

建信汇利灵活配置混合型证券投资基金 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：兴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。

资产托管人兴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	5
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	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
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	11
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	11
§ 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	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43

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	44
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	44
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	44
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	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 盈利投资者数量占比	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4 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	45
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	46
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	47
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信汇利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	建信汇利灵活配置混合
基金主代码	002573
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 9 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	30,559,874.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金自上而下积极、动态地配置大类资产，同时通过合理的证券选择，在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整大类资产配置比例，同时将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，运用自上而下和自下而上相结合的个股、个券投资策略，在大类资产配置和证券选择两个层面上实现投资组合的双重优化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中债总财富（总值）指数收益率×35%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	冯萌
	联系电话	010-66228888	021-52629999-213310
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-81-95533；010-66228000	95561
传真		010-66228001	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		100033	200120
法定代表人		曲寅军	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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)
本期已实现收益	3,970,102.41
本期利润	7,304,089.51
加权平均基金份额本期利润	0.2296
本期加权平均净值利润率	13.36%
本期基金份额净值增长率	14.35%
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	25,398,778.85
期末可供分配基金份额利润	0.8311
期末基金资产净值	55,958,652.97
期末基金份额净值	1.8311
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	75.90%

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	14.79%	1.59%	8.13%	0.82%	6.66%	0.77%
过去六个月	14.35%	1.66%	5.74%	0.74%	8.61%	0.92%
过去一年	33.67%	1.38%	17.40%	0.66%	16.27%	0.72%
过去三年	18.93%	1.21%	24.81%	0.71%	-5.88%	0.50%

过去五年	-13.86%	1.19%	6.36%	0.72%	-20.22%	0.47%
过去七年	50.36%	1.21%	35.17%	0.75%	15.19%	0.46%
自基金合同生效起至今	75.90%	1.17%	38.45%	0.78%	37.45%	0.39%

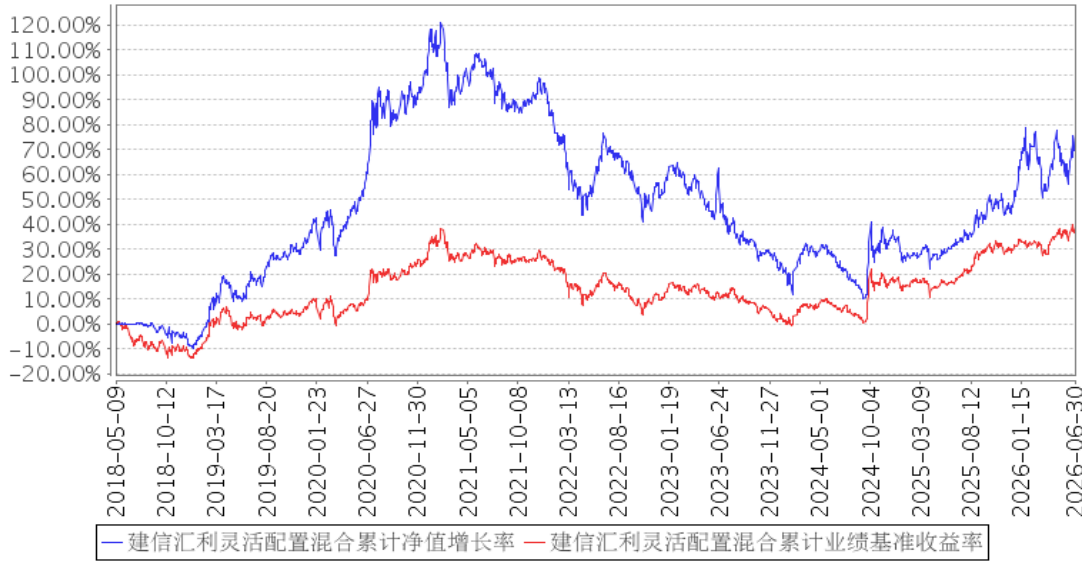
注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中债总财富（总值）指数收益率×35%。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制的，从上海和深圳股票市场中选取的 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。该指数为具有良好的市场代表性、能够反映 A 股市场整体走势的指数。

中债总财富（总值）指数是由中央国债登记结算有限责任公司推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中债总财富（总值）指数为掌握我国债券市场价格波动幅度和变动趋势、测算债券投资回报率水平提供了很好的依据。

