

建信收益增强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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

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	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.11 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信收益增强债券型证券投资基金	
基金简称	建信收益增强债券	
基金主代码	530009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 6 月 2 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	144,526,593.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信收益增强债券 A	建信收益增强债券 C
下属分级基金的交易代码	530009	531009
报告期末下属分级基金的份额总额	100,378,703.44 份	44,147,890.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持资产流动性的基础上，发挥投研团队在固定收益、股票及金融衍生产品方面的综合研究实力，在有效控制风险的前提下追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建信用类债券投资组合，运用基本面研究择机介入上市公司股票及参与新股申购，以实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	30%×中债企业债总指数+70%×中债国债总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，但高于货币市场基金以及不涉及股票二级市场投资的债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	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 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市东城区建国门内大街 69 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	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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)	
	建信收益增强债券 A	建信收益增强债券 C
本期已实现收益	2,559,585.87	1,866,331.30
本期利润	2,918,434.73	1,765,480.52
加权平均基金份 额本期利润	0.0661	0.0585
本期加权平均净 值利润率	4.06%	3.86%
本期基金份额净 值增长率	4.18%	3.99%
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	64,832,585.63	23,729,881.17
期末可供分配基 金份额利润	0.6459	0.5375
期末基金资产净 值	165,211,289.07	67,877,771.42
期末基金份额净 值	1.646	1.538
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	127.80%	113.14%
-------------	---------	---------

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

建信收益增强债券 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	3.13%	0.30%	1.08%	0.05%	2.05%	0.25%
过去六个月	4.18%	0.29%	1.81%	0.05%	2.37%	0.24%
过去一年	6.61%	0.22%	1.24%	0.07%	5.37%	0.15%
过去三年	12.81%	0.23%	13.60%	0.09%	-0.79%	0.14%
过去五年	14.71%	0.31%	25.33%	0.08%	-10.62%	0.23%
过去七年	27.18%	0.33%	36.01%	0.09%	-8.83%	0.24%
过去十年	33.05%	0.31%	50.05%	0.09%	-17.00%	0.22%
自基金合同生效起至今	127.80%	0.32%	105.03%	0.10%	22.77%	0.22%

建信收益增强债券 C

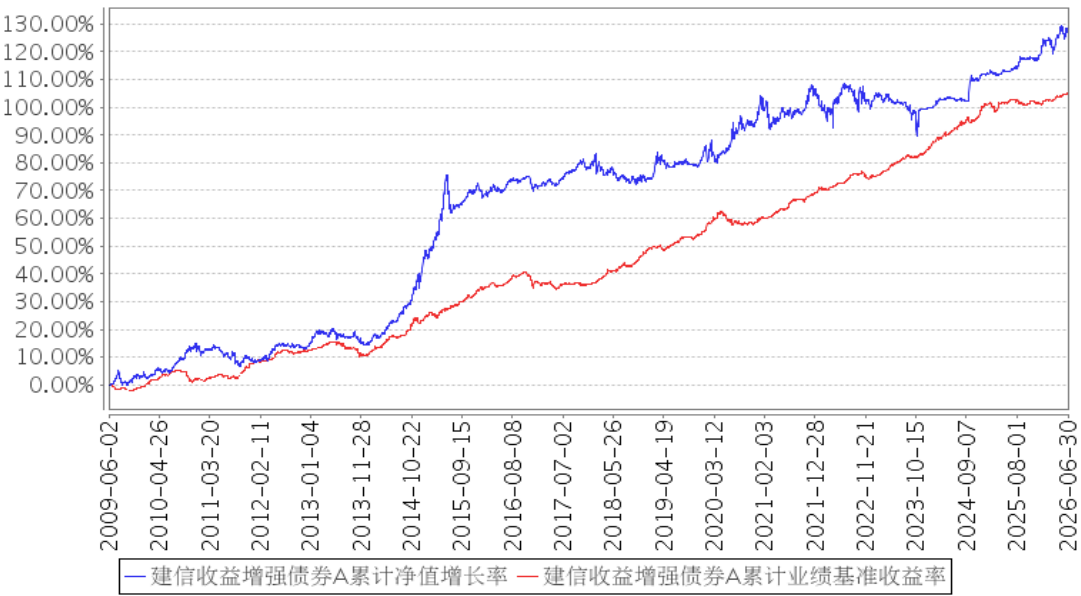
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.01%	0.30%	1.08%	0.05%	1.93%	0.25%
过去六个月	3.99%	0.30%	1.81%	0.05%	2.18%	0.25%

过去一年	6.22%	0.23%	1.24%	0.07%	4.98%	0.16%
过去三年	11.54%	0.23%	13.60%	0.09%	-2.06%	0.14%
过去五年	12.52%	0.31%	25.33%	0.08%	-12.81%	0.23%
过去七年	23.74%	0.33%	36.01%	0.09%	-12.27%	0.24%
过去十年	27.79%	0.31%	50.05%	0.09%	-22.26%	0.22%
自基金合同生效起至今	113.14%	0.32%	105.03%	0.10%	8.11%	0.22%

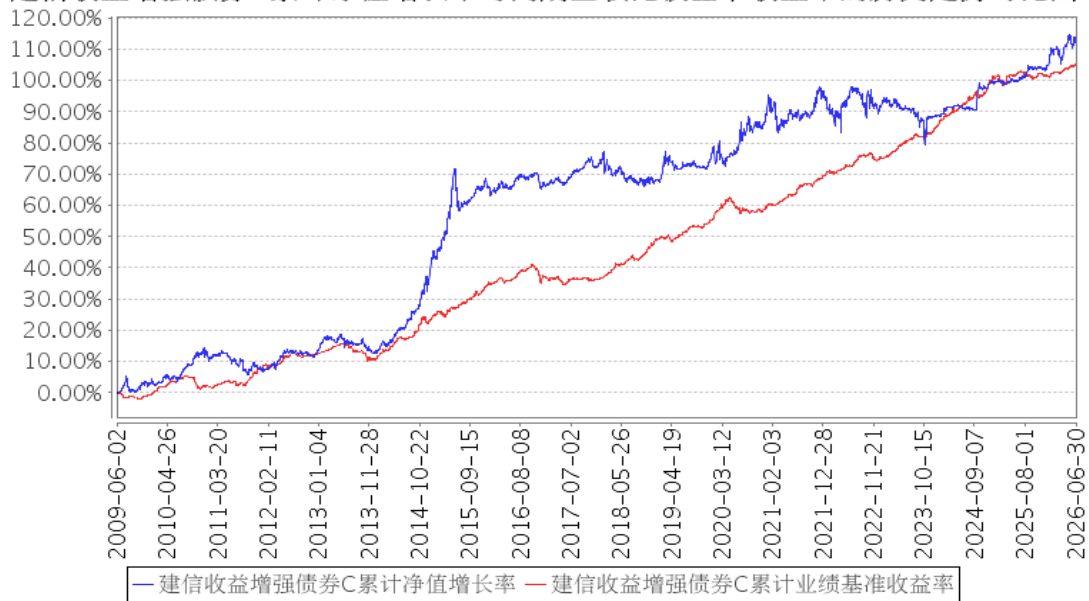
注：本基金的业绩比较基准为：30%×中债企业债总指数+70%×中债国债总指数。中债企业债总指数、中债国债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司（简称“中债公司”）编制的、分别反映我国国债市场和企业债市场整体价格和投资回报情况的指数。其中，中债国债总指数样本券包括在银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有记帐式国债；中债企业债总指数样本券包括在银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有中央企业债和地方企业债。该两个指数具有广泛的市场代表性，能够分别反映我国国债、企业债市场的总体走势。

