

建信沪深 300 指数增强型证券投资基金  
(LOF)  
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 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，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	58
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）	
基金简称	建信沪深 300 指数增强（LOF）	
场内简称	沪深 300 增强	
基金主代码	165310	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 7 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	531,794,657.79 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所	
下属分级基金的基 金简称	建信沪深 300 指数增强（LOF）A	建信沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的场 内简称	沪深 300 增强	—
下属分级基金的交 易代码	165310	009208
报告期末下属分级 基金的份额总额	347,168,029.19 份	184,626,628.60 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以沪深 300 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公司	招商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	吴曙明	张姗
	联系电话	010-66228888	400-61-95555
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-81-95533；010-66228000	400-61-95555
传真		010-66228001	0755-83195201
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		生柳荣	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

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

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)	
	建信沪深 300 指数增强（LOF）A	建信沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	6,330,535.73	2,808,906.90
本期利润	4,655,540.38	1,831,447.37
加权平均基金份 额本期利润	0.0129	0.0097
本期加权平均净 值利润率	1.07%	0.82%
本期基金份额净 值增长率	1.07%	0.88%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	252,159,765.41	38,746,678.47
期末可供分配基金份额利润	0.7263	0.2099
期末基金资产净值	428,713,781.55	223,373,307.07
期末基金份额净值	1.2349	1.2099
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	23.49%	19.77%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信沪深 300 指数增强（LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.48%	0.53%	2.37%	0.55%	0.11%	-0.02%
过去三个月	1.42%	1.09%	1.21%	1.04%	0.21%	0.05%
过去六个月	1.07%	0.99%	0.07%	0.97%	1.00%	0.02%
过去一年	13.47%	1.28%	13.12%	1.32%	0.35%	-0.04%
过去三年	-4.93%	1.03%	-11.43%	1.05%	6.50%	-0.02%
自基金合同生效起至今	23.49%	1.09%	0.50%	1.12%	22.99%	-0.03%

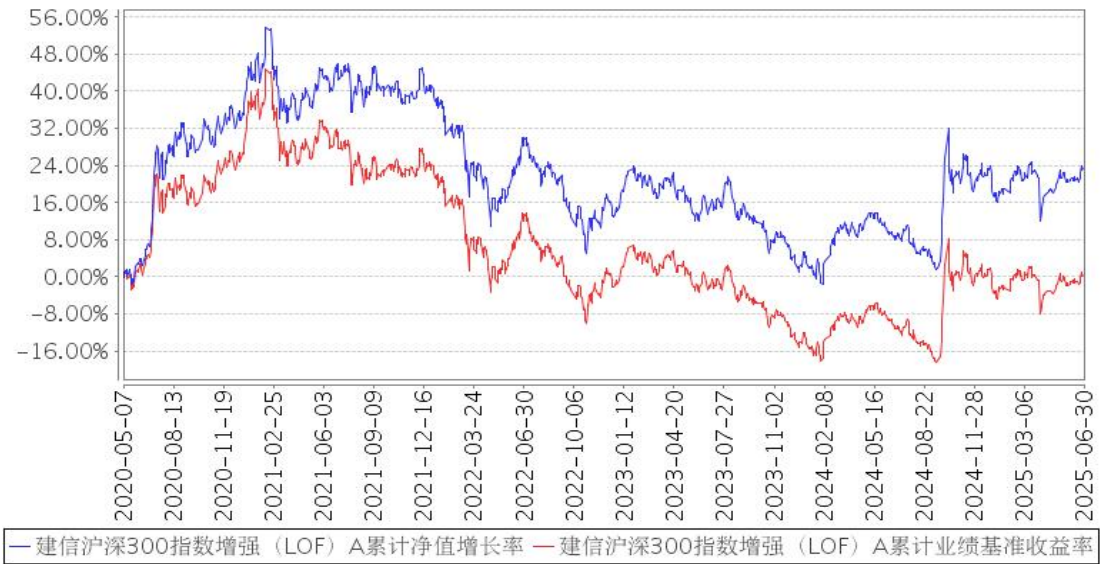
建信沪深 300 指数增强 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	2.45%	0.53%	2.37%	0.55%	0.08%	-0.02%
过去三个月	1.32%	1.09%	1.21%	1.04%	0.11%	0.05%
过去六个月	0.88%	0.99%	0.07%	0.97%	0.81%	0.02%
过去一年	13.02%	1.28%	13.12%	1.32%	-0.10%	-0.04%
过去三年	-6.06%	1.03%	-11.43%	1.05%	5.37%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	19.77%	1.09%	-0.08%	1.12%	19.85%	-0.03%