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

建信汇利灵活配置混合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		
蒋严泽	权益投资部基金经理兼研究部副总经理，本基金的基金经理	2025 年 9 月 16 日	-	11	蒋严泽先生，权益投资部基金经理兼研究部副总经理，硕士。2014 年 6 月毕业于美国南加利福尼亚大学金融工程专业，2015 年 1 月加入建信基金研究部，历任助理研究员、初级研究员、研究员、策略研究主管、总经理助理、副总经理兼基金经理助理职务。2022 年 10 月 14 日起任建信恒久价值混合型证券投资基金的基金经理；2024 年 4 月 1 日至 2024 年 10 月 11 日任建信锋睿优选混合型证券投资基金的基金经理；2025 年 9 月 16 日起任建信汇利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2025 年 11 月 28 日起任建信红利严选混合型发起式证券投资基金的基金经理；2026 年 2 月 10 日起任建信资源严选股票型发起式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《建信汇利灵活配置混合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，大类资产总体呈现股强债弱、黄金领先、商品内部剧烈分化的格局。黄金在货币信用、央行购金、联储政策预期及地缘风险共同推动下，出现一轮过山车行情；国内债券的防御性下降，名义增长和通胀预期回升对利率形成上行压力。权益市场总体上涨，但收益高度集中于 AI 映射下的科技成长风格和极少数景气行业。

从宽基和风格指数看，成长与价值、科技与红利之间形成了明显的收益差。上半年的风格变化，本质上是定价主线从地缘和再通胀预期转向产业盈利兑现。一季度，资源品和能源资产受益于供给风险、价格弹性和战略安全；二季度，随着 AI 产业链盈利预期持续上修，市场重新把更高估值给予能够兑现收入、利润和订单的科技公司。传统价值和红利并非长期逻辑全面失效，而是

在缺少新增盈利催化的情况下，相对吸引力被快速上修的科技成长所压制，市场把有限资金集中到盈利上修速度最快、产业趋势最清晰的方向。指数上涨和结构性的超高收益掩盖了大量行业和个股下跌，这种结构性行情中，行业选择和切换节奏对收益的影响远大于指数方向判断。科技产业盈利上修推动二季度形成极端成长行情，红利和传统价值则在缺乏新增催化时显著回撤。权益组合的收益表现更多取决于行业选择、配置偏离、切换节奏和集中度管理。本组合一季度的行业配置主要集中于周期与价值，具体包括：有色金属、基础化工、非银金融，对电子配置相对较低。一季度面对资源品大幅波动，组合通过细分行业轮动获得部分正贡献，煤炭配置表现较好，但未参与黄金行情，油气和化工的风险收益表现不佳。进入二季度，组合逐步降低铜、铝、石油和碳酸锂的配置，增加科技龙头配置。在极致结构性行情演绎下，跟随基准指数的行业权重变化提升了电子、通信行业配置，同时主动增配锂电龙头、以 GARP 策略精选个股对冲部分行业的拥挤风险。

回顾上半年，组合管理的不足之处在于：一是年初对黄金配置不足，在有色行情中没有充分体现周期品细分领域的 alpha；二是科技切换前，周期和价值仓位经历了较大回撤，包括保险、碳酸锂，下跌止损不够坚决；三是周期行业中与 AI 需求相关的金属、材料和设备可能获得成长定价，相关细分领域聚焦在 AI 小金属、电子布、AI 通胀链条等，本身与传统周期品重合度较高，但由于传统周期思维框架局限、本基金对于相关主题交易的把握不够及时。

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 14.35% 波动率 1.66% 业绩比较基准收益率 5.74% 波动率 0.74%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期市场仍处于业绩验证与高波动并存阶段。中报和三季度经营数据将提高股价与盈利兑现的相关性，科技主线由于拥挤度过高而存在交易风险，AI 宏大叙事催化的极致 beta 行情将转向订单、收入、利润率的具体经营表现与当前市值所隐含的未来预期的比较和评估。红利和传统价值在二季度大幅回撤后具备修复基础，但修复不会平均发生。银行、公用事业和部分高现金流央国企仍具有底仓价值，但也同样需要警惕资金阶段性追捧后的下跌消化；煤炭、石油、有色等周期型红利需要同时验证价格、成本和分红能力。

中期我们对权益市场仍保持积极判断，尤其是我们不认为市场在这个位置会由于交易拥挤和局部流动性问题而进入“熊市”。我们认为市场驱动将进一步从估值扩张转向盈利增长，指数层面的机会仍然存在，但行业和个股分化会继续扩大。名义增长、PPI、工业企业利润和企业盈利修订若持续改善，将支持顺周期和中游制造；如果这些指标再次转弱，市场将更加集中于少数确定性成长和高现金流资产。