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

建信收益增强债券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



建信收益增强债券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		
牛兴华	本基金的基金经理	2021 年 9 月 30 日	—	15	牛兴华先生，硕士，2008 年毕业于英国卡迪夫大学国际经济、银行与金融学专业。2008 年 10 月至 2009 年 12 月任神州数码中国有限公司任投资专员；2010 年 9 月至 2013 年 4 月任中诚信国际信用评级有限责任公司高级分析师；2013 年 4 月加入建信基金，历任债券研究员、基金经理等职务。2014 年 12 月 2 日至 2017 年 6 月 30 日任建信稳定得利债券型证券投资基金的基金经理；2015 年 4 月 17 日至 2020 年 8 月 6 日任建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 5 月 13 日至 2019 年 1 月 21 日任建信回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 5 月 14 日至 2022 年 12 月 27 日任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 6 月 16 日至 2018 年 1 月 23 日任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2015 年 11 月 25 日任建信鑫裕回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 10 月 29 日至 2017 年 7 月 12 日任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 2 月 22 日至 2018 年 1 月 23 日任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理；2016 年 10 月 25 日至 2017 年 12 月 6 日任建信瑞盛添利混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 12 月 2 日至 2018 年 4 月 2 日任建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 12 月 23 日至 2017 年 12 月 29 日任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 3 月 1 日至 2023 年 9 月 26 日任建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 4 月 20 日起任建信安心保本混合型证券投资基金的基金经理，该基金于 2019 年 10 月 11 日起转型为建信灵活配置混合型证券投资基金。牛兴华自 2019 年 10 月 11 日至 2024 年 5 月 17 日担任该基金的基金经理；2019 年 3 月 26 日至 2024 年 10 月 14 日任建信

					润利增强债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 8 月 6 日至 2020 年 12 月 15 日任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 8 月 6 日至 2021 年 3 月 9 日任建信稳定添利债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 10 日至 2025 年 9 月 4 日任建信兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2021 年 1 月 25 日至 2025 年 9 月 5 日任建信转债增强债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 30 日起任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 5 月 17 日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
张溢麟	本基金的基金经理	2025 年 11 月 17 日	-	9	张溢麟先生，硕士。2016 年 5 月毕业于美国芝加哥大学统计专业，同年 9 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理兼研究员、投资经理等职务。2023 年 1 月 4 日起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 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；2025 年 3 月 20 日起任建信上证智选科创板创新价值交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 6 月 20 日起任建信上证智选科创板创新价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2025 年 9 月 30 日起任建信中证 A 股指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 11 月 17 日起任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理；2025 年 11 月 17 日起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；2025 年 11 月 17 日起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；2026 年 6 月 24 日起任建信中证 A 股交易型开放式指数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《建信收益增强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 GDP 同比增长 4.7%，达成年初目标，经济整体平稳但呈前高后低态势。一季度运行良好，二季度受中东地缘冲突拖累放缓，各分项均现季初强季末弱，投资（固投同比-5.7%）与消费（社零同比 1.3% 受补贴退坡及油价抑制）双双下滑。出口（进出口同比 21.2% 出口 17.6%）则因早结汇抢跑及海外补库超预期高增，凭借外需韧性对冲了内需疲软，形成典型的内弱外强格局。

价格方面, 2026 年上半年 CPI 同比涨 1.0%，原油上行抵消猪价下行，涨幅温和；PPI 同比涨 1.5%，3 月转正后反弹明显。年初贵金属等曾泡沫化上涨，1 月末剧烈回撤。3 月美伊冲突引爆油价，带动能化商品走高，二季度持续推升 PPI。

货币政策方面，2026 年上半年货币政策整体偏宽松，虽未降准降息，但除 4 月外均增量续作 MLF，3 月起通过买断式逆回购缩量回笼过剩流动性。6 月新设隔夜逆回购工具并于末日首次投放以调节特殊时点。汇率受出口强劲及油储充足支撑，人民币兑美元中间价从年初 6.9890 升至 6.7852，半年升值 2.92%；后期因美联储加息预期升温转震荡，前期则呈快速走强态势。

上半年债市主要受预期博弈与突发事件驱动，年初及美伊冲突爆发后收益率均现先上后下；二季度资金面超预期宽松推动曲线震荡下行，30 年期国债表现突出。期末 10 年、1 年期国开债收益率分别较 2025 年末下行 22BP、20BP 至 1.78%、1.35%，曲线形态基本稳定。权益端沪深 300 涨 7.55%收报 4979.43 点；中证转债指数涨 2.51%收报 504.27 点，表现弱于大盘。

回顾上半年的基金管理工作，权益方面，本基金利用量化模型进行选股，力争获取较为稳定的收益。债券方面，本基金主要配置中长期信用债，以获取稳定票息收益同时博弈资本利得机会。

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 4.18%，波动率 0.29%，业绩比较基准收益率 1.81%，波动率 0.05%。本报告期本基金 C 净值增长率 3.99%，波动率 0.30%，业绩比较基准收益率 1.81%，波动率 0.05%。

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，中东局势与油价扰动将缓和，但在美中期选举、联储政策摇摆及厄尔尼诺冲击下，全球资产价格波动仍大，国内政策聚焦科技追赶与内需提振。海外看，二季度美伊冲突叠加世界杯就业拉动推升联储加息预期；随战事趋缓及临时就业消退，美三季度通胀就业或再走弱并重启降息预期。国内出口难续上半年强势，经济动能承压，政策重心转向撬动居民投融资与消费。货币政策料维持适度宽松，降准降息仍可期，债市偏乐观。组合管理上严控信用风险并积极操作，择机调节久期杠杆，捕捉宏微观数据边际变化及风险事件、监管变动引发的交易机会。