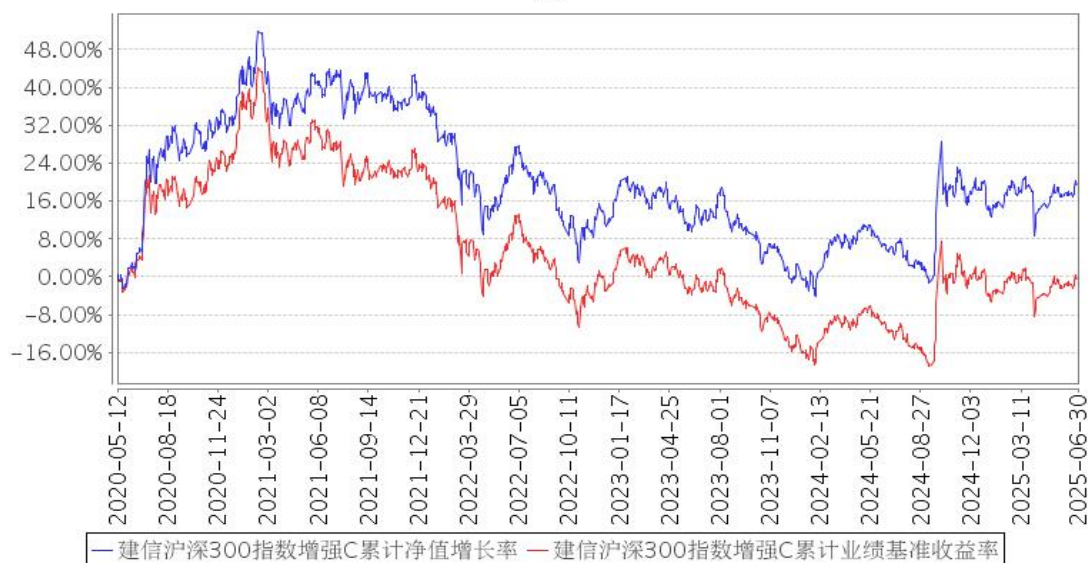
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信沪深300指数增强（LOF）A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





建信沪深300指数增强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9000万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至2025年6月30日，公司管理运作177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1.21余万亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛玲	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2024 年 1 月 29 日	-	12	薛玲女士，数量投资部副总经理，博士。2009 年 5 月至 2010 年 1 月任中国电力科学研究院农电与配电研究所工程师、2010 年 1 月至 2013 年 4 月任路孚特（中国）科技有限公司高级软件工程师、2013 年 4 月至 2015 年 9 月任中国中金财富证券有限公司研究员、投资经理，2015 年 9 月加入我公司，历任金融工程及指数投资部基金经理助理、基金经理、部门总经理助理、部门副总经理等职务。2016 年 7 月 4 日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；2016 年 7 月 4 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；2017 年 5 月 27 日至 2018 年 4 月 25 日任建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 9 月 13 日至 2023 年 8 月 29 日任建信量化事件驱动股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 9 月 28 日起任建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2017 年 9 月 28 日起任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 20 日起任建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 22 日起任建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 3 月 5 日至 2021 年 5 月 31 日任建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 10 月 25 日起任建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2018 年 12 月 13 日至 2021 年 8 月 9 日任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 12 月 15 日至 2021 年 12 月 14 日任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 9 月 21 日起任建信恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理；2023 年 1 月 5 日至 2024 年 1 月 29 日任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2024