组合管理仍将沿着自上而下配置框架，做好行业比较和轮动配置。在中期维度上，重点关注

三条逻辑主线：第一是受益供给约束、战略安全和自由现金流改善的行业，重点观察有色金属、基础化工、能源。在相关领域的细分领域轮动中，必须同时满足供给纪律、价格支撑和资本回报改善，不能只依赖宏观叙事或静态低估值。第二是代表中国硬实力的科技制造领域，其中既包括想象空间仍然巨大的国产算力链，也包括充分参与全球竞争、体现中国制造实力的核心资产个股。第三，对高质量红利和现金流价值仍然保持重视，尤其是盈利稳定、资本开支可控、分红政策清晰、资产负债表健康的公司，相关公司如果能够和前述两条逻辑形成共振，将成为组合重点配置的方向；但与此同时，要对周期高点形成的高股息保持谨慎、对市场资金阶段性避险选择导致的风格轮动保持警醒。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信汇利灵活配置混合型证券投资基金

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	8,908,733.06	10,999,053.14
结算备付金		286,155.22	317,350.06
存出保证金		73,632.10	93,026.54
交易性金融资产	6.4.7.2	47,602,176.58	41,464,271.96
其中：股票投资		47,602,176.58	41,464,271.96
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		122,874.75	186,587.19
应收股利		-	-
应收申购款		660.76	512.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	10,838.58	96,000.00
资产总计		57,005,071.05	53,156,801.49
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		592,586.94	186,614.50
应付赎回款		21,359.60	84,642.23
应付管理人报酬		52,220.33	52,005.20
应付托管费		8,703.38	8,667.55
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	371,547.83	447,280.31
负债合计		1,046,418.08	779,209.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	30,559,874.12	32,709,179.32
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	25,398,778.85	19,668,412.38
净资产合计		55,958,652.97	52,377,591.70
负债和净资产总计		57,005,071.05	53,156,801.49

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.8311 元，基金份额总额 30,559,874.12 份。

6.2 利润表

会计主体：建信汇利灵活配置混合型证券投资基金

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,734,418.00	-374,938.63
1. 利息收入		23,927.19	9,781.54
其中：存款利息收入	6.4.7.13	23,927.19	9,781.54
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）		4,372,736.48	-510,834.66
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,291,156.01	-1,534,561.42
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	81,580.47	1,023,726.76
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	3,333,987.10	125,752.27
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	3,767.23	362.22
减：二、营业总支出		430,328.49	335,692.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	325,687.47	286,810.48
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	54,281.23	47,801.73
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	50, 359. 79	1, 080. 00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7, 304, 089. 51	-710, 630. 84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7, 304, 089. 51	-710, 630. 84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7, 304, 089. 51	-710, 630. 84

6.3 净资产变动表

会计主体：建信汇利灵活配置混合型证券投资基金

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	32, 709, 179. 32	-	19, 668, 412. 38	52, 377, 591. 70
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	32, 709, 179. 32	-	19, 668, 412. 38	52, 377, 591. 70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2, 149, 305. 20	-	5, 730, 366. 47	3, 581, 061. 27
（一）、综合收益总额	-	-	7, 304, 089. 51	7, 304, 089. 51
（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, 149, 305. 20	-	-1, 573, 723. 04	-3, 723, 028. 24
其中：1. 基金申购款	1, 015, 459. 99	-	770, 035. 22	1, 785, 495. 21
2. 基金赎回款	-3, 164, 765. 19	-	-2, 343, 758. 26	-5, 508, 523. 45
（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	30,559,874.12	-	25,398,778.85	55,958,652.97
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	36,723,047.15	-	14,244,390.91	50,967,438.06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	36,723,047.15	-	14,244,390.91	50,967,438.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,244,167.82	-	-1,120,811.96	-2,364,979.78
（一）、综合收益总额	-	-	-710,630.84	-710,630.84
（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）	-1,244,167.82	-	-410,181.12	-1,654,348.94
其中：1. 基金申购款	65,172.84	-	22,085.43	87,258.27
2. 基金赎回款	-1,309,340.66	-	-432,266.55	-1,741,607.21
（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	35,478,879.33	-	13,123,578.95	48,602,458.28

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

基金管理人负责人

莫红

主管会计工作负责人

丁颖

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信汇利灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）是由原建信安心保本六号混合型证券投资基金转型而来。根据原建信安心保本六号混合型证券投资基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司发布的《建信安心保本六号混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为建信汇利灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》，生效日为 2018 年 5 月 9 日。原建信安心保本六号混合型证券投资基金转型为非避险策略基金，基金名称相应变更为“建信汇利灵活配置混合型证券投资基金”，建信安心保本六号混合型证券投资基金份额转换为建信汇利灵活配置混合型证券投资基金份额。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2018 年 5 月 9 日起《建信汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《建信汇利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》生效，原《建信安心保本六号混合型证券投资基金基金合同》、《建信安心保本六号混合型证券投资基金托管协议》自同一日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、地方债、央行票据、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、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的 0%-95%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例不低于 5%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约

