策目标。投资方面，上半年全国固定资产投资累计同比增长-5.7%，较去年全年增速回落 1.9 个百分点。各投资分项均呈现一季度走强，然后在二季度走弱的特征，并拖累了上半年经济的整体表现。消费方面，2026 年上半年社会消费品零售总额同比增长 1.3%，相比于去年全年回落 2.4 个百分点。虽然上半年仍然实施了一定的消费补贴政策，但部分品类补贴力度

边际下降、补贴门槛偏高，叠加油价上涨抑制旅游消费，多重因素共同推动了消费增速的下滑。出口方面，上半年外贸进出口总额同比增长 21.2%，其中出口同比增长 17.6%，进口同比增长 26.6%。年初受人民币升值预期影响，外贸企业为早结汇而抢出口。进入二季度海外企业受能源价格上涨影响，供给端出现问题，在供应链断裂的预期下提前补库，进一步拉动了国内的出口。整体看，内需弱、外需强的格局成为上半年经济的主要特征，出口的超预期对冲了国内投资、消费的下滑，宏观经济整体运行平稳。

通胀方面，2026 年上半年受工业品价格反弹以及低基数的影响，消费者价格指数（CPI）同比增速上涨 1.0%，其中原油价格的上涨对冲了猪肉价格的下行，CPI 涨幅较为温和。工业品价格指数（PPI）上半年同比上涨 1.5%，自 3 月起转正后，整体反弹趋势较为显著。年初黄金为代表的贵金属和有色金属在一致预期下呈现泡沫化上涨的状态，直至 1 月末出现较大的波动与回撤。3 月后随着美伊冲突爆发，原油价格带动能源、化工等商品价格同步上涨，在二季度持续推升 PPI 读数。

货币政策方面，上半年人民银行整体维持偏宽松的资金面。公开市场操作层面，因市场资金面较为充裕，自 3 月起央行持续通过买断式逆回购的缩量续作回笼流动性，但除 4 月外，均增量续作到期的中期借贷便利（MLF），以维持货币政策的适度宽松。总量政策层面，上半年央行未进行降准、降息操作，但于 6 月设立了隔夜逆回购工具，用于在特殊时点调节流动性，并于 6 月末进行了首次投放。汇率方面，上半年在面对美伊冲击时，由于我国原油战略储备充足、产业链稳定性较强，导致出口持续向好，一季度人民币相对于美元快速走强。随后因美联储加息预期升温，导致美元指数上行，汇率再度转为震荡。具体来看，人民币兑美元中间价从年初的 6.9890 升值到上半年末的 6.7852，升值幅度为 2.92%。

在此背景下，上半年债券市场更多演绎预期博弈以及突发事件的冲击应对。在年初与美伊冲突爆发后收益率均呈现先上后下的走势，二季度随着资金面超预期宽松，收益率曲线整体震荡下行，其中 30y 国债表现较好。整体看 10 年国开债收益率相比 2025 年年末下行 22BP 到 1.78%，而 1 年期国开债相较于去年末下行 20BP 至 1.35%，收益率曲线形态变化不大。权益市场方面，沪深 300 指数上半年上涨 7.55%，最终收于 4979.43 点。相较于股市，转债市场表现弱于大盘，2026 年半年末中证转债指数收于 504.27 点，相比于去年末上涨 2.51%。

回顾上半年的基金管理工作，组合维持各类高波动资产的灵活交易，力求净值增长的同时控制好回撤。债券投资方面，上半年组合维持中性的杠杆水平，通过超配二级资本债，以及交易长限利率债调节组合久期。权益投资方面，年初以来，市场受到春季躁动预期的影响，出现了连续小幅上涨，为更好地给投资者创造收益，及时增加了权益持仓中成长股的比例，以跟上市场涨

幅。权益结构呈均衡配置，红利、质量、成长 1：1：1。进入 3 月中旬，市场受到美伊战争的冲击现了较大波动，本基金分步骤下降仓位至 15%。进入二季度，科技股带领 A 股走出了结构性牛市，A 股科技板块的快速上涨从某种程度上导致了其他板块的抽水效应。这种此消彼长的效应导致了 A 股的行业结构上出现了较大的变化，沪深 300、中证 500、中证 1000 等主要指数中电子、通信行业的权重达到 30%左右。二季度的股票操作主要跟随市场结构的变化，在行业配置上跟随市场进行紧密调整，逐步增加电子、通信仓位同时精选个股以获得超越市场的收益。

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 2.84%，波动率 0.24%，业绩比较基准收益率 1.17%，波动率 0.12%。本报告期本基金 C 净值增长率 2.64%，波动率 0.24%，业绩比较基准收益率 1.17%，波动率 0.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中东地缘冲突以及其引发的原油价格上涨将逐步缓和，但在美国中期选举临近、美联储货币政策反复以及“厄尔尼诺”现象冲击下，全球商品与资产价格仍将出现较大的波动，而国内政策或仍将聚焦科技的追赶以及内需的提振。海外方面，二季度美伊冲突对于原油价格以及美国通胀的影响较为显著，叠加世界杯对于就业的拉动，带来美联储加息预期的升温。但随着战争趋缓以及事件驱动就业的结束，美国三季度通胀与就业存在再度走弱的概率，进而导致降息预期的重启。国内方面，随着地缘冲突的缓解以及海外供应链的恢复，出口方面或难以维系上半年的强势，国内经济动能的压力将有所提升。在继续推进科技领域发展的同时，如何提振居民端的投资与消费或将成为政策的关注点。在此背景下，货币政策预计仍将保持适度宽松，降准、降息等总量政策在下半年依然可以预期。因此，我们对下半年债券市场持乐观态度。股票市场方面，下半年 A 股和港股，陆续有存储芯片、AI、机器人等大型公司的股票上市。为推进科技兴国战略，监管层会尽力保持市场稳定，极端情况下，不排除国家队救市的可能。结合目前市场波动率加大的现状，总体判断市场在将在 3800 点至 4200 点宽幅震荡。结构上和二季度相比，相对均衡。具体操作层面，债券投资将在继续控制信用风险的前提下积极操作，择机调整组合久期与杠杆水平，密切跟踪宏观微观数据边际变化带来的投资机会，并关注因风险事件、监管政策变化引发收益率波动所带来的交易性机会。权益投资则跟随市场在科技行业的配置，同时精选红利、高质量的优质个股，从而获得更好的收益。

本基金下半年将在严控各类风险的前提下，加强组合投资的灵活性，合理调节债券持仓的久期、杠杆，力求为持有人获得较好的投资回报。

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

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、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：建信丰融债券型证券投资基金