					<p>年 1 月 29 日起任建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理；2024 年 6 月 27 日起任建信双债增强债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 7 月 16 日起任建信红利精选股票型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 2 月 27 日起任建信丰融债券型证券投资基金的基金经理。</p>
梁洪 昀	数量投资 部高级基 金经理， 本基金的 基金经理	2020 年 5 月 7 日	-	22	<p>梁洪昀先生，数量投资部高级基金经理，博士。特许金融分析师（CFA）。曾任大成基金管理有限公司金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005 年 8 月加入建信基金，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部总监、金融工程及指数投资部总经理、数量投资部总经理等职务。2009 年 11 月 5 日起任建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理；2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 日任建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2011 年 9 月 8 日至 2016 年 7 月 20 日任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2011 年 9 月 8 日至 2016 年 7 月 20 日任建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2012 年 3 月 16 日起任建信深证 100 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 3 月 25 日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理，该基金于 2020 年 5 月 7 日起转型为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF），梁洪昀继续担任该基金的基金经理；2015 年 7 月 31 日至 2018 年 7 月 31 日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 6 日至 2016 年 10 月 25 日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 6 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 7 日至 2022 年 8 月 8 日任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资</p>

					基金的基金经理；2018 年 4 月 19 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 5 月 16 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2018 年 6 月 13 日至 2019 年 11 月 25 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定。

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，本基金管理人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%的情况有 4 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

#### 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

报告期内，管理人以量化分析研究为基础，借助量化模型，对基金进行指数增强管理。投资组合保持与基准指数贴近的行业和风格配置，所持股票适度分散。基金收益表现与业绩比较基准保持着较高的相关性，在此基础上，力求稳健地积累超额收益。

管理人对超额收益的变化情况进行密切跟踪，在报告期内，还结合标的指数的市值分布、风格特征等特性，适当对量化模型进行优化调整。基金的换手率保持适中，以平衡组合优化需求和交易成本控制需求。

在报告期初期和中期，标的指数各出现了一次明显的回调，尤其是中期，受事件冲击，波动尤为剧烈，但随即快速平复，并平稳回升。在市场波动加大的过程中，管理人尽力保持了基金组合的运作平稳。

报告期内，标的指数成分股进行了例行调整，管理人据此对投资组合做了相应操作，组合实现了平稳过渡。

在报告期内，基金参与了一级市场申购，并适时进行了兑现，以求进一步增厚投资回报。

##### 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 1.07%，波动率 0.99%，业绩比较基准收益率 0.07%，波动率 0.97%。本报告期本基金 C 净值增长率 0.88%，波动率 0.99%，业绩比较基准收益率 0.07%，波动率 0.97%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济和市场在经历了上半年一系列事件的冲击后，逐渐恢复平稳。各个主要经济体更多地选择对话和协商，取代对抗与摩擦，这为解决矛盾与纷争奠定了基础。

展望下半年，全球经济有望维持温和复苏态势。美国和欧元区在货币政策相继进入“观望期”后，将更加关注增长与通胀的平衡；新兴市场在外资回流和大宗商品价格企稳的支持下，将呈现出分化但总体向好的局面。贸易摩擦虽仍有不确定性，但随着对话机制重启，出现上半年那种事件剧烈冲击的可能性会明显降低。

国内经济方面，外部环境仍有不确定性，国内经济结构调整亦面临压力，但我们认为中国经济有望延续稳定增长的态势。

上半年国民经济稳中有进，为实现全年目标打下了坚实基础。高质量发展的长期趋势正在巩固，经济结构持续优化。其中，服务业已成为经济增长的核心驱动力，其对 GDP 增长的贡献率超过 60%。内需方面，消费作为经济“压舱石”的作用日益凸显，在上半年一系列促消费政策的带