需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 65%+中债总财富（总值）指数收益率 $\times$ 35%。

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、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	8,908,733.06
等于：本金	8,907,895.09
加：应计利息	837.97
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	8,908,733.06

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		40,455,643.11	-	47,602,176.58	7,146,533.47
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		40,455,643.11	-	47,602,176.58	7,146,533.47

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	10,838.58
待摊费用	-
合计	10,838.58

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	24.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	316,600.91
其中：交易所市场	316,600.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	54,922.86
合计	371,547.83

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	32,709,179.32	32,709,179.32
本期申购	1,015,459.99	1,015,459.99
本期赎回（以“-”号填列）	-3,164,765.19	-3,164,765.19
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	30,559,874.12	30,559,874.12

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	30,383,890.28	-10,715,477.90	19,668,412.38
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	30,383,890.28	-10,715,477.90	19,668,412.38
本期利润	3,970,102.41	3,333,987.10	7,304,089.51
本期基金份额交易产生的变动数	-2,250,695.72	676,972.68	-1,573,723.04
其中：基金申购款	1,050,568.84	-280,533.62	770,035.22
基金赎回款	-3,301,264.56	957,506.30	-2,343,758.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,103,296.97	-6,704,518.12	25,398,778.85

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	22,677.54
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	668.63
其他	581.02
合计	23,927.19

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	4,291,156.01
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	4,291,156.01

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	310,188,065.53
减：卖出股票成本总额	305,430,265.44
减：交易费用	466,644.08
买卖股票差价收入	4,291,156.01

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

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	81,580.47
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	81,580.47

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	3,333,987.10
股票投资	3,333,987.10
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	3,333,987.10

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	3,653.36
基金转换费收入	113.87
合计	3,767.23

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	4,537.44
信息披露费	30,246.84
证券出借违约金	-
银行划款手续费	961.19
银行间账户维护费	14,314.32
其他	300.00
合计	50,359.79

注：本基金本报告期部分“信息披露费”、“银行间账户维护费”等费用由管理人予以承担。

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、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	325,687.47	286,810.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	102,016.02	89,498.03
应支付基金管理人的净管理费	223,671.45	197,312.45

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/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	54,281.23	47,801.73

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	7,652,157.16	7,844,198.63
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	7,652,157.16	7,844,198.63
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	25.04%	22.11%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行-活期	8,908,733.06	22,677.54	6,215,216.30	9,538.72

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300750	宁德时代	2026 年 4 月 24 日	6 个月	新发未上市	410.34	373.17	3,800	1,559,292.00	1,418,046.00	-

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	2,220	1,555,258.04	1,952,556.60	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理与内控合规委员会、督察长、风险与合规管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和风险与合规管理部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人会对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申

请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	8,908,733.06	-	-	-	8,908,733.06
结算备付金	286,155.22	-	-	-	286,155.22
存出保证金	73,632.10	-	-	-	73,632.10
交易性金融资产	-	-	-	47,602,176.58	47,602,176.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	122,874.75	122,874.75
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	660.76	660.76
其他资产	-	-	-	10,838.58	10,838.58
资产总计	9,268,520.38	-	-	47,736,550.67	57,005,071.05
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	-	-	-	592,586.94	592,586.94
应付赎回款	-	-	-	21,359.60	21,359.60
应付管理人报酬	-	-	-	52,220.33	52,220.33
应付托管费	-	-	-	8,703.38	8,703.38
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	-	-	-	371,547.83	371,547.83
负债总计	-	-	-	1,046,418.08	1,046,418.08
利率敏感度缺口	9,268,520.38	-	-	46,690,132.59	55,958,652.97
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	10,999,053.14	-	-	-	10,999,053.14
结算备付金	317,350.06	-	-	-	317,350.06
存出保证金	93,026.54	-	-	-	93,026.54
交易性金融资产	-	-	-	41,464,271.96	41,464,271.96
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	186,587.19	186,587.19
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	512.60	512.60
其他资产	-	-	-	96,000.00	96,000.00
资产总计	11,409,429.74	-	-	41,747,371.75	53,156,801.49
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	-	-	-	186,614.50	186,614.50
应付赎回款	-	-	-	84,642.23	84,642.23
应付管理人报酬	-	-	-	52,005.20	52,005.20
应付托管费	-	-	-	8,667.55	8,667.55
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	-	-	-	447,280.31	447,280.31
负债总计	-	-	-	779,209.79	779,209.79
利率敏感度缺口	11,409,429.74	-	-	40,968,161.96	52,377,591.70