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	2,241,015.19	1,080,891.67
结算备付金		259,608.08	289,464.97
存出保证金		45,616.43	113,023.08
交易性金融资产	6.4.7.2	202,081,443.65	379,528,439.52
其中：股票投资		29,405,053.48	57,791,405.95
基金投资		-	-
债券投资		172,676,390.17	321,737,033.57
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		-	2,585,581.72
应收股利		-	3,234.24
应收申购款		26,395.54	27,146.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		204,654,078.89	383,627,781.30
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		45,011,501.50	73,315,328.21
应付清算款		-	-
应付赎回款		343,454.57	14,789,470.57
应付管理人报酬		79,005.99	165,145.03
应付托管费		19,751.50	41,286.24
应付销售服务费		18,693.62	34,830.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,638.76	5,263.84
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	246,037.05	281,335.56
负债合计		45,721,082.99	88,632,659.73
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.10	150,206,393.58	286,451,660.60
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	8,726,602.32	8,543,460.97
净资产合计		158,932,995.90	294,995,121.57
负债和净资产总计		204,654,078.89	383,627,781.30

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 150,206,393.58 份，其中建信丰融债券 A 基金份额总额 95,553,699.09 份，基金份额净值人民币 1.0602 元；建信丰融债券 C 基金份额总额 54,652,694.49 份，基金份额净值人民币 1.0545 元。

6.2 利润表

会计主体：建信丰融债券型证券投资基金

本报告期：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 2 月 27 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,451,809.67	25,529,216.90
1. 利息收入		4,831.09	8,709,177.60
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,831.09	404,148.62
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	8,305,028.98

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,332,906.04	13,694,049.80
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,211,642.54	-258,161.88
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	1,874,270.34	12,230,624.05
资产支持证券投资 收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	246,993.16	1,721,587.63
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）	6.4.7.21	2,108,200.64	2,881,450.07
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.22	5,871.90	244,539.43
减：二、营业总支出		1,381,712.38	9,331,861.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	596,804.35	5,867,844.43
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	149,201.10	1,466,961.16
3. 销售服务费		136,267.34	1,642,753.56
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		405,876.01	315,951.00
其中：卖出回购金融资产 支出		405,876.01	315,951.00
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		2,128.15	11,905.72
8. 其他费用	6.4.7.25	91,435.43	26,445.80
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		6,070,097.29	16,197,355.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		6,070,097.29	16,197,355.23
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		6,070,097.29	16,197,355.23

6.3 净资产变动表

会计主体：建信丰融债券型证券投资基金

本报告期：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	286,451,660.60	-	8,543,460.97	294,995,121.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	286,451,660.60	-	8,543,460.97	294,995,121.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-136,245,267.02	-	183,141.35	-136,062,125.67
(一)、综合收益总额	-	-	6,070,097.29	6,070,097.29
(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)	-136,245,267.02	-	-5,886,955.94	-142,132,222.96
其中：1. 基金申购款	21,894,934.71	-	957,064.61	22,851,999.32
2. 基金赎回款	-158,140,201.73	-	-6,844,020.55	-164,984,222.28
(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	150,206,393.58	-	8,726,602.32	158,932,995.90
项目	上年度可比期间 2025 年 2 月 27 日(基金合同生效日)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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,132,091,235.00	-	-	4,132,091,235.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,958,168,208.60	-	7,693,584.66	-2,950,474,623.94
(一)、综合收益总额	-	-	16,197,355.23	16,197,355.23
(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)	-2,958,168,208.60	-	-8,503,770.57	-2,966,671,979.17
其中：1. 基金申购款	538,386,581.78	-	2,023,027.74	540,409,609.52
2. 基金赎回款	-3,496,554,790.38	-	-10,526,798.31	-3,507,081,588.69
(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	1,173,923,026.40	-	7,693,584.66	1,181,616,611.06

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

建信丰融债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1544号《关于准予建信丰融债券型证券投资基金注册的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信丰融债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,130,943,013.69 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第 70071792_A05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信丰融债券型证券投资基金基金合同》于 2025 年 2 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,132,091,235.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,148,221.31 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信丰融债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（仅包括全市场的股票型 ETF 及本基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金，不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资基金的基金、货币市场基金、非本基金管理人管理的基金（全市场的股票型 ETF 除外）、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款，定期存款以及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金对债券的投资比例

不低于基金资产的 80%；本基金对股票、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资比例合计不超过基金资产的 20%，其中，港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 90%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 8%+恒生指数收益率（经汇率调整） $\times$ 2%。

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。

6.4.6.5 境外投资

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

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	2,241,015.19
等于：本金	2,240,778.92
加：应计利息	236.27
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	2,241,015.19

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		27,988,359.74	-	29,405,053.48	1,416,693.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	21,504,388.70	212,174.71	21,804,194.61	87,631.20
	银行间市场	148,220,637.05	1,493,695.56	150,872,195.56	1,157,862.95
	合计	169,725,025.75	1,705,870.27	172,676,390.17	1,245,494.15
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		197,713,385.49	1,705,870.27	202,081,443.65	2,662,187.89

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	3.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	166,317.04
其中：交易所市场	161,046.12
银行间市场	5,270.92
应付利息	-
预提费用	79,716.24
合计	246,037.05

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信丰融债券 A

项目	本期	
	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	197,201,114.94	197,201,114.94
本期申购	4,015,423.09	4,015,423.09
本期赎回（以“-”号填列）	-105,662,838.94	-105,662,838.94
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	95,553,699.09	95,553,699.09

建信丰融债券 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	89,250,545.66	89,250,545.66
本期申购	17,879,511.62	17,879,511.62
本期赎回（以“-”号填列）	-52,477,362.79	-52,477,362.79
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	54,652,694.49	54,652,694.49

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

建信丰融债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,743,648.22	-1,649,929.83	6,093,718.39
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,743,648.22	-1,649,929.83	6,093,718.39
本期利润	2,734,144.36	1,444,883.61	4,179,027.97
本期基金份额交易产生的变动数	-4,858,681.54	334,085.13	-4,524,596.41
其中：基金申购款	205,379.97	-15,706.39	189,673.58
基金赎回款	-5,064,061.51	349,791.52	-4,714,269.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,619,111.04	129,038.91	5,748,149.95

建信丰融债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,194,842.64	-745,100.06	2,449,742.58
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,194,842.64	-745,100.06	2,449,742.58
本期利润	1,227,752.29	663,317.03	1,891,069.32
本期基金份额交易产生的变动数	-1,516,528.76	154,169.23	-1,362,359.53
其中：基金申购款	821,460.89	-54,069.86	767,391.03
基金赎回款	-2,337,989.65	208,239.09	-2,129,750.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,906,066.17	72,386.20	2,978,452.37