动下市场趋于活跃,预计在政策继续加力的情况下,消费将保持良好增势。消费升级、绿色消费及假日经济等新趋势将持续为市场注入活力。宏观政策将继续为经济稳定运行保驾护航。有关部门已明确将加快推出下半年支持性政策,并做好了丰富的政策储备,以应对市场变化,为经济增长托底。随着总需求持续扩张、扩内需政策效果显现以及基数效应减弱,通胀中枢有望企稳回升。

国内股票市场在经历了波动与调整后,正逐步消化各类事件性冲击带来的影响,投资者的悲观情绪得到了显著修复。随着信心企稳,市场整体估值已从低位反弹,回归至相对合理的区间。这标志着市场的主要矛盾,正从对系统性风险的过度担忧,转向对未来增长质量的重新审视。

我们认为,市场下一阶段的驱动力,将更多地由估值修复转向盈利驱动和基本面驱动。在经济结构转型和高质量发展的大趋势下,市场的结构性机会将持续显现。投资者仍有必要密切关注国内外宏观环境的边际变化,以及潜在的政策调整。未来市场的机遇与挑战并存。

管理人将继续优化和改进量化模型,力争在适当控制跟踪误差的基础上,持续获得相对于业绩比较基准的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本公司设立资产估值委员会,主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜,确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、风险与合规管理部、投资风险管理部和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作,熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作,由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配,符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	34,610,989.22	2,185,773.40
结算备付金		5,831,092.95	5,355,766.46
存出保证金		1,757,886.44	189,319.34
交易性金融资产	6.4.7.2	615,406,105.23	678,055,903.31
其中：股票投资		601,228,224.68	642,280,364.96
基金投资		—	—
债券投资		14,177,880.55	35,775,538.35
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		-	1,729,270.51
应收股利		-	-
应收申购款		310,901.52	562,797.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		657,916,975.36	688,078,830.65
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,165,079.81	1,046,010.57
应付管理人报酬		533,577.40	563,240.63
应付托管费		106,715.47	112,648.14
应付销售服务费		72,577.65	48,673.61
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	7,261.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	951,936.41	1,049,785.71
负债合计		5,829,886.74	2,827,620.19
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	361,180,644.74	382,885,584.29
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	290,906,443.88	302,365,626.17
净资产合计		652,087,088.62	685,251,210.46
负债和净资产总计		657,916,975.36	688,078,830.65

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 531,794,657.79 份，其中建信沪深 300 指数增强（LOF）A 基金份额总额 347,168,029.19 份，基金份额净值人民币 1.2349 元；建信沪深 300 指数增强 C 基金份额总额 184,626,628.60 份，基金份额净值人民币 1.2099 元。



6.2 利润表

会计主体：建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		10,986,297.46	17,065,506.40
1. 利息收入		74,251.29	70,139.78
其中：存款利息收入	6.4.7.13	72,717.32	70,139.78
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		1,533.97	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		13,454,013.71	-24,572,073.15
其中：股票投资收益	6.4.7.14	5,354,773.12	-29,561,124.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	146,007.12	-
资产支持证券投 资收益	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	310,113.08	-281.68
股利收益	6.4.7.19	7,643,120.39	4,989,332.54
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	-2,652,454.88	41,544,861.87
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	110,487.34	22,577.90
减：二、营业总支出		4,499,309.71	2,883,449.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,264,345.08	2,194,607.41
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	652,868.93	438,921.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	442,770.12	58,033.23
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		1, 314. 64	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	138, 010. 94	191, 887. 53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6, 486, 987. 75	14, 182, 056. 81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6, 486, 987. 75	14, 182, 056. 81
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6, 486, 987. 75	14, 182, 056. 81