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：建信收益增强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	17,192,341.16	985,051.97
结算备付金		340,129.52	68,061.36
存出保证金		21,217.41	38,148.14
交易性金融资产	6.4.7.2	232,996,883.86	80,471,848.50
其中：股票投资		42,701,290.10	14,339,192.88
基金投资		—	—
债券投资		190,295,593.76	66,132,655.62
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
债权投资	6.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	6.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		3,007,751.10	1,978.54
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		253,558,323.05	81,565,088.51
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		14,500,971.12	—
应付赎回款		5,447,643.07	350,381.42

应付管理人报酬		96,018.14	47,999.41
应付托管费		27,433.75	13,714.14
应付销售服务费		15,960.47	14,384.26
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,310.07	3,163.18
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	377,925.94	534,778.03
负债合计		20,469,262.56	964,420.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	144,526,593.69	52,838,693.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	88,562,466.80	27,761,974.55
净资产合计		233,089,060.49	80,600,668.07
负债和净资产总计		253,558,323.05	81,565,088.51

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 144,526,593.69 份，其中建信收益增强债券 A 基金份额总额 100,378,703.44 份，基金份额净值人民币 1.6460 元；建信收益增强债券 C 基金份额总额 44,147,890.25 份，基金份额净值人民币 1.5380 元。

6.2 利润表

会计主体：建信收益增强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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,374,607.52	1,473,969.05
1. 利息收入		6,523.08	24,657.25
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,523.08	24,657.25
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）		5,103,292.95	3,500,319.94
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,801,140.11	289,153.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,171,467.06	3,126,331.22
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-

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	130,685.78	84,835.56
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	257,998.08	-2,077,417.86
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	6,793.41	26,409.72
减：二、营业总支出		690,692.27	719,607.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	403,752.15	404,730.85
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	115,357.74	115,637.29
3. 销售服务费		90,540.36	87,287.83
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		11,636.39	4,370.46
其中：卖出回购金融资产支出		11,636.39	4,370.46
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,133.26	2,106.52
8. 其他费用	6.4.7.23	67,272.37	105,474.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,683,915.25	754,361.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,683,915.25	754,361.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,683,915.25	754,361.50

6.3 净资产变动表

会计主体：建信收益增强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	52,838,693.52	-	27,761,974.55	80,600,668.07

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	52,838,693.52	-	27,761,974.55	80,600,668.07
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	91,687,900.17	-	60,800,492.25	152,488,392.42
(一)、综合收益总额	-	-	4,683,915.25	4,683,915.25
(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)	91,687,900.17	-	56,116,577.00	147,804,477.17
其中：1. 基金申购款	101,773,872.54	-	62,095,298.49	163,869,171.03
2. 基金赎回款	-10,085,972.37	-	-5,978,721.49	-16,064,693.86
(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	144,526,593.69	-	88,562,466.80	233,089,060.49
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	107,134,646.95	-	54,137,620.24	161,272,267.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	107,134,646.95	-	54,137,620.24	161,272,267.19

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-51,665,385.75	-	-26,869,802.90	-78,535,188.65
(一)、综合收益总额	-	-	754,361.50	754,361.50
(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)	-51,665,385.75	-	-27,624,164.40	-79,289,550.15
其中：1. 基金申购款	6,503,218.29	-	3,107,205.01	9,610,423.30
2. 基金赎回款	-58,168,604.04	-	-30,731,369.41	-88,899,973.45
(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	55,469,261.20	-	27,267,817.34	82,737,078.54

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

建信收益增强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[2009]281 号《关于核准建信收益增强债券型证券投资基金募集的批复》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《建信收益增强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 7,962,663,348.06 元，业经普华永道中天会计师事

务有限公司普华永道中天验字（2009）第 107 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》于 2009 年 6 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,964,474,021.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,810,673.02 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、申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的，称为 A 类基金份额；不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资者可自行选择认/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《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为公司债、国债、金融债、企业债、可转换债券（含可分离式）、中央银行票据、资产支持证券、债券回购、股票（含存托凭证）、权证以及中国证监会批准的允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，其中，本基金持有公司债、金融债、企业债、资产支持证券等除国债、中央银行票据以外的固定收益类资产的比例不低于债券资产的 30%，本基金投资于股票（含一级市场新股申购）等权益类品种的比例为基金资产的 0—20%，现金和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 $30\% \times \text{中债企业债总指数} + 70\% \times \text{中债国债总指数}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》和中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

6.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的规定》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债

券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	17,192,341.16
等于：本金	17,191,900.11
加：应计利息	441.05
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	17,192,341.16

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		42,673,937.96	-	42,701,290.10	27,352.14
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	47,400,374.39	335,689.94	47,950,455.94	214,391.61
	银行间市场	141,145,626.81	846,637.82	142,345,137.82	352,873.19
	合计	188,546,001.20	1,182,327.76	190,295,593.76	567,264.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		231,219,939.16	1,182,327.76	232,996,883.86	594,616.94

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	250,000.00
应付赎回费	4,061.20
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	68,941.88
其中：交易所市场	67,391.88
银行间市场	1,550.00
应付利息	—
预提费用	54,922.86
合计	377,925.94

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信收益增强债券 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	24,390,259.58	24,390,259.58
本期申购	82,741,448.34	82,741,448.34
本期赎回（以“-”号填列）	-6,753,004.48	-6,753,004.48
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	100,378,703.44	100,378,703.44

建信收益增强债券 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	28,448,433.94	28,448,433.94
本期申购	19,032,424.20	19,032,424.20
本期赎回（以“-”号填列）	-3,332,967.89	-3,332,967.89
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	44,147,890.25	44,147,890.25

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

建信收益增强债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,762,068.58	-614,903.68	14,147,164.90
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	14,762,068.58	-614,903.68	14,147,164.90
本期利润	2,559,585.87	358,848.86	2,918,434.73
本期基金份额交易产生的变动数	50,577,532.36	-2,810,546.36	47,766,986.00
其中：基金申购款	55,056,757.87	-3,019,355.26	52,037,402.61
基金赎回款	-4,479,225.51	208,808.90	-4,270,416.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,899,186.81	-3,066,601.18	64,832,585.63

建信收益增强债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,294,190.19	-679,380.54	13,614,809.65
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	14,294,190.19	-679,380.54	13,614,809.65
本期利润	1,866,331.30	-100,850.78	1,765,480.52
本期基金份额交易产生的变动数	8,844,300.32	-494,709.32	8,349,591.00
其中：基金申购款	10,654,338.32	-596,442.44	10,057,895.88
基金赎回款	-1,810,038.00	101,733.12	-1,708,304.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,004,821.81	-1,274,940.64	23,729,881.17

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	4,646.64
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	528.17
其他	1,348.27
合计	6,523.08

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	3,801,140.11
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	3,801,140.11

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	65,788,545.56
减：卖出股票成本总额	61,875,530.38
减：交易费用	111,875.07
买卖股票差价收入	3,801,140.11

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

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	1,074,563.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	96,903.35
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	1,171,467.06