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	4,298.26
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	406.94
其他	125.89
合计	4,831.09

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	3,211,642.54
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	3,211,642.54

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	174,770,910.31
减：卖出股票成本总额	171,311,441.29
减：交易费用	247,826.48
买卖股票差价收入	3,211,642.54

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,378,391.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-504,121.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,874,270.34

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	250,192,817.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	247,742,066.65
减：应计利息总额	2,950,109.48

减：交易费用	4,762.50
买卖债券差价收入	-504,121.00

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 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	246,993.16
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	246,993.16

6.4.7.21 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	2,108,200.64
股票投资	-305,669.57
债券投资	2,413,870.21
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	2,108,200.64

6.4.7.22 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	5,870.37
基金转换费收入	1.53
合计	5,871.90

6.4.7.23 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.24 信用减值损失

无。

6.4.7.25 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	2,116.28
银行间账户维护费	18,600.00
其他	300.00
存托服务费	2.91
合计	91,435.43

6.4.7.26 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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 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 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	596,804.35	5,867,844.43
其中：应支付销售机构的客户维护费	274,625.60	2,703,120.16
应支付基金管理人的净管理费	322,178.75	3,164,724.27

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

$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	149,201.10	1,466,961.16

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

$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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		
	建信丰融债券 A	建信丰融债券 C	合计
建信基金	-	3.51	3.51
中国建设银行	-	69,524.20	69,524.20
中国农业银行	-	62,722.92	62,722.92
合计	-	132,250.63	132,250.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信丰融债券 A	建信丰融债券 C	合计
建信基金	-	97.32	97.32
中国建设银行	-	458,012.33	458,012.33
中国农业银行	-	1,180,724.83	1,180,724.83
合计	-	1,638,834.48	1,638,834.48

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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	4,240,971.62	-	-	-	-
上年度可比期间						
2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日						

银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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 2 月 27 日（基金合同生效日）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
中国农业银行-活期	2,241,015.19	4,298.26	5,899,740.35	357,816.24

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

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

无。

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	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	200	103,170.00	175,906.00	-

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

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 45,011,501.50 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102581808	25 电网 MTN019	2026 年 7 月 2 日	100.90	100,000	10,090,061.37
232380089	23 中信银行二级资本债 01A	2026 年 7 月 2 日	105.48	100,000	10,547,640.55
232480035	24 平安银行二级资本债 01A	2026 年 7 月 2 日	104.10	140,000	14,573,321.10
232580006	25 民生银行二级资本债 01	2026 年 7 月 2 日	102.30	140,000	14,321,313.42
合计				480,000	49,532,336.44

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	104,384,357.86	145,136,518.93
AAA 以下	-	9,960,706.85
未评级	36,360,928.11	106,896,525.60
合计	140,745,285.97	261,993,751.38

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

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	2,241,015.19	-	-	-	2,241,015.19
结算备付金	259,608.08	-	-	-	259,608.08
存出保证金	45,616.43	-	-	-	45,616.43
交易性金融资产	10,126,909.59	130,655,224.60	31,894,255.98	29,405,053.48	202,081,443.65
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	-	-	-	26,395.54	26,395.54
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,673,149.29	130,655,224.60	31,894,255.98	29,431,449.02	204,654,078.89
负债					
卖出回购金融资产款	45,011,501.50	-	-	-	45,011,501.50
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	-	-	-	343,454.57	343,454.57
应付管理人报酬	-	-	-	79,005.99	79,005.99
应付托管费	-	-	-	19,751.50	19,751.50
应付销售服务费	-	-	-	18,693.62	18,693.62

应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,638.76	2,638.76
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	246,037.05	246,037.05
负债总计	45,011,501.50	-	-	709,581.49	45,721,082.99
利率敏感度缺口	-32,338,352.21	130,655,224.60	31,894,255.98	28,721,867.53	158,932,995.90
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	1,080,891.67	-	-	-	1,080,891.67
结算备付金	289,464.97	-	-	-	289,464.97
存出保证金	113,023.08	-	-	-	113,023.08
交易性金融资产	30,625,043.84	222,064,840.69	69,047,149.04	57,791,405.95	379,528,439.52
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,585,581.72	2,585,581.72
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	3,234.24	3,234.24
应收申购款	-	-	-	27,146.10	27,146.10
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,108,423.56	222,064,840.69	69,047,149.04	60,407,368.01	383,627,781.30
负债					
卖出回购金融资产款	73,315,328.21	-	-	-	73,315,328.21
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	-	-	-	14,789,470.57	14,789,470.57
应付管理人报酬	-	-	-	165,145.03	165,145.03
应付托管费	-	-	-	41,286.24	41,286.24
应付销售服务费	-	-	-	34,830.28	34,830.28
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5,263.84	5,263.84
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	281,335.56	281,335.56
负债总计	73,315,328.21	-	-	15,317,331.52	88,632,659.73
利率敏感度缺口	-41,206,904.65	222,064,840.69	69,047,149.04	45,090,036.49	294,995,121.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	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）
	市场利率下降 25 个基点	1,891,265.65	2,890,753.11
	市场利率上升 25 个基点	-1,840,704.25	-2,841,681.02

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	29,405,053.48	18.50	57,791,405.95	19.59
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	172,676,390.17	108.65	321,737,033.57	109.07
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	202,081,443.65	127.15	379,528,439.52	128.66

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例如附注 6.4.13.4.3.1 所示，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

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	29,229,147.48	57,450,893.95
第二层次	172,852,296.17	322,077,545.57
第三层次	—	—
合计	202,081,443.65	379,528,439.52

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	29,405,053.48	14.37
	其中：股票	29,405,053.48	14.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	172,676,390.17	84.37
	其中：债券	172,676,390.17	84.37
	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	2,500,623.27	1.22
8	其他各项资产	72,011.97	0.04
9	合计	204,654,078.89	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,305,646.00	0.82
C	制造业	19,657,040.52	12.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	612,297.00	0.39
E	建筑业	118,574.00	0.07
F	批发和零售业	370,154.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	674,216.00	0.42

H	住宿和餐饮业	17,990.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,710,678.36	1.08
J	金融业	3,970,160.80	2.50
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	301,322.20	0.19
M	科学研究和技术服务业	352,143.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	190,882.60	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,248.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	121,701.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	29,405,053.48	18.50