6.3 净资产变动表

会计主体：建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	382, 885, 584. 29	-	302, 365, 626. 17	685, 251, 210. 46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	382, 885, 584. 29	-	302, 365, 626. 17	685, 251, 210. 46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21, 704, 939. 55	-	-11, 459, 182. 29	-33, 164, 121. 84
（一）、综合收益总额	-	-	6, 486, 987. 75	6, 486, 987. 75
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-21, 704, 939. 55	-	-17, 946, 170. 04	-39, 651, 109. 59
其中：1. 基金申购款	35, 813, 562. 48	-	38, 382, 591. 30	74, 196, 153. 78
2. 基金赎回	-57, 518, 502. 03	-	-56, 328, 761. 34	-113, 847, 263. 37

回款				
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	361,180,644.74	-	290,906,443.88	652,087,088.62
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	206,751,180.76	-	202,269,957.32	409,021,138.08
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	206,751,180.76	-	202,269,957.32	409,021,138.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	19,077,778.32	-	21,482,064.37	40,559,842.69
(一)、综合收益总额	-	-	14,182,056.81	14,182,056.81
(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)	19,077,778.32	-	7,300,007.56	26,377,785.88
其中：1. 基金申购款	49,217,472.60	-	17,300,581.90	66,518,054.50
2. 基金赎回款	-30,139,694.28	-	-10,000,574.34	-40,140,268.62
(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	225,828,959.08	-	223,752,021.69	449,580,980.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）是由原建信双利策略主题分级股票型证券投资基金转型而来。根据原建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司发布的《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，转型日为 2020 年 5 月 7 日，基金名称相应变更为“建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）”，建信双利策略主题分级股票型证券投资基金份额转换为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）份额。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2020 年 5 月 7 日起《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》生效，原《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金托管协议》自同一日起失效。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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间可以互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券等）、货币市场工具（含同业存单）、银行存款、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款税后利率 $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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〉》以及中国证监会和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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	34,610,989.22
等于：本金	34,607,370.13
加：应计利息	3,619.09
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	34,610,989.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		587,135,484.00	-	601,228,224.68	14,092,740.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	14,003,042.71	177,880.55	14,177,880.55	-3,042.71
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,003,042.71	177,880.55	14,177,880.55	-3,042.71
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		601,138,526.71	177,880.55	615,406,105.23	14,089,697.97

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

单位：人民币元



项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	13,792,712.31	-	-	-
其中：股指期货投资	13,792,712.31	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,792,712.31	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2509	IF2509	12.00	13,993,200.00	200,487.69
合计				200,487.69
减：可抵销期货暂收款				200,487.69
净额				0.00

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

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,396.65
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	855,696.60
其中：交易所市场	855,696.60
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	83,843.16
合计	951,936.41

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信沪深 300 指数增强（LOF）A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	369,444,355.07	187,882,686.51
本期申购	53,188,332.32	27,049,195.59
本期赎回（以“-”号填列）	-75,464,658.20	-38,377,865.96
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	347,168,029.19	176,554,016.14
-----	----------------	----------------

建信沪深 300 指数增强 C

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	195,002,897.78	195,002,897.78
本期申购	8,764,366.89	8,764,366.89
本期赎回 (以“-”号填列)	-19,140,636.07	-19,140,636.07
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	184,626,628.60	184,626,628.60

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

建信沪深 300 指数增强 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	374,498,311.00	-111,011,024.47	263,487,286.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	374,498,311.00	-111,011,024.47	263,487,286.53
本期利润	6,330,535.73	-1,674,995.35	4,655,540.38
本期基金份额交易产生的变动数	-22,727,165.59	6,744,104.09	-15,983,061.50
其中：基金申购款	54,234,317.85	-17,443,915.79	36,790,402.06
基金赎回款	-76,961,483.44	24,188,019.88	-52,773,463.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	358,101,681.14	-105,941,915.73	252,159,765.41

建信沪深 300 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	97,508,777.48	-58,630,437.84	38,878,339.64
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	97,508,777.48	-58,630,437.84	38,878,339.64
本期利润	2,808,906.90	-977,459.53	1,831,447.37
本期基金份额交易产	-5,205,177.14	3,242,068.60	-1,963,108.54