6.4.7.15.2 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	111,578,102.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	110,628,067.20
减：应计利息总额	849,160.97
减：交易费用	3,971.43
买卖债券差价收入	96,903.35

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	130,685.78
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	130,685.78

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	257,998.08
股票投资	-260,030.45
债券投资	518,028.53
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	257,998.08

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	3,283.83
基金转换费收入	3,509.58
合计	6,793.41

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	5,951.28
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,749.51
银行间账户维护费	18,600.00
其他	300.00

合计	67,272.37
----	-----------

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
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 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	403,752.15	404,730.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	86,809.89	75,045.27
应支付基金管理人的净管理费	316,942.26	329,685.58

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%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×0.70%/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	115,357.74	115,637.29

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信收益增强债券 A	建信收益增强债券 C	合计
建信基金	-	270.36	270.36
中国建设银行	-	77,442.44	77,442.44
中国农业银行	-	3,035.27	3,035.27
合计	-	80,748.07	80,748.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信收益增强债券 A	建信收益增强债券 C	合计
建信基金	-	238.22	238.22
中国建设银行	-	76,303.55	76,303.55

中国农业银行	-	3,029.46	3,029.46
合计	-	79,571.23	79,571.23

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.4%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	建信收益增强债券 A	建信收益增强债券 C
报告期初持有的基金份额	0.00	-
报告期间申购/买入总份额	37,071,924.86	-
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	37,071,924.86	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	36.93%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	建信收益增强债券 A	建信收益增强债券 C

报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：分级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。期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。基金管理人在本报告期申购本基金的交易委托建信基金直销中心办理, 费率为 1000/笔。

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
中国农业银行-活期	17, 192, 341. 16	4, 646. 64	2, 887, 350. 26	23, 669. 77

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

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
603722	阿科力	2026 年 6 月 29 日	重大事项	39.60	2026 年 7 月 6 日	43.56	2,100	84,017.22	83,160.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,073,446.58	10,202,582.19
合计	10,073,446.58	10,202,582.19

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。

6.4.13.2.2 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	106,697,753.16	-
AAA 以下	5,159,720.00	2,168,793.44
未评级	20,414,218.08	20,488,311.51
合计	132,271,691.24	22,657,104.95

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	17,192,341.16	-	-	-	17,192,341.16
结算备付金	340,129.52	-	-	-	340,129.52
存出保证金	21,217.41	-	-	-	21,217.41
交易性金融资产	32,140,164.09	122,027,733.98	36,127,695.69	42,701,290.10	232,996,883.86
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	-	-	-	3,007,751.10	3,007,751.10
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	49,693,852.18	122,027,733.98	36,127,695.69	45,709,041.20	253,558,323.05
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	-	-	-	14,500,971.12	14,500,971.12
应付赎回款	-	-	-	5,447,643.07	5,447,643.07
应付管理人报酬	-	-	-	96,018.14	96,018.14
应付托管费	-	-	-	27,433.75	27,433.75
应付销售服务费	-	-	-	15,960.47	15,960.47
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,310.07	3,310.07
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	377,925.94	377,925.94
负债总计	-	-	-	20,469,262.56	20,469,262.56
利率敏感度缺口	49,693,852.18	122,027,733.98	36,127,695.69	25,239,778.64	233,089,060.49
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	985,051.97	-	-	-	985,051.97
结算备付金	68,061.36	-	-	-	68,061.36
存出保证金	38,148.14	-	-	-	38,148.14
交易性金融资产	44,256,914.07	11,985,135.21	9,890,606.34	14,339,192.88	80,471,848.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,978.54	1,978.54
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	45,348,175.54	11,985,135.21	9,890,606.34	14,341,171.42	81,565,088.51
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	350,381.42	350,381.42
应付管理人报酬	-	-	-	47,999.41	47,999.41
应付托管费	-	-	-	13,714.14	13,714.14
应付销售服务费	-	-	-	14,384.26	14,384.26
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,163.18	3,163.18
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	534,778.03	534,778.03
负债总计	-	-	-	964,420.44	964,420.44
利率敏感度缺口	45,348,175.54	11,985,135.21	9,890,606.34	13,376,750.98	80,600,668.07

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）
	市场利率下降 25 个基点	2,344,610.65	370,623.62
	市场利率上升 25 个基点	-2,286,456.21	-358,115.34

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	42,701,290.10	18.32	14,339,192.88	17.79
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	190,295,593.76	81.64	66,132,655.62	82.05
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	232,996,883.86	99.96	80,471,848.50	99.84

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	42,618,130.10	16,507,986.32
第二层次	190,378,753.76	63,963,862.18
第三层次	—	—
合计	232,996,883.86	80,471,848.50

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	42,701,290.10	16.84
	其中：股票	42,701,290.10	16.84

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	190,295,593.76	75.05
	其中：债券	190,295,593.76	75.05
	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	17,532,470.68	6.91
8	其他各项资产	3,028,968.51	1.19
9	合计	253,558,323.05	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	276,164.00	0.12
B	采矿业	313,458.00	0.13
C	制造业	32,407,938.50	13.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	570,987.00	0.24
E	建筑业	669,086.00	0.29
F	批发和零售业	894,403.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	492,668.00	0.21
H	住宿和餐饮业	254,144.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,245,743.60	1.39
J	金融业	96,668.00	0.04
K	房地产业	522,404.00	0.22
L	租赁和商务服务业	616,335.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	1,001,517.20	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	512,714.80	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	102,904.00	0.04
Q	卫生和社会工作	132,632.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	506,598.00	0.22
S	综合	84,925.00	0.04
	合计	42,701,290.10	18.32

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	600425	青松建化	171,500	560,805.00	0.24
2	688059	华锐精密	2,200	439,362.00	0.19
3	603102	百合股份	13,200	416,724.00	0.18
4	301086	鸿富瀚	1,940	406,003.20	0.17
5	603061	金海通	735	369,131.70	0.16
6	600123	兰花科创	58,700	313,458.00	0.13
7	688045	必易微	3,600	290,808.00	0.12
8	603519	立霸股份	19,000	290,700.00	0.12
9	688627	精智达	400	286,000.00	0.12
10	688677	海泰新光	2,800	283,164.00	0.12
11	688025	杰普特	600	282,000.00	0.12
12	002975	博杰股份	1,980	281,160.00	0.12
13	001322	箭牌家居	44,600	269,384.00	0.12
14	603801	志邦家居	49,300	267,699.00	0.11
15	688388	嘉元科技	6,080	267,520.00	0.11
16	605289	罗曼股份	1,760	255,200.00	0.11
17	000428	华天酒店	83,600	254,144.00	0.11
18	002375	亚厦股份	74,700	252,486.00	0.11
19	688531	日联科技	1,400	248,976.00	0.11
20	688195	腾景科技	1,280	246,502.40	0.11
21	688257	新锐股份	2,400	244,560.00	0.10
22	301536	星辰科技	1,900	244,549.00	0.10
23	002540	亚太科技	52,200	243,774.00	0.10
24	300575	中旗股份	48,500	238,620.00	0.10
25	688368	晶丰明源	1,080	233,841.60	0.10
26	002274	华昌化工	50,500	233,815.00	0.10
27	301002	崧盛股份	6,000	231,600.00	0.10
28	600641	先导基电	5,400	215,244.00	0.09
29	002302	西部建设	48,300	208,656.00	0.09
30	688309	恒誉环保	3,400	206,992.00	0.09
31	603707	健友股份	29,100	205,737.00	0.09
32	688267	中触媒	10,400	204,880.00	0.09
33	603186	华正新材	900	202,770.00	0.09
34	301215	中汽股份	37,800	196,182.00	0.08
35	300789	唐源电气	11,000	195,470.00	0.08
36	002577	雷柏科技	10,500	192,780.00	0.08
37	600616	金枫酒业	51,000	191,250.00	0.08
38	002947	恒铭达	2,500	190,125.00	0.08
39	301568	思泰克	1,700	189,720.00	0.08
40	002234	民和股份	29,400	188,454.00	0.08