7.2.2 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

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	300373	扬杰科技	2,000	314,460.00	0.20
2	600183	生益科技	1,500	260,100.00	0.16
3	300308	中际旭创	200	254,000.00	0.16
4	000807	云铝股份	11,100	245,754.00	0.15
5	603986	兆易创新	300	244,500.00	0.15
6	002156	通富微电	3,200	242,784.00	0.15
7	600549	厦门钨业	2,800	238,560.00	0.15
8	601138	工业富联	3,200	230,880.00	0.15
9	688766	普冉股份	300	229,980.00	0.14
10	002027	分众传媒	45,900	222,156.00	0.14
11	300033	同花顺	920	221,720.00	0.14
12	002558	巨人网络	7,900	217,724.00	0.14
13	688002	睿创微纳	1,394	215,637.86	0.14
14	688396	华润微	2,200	214,610.00	0.14
15	301308	江波龙	300	211,140.00	0.13
16	000776	广发证券	9,000	210,600.00	0.13
17	688012	中微公司	447	209,419.50	0.13
18	002281	光迅科技	800	205,552.00	0.13
19	601688	华泰证券	9,900	204,138.00	0.13
20	000538	云南白药	4,300	203,691.00	0.13
21	601169	北京银行	40,800	199,920.00	0.13
22	002353	杰瑞股份	1,300	198,250.00	0.12

23	600803	新奥股份	12,400	195,920.00	0.12
24	601077	渝农商行	32,000	195,520.00	0.12
25	001309	德明利	200	188,580.00	0.12
26	000408	藏格矿业	2,700	187,164.00	0.12
27	601168	西部矿业	6,800	184,552.00	0.12
28	002463	沪电股份	1,200	183,360.00	0.12
29	002371	北方华创	200	176,912.00	0.11
30	600522	中天科技	2,900	175,972.00	0.11
31	688072	拓荆科技	200	175,906.00	0.11
32	002532	天山铝业	16,300	174,899.00	0.11
33	002709	天赐材料	3,400	174,862.00	0.11
34	300502	新易盛	280	169,960.00	0.11
35	001389	广合科技	700	166,075.00	0.10
36	301377	鼎泰高科	300	165,270.00	0.10
37	000423	东阿阿胶	3,400	154,224.00	0.10
38	688233	神工股份	700	150,094.00	0.09
39	600489	中金黄金	8,300	149,815.00	0.09
40	601872	招商轮船	8,500	149,345.00	0.09
41	688525	佰维存储	300	148,419.00	0.09
42	002128	电投能源	6,300	145,656.00	0.09
43	300394	天孚通信	480	145,286.40	0.09
44	300476	胜宏科技	400	138,572.00	0.09
45	002916	深南电路	300	137,370.00	0.09
46	688082	盛美上海	300	129,600.00	0.08
47	300054	鼎龙股份	1,200	127,164.00	0.08
48	600498	烽火通信	1,700	125,120.00	0.08
49	600009	上海机场	5,200	120,120.00	0.08
50	000661	长春高新	1,800	119,880.00	0.08
51	600519	贵州茅台	100	118,549.00	0.07
52	600025	华能水电	13,200	117,348.00	0.07
53	600885	宏发股份	3,400	117,266.00	0.07
54	600196	复星医药	5,200	116,844.00	0.07
55	688169	石头科技	1,200	113,964.00	0.07
56	600188	兖矿能源	6,400	113,728.00	0.07
57	688472	阿特斯	10,500	113,610.00	0.07
58	600233	圆通速递	7,200	113,400.00	0.07
59	000301	东方盛虹	9,900	113,355.00	0.07
60	600346	恒力石化	6,400	113,344.00	0.07
61	002409	雅克科技	500	112,250.00	0.07
62	600961	株冶集团	3,400	110,126.00	0.07
63	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.07
64	002001	新 和 成	3,800	107,996.00	0.07
65	002493	荣盛石化	10,000	107,500.00	0.07

66	600010	包钢股份	48,000	107,040.00	0.07
67	002304	洋河股份	2,800	106,820.00	0.07
68	600426	华鲁恒升	4,400	105,248.00	0.07
69	002384	东山精密	400	104,940.00	0.07
70	688111	金山办公	492	104,820.60	0.07
71	600150	中国船舶	3,100	104,749.00	0.07
72	002466	天齐锂业	1,700	104,244.00	0.07
73	000858	五 粮 液	1,400	103,600.00	0.07
74	000983	山西焦煤	17,700	102,660.00	0.06
75	300604	长川科技	300	102,426.00	0.06
76	603129	春风动力	400	102,320.00	0.06
77	603259	药明康德	800	99,608.00	0.06
78	300223	北京君正	400	99,560.00	0.06
79	301217	铜冠铜箔	600	99,042.00	0.06
80	002460	赣锋锂业	1,500	98,100.00	0.06
81	688025	杰普特	200	94,000.00	0.06
82	603124	江南新材	500	93,490.00	0.06
83	688008	澜起科技	300	92,970.00	0.06
84	000725	京东方 A	10,700	92,876.00	0.06
85	688409	富创精密	300	91,875.00	0.06
86	600026	中远海能	5,100	91,494.00	0.06
87	002595	豪迈科技	1,960	91,336.00	0.06
88	300475	香农芯创	300	90,000.00	0.06
89	600690	海尔智家	4,400	89,804.00	0.06
90	601336	新华保险	1,500	89,490.00	0.06
91	002155	湖南黄金	3,700	88,319.00	0.06
92	688019	安集科技	260	88,259.60	0.06
93	601658	邮储银行	17,800	87,754.00	0.06
94	601838	成都银行	4,900	86,730.00	0.05
95	601319	中国人保	12,800	86,528.00	0.05
96	688052	纳芯微	300	86,493.00	0.05
97	600887	伊利股份	3,600	86,256.00	0.05
98	601398	工商银行	12,200	86,254.00	0.05
99	601229	上海银行	9,900	85,932.00	0.05
100	600066	宇通客车	3,200	85,792.00	0.05
101	688257	新锐股份	840	85,596.00	0.05
102	605358	立昂微	1,100	85,360.00	0.05
103	600036	招商银行	2,400	85,200.00	0.05
104	600958	东方证券	9,000	84,960.00	0.05
105	601988	中国银行	14,800	84,656.00	0.05
106	601166	兴业银行	5,100	84,456.00	0.05
107	002352	顺丰控股	2,700	84,402.00	0.05
108	600015	华夏银行	13,200	84,348.00	0.05