生的变动数			
其中：基金申购款	4,419,523.73	-2,827,334.49	1,592,189.24
基金赎回款	-9,624,700.87	6,069,403.09	-3,555,297.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	95,112,507.24	-56,365,828.77	38,746,678.47

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	49,387.69
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	22,978.56
其他	351.07
合计	72,717.32

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,354,773.12
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	5,354,773.12

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,360,938,858.94
减：卖出股票成本总额	1,354,224,276.18
减：交易费用	1,359,809.64
买卖股票差价收入	5,354,773.12

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	156,977.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-10,970.45
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	146,007.12

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	23,699,448.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	23,504,928.45
减：应计利息总额	205,490.43
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-10,970.45

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	310,113.08

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,643,120.39
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	7,643,120.39

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,852,942.57
股票投资	-2,791,174.02
债券投资	-61,768.55
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	200,487.69
权证投资	-
期货投资	200,487.69
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动	-

产生的预估增值税	
合计	-2,652,454.88

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	108,977.96
基金转换费收入	1,509.38
合计	110,487.34

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	5,778.54
指数使用费	43,889.24
银行间账户维护费	9,000.00
合计	138,010.94

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 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
------------------------	-----------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,264,345.08	2,194,607.41
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,134,842.77	433,399.98
应支付基金管理人的净管理费	2,129,502.31	1,761,207.43

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	652,868.93	438,921.42

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



按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	建信沪深 300 指数增强 C	合计
建信基金	-	247.51	247.51
招商银行	-	1,261.94	1,261.94
中国建设银行	-	40,446.98	40,446.98
合计	-	41,956.43	41,956.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	建信沪深 300 指数增强 C	合计
建信基金	-	116.34	116.34
招商银行	-	228.63	228.63
中国建设银行	-	9,698.89	9,698.89
合计	-	10,043.86	10,043.86

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

日销售服务费=前一日基金资产净值×约定年费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期	34,610,989.22	49,387.69	43,679,414.44	62,676.64

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（2025 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
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新发未上市	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚	2025 年 3 月	6 个月	新发未上	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-

	电 缆	13 日		市						
301173	毓 恬 冠 佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新发 未上 市	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉 朔 科 技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新发 未上 市	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301458	钧 崴 电 子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新发 未上 市	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘 景 光 电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新发 未上 市	29.93	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒 鑫 生 活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新发 未上 市	27.49	45.22	350	9,620.72	15,827.00	-
301535	浙 江 华 远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新发 未上 市	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众 捷 汽 车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新发 未上 市	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优 优 绿 能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新发 未上 市	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301636	泽 润 新 能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新发 未上 市	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首 航 新 能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新发 未上 市	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰 禾	2025 年 4 月	6 个月	新发 未上	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-

	股份	2 日		市						
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新发未上市	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新发未上市	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新发未上市	46.50	42.85	314	14,601.00	13,454.90	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新发未上市	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新发未上市	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新发未上市	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新发未上市	93.50	90.66	107	10,004.50	9,700.62	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新发未上市	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新发未上市	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新发未上市	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新发未上市	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-

603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新发未上市	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新发未上市	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新发未上市	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新发未上市	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新发未上市	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新发未上市	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	34,610,989.22	-	-	-	34,610,989.22
结算备付金	5,831,092.95	-	-	-	5,831,092.95
存出保证金	1,757,886.44	-	-	-	1,757,886.44
交易性金融资产	14,177,880.55	-	-	-601,228,224.68	615,406,105.23
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	-	-	-	310,901.52	310,901.52
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	56,377,849.16	-	-	-601,539,126.20	657,916,975.36
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	-	-	-	4,165,079.81	4,165,079.81
应付管理人报酬	-	-	-	533,577.40	533,577.40
应付托管费	-	-	-	106,715.47	106,715.47
应付销售服务费	-	-	-	72,577.65	72,577.65
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	951,936.41	951,936.41
负债总计	-	-	-	5,829,886.74	5,829,886.74
利率敏感度缺口	56,377,849.16	-	-	-595,709,239.46	652,087,088.62
上年度末 2024 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	2,185,773.40	-	-	-	2,185,773.40
结算备付金	5,355,766.46	-	-	-	5,355,766.46
存出保证金	189,319.34	-	-	-	189,319.34
交易性金融资产	35,775,538.35	-	-	-642,280,364.96	678,055,903.31
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-