41	301090	华润材料	29,400	184,338.00	0.08
42	300814	中富电路	900	184,050.00	0.08
43	301021	英诺激光	1,500	182,850.00	0.08
44	603551	奥普科技	20,300	182,497.00	0.08
45	688156	路德科技	6,000	181,500.00	0.08
46	603569	长久物流	34,200	181,260.00	0.08
47	000962	东方钨业	2,000	181,200.00	0.08
48	301529	福赛科技	1,880	181,156.80	0.08
49	688199	久日新材	5,200	179,556.00	0.08
50	301169	零点有数	2,500	176,650.00	0.08
51	688218	江苏北人	3,200	175,872.00	0.08
52	301102	兆讯传媒	20,300	173,565.00	0.07
53	688167	炬光科技	490	173,562.90	0.07
54	688391	钜泉科技	4,800	172,176.00	0.07
55	002768	国恩股份	3,300	171,798.00	0.07
56	301113	雅艺科技	11,500	171,465.00	0.07
57	002376	新北洋	29,400	169,050.00	0.07
58	301311	昆船智能	12,900	167,571.00	0.07
59	603301	振德医疗	1,900	165,604.00	0.07
60	301081	严牌股份	12,000	164,160.00	0.07
61	000657	中钨高新	1,700	162,724.00	0.07
62	300795	米奥会展	19,000	162,640.00	0.07
63	300959	线上线下	1,100	162,591.00	0.07
64	300905	宝丽迪	3,200	161,920.00	0.07
65	688378	奥来德	2,600	161,200.00	0.07
66	300786	国林科技	6,400	160,448.00	0.07
67	688359	三孚新科	800	158,752.00	0.07
68	688628	优利德	1,600	158,304.00	0.07
69	002969	嘉美包装	11,200	157,696.00	0.07
70	603125	常青科技	4,800	157,152.00	0.07
71	603107	上海汽配	13,600	154,360.00	0.07
72	300478	杭州高新	4,200	154,098.00	0.07
73	603181	皇马科技	9,500	154,090.00	0.07
74	301359	东南电子	9,600	152,448.00	0.07
75	300681	英搏尔	5,300	151,686.00	0.07
76	300168	万达信息	33,000	151,470.00	0.06
77	688559	海目星	1,800	151,056.00	0.06
78	601061	中信金属	14,000	150,780.00	0.06
79	301196	唯科科技	1,200	150,504.00	0.06
80	603053	成都燃气	18,000	150,480.00	0.06
81	688383	新益昌	800	150,432.00	0.06
82	688668	鼎通科技	400	149,320.00	0.06
83	688132	邦彦技术	11,352	149,278.80	0.06

84	603150	万朗磁塑	2,100	148,680.00	0.06
85	001323	慕思股份	9,400	148,520.00	0.06
86	301389	隆扬电子	1,700	147,543.00	0.06
87	601858	中国科传	8,500	147,135.00	0.06
88	300953	震裕科技	1,100	147,070.00	0.06
89	601126	四方股份	2,300	145,360.00	0.06
90	603738	泰晶科技	2,400	144,120.00	0.06
91	603538	美诺华	4,400	143,220.00	0.06
92	688679	通源环境	3,400	143,106.00	0.06
93	301307	美利信	1,900	143,051.00	0.06
94	300903	科翔股份	1,400	141,834.00	0.06
95	301413	安培龙	2,000	141,760.00	0.06
96	688737	中自科技	7,400	141,636.00	0.06
97	300740	水羊股份	7,600	139,916.00	0.06
98	301369	联动科技	570	139,650.00	0.06
99	688081	兴图新科	3,400	138,992.00	0.06
100	002205	国统股份	13,600	137,224.00	0.06
101	603587	地素时尚	12,300	136,653.00	0.06
102	300990	同飞股份	1,300	136,591.00	0.06
103	600782	新钢股份	54,900	136,152.00	0.06
104	600716	凤凰股份	40,500	136,080.00	0.06
105	300872	天阳科技	8,600	135,880.00	0.06
106	600287	苏豪时尚	30,500	134,505.00	0.06
107	603882	金域医学	5,900	132,632.00	0.06
108	300938	信测标准	2,640	131,683.20	0.06
109	002384	东山精密	500	131,175.00	0.06
110	603689	皖天然气	18,900	130,977.00	0.06
111	601113	华鼎股份	39,600	130,680.00	0.06
112	300586	美联新材	8,300	129,812.00	0.06
113	688182	灿勤科技	3,000	129,210.00	0.06
114	002290	禾盛新材	1,400	128,618.00	0.06
115	601158	重庆水务	33,300	128,538.00	0.06
116	688035	德邦科技	1,400	128,520.00	0.06
117	603121	华培动力	10,900	128,075.00	0.05
118	301312	智立方	1,100	127,611.00	0.05
119	688275	万润新能	1,000	127,550.00	0.05
120	300700	岱勒新材	5,900	125,552.00	0.05
121	001359	平安电工	1,000	125,250.00	0.05
122	300682	朗新科技	12,600	124,740.00	0.05
123	688616	西力科技	12,200	123,220.00	0.05
124	688030	山石网科	7,800	123,162.00	0.05
125	002885	京泉华	3,000	122,580.00	0.05
126	301093	华兰股份	900	122,067.00	0.05