109	601328	交通银行	13,100	84,233.00	0.05
110	600919	江苏银行	7,800	84,084.00	0.05
111	688126	沪硅产业	2,100	83,769.00	0.05
112	000157	中联重科	12,000	83,640.00	0.05
113	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.05
114	000001	平安银行	8,300	83,415.00	0.05
115	000999	华润三九	3,700	83,213.00	0.05
116	002142	宁波银行	2,800	83,132.00	0.05
117	600019	宝钢股份	15,300	83,079.00	0.05
118	605117	德业股份	780	82,820.40	0.05
119	601601	中国太保	2,900	82,708.00	0.05
120	600000	浦发银行	9,600	82,656.00	0.05
121	600028	中国石化	18,500	82,510.00	0.05
122	601998	中信银行	11,900	82,467.00	0.05
123	600741	华域汽车	5,300	82,256.00	0.05
124	601009	南京银行	8,300	82,087.00	0.05
125	601818	光大银行	28,400	82,076.00	0.05
126	002436	兴森科技	1,600	81,520.00	0.05
127	601628	中国人寿	2,300	81,305.00	0.05
128	600016	民生银行	25,200	81,144.00	0.05
129	000783	长江证券	8,300	80,925.00	0.05
130	601916	浙商银行	30,500	80,215.00	0.05
131	688059	华锐精密	400	79,884.00	0.05
132	601108	财通证券	9,200	79,580.00	0.05
133	688100	威胜信息	2,600	79,534.00	0.05
134	688981	中芯国际	500	79,410.00	0.05
135	601825	沪农商行	10,600	79,394.00	0.05
136	002273	水晶光电	2,200	78,056.00	0.05
137	002517	恺英网络	4,800	78,000.00	0.05
138	601728	中国电信	14,800	76,812.00	0.05
139	600050	中国联通	19,200	76,800.00	0.05
140	300017	网宿科技	5,900	76,759.00	0.05
141	601318	中国平安	1,600	76,384.00	0.05
142	600563	法拉电子	400	76,320.00	0.05
143	300620	光库科技	200	75,640.00	0.05
144	600909	华安证券	6,800	75,548.00	0.05
145	600926	杭州银行	5,200	75,140.00	0.05
146	600219	南山铝业	18,800	75,012.00	0.05
147	300012	华测检测	5,400	74,844.00	0.05
148	600105	永鼎股份	1,100	74,228.00	0.05
149	300570	太辰光	300	74,013.00	0.05
150	603606	东方电缆	1,780	73,887.80	0.05
151	002484	江海股份	700	73,500.00	0.05

152	002056	横店东磁	2,400	73,152.00	0.05
153	003031	中瓷电子	400	72,120.00	0.05
154	601555	东吴证券	9,100	72,072.00	0.05
155	300661	圣邦股份	500	71,740.00	0.05
156	002555	三七互娱	3,800	71,706.00	0.05
157	603444	吉比特	200	71,684.00	0.05
158	002444	巨星科技	2,300	71,530.00	0.05
159	688582	芯动联科	1,100	71,500.00	0.04
160	300628	亿联网络	2,100	71,022.00	0.04
161	300903	科翔股份	700	70,917.00	0.04
162	688271	联影医疗	700	70,861.00	0.04
163	688777	中控技术	600	70,500.00	0.04
164	688266	泽璟制药	600	69,996.00	0.04
165	000895	双汇发展	3,083	69,059.20	0.04
166	600298	安琪酵母	1,900	68,780.00	0.04
167	603993	洛阳钼业	3,900	68,445.00	0.04
168	003010	若羽臣	2,800	68,040.00	0.04
169	300857	协创数据	200	67,980.00	0.04
170	688469	芯联集成	6,400	67,904.00	0.04
171	601899	紫金矿业	2,700	67,878.00	0.04
172	301319	唯特偶	400	66,932.00	0.04
173	688172	燕东微	800	66,928.00	0.04
174	301205	联特科技	200	66,820.00	0.04
175	300408	三环集团	400	66,760.00	0.04
176	000792	盐湖股份	2,200	66,418.00	0.04
177	002472	双环传动	1,600	66,416.00	0.04
178	605178	时空科技	700	66,374.00	0.04
179	002138	顺络电子	900	65,790.00	0.04
180	600487	亨通光电	600	65,604.00	0.04
181	603132	金徽股份	4,200	65,436.00	0.04
182	601198	东兴证券	4,800	65,232.00	0.04
183	002170	芭田股份	6,000	65,160.00	0.04
184	601100	恒立液压	600	64,536.00	0.04
185	603040	新坐标	1,015	64,016.05	0.04
186	300735	光弘科技	2,800	63,672.00	0.04
187	000933	神火股份	3,000	63,600.00	0.04
188	002648	卫星化学	2,700	63,423.00	0.04
189	301665	泰禾股份	3,000	62,880.00	0.04
190	601600	中国铝业	7,600	62,472.00	0.04
191	688205	德科立	300	62,457.00	0.04
192	600584	长电科技	600	62,130.00	0.04
193	002402	和而泰	2,400	61,992.00	0.04
194	600143	金发科技	4,000	61,800.00	0.04

195	688150	莱特光电	900	61,758.00	0.04
196	600236	桂冠电力	7,000	61,460.00	0.04
197	600060	海信视像	2,200	61,314.00	0.04
198	002078	太阳纸业	4,900	61,201.00	0.04
199	603317	天味食品	4,700	61,147.00	0.04
200	688262	国芯科技	1,412	61,040.76	0.04
201	601128	常熟银行	10,440	60,760.80	0.04
202	605118	力鼎光电	1,700	59,313.00	0.04
203	688107	安路科技	1,300	59,280.00	0.04
204	300458	全志科技	1,500	59,190.00	0.04
205	601958	金钼股份	2,100	59,031.00	0.04
206	603979	金诚信	1,000	59,030.00	0.04
207	300672	国科微	200	59,000.00	0.04
208	001337	四川黄金	1,600	58,656.00	0.04
209	688195	腾景科技	300	57,774.00	0.04
210	300001	特锐德	1,500	56,745.00	0.04
211	000551	创元科技	2,700	55,701.00	0.04
212	688313	仕佳光子	300	55,395.00	0.03
213	000975	山金国际	3,200	54,400.00	0.03
214	605376	博迁新材	200	54,260.00	0.03
215	688221	前沿生物	2,400	53,760.00	0.03
216	603629	利通电子	300	53,643.00	0.03
217	688213	思特威	500	53,535.00	0.03
218	002847	盐津铺子	1,200	53,520.00	0.03
219	300323	华灿光电	2,600	53,040.00	0.03
220	301031	中熔电气	444	53,035.80	0.03
221	301321	翰博高新	1,200	52,980.00	0.03
222	688183	生益电子	400	52,960.00	0.03
223	300434	金石亚药	4,700	52,781.00	0.03
224	002938	鹏鼎控股	500	52,690.00	0.03
225	601577	长沙银行	6,000	52,260.00	0.03
226	688322	奥比中光	400	52,220.00	0.03
227	605289	罗曼股份	360	52,200.00	0.03
228	600699	均胜电子	2,400	51,864.00	0.03
229	300801	泰和科技	1,600	51,680.00	0.03
230	301349	信德新材	700	51,520.00	0.03
231	603233	大参林	3,400	51,102.00	0.03
232	688275	万润新能	400	51,020.00	0.03
233	688235	百济神州	200	50,922.00	0.03
234	001314	亿道信息	800	49,440.00	0.03
235	002354	天娱数科	5,300	49,290.00	0.03
236	688127	蓝特光学	500	48,800.00	0.03
237	601665	齐鲁银行	8,400	48,468.00	0.03