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	47,602,176.58	85.07	41,464,271.96	79.16
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	47,602,176.58	85.07	41,464,271.96	79.16

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%	4,298,249.96	3,240,921.64

	业绩比较基准下降 5%	-4, 298, 249. 96	-3, 240, 921. 64
--	----------------	------------------	------------------

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	44, 231, 573. 98	40, 953, 220. 20
第二层次	1, 952, 556. 60	511, 051. 76
第三层次	1, 418, 046. 00	-
合计	47, 602, 176. 58	41, 464, 271. 96

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	47,602,176.58	83.51
	其中：股票	47,602,176.58	83.51
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	9,194,888.28	16.13
8	其他各项资产	208,006.19	0.36
9	合计	57,005,071.05	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	4,035,226.00	7.21
C	制造业	36,801,106.20	65.76
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	6,765,844.38	12.09
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	47,602,176.58	85.07

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	300308	中际旭创	2,200	2,794,000.00	4.99
2	688041	海光信息	7,469	2,765,770.70	4.94
3	688981	中芯国际	16,900	2,684,058.00	4.80
4	688521	芯原股份	6,829	2,534,515.06	4.53
5	000811	冰轮环境	44,900	2,524,278.00	4.51
6	300750	宁德时代	6,400	2,439,872.00	4.36
7	300438	鹏辉能源	28,000	2,319,800.00	4.15
8	688256	寒武纪	1,364	2,176,330.20	3.89
9	300604	长川科技	6,000	2,048,520.00	3.66
10	688072	拓荆科技	2,220	1,952,556.60	3.49
11	688498	源杰科技	955	1,801,130.00	3.22
12	603979	金诚信	25,700	1,517,071.00	2.71
13	600487	亨通光电	13,300	1,454,222.00	2.60
14	300502	新易盛	2,380	1,444,660.00	2.58
15	603993	洛阳钼业	79,300	1,391,715.00	2.49
16	300390	天华新能	13,800	1,290,438.00	2.31
17	688630	芯碁微装	2,169	1,191,626.91	2.13
18	002192	融捷股份	12,600	1,126,440.00	2.01
19	300568	星源材质	58,000	1,085,760.00	1.94
20	002384	东山精密	4,100	1,075,635.00	1.92
21	301396	宏景科技	2,800	928,480.00	1.66
22	688368	晶丰明源	3,931	851,140.12	1.52
23	688082	盛美上海	1,479	638,928.00	1.14
24	688172	燕东微	7,579	634,059.14	1.13
25	300666	江丰电子	1,700	626,620.00	1.12
26	300054	鼎龙股份	5,900	625,223.00	1.12
27	300620	光库科技	1,600	605,120.00	1.08

28	301611	珂玛科技	3,300	594,231.00	1.06
29	600549	厦门钨业	6,900	587,880.00	1.05
30	300260	新莱应材	5,500	552,530.00	0.99
31	300857	协创数据	1,600	543,840.00	0.97
32	688388	嘉元科技	12,235	538,340.00	0.96
33	605376	博迁新材	1,900	515,470.00	0.92
34	300285	国瓷材料	4,900	505,582.00	0.90
35	688001	华兴源创	5,445	466,636.50	0.83
36	688141	杰华特	1,794	275,379.00	0.49
37	688090	瑞松科技	2,443	260,057.35	0.46
38	301319	唯特偶	1,400	234,262.00	0.42

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	001203	大中矿业	5,239,963.00	10.00
2	688521	芯原股份	4,742,829.34	9.06
3	000688	国城矿业	4,558,256.00	8.70
4	002756	永兴材料	4,522,042.00	8.63
5	601318	中国平安	4,439,772.00	8.48
6	688361	中科飞测	4,368,886.19	8.34
7	600549	厦门钨业	4,139,846.00	7.90
8	300308	中际旭创	4,036,557.00	7.71
9	600188	兖矿能源	3,735,877.50	7.13
10	300567	精测电子	3,724,560.00	7.11
11	002379	宏桥控股	3,552,470.00	6.78
12	300390	天华新能	3,524,381.00	6.73
13	002837	英维克	3,502,500.60	6.69
14	688041	海光信息	3,457,953.19	6.60
15	688256	寒武纪	3,430,584.97	6.55
16	300502	新易盛	3,269,375.00	6.24
17	688809	强一股份	3,257,833.39	6.22
18	688261	东微半导	3,176,803.14	6.07
19	300316	晶盛机电	3,025,305.00	5.78
20	300751	迈为股份	3,002,272.00	5.73
21	603979	金诚信	2,940,978.00	5.61
22	601899	紫金矿业	2,929,057.00	5.59
23	600988	赤峰黄金	2,837,361.00	5.42
24	688981	中芯国际	2,808,603.52	5.36
25	688409	富创精密	2,773,222.12	5.29
26	000807	云铝股份	2,721,548.00	5.20
27	300438	鹏辉能源	2,688,122.00	5.13
28	300677	英科医疗	2,684,342.00	5.12