127	600874	创业环保	22,500	120,600.00	0.05
128	600941	中国移动	1,400	120,582.00	0.05
129	603626	科森科技	6,500	120,250.00	0.05
130	603660	苏州科达	9,800	120,050.00	0.05
131	603680	今创集团	12,200	119,682.00	0.05
132	300976	达瑞电子	1,500	119,475.00	0.05
133	001389	广合科技	500	118,625.00	0.05
134	688258	卓易信息	1,000	118,540.00	0.05
135	603507	振江股份	3,600	118,404.00	0.05
136	601518	吉林高速	42,200	118,160.00	0.05
137	603357	设计总院	19,300	117,344.00	0.05
138	000553	安道麦 A	21,800	116,630.00	0.05
139	688215	瑞晟智能	2,900	116,464.00	0.05
140	688345	博力威	2,000	116,160.00	0.05
141	301626	苏州天脉	300	115,188.00	0.05
142	300322	硕贝德	4,500	113,400.00	0.05
143	001267	汇绿生态	2,100	112,350.00	0.05
144	603124	江南新材	600	112,188.00	0.05
145	300806	斯迪克	1,000	112,000.00	0.05
146	688372	伟测科技	600	111,600.00	0.05
147	603960	克来机电	6,400	111,424.00	0.05
148	600622	光大嘉宝	56,300	110,348.00	0.05
149	300843	胜蓝股份	700	109,375.00	0.05
150	603929	亚翔集成	400	108,808.00	0.05
151	688389	普门科技	11,000	107,690.00	0.05
152	688225	亚信安全	8,600	106,812.00	0.05
153	688609	九联科技	9,600	105,696.00	0.05
154	301004	嘉益股份	3,400	105,400.00	0.05
155	002484	江海股份	1,000	105,000.00	0.05
156	002643	万润股份	5,000	104,750.00	0.04
157	000819	岳阳兴长	9,200	104,236.00	0.04
158	688693	锆威特	1,000	103,950.00	0.04
159	601921	浙版传媒	15,500	103,695.00	0.04
160	002181	粤传媒	10,400	103,480.00	0.04
161	688173	希荻微	5,400	103,356.00	0.04
162	605098	行动教育	1,900	102,904.00	0.04
163	301391	卡莱特	1,800	102,780.00	0.04
164	300868	杰美特	700	102,697.00	0.04
165	300857	协创数据	300	101,970.00	0.04
166	603511	爱慕股份	8,800	101,200.00	0.04
167	301285	鸿日达	900	99,297.00	0.04
168	688152	麒麟信安	3,600	98,928.00	0.04
169	600628	新世界	17,200	96,836.00	0.04

170	601988	中国银行	16,900	96,668.00	0.04
171	688239	航宇科技	1,600	95,728.00	0.04
172	002758	浙农股份	12,100	95,590.00	0.04
173	301136	招标股份	8,700	95,526.00	0.04
174	603868	飞科电器	3,100	95,480.00	0.04
175	600105	永鼎股份	1,400	94,472.00	0.04
176	301189	奥尼电子	1,600	94,288.00	0.04
177	603928	兴业股份	6,370	94,276.00	0.04
178	688177	百奥泰	5,600	94,192.00	0.04
179	688028	沃尔德	600	93,522.00	0.04
180	688593	新相微	2,400	93,408.00	0.04
181	002079	苏州固锔	6,200	93,186.00	0.04
182	002840	华统股份	12,700	92,583.00	0.04
183	603970	中农立华	9,600	92,448.00	0.04
184	688141	杰华特	600	92,100.00	0.04
185	300969	恒帅股份	980	91,884.80	0.04
186	605186	健麾信息	2,900	90,944.00	0.04
187	300610	晨化股份	9,300	90,675.00	0.04
188	300817	双飞集团	5,800	90,480.00	0.04
189	688653	康希通信	5,200	90,376.00	0.04
190	002645	华宏科技	3,280	90,232.80	0.04
191	688386	泛亚微透	1,000	89,840.00	0.04
192	603629	利通电子	500	89,405.00	0.04
193	300022	吉峰科技	11,500	89,355.00	0.04
194	300778	新城市	9,300	88,815.00	0.04
195	301024	霍普股份	2,400	88,368.00	0.04
196	000592	平潭发展	13,200	88,308.00	0.04
197	002718	友邦吊顶	800	88,200.00	0.04
198	603958	哈森股份	5,200	88,088.00	0.04
199	603701	德宏股份	4,000	87,920.00	0.04
200	301220	亚香股份	2,700	86,994.00	0.04
201	603090	宏盛股份	1,700	86,802.00	0.04
202	001314	亿道信息	1,400	86,520.00	0.04
203	603927	中科软	6,800	86,428.00	0.04
204	301186	超达装备	2,100	86,100.00	0.04
205	300137	先河环保	4,900	85,456.00	0.04
206	301252	同星科技	2,100	85,113.00	0.04
207	600620	天宸股份	21,500	84,925.00	0.04
208	603991	领先股份	600	84,690.00	0.04
209	300286	安科瑞	3,500	84,525.00	0.04
210	601218	吉鑫科技	19,500	83,850.00	0.04
211	002382	蓝帆医疗	16,500	83,820.00	0.04
212	000922	佳电股份	6,000	83,760.00	0.04

213	002919	名臣健康	4,400	83,556.00	0.04
214	603722	阿科力	2,100	83,160.00	0.04
215	601801	皖新传媒	16,600	81,838.00	0.04
216	605155	西大门	6,900	81,696.00	0.04
217	301318	维海德	4,000	81,600.00	0.04
218	688110	东芯股份	400	81,480.00	0.03
219	301338	凯格精机	500	81,445.00	0.03
220	603897	长城科技	2,500	81,150.00	0.03
221	603516	淳中科技	600	80,766.00	0.03
222	002706	良信股份	7,400	80,734.00	0.03
223	300942	易瑞生物	13,900	80,342.00	0.03
224	001328	登康口腔	3,100	80,321.00	0.03
225	300745	欣锐科技	1,900	80,218.00	0.03
226	688667	菱电电控	600	80,190.00	0.03
227	301320	豪江智能	6,200	79,980.00	0.03
228	002677	浙江美大	14,400	79,632.00	0.03
229	300069	金利华电	2,500	79,575.00	0.03
230	301321	翰博高新	1,800	79,470.00	0.03
231	301183	东田微	300	79,461.00	0.03
232	002757	南兴股份	4,400	79,420.00	0.03
233	001317	三羊马	2,000	79,160.00	0.03
234	300946	恒而达	2,000	78,780.00	0.03
235	605066	天正电气	11,600	78,764.00	0.03
236	300596	利安隆	1,500	78,720.00	0.03
237	301128	强瑞技术	500	77,950.00	0.03
238	002805	丰元股份	2,700	77,193.00	0.03
239	603083	剑桥科技	300	76,461.00	0.03
240	603219	富佳股份	4,900	76,342.00	0.03
241	300425	中建环能	20,400	76,296.00	0.03
242	688458	美芯晟	1,800	75,168.00	0.03
243	300839	博汇股份	6,400	74,944.00	0.03
244	301316	慧博云通	1,900	74,822.00	0.03
245	603618	杭电股份	1,500	74,820.00	0.03
246	603178	圣龙股份	5,400	74,790.00	0.03
247	301322	绿通科技	1,400	74,690.00	0.03
248	000910	大亚圣象	14,500	74,385.00	0.03
249	603151	邦基科技	6,700	73,633.00	0.03
250	603112	华翔股份	4,400	73,612.00	0.03
251	605100	华丰股份	1,820	73,564.40	0.03
252	301007	德迈仕	2,400	73,440.00	0.03
253	300816	艾可蓝	1,000	73,200.00	0.03
254	300565	科信技术	7,100	72,278.00	0.03
255	605068	明新旭腾	4,300	72,154.00	0.03