238	002174	游族网络	3,800	47,918.00	0.03
239	301176	逸豪新材	700	47,600.00	0.03
240	300596	利安隆	900	47,232.00	0.03
241	605016	百龙创园	1,800	46,530.00	0.03
242	002020	京新药业	3,700	46,213.00	0.03
243	301345	涛涛车业	200	46,200.00	0.03
243	688680	海优新材	1,100	46,200.00	0.03
244	688031	星环科技	400	46,072.00	0.03
245	002901	大博医疗	1,100	45,958.00	0.03
246	002134	天津普林	1,500	45,630.00	0.03
246	002947	恒铭达	600	45,630.00	0.03
247	603399	永杉锂业	2,000	44,960.00	0.03
248	688373	盟科药业	9,917	44,924.01	0.03
249	603668	天马科技	3,500	44,310.00	0.03
250	002609	捷顺科技	5,800	44,196.00	0.03
251	002673	西部证券	6,800	44,132.00	0.03
252	600323	瀚蓝环境	1,600	43,936.00	0.03
253	600288	大恒科技	3,300	43,890.00	0.03
254	301201	诚达药业	1,200	43,632.00	0.03
255	300860	锋尚文化	1,700	43,520.00	0.03
256	301190	善水科技	2,700	43,281.00	0.03
257	603920	世运电路	900	43,236.00	0.03
258	301511	德福科技	300	43,155.00	0.03
259	601717	中创智领	3,100	43,121.00	0.03
260	688215	瑞晟智能	1,070	42,971.20	0.03
261	300404	博济医药	4,900	42,924.00	0.03
262	002488	金固股份	4,800	42,768.00	0.03
263	603508	思维列控	2,000	42,720.00	0.03
264	300627	华测导航	1,500	42,600.00	0.03
265	600901	江苏金租	7,400	42,550.00	0.03
266	603980	吉华集团	6,400	42,496.00	0.03
267	300397	天和防务	2,800	42,392.00	0.03
268	301215	中汽股份	8,100	42,039.00	0.03
269	688456	有研粉材	300	41,880.00	0.03
270	601991	大唐发电	5,900	41,772.00	0.03
271	605298	必得科技	800	41,560.00	0.03
272	002824	和胜股份	1,200	41,496.00	0.03
273	002287	奇正藏药	2,200	41,448.00	0.03
274	300768	迪普科技	3,000	41,310.00	0.03
275	603162	海通发展	4,600	41,262.00	0.03
276	300487	蓝晓科技	700	41,195.00	0.03
277	300980	祥源新材	1,400	41,174.00	0.03
278	301109	军信股份	3,300	41,118.00	0.03

279	300283	温州宏丰	2,000	41,100.00	0.03
280	002946	新乳业	2,900	40,832.00	0.03
281	603933	睿能科技	1,800	40,590.00	0.03
282	300700	岱勒新材	1,900	40,432.00	0.03
283	300098	高新兴	8,800	40,392.00	0.03
284	603817	海峡环保	7,900	40,369.00	0.03
285	688128	中国电研	1,700	40,358.00	0.03
286	688787	海天瑞声	300	40,335.00	0.03
287	600822	上海物贸	5,300	40,333.00	0.03
288	300853	申昊科技	1,300	40,157.00	0.03
289	300226	上海钢联	2,620	40,112.20	0.03
290	003029	吉大正元	2,500	40,050.00	0.03
291	603966	法兰泰克	4,900	39,935.00	0.03
292	002391	长青股份	8,200	39,934.00	0.03
293	603803	瑞斯康达	3,400	39,916.00	0.03
294	301339	通行宝	3,900	39,897.00	0.03
295	300797	钢研纳克	3,000	39,780.00	0.03
296	000885	城发环境	3,300	39,699.00	0.02
297	603013	亚普股份	2,500	39,475.00	0.02
298	300750	宁德时代	100	39,301.00	0.02
299	688339	亿华通	2,100	39,270.00	0.02
300	603888	新华网	2,300	39,169.00	0.02
301	301571	国科天成	600	39,108.00	0.02
302	600230	沧州大化	3,000	39,060.00	0.02
303	300662	科锐国际	2,300	39,054.00	0.02
304	600825	新华传媒	8,600	38,872.00	0.02
305	301329	信音电子	1,600	38,864.00	0.02
306	600166	福田汽车	13,300	38,703.00	0.02
307	000880	潍柴重机	1,680	38,656.80	0.02
308	001332	锡装股份	980	38,484.60	0.02
309	000987	越秀资本	4,900	38,318.00	0.02
310	002318	久立特材	1,600	38,240.00	0.02
311	603025	大豪科技	2,800	38,192.00	0.02
312	301025	读客文化	4,900	38,024.00	0.02
313	300697	电工合金	2,500	37,875.00	0.02
314	002085	万丰奥威	3,400	37,706.00	0.02
315	603579	荣泰健康	2,200	37,334.00	0.02
316	002640	跨境通	12,400	37,324.00	0.02
317	300504	天邑股份	2,300	37,099.00	0.02
318	301606	绿联科技	600	36,612.00	0.02
319	300816	艾可蓝	500	36,600.00	0.02
320	001316	润贝航科	1,100	36,278.00	0.02
321	688365	光云科技	2,300	36,271.00	0.02