29	301396	宏景科技	2,644,187.00	5.05
30	300750	宁德时代	2,594,813.00	4.95
31	605117	德业股份	2,579,493.00	4.92
32	600259	中稀有色	2,485,617.00	4.75
33	000811	冰轮环境	2,426,779.00	4.63
34	300274	阳光电源	2,379,089.00	4.54
35	002532	天山铝业	2,292,976.00	4.38
36	603799	华友钴业	2,284,592.00	4.36
37	300054	鼎龙股份	2,251,717.00	4.30
38	000973	佛塑科技	2,237,956.00	4.27
39	002475	立讯精密	2,213,762.00	4.23
40	002738	中矿资源	2,182,484.00	4.17
41	601225	陕西煤业	2,181,594.00	4.17
42	600489	中金黄金	2,175,234.00	4.15
43	002192	融捷股份	2,136,129.00	4.08
44	000975	山金国际	2,131,189.15	4.07
45	002001	新 和 成	2,114,543.00	4.04
46	601001	晋控煤业	2,102,987.00	4.02
47	688700	东威科技	2,095,928.11	4.00
48	603993	洛阳钼业	2,085,276.00	3.98
49	688778	厦钨新能	1,990,097.79	3.80
50	000949	新乡化纤	1,989,090.00	3.80
51	300666	江丰电子	1,934,506.00	3.69
52	688516	奥特维	1,912,966.27	3.65
53	002384	东山精密	1,880,162.00	3.59
54	688012	中微公司	1,873,162.88	3.58
55	300394	天孚通信	1,865,763.40	3.56
56	688717	艾罗能源	1,753,993.02	3.35
57	688008	澜起科技	1,722,945.05	3.29
58	000657	中钨高新	1,715,228.00	3.27
59	601336	新华保险	1,700,933.00	3.25
60	600989	宝丰能源	1,694,027.00	3.23
61	002466	天齐锂业	1,682,418.00	3.21
62	600589	大位科技	1,679,473.00	3.21
63	002025	航天电器	1,668,610.00	3.19
64	002371	北方华创	1,629,343.00	3.11
65	000831	中国稀土	1,624,612.00	3.10
66	300782	卓胜微	1,621,556.00	3.10
67	000510	新金路	1,608,030.00	3.07
68	600111	北方稀土	1,606,868.00	3.07
69	601898	中煤能源	1,601,249.00	3.06
70	688331	荣昌生物	1,597,665.48	3.05
71	688702	盛科通信	1,568,123.38	2.99

72	601699	潞安环能	1,566,907.00	2.99
73	688072	拓荆科技	1,555,258.04	2.97
74	300604	长川科技	1,546,993.00	2.95
75	002460	赣锋锂业	1,467,746.00	2.80
76	688180	君实生物	1,438,116.76	2.75
77	603127	昭衍新药	1,408,163.00	2.69
78	688200	华峰测控	1,377,765.75	2.63
79	600546	山煤国际	1,376,633.00	2.63
80	600426	华鲁恒升	1,363,119.00	2.60
81	300857	协创数据	1,348,729.00	2.58
82	600392	盛和资源	1,343,320.00	2.56
83	000960	锡业股份	1,336,136.00	2.55
84	603026	石大胜华	1,275,002.00	2.43
85	300641	正丹股份	1,209,182.00	2.31
86	002709	天赐材料	1,203,534.00	2.30
87	002455	百川股份	1,201,012.00	2.29
88	300763	锦浪科技	1,197,644.00	2.29
89	601615	明阳智能	1,195,015.00	2.28
90	002497	雅化集团	1,179,250.00	2.25
91	688172	燕东微	1,170,553.18	2.23
92	600391	航发科技	1,163,165.00	2.22
93	002812	恩捷股份	1,153,700.00	2.20
94	600352	浙江龙盛	1,148,285.00	2.19
95	300846	首都在线	1,141,127.00	2.18
96	301500	飞南资源	1,136,140.00	2.17
97	000962	东方钨业	1,135,185.00	2.17
98	300115	长盈精密	1,131,457.00	2.16
99	001376	百通能源	1,123,969.00	2.15
100	000933	神火股份	1,123,475.00	2.14
101	605196	华通线缆	1,112,527.00	2.12
102	002353	杰瑞股份	1,102,429.00	2.10
103	688385	复旦微电	1,099,841.72	2.10
104	688726	拉普拉斯	1,098,701.92	2.10
105	688388	嘉元科技	1,094,924.32	2.09
106	300568	星源材质	1,093,620.00	2.09
107	300395	菲利华	1,084,020.00	2.07
108	688531	日联科技	1,078,194.12	2.06
109	688502	茂莱光学	1,073,452.66	2.05
110	002273	水晶光电	1,073,145.00	2.05
111	688498	源杰科技	1,067,967.10	2.04
112	601101	昊华能源	1,067,884.60	2.04
113	600309	万华化学	1,065,765.00	2.03
114	000895	双汇发展	1,064,442.00	2.03