256	688410	山外山	5,000	71,800.00	0.03
257	688510	航亚科技	3,000	71,640.00	0.03
258	688611	杭州柯林	1,000	71,450.00	0.03
259	688369	致远互联	3,400	71,434.00	0.03
260	688579	地纬智能	9,400	71,346.00	0.03
261	301550	斯菱智驱	780	71,315.40	0.03
262	605005	合兴股份	4,500	71,145.00	0.03
263	603096	新经典	5,300	70,914.00	0.03
264	301487	盟固利	3,700	70,855.00	0.03
265	301097	天益医疗	1,961	70,007.70	0.03
266	688191	智洋创新	1,960	69,972.00	0.03
267	002364	中恒电气	1,300	69,940.00	0.03
268	002250	联化科技	5,100	69,717.00	0.03
269	300004	南风股份	6,900	69,690.00	0.03
270	301326	捷邦科技	500	69,685.00	0.03
271	603268	松发股份	500	69,640.00	0.03
272	002487	大金重工	1,200	69,564.00	0.03
273	605138	盛泰集团	12,600	69,552.00	0.03
274	002931	锋龙股份	1,000	68,980.00	0.03
275	688051	佳华科技	3,000	68,940.00	0.03
276	688226	威腾电气	1,600	68,528.00	0.03
277	300732	设研院	12,300	68,511.00	0.03
278	002912	中新赛克	3,700	68,228.00	0.03
279	605318	法狮龙	600	67,716.00	0.03
280	300600	国瑞科技	7,200	67,608.00	0.03
281	301203	国泰环保	1,600	67,600.00	0.03
282	301396	宏景科技	200	66,320.00	0.03
283	002406	远东传动	10,000	65,600.00	0.03
284	688125	安达智能	400	65,400.00	0.03
285	300572	安车检测	2,300	65,251.00	0.03
286	688390	固德威	600	65,106.00	0.03
287	603299	苏盐井神	7,400	65,046.00	0.03
288	601156	东航物流	4,000	64,480.00	0.03
289	300984	金沃股份	1,200	64,476.00	0.03
290	300054	鼎龙股份	600	63,582.00	0.03
291	601568	北元化工	18,700	63,580.00	0.03
292	688085	三友医疗	5,280	63,201.60	0.03
293	301226	祥明智能	1,900	63,061.00	0.03
294	000599	青岛双星	14,900	62,878.00	0.03
295	301486	致尚科技	300	62,496.00	0.03
296	300842	帝科股份	700	62,419.00	0.03
297	300067	安诺其	11,400	61,788.00	0.03
298	300553	集智股份	1,000	61,390.00	0.03

299	600605	汇通能源	2,100	60,732.00	0.03
300	600648	外高桥	7,600	60,724.00	0.03
301	300818	耐普矿机	3,200	60,480.00	0.03
302	002957	科瑞技术	1,100	60,324.00	0.03
303	300696	爱乐达	2,300	59,869.00	0.03
304	603990	麦迪科技	2,800	59,612.00	0.03
304	688090	瑞松科技	560	59,612.00	0.03
305	301295	美硕科技	1,400	59,052.00	0.03
306	002880	卫光生物	3,000	58,440.00	0.03
307	601811	新华文轩	5,300	57,982.00	0.02
308	000565	渝三峡 A	10,200	57,936.00	0.02
309	301181	标榜股份	2,500	57,850.00	0.02
310	603020	爱普股份	4,100	57,810.00	0.02
311	300720	海川智能	600	57,720.00	0.02
312	688176	亚虹医药	5,800	57,536.00	0.02
313	688328	深科达	600	57,420.00	0.02
314	300151	昌红科技	2,300	57,385.00	0.02
315	688162	巨一科技	2,400	56,736.00	0.02
316	600156	华升股份	6,800	56,576.00	0.02
317	300981	中红医疗	5,900	56,463.00	0.02
318	002843	泰嘉股份	2,600	55,822.00	0.02
319	003012	东鹏控股	12,800	55,808.00	0.02
320	603153	上海建科	4,400	55,792.00	0.02
321	300965	恒宇信通	1,300	55,068.00	0.02
322	000510	新金路	2,200	54,648.00	0.02
322	301258	富士莱	2,400	54,648.00	0.02
323	603931	格林达	900	53,460.00	0.02
324	002970	锐明技术	1,000	53,430.00	0.02
325	301548	崇德科技	600	53,262.00	0.02
326	688663	新风光	600	53,076.00	0.02
327	688513	苑东生物	1,200	52,752.00	0.02
328	002749	国光股份	6,600	52,668.00	0.02
329	600234	科新发展	1,900	52,592.00	0.02
330	600590	泰豪科技	5,200	52,520.00	0.02
331	003023	彩虹集团	2,700	52,488.00	0.02
332	000534	万泽股份	1,900	51,984.00	0.02
333	603306	华懋科技	500	51,845.00	0.02
334	002134	天津普林	1,700	51,714.00	0.02
335	301112	信邦智能	1,700	51,408.00	0.02
336	688607	康众医疗	1,000	51,000.00	0.02
337	301248	杰创智能	600	50,358.00	0.02
338	300824	北鼎股份	7,000	50,260.00	0.02
339	688020	方邦股份	200	49,920.00	0.02