322	301200	大族数控	100	36,065.00	0.02
323	603939	益丰药房	2,000	35,960.00	0.02
324	603285	键邦股份	800	35,848.00	0.02
325	301019	宁波色母	2,000	35,660.00	0.02
326	688531	日联科技	200	35,568.00	0.02
327	001696	宗申动力	1,700	35,377.00	0.02
328	002831	裕同科技	981	34,884.36	0.02
329	600282	南钢股份	7,600	34,884.00	0.02
330	301608	博实结	694	34,880.44	0.02
331	002943	宇晶股份	780	34,499.40	0.02
332	000887	中鼎股份	1,900	33,991.00	0.02
333	688608	恒玄科技	200	33,438.00	0.02
334	600642	申能股份	3,800	33,174.00	0.02
335	300839	博汇股份	2,800	32,788.00	0.02
336	000513	丽珠集团	1,100	31,779.00	0.02
337	601000	唐山港	7,500	31,125.00	0.02
338	301428	世纪恒通	900	31,113.00	0.02
339	600578	京能电力	4,800	30,960.00	0.02
340	600737	中粮糖业	2,500	30,825.00	0.02
341	002926	华西证券	3,700	30,229.00	0.02
342	002867	周大生	2,700	30,105.00	0.02
343	688188	柏楚电子	280	29,876.00	0.02
344	301136	招标股份	2,700	29,646.00	0.02
345	603568	伟明环保	1,920	29,529.60	0.02
346	000598	兴蓉环境	4,400	28,248.00	0.02
347	000750	国海证券	7,500	27,600.00	0.02
348	688772	珠海冠宇	1,400	27,482.00	0.02
349	300760	迈瑞医疗	200	27,166.00	0.02
350	600535	天士力	2,000	26,460.00	0.02
351	000921	海信家电	900	24,588.00	0.02
352	603345	安井食品	300	24,057.00	0.02
353	600004	白云机场	3,300	23,958.00	0.02
354	600038	中直股份	900	22,761.00	0.01
355	002773	康弘药业	1,100	22,495.00	0.01
356	600809	山西汾酒	200	21,874.00	0.01
357	600436	片仔癀	200	21,856.00	0.01
358	601061	中信金属	2,000	21,540.00	0.01
359	600483	福能股份	2,100	21,399.00	0.01
360	688677	海泰新光	200	20,226.00	0.01
361	000429	粤高速 A	1,400	19,110.00	0.01
362	002508	老板电器	1,300	19,006.00	0.01
363	002850	科达利	100	18,930.00	0.01
364	000883	湖北能源	4,300	18,576.00	0.01

365	300718	长盛轴承	300	18,291.00	0.01
366	601799	星宇股份	200	18,124.00	0.01
367	600754	锦江酒店	1,000	17,990.00	0.01
368	600906	财达证券	2,400	17,904.00	0.01
369	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.01
370	600517	国网英大	3,700	17,316.00	0.01
371	603341	龙旗科技	400	16,996.00	0.01
372	603688	石英股份	200	16,522.00	0.01
373	002920	德赛西威	200	16,300.00	0.01
374	300613	富瀚微	200	16,016.00	0.01
375	301292	海科新源	200	15,946.00	0.01
376	300274	阳光电源	100	15,902.00	0.01
377	603529	爱玛科技	800	15,608.00	0.01
378	301358	湖南裕能	200	15,174.00	0.01
379	301165	锐捷网络	180	14,481.00	0.01
380	300724	捷佳伟创	200	14,120.00	0.01
381	600098	广州发展	2,300	13,593.00	0.01
382	600062	华润双鹤	800	12,832.00	0.01
383	300964	本川智能	140	12,063.80	0.01
384	301095	广立微	100	11,805.00	0.01
385	301391	卡莱特	200	11,420.00	0.01
386	002756	永兴材料	200	11,328.00	0.01
387	600160	巨化股份	200	10,602.00	0.01
388	688698	伟创电气	200	10,490.00	0.01
389	300895	铜牛信息	200	10,408.00	0.01
390	300624	万兴科技	200	10,374.00	0.01
391	300650	太龙股份	700	10,171.00	0.01
392	688084	晶品特装	200	10,056.00	0.01
393	301333	诺思格	200	10,018.00	0.01
394	603156	养元饮品	200	9,814.00	0.01
395	301080	百普赛斯	200	9,600.00	0.01
396	300913	兆龙互连	200	9,582.00	0.01
397	603501	豪威集团	100	9,485.00	0.01
398	301155	海力风电	200	8,580.00	0.01
399	600928	西安银行	2,600	8,502.00	0.01
400	603338	浙江鼎力	200	8,500.00	0.01
401	605305	中际联合	200	8,384.00	0.01
402	002608	江苏国信	1,200	8,280.00	0.01
403	002839	张家港行	2,100	8,190.00	0.01
404	300731	科创新源	140	8,170.40	0.01
405	605020	永和股份	200	8,144.00	0.01
406	301498	乖宝宠物	200	8,118.00	0.01
407	603379	三美股份	100	7,589.00	0.00

408	688636	智明达	200	7,246.00	0.00
409	688584	上海合晶	200	7,190.00	0.00
410	603236	移远通信	140	7,163.80	0.00
411	000977	浪潮信息	100	7,000.00	0.00
412	301137	哈焊华通	200	6,872.00	0.00
413	600482	中国动力	200	6,560.00	0.00
414	301510	固高科技	200	6,386.00	0.00
415	301138	华研精机	200	6,200.00	0.00
416	688518	联赢激光	200	6,180.00	0.00
417	603605	珀莱雅	100	5,992.00	0.00
418	688428	诺诚健华	200	5,694.00	0.00
419	300191	潜能恒信	200	5,530.00	0.00
420	002074	国轩高科	200	5,502.00	0.00
421	688475	萤石网络	200	5,470.00	0.00
422	301029	怡合达	200	5,402.00	0.00
423	301302	华如科技	200	5,384.00	0.00
424	300850	新强联	200	5,360.00	0.00
425	300992	泰福泵业	200	4,986.00	0.00
426	002126	银轮股份	100	4,980.00	0.00
427	301598	博科测试	100	4,952.00	0.00
428	603369	今世缘	200	4,742.00	0.00
429	002048	宁波华翔	200	4,600.00	0.00
429	301382	蜂助手	100	4,600.00	0.00
430	002311	海大集团	100	4,461.00	0.00
431	002050	三花智控	100	4,383.00	0.00
432	300832	新产业	100	4,200.00	0.00
433	003030	祖名股份	200	4,110.00	0.00
434	002032	苏泊尔	100	3,960.00	0.00
435	603195	公牛集团	100	3,915.00	0.00
436	600285	羚锐制药	200	3,876.00	0.00
437	301230	泓博医药	100	3,684.00	0.00
438	003011	海象新材	200	3,634.00	0.00
439	600071	凤凰光学	200	3,426.00	0.00
440	600315	上海家化	200	3,364.00	0.00
441	600845	宝信软件	200	3,326.00	0.00
442	300363	博腾股份	200	3,248.00	0.00
443	601231	环旭电子	100	3,240.00	0.00
444	300748	金力永磁	100	3,085.00	0.00
445	301509	金凯生科	100	3,041.00	0.00
446	603833	欧派家居	100	3,011.00	0.00
447	600148	长春一东	200	2,902.00	0.00
448	002368	太极股份	200	2,798.00	0.00
449	002801	微光股份	100	2,760.00	0.00