115	688048	长光华芯	1,063,604.14	2.03
116	601628	中国人寿	1,061,906.00	2.03
117	600522	中天科技	1,057,997.00	2.02
118	603083	剑桥科技	1,047,792.00	2.00

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	601318	中国平安	6,394,119.00	12.21
2	601899	紫金矿业	6,171,884.00	11.78
3	002379	宏桥控股	5,782,913.00	11.04
4	001203	大中矿业	5,009,151.00	9.56
5	002756	永兴材料	4,801,676.80	9.17
6	000688	国城矿业	4,430,531.00	8.46
7	688361	中科飞测	4,160,534.24	7.94
8	002738	中矿资源	4,154,293.00	7.93
9	600188	兖矿能源	4,135,092.00	7.89
10	600549	厦门钨业	4,031,668.59	7.70
11	300567	精测电子	3,930,994.00	7.51
12	688521	芯原股份	3,548,835.63	6.78
13	601225	陕西煤业	3,529,317.00	6.74
14	000960	锡业股份	3,478,815.00	6.64
15	002532	天山铝业	3,356,278.00	6.41
16	300316	晶盛机电	3,313,585.00	6.33
17	300751	迈为股份	3,301,866.00	6.30
18	000807	云铝股份	3,230,978.00	6.17
19	002837	英维克	3,230,186.00	6.17
20	688809	强一股份	3,222,083.52	6.15
21	600988	赤峰黄金	2,987,115.00	5.70
22	000408	藏格矿业	2,971,809.00	5.67
23	688261	东微半导	2,858,806.56	5.46
24	300115	长盈精密	2,770,162.00	5.29
25	600111	北方稀土	2,718,268.00	5.19
26	688409	富创精密	2,668,250.57	5.09
27	605117	德业股份	2,593,652.80	4.95
28	688012	中微公司	2,573,911.51	4.91
29	002475	立讯精密	2,536,507.00	4.84
30	600259	中稀有色	2,484,722.00	4.74
31	688256	寒武纪	2,406,105.04	4.59
32	300390	天华新能	2,404,824.00	4.59
33	300677	英科医疗	2,396,858.00	4.58
34	688200	华峰测控	2,381,000.98	4.55
35	601628	中国人寿	2,352,762.00	4.49

36	601001	晋控煤业	2, 299, 485. 00	4. 39
37	603993	洛阳钼业	2, 258, 789. 34	4. 31
38	000973	佛塑科技	2, 244, 254. 00	4. 28
39	300054	鼎龙股份	2, 214, 933. 00	4. 23
40	688700	东威科技	2, 177, 870. 09	4. 16
41	000830	鲁西化工	2, 127, 878. 00	4. 06
42	603799	华友钴业	2, 122, 219. 00	4. 05
43	600309	万华化学	2, 119, 284. 00	4. 05
44	000949	新乡化纤	2, 086, 958. 00	3. 98
45	601601	中国太保	2, 078, 565. 00	3. 97
46	002001	新 和 成	2, 068, 971. 00	3. 95
47	600489	中金黄金	2, 061, 566. 00	3. 94
48	000975	山金国际	2, 029, 491. 00	3. 87
49	688516	奥特维	2, 026, 799. 09	3. 87
50	300502	新易盛	1, 996, 712. 00	3. 81
51	002709	天赐材料	1, 928, 302. 00	3. 68
52	301396	宏景科技	1, 926, 720. 00	3. 68
53	600589	大位科技	1, 916, 279. 00	3. 66
54	688778	厦钨新能	1, 915, 131. 67	3. 66
55	300274	阳光电源	1, 911, 592. 00	3. 65
56	300394	天孚通信	1, 867, 415. 00	3. 57
57	600989	宝丰能源	1, 853, 008. 00	3. 54
58	688981	中芯国际	1, 713, 987. 00	3. 27
59	688717	艾罗能源	1, 699, 884. 01	3. 25
60	002240	盛新锂能	1, 685, 595. 00	3. 22
61	603127	昭衍新药	1, 684, 637. 00	3. 22
62	688008	澜起科技	1, 681, 191. 40	3. 21
63	000831	中国稀土	1, 653, 299. 00	3. 16
64	688180	君实生物	1, 619, 187. 89	3. 09
65	688331	荣昌生物	1, 614, 965. 03	3. 08
66	002371	北方华创	1, 608, 063. 00	3. 07
67	601699	潞安环能	1, 599, 138. 00	3. 05
68	000657	中钨高新	1, 580, 347. 00	3. 02
69	300666	江丰电子	1, 574, 132. 00	3. 01
70	601336	新华保险	1, 559, 185. 00	2. 98
71	002025	航天电器	1, 558, 018. 00	2. 97
72	002466	天齐锂业	1, 497, 660. 00	2. 86
73	601898	中煤能源	1, 472, 676. 50	2. 81
74	688702	盛科通信	1, 459, 535. 74	2. 79
75	300782	卓胜微	1, 391, 789. 00	2. 66
76	600546	山煤国际	1, 390, 025. 00	2. 65
77	300750	宁德时代	1, 386, 783. 00	2. 65
78	002064	华峰化学	1, 360, 974. 00	2. 60