340	002792	通宇通讯	1,400	49,798.00	0.02
341	000755	山西高速	11,700	49,608.00	0.02
342	688717	艾罗能源	600	49,542.00	0.02
343	300055	万邦达	7,700	49,511.00	0.02
344	002825	纳尔股份	6,000	49,320.00	0.02
345	301172	君逸数码	1,900	49,305.00	0.02
346	300039	上海凯宝	11,400	48,564.00	0.02
347	605123	派克新材	500	48,505.00	0.02
348	300277	汽轮科技	3,200	48,128.00	0.02
349	301360	荣旗科技	700	47,943.00	0.02
350	603031	安孚科技	900	47,925.00	0.02
351	688238	和元生物	8,800	47,696.00	0.02
352	001278	一彬科技	3,100	47,678.00	0.02
353	001230	劲旅环境	3,080	47,308.80	0.02
354	002246	北化股份	2,500	47,000.00	0.02
355	300480	光力科技	1,100	46,948.00	0.02
356	002633	申科股份	3,100	46,903.00	0.02
357	688398	赛特新材	1,800	46,638.00	0.02
358	688282	理工导航	800	46,560.00	0.02
359	688021	奥福科技	2,400	46,464.00	0.02
360	688393	安必平	2,600	46,228.00	0.02
361	002838	道恩股份	1,500	45,930.00	0.02
362	002922	伊戈尔	1,400	45,920.00	0.02
363	300835	龙磁科技	200	45,898.00	0.02
364	600540	新赛股份	13,800	45,678.00	0.02
365	688399	硕世生物	1,000	45,390.00	0.02
366	002169	智光电气	3,100	45,384.00	0.02
367	000576	甘化科工	6,900	45,333.00	0.02
368	300833	浩洋股份	1,500	45,270.00	0.02
369	301068	大地海洋	1,900	45,220.00	0.02
370	300426	华智数媒	8,900	45,034.00	0.02
371	002008	大族激光	300	45,033.00	0.02
372	301168	通灵股份	1,000	44,910.00	0.02
373	300461	田中精机	1,200	44,448.00	0.02
374	603173	福斯达	1,300	44,070.00	0.02
375	603016	新宏泰	1,300	43,888.00	0.02
376	002867	周大生	3,900	43,485.00	0.02
377	000589	贵州轮胎	10,600	43,036.00	0.02
378	002534	西子洁能	2,300	42,665.00	0.02
379	002772	众兴菌业	3,700	42,032.00	0.02
380	605077	华康股份	3,800	41,078.00	0.02
381	603590	康辰药业	1,400	40,614.00	0.02
382	600396	华电辽能	2,700	40,392.00	0.02

383	601388	怡球资源	14,000	39,620.00	0.02
-----	--------	------	--------	-----------	------

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	600425	青松建化	552,077.00	0.68
2	603102	百合股份	530,643.00	0.66
3	002014	永新股份	490,757.00	0.61
4	002234	民和股份	461,550.00	0.57
5	600123	兰花科创	443,748.00	0.55
6	300903	科翔股份	439,868.00	0.55
7	688059	华锐精密	417,740.00	0.52
8	001322	箭牌家居	408,665.00	0.51
9	603677	奇精机械	392,739.00	0.49
10	301102	兆讯传媒	382,114.00	0.47
11	301285	鸿日达	329,677.00	0.41
12	603801	志邦家居	322,681.00	0.40
13	688309	恒誉环保	314,409.57	0.39
14	300806	斯迪克	308,383.00	0.38
15	688025	杰普特	303,650.00	0.38
16	301086	鸿富瀚	296,580.00	0.37
17	688677	海泰新光	295,330.48	0.37
18	688257	新锐股份	294,989.75	0.37
19	300112	万讯自控	293,766.00	0.36
20	301002	崧盛股份	290,715.78	0.36

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	002014	永新股份	507,766.60	0.63
2	603677	奇精机械	427,690.00	0.53
3	300903	科翔股份	423,527.00	0.53
4	300806	斯迪克	330,287.00	0.41
5	688079	美迪凯	327,910.26	0.41
6	301285	鸿日达	323,179.00	0.40
7	301248	杰创智能	285,530.00	0.35
8	301177	迪阿股份	281,513.00	0.35
9	688661	和林微纳	280,980.00	0.35
10	301489	思泉新材	275,934.00	0.34
11	603693	江苏新能	274,004.00	0.34
12	300112	万讯自控	263,860.00	0.33
13	600101	明星电力	255,997.00	0.32

14	301106	骏成科技	246,193.00	0.31
15	300756	金马游乐	244,692.40	0.30
16	688103	国力电子	239,606.72	0.30
17	301396	宏景科技	238,743.60	0.30
18	300975	商络电子	237,263.00	0.29
19	301102	兆讯传媒	234,190.00	0.29
20	301339	通行宝	233,369.00	0.29

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	90,497,658.05
卖出股票收入（成交）总额	65,788,545.56

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	47,950,455.94	20.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	111,857,473.16	47.99
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,073,446.58	4.32
6	中期票据	20,414,218.08	8.76
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	190,295,593.76	81.64

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	232680012	26 邮储银行二级资本债 01BC	200,000	20,074,832.88	8.61
2	232680010	26 兴业银行二级资本债 02	200,000	20,009,426.85	8.58
3	019547	16 国债 19	167,600	19,905,131.09	8.54
4	019780	25 国债 11	162,000	16,222,564.60	6.96
5	019792	25 国债 19	117,000	11,822,760.25	5.07

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 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的投资范围。

7.11.3 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	21,217.41
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,007,751.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,028,968.51

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
建信收益增强债券 A	4,727	21,235.18	74,594,279.75	74.31	25,784,423.69	25.69
建信收益增强债券 C	4,882	9,042.99	13,298,440.83	30.12	30,849,449.42	69.88
合计	9,609	15,040.75	87,892,720.58	60.81	56,633,873.11	39.19

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	建信收益增强债券 A	21,762.95	0.02
	建信收益增强债券 C	0.00	0.00
	合计	21,762.95	0.02

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金

份额总额)。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信收益增强债券 A	—
	建信收益增强债券 C	—
	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	建信收益增强债券 A	0~10
	建信收益增强债券 C	—
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信收益增强债券 A	建信收益增强债券 C
基金合同生效日 (2009 年 6 月 2 日) 基金份额总额	2,752,981,309.86	5,211,492,711.22
本报告期期初基金份额总额	24,390,259.58	28,448,433.94
本报告期基金总申购份额	82,741,448.34	19,032,424.20
减：本报告期基金总赎回份额	6,753,004.48	3,332,967.89
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	100,378,703.44	44,147,890.25

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

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华创证券	2	83,001,545.78	53.11	37,011.52	53.68	—
华福证券	1	73,284,657.83	46.89	31,943.22	46.32	—
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	-	-	-	-	-
平安证券	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(%)
华创证券	10,054,189.99	5.19	-	-	-	-
华福证券	183,595,261.25	94.81	179,971,000.00	100.00	-	-
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	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	指定报刊和/或公司网站	2026 年 6 月 26 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

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 03 月 31 日-2026 年 06 月 30 日	0.00	37,071,924.86	0.00	37,071,924.86	25.65
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

本基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布《建信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与基金托管人协商一致，决定自 2026 年 7 月 27 日起，将本基金业绩比较基准由“中债国债总指数*70%+中债企业债总指数*30%”调整为“中债-综合财富(总值)指数收益率*82%+中证全指指数收益率*18%”。详情请参见基金管理人相关公告。

§ 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收益增强债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信收益增强债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信收益增强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