450	603733	仙鹤股份	100	2,701.00	0.00
451	002258	利尔化学	200	2,542.00	0.00
452	002396	星网锐捷	130	2,492.10	0.00
453	002624	完美世界	200	2,484.00	0.00
454	300003	乐普医疗	200	2,370.00	0.00
455	603882	金域医学	100	2,248.00	0.00
456	603556	海兴电力	100	2,200.00	0.00
457	603776	永安行	100	2,087.00	0.00
458	600389	江山股份	100	1,952.00	0.00
459	603787	新日股份	200	1,818.00	0.00
460	600817	宇通重工	200	1,760.00	0.00
461	603206	嘉环科技	100	1,593.00	0.00
462	002017	东信和平	100	1,463.00	0.00
463	603161	科华控股	100	1,327.00	0.00
464	300528	幸福蓝海	100	1,285.00	0.00
465	301180	万祥科技	100	1,253.00	0.00
466	600927	永安期货	100	1,245.00	0.00
467	000531	穗恒运 A	200	1,198.00	0.00
468	601865	福莱特	100	1,051.00	0.00
469	601187	厦门银行	100	683.00	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	601872	招商轮船	779,567.00	0.26
2	002709	天赐材料	728,346.00	0.25
3	601168	西部矿业	698,452.00	0.24
4	600549	厦门钨业	697,602.00	0.24
5	601600	中国铝业	595,857.00	0.20
6	301377	鼎泰高科	584,174.00	0.20
7	600690	海尔智家	560,102.00	0.19
8	002532	天山铝业	543,748.00	0.18
9	601169	北京银行	525,885.00	0.18
10	688002	睿创微纳	520,472.75	0.18
11	603993	洛阳钼业	520,137.00	0.18
12	002558	巨人网络	496,546.00	0.17
13	002156	通富微电	492,460.00	0.17
14	000807	云铝股份	492,403.00	0.17
15	600489	中金黄金	491,365.00	0.17
16	600096	云天化	491,109.00	0.17
17	600989	宝丰能源	477,375.00	0.16
18	600000	浦发银行	474,786.00	0.16
19	688082	盛美上海	472,022.00	0.16

20	000661	长春高新	451,369.00	0.15
----	--------	------	------------	------

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	1,245,221.00	0.42
2	603993	洛阳钼业	1,192,737.00	0.40
3	600000	浦发银行	989,350.00	0.34
4	601169	北京银行	930,881.00	0.32
5	600919	江苏银行	899,046.00	0.30
6	600926	杭州银行	873,433.00	0.30
7	601336	新华保险	863,675.00	0.29
8	601872	招商轮船	849,508.00	0.29
9	601077	渝农商行	816,450.00	0.28
10	600690	海尔智家	815,487.00	0.28
11	603259	药明康德	808,802.00	0.27
12	601601	中国太保	754,039.00	0.26
13	600016	民生银行	750,286.00	0.25
14	300033	同花顺	746,010.00	0.25
15	601319	中国人保	712,416.00	0.24
16	002028	思源电气	708,653.00	0.24
17	300394	天孚通信	657,841.00	0.22
18	601138	工业富联	643,358.00	0.22
19	601628	中国人寿	643,058.00	0.22
20	600989	宝丰能源	631,848.00	0.21

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	143,230,758.39
卖出股票收入（成交）总额	174,770,910.31

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	21,804,194.61	13.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	114,511,267.45	72.05
	其中：政策性金融债	10,126,909.59	6.37
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	36,360,928.11	22.88
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	172,676,390.17	108.65

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019547	16 国债 19	183,590	21,804,194.61	13.72
2	102580744	25 汇金 MTN002	150,000	15,172,826.30	9.55
3	232480035	24 平安银行二 级资本债 01A	140,000	14,573,321.10	9.17
4	232480039	24 广发银行二 级资本债 01A	140,000	14,473,134.79	9.11
5	232580006	25 民生银行二 级资本债 01	140,000	14,321,313.42	9.01

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.11 本报告期投资基金情况

7.11.1 投资政策及风险说明

无。

7.11.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

无。

7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，广发银行股份有限公司于 2025 年 9 月 12 日发布公告称公司于近日收到国家金融监督管理总局行政处罚决定书（金罚决字[2025]197 号），因公司相关贷款、票据、保理等业务管理不审慎，监管数据报送不合规等，被处以 6670 万元罚款。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合基金管理人投资制度的规定。

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	45,616.43
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,395.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,011.97

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

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
建信丰融 债券 A	1,152	82,945.92	972.23	0.00	95,552,726.86	100.00
建信丰融 债券 C	832	65,688.33	158,992.03	0.29	54,493,702.46	99.71
合计	1,984	75,708.87	159,964.26	0.11	150,046,429.32	99.89

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	建信丰融债券 A	59,636.22	0.06
	建信丰融债券 C	0.00	0.00
	合计	59,636.22	0.04

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

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

项目	建信丰融债券 A	建信丰融债券 C
基金合同生效日 (2025 年 2 月 27 日) 基金份额总额	2,133,214,466.79	1,998,876,768.21
本报告期期初基金份 额总额	197,201,114.94	89,250,545.66
本报告期基金总申购 份额	4,015,423.09	17,879,511.62

减：本报告期基金总赎回份额	105,662,838.94	52,477,362.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	95,553,699.09	54,652,694.49

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。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7.3 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。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.8 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

10.8.1 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 (%)	
华福证券	1	175,569,141.95	55.21	76,526.63	54.65	-
华创证券	2	142,432,526.75	44.79	63,513.08	45.35	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	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，并能基金提供全面的信息服
- (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交易单元，剔除华鑫证券 1 个交易单元。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。

10.8.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
华福证券	95,399,346.20	100.00	7,106,000.00	100.00	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增深圳前海微众银行股份有限公司为建信双债增强债券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 4 月 20 日
2	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
3	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
无。

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丰融债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信丰融债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信丰融债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信丰融债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

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