79	000510	新金路	1,360,349.00	2.60
80	688041	海光信息	1,330,484.09	2.54
81	605196	华通线缆	1,328,255.00	2.54
82	002460	赣锋锂业	1,327,996.00	2.54
83	002812	恩捷股份	1,309,794.00	2.50
84	600392	盛和资源	1,307,540.00	2.50
85	601615	明阳智能	1,307,110.00	2.50
86	300846	首都在线	1,304,801.00	2.49
87	002407	多氟多	1,268,834.00	2.42
88	300641	正丹股份	1,264,172.00	2.41
89	600426	华鲁恒升	1,260,096.00	2.41
90	002455	百川股份	1,245,227.00	2.38
91	000967	盈峰环境	1,237,781.00	2.36
92	603026	石大胜华	1,233,479.83	2.35
93	688502	茂莱光学	1,205,715.99	2.30
94	000811	冰轮环境	1,196,397.00	2.28
95	002497	雅化集团	1,139,051.00	2.17
96	002353	杰瑞股份	1,132,774.00	2.16
97	002493	荣盛石化	1,132,362.00	2.16
98	688385	复旦微电	1,127,266.11	2.15
99	002428	云南锗业	1,113,732.00	2.13
100	300803	指南针	1,107,528.00	2.11
101	300763	锦浪科技	1,106,750.00	2.11
102	600522	中天科技	1,101,661.00	2.10
103	000895	双汇发展	1,093,199.00	2.09
104	000933	神火股份	1,088,290.00	2.08
105	600346	恒力石化	1,077,540.00	2.06
106	600391	航发科技	1,076,061.00	2.05
107	688726	拉普拉斯	1,071,946.86	2.05
108	601600	中国铝业	1,070,546.00	2.04
109	688048	长光华芯	1,061,075.72	2.03
110	300442	润泽科技	1,049,360.00	2.00

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	308,234,182.96
卖出股票收入（成交）总额	310,188,065.53

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	73,632.10
2	应收清算款	122,874.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	660.76
6	其他应收款	10,838.58
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	208,006.19

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	1,952,556.60	3.49	重大事项停牌
2	300750	宁德时代	1,418,046.00	2.53	非公开流通受限

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

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（%）
1,119	27,309.99	7,652,157.16	25.04	22,907,716.96	74.96

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	95.66

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	195,810.16	0.64

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10 [^] 50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 5 月 9 日）基金份额总额	499,388,985.77
-------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	32,709,179.32
本报告期基金总申购份额	1,015,459.99
减：本报告期基金总赎回份额	3,164,765.19
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	30,559,874.12

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 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

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

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(%)	
华泰证券	2	348,185,545.69	56.44	154,821.36	57.03	-
中信证券	2	268,677,410.80	43.56	116,647.62	42.97	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	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(%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下基金投资询价转让股票的公告	指定报刊和/或公司网站	2026 年 4 月 28 日
2	关于新增易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为建信消费升级混合型证券投资基金等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2026 年 1 月 7 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2026 年 01 月 01 日-2026 年	7,652,157.16	0.00	0.00	7,652,157.16	25.04

		06 月 30 日					
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。							

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汇利灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信汇利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信汇利灵活配置混合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