应收清算款	-	-	-	1,729,270.51	1,729,270.51
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	562,797.63	562,797.63
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	43,506,397.55	-	-	644,572,433.10	688,078,830.65
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,046,010.57	1,046,010.57
应付管理人报酬	-	-	-	563,240.63	563,240.63
应付托管费	-	-	-	112,648.14	112,648.14
应付销售服务费	-	-	-	48,673.61	48,673.61
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,261.53	7,261.53
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,049,785.71	1,049,785.71
负债总计	-	-	-	2,827,620.19	2,827,620.19
利率敏感度缺口	43,506,397.55	-	-	-641,744,812.91	685,251,210.46

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	2,424.83	50,254.52
	市场利率上升 25 个基点	-2,424.00	-50,113.75

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	601,228,224.68	92.20	642,280,364.96	93.73
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	14,177,880.55	2.17	35,775,538.35	5.22
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	615,406,105.23	94.37	678,055,903.31	98.95

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	31,378,350.22	32,557,925.91
	业绩比较基准下降	-31,378,350.22	-32,557,925.91

	5%		
--	----	--	--

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	600,886,295.15	641,918,781.95
第二层次	14,177,880.55	35,803,274.85
第三层次	341,929.53	333,846.51
合计	615,406,105.23	678,055,903.31

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	601,228,224.68	91.38
	其中：股票	601,228,224.68	91.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,177,880.55	2.15
	其中：债券	14,177,880.55	2.15
	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	40,442,082.17	6.15
8	其他各项资产	2,068,787.96	0.31
9	合计	657,916,975.36	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,993,909.40	0.31
B	采矿业	27,207,337.40	4.17
C	制造业	226,410,195.24	34.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,940,441.04	3.21
E	建筑业	9,137,396.00	1.40
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	22,180,245.20	3.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,705,226.00	4.25
J	金融业	147,013,033.50	22.54
K	房地产业	5,391,603.00	0.83
L	租赁和商务服务业	1,348,214.00	0.21

M	科学研究和技术服务业	4,817,768.00	0.74
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	7,377,240.00	1.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	501,522,608.78	76.91

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,884.00	0.00
B	采矿业	2,779,690.00	0.43
C	制造业	70,377,719.86	10.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	620,280.00	0.10
E	建筑业	1,419,478.00	0.22
F	批发和零售业	1,424,558.82	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	390,248.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,964,016.20	0.45
J	金融业	12,858,554.52	1.97
K	房地产业	660,916.00	0.10
L	租赁和商务服务业	133,170.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	3,507,012.50	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	2,435.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,065,600.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	1,499,053.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	99,705,615.90	15.29

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	21,812	30,744,450.24	4.71
2	300750	宁德时代	88,542	22,332,063.24	3.42
3	601288	农业银行	2,678,100	15,747,228.00	2.41
4	601398	工商银行	2,048,600	15,548,874.00	2.38
5	601328	交通银行	1,739,700	13,917,600.00	2.13
6	601728	中国电信	1,597,700	12,382,175.00	1.90
7	002594	比亚迪	37,200	12,347,052.00	1.89
8	600900	长江电力	384,600	11,591,844.00	1.78
9	601857	中国石油	1,339,388	11,451,767.40	1.76
10	000001	平安银行	821,500	9,915,505.00	1.52
11	601766	中国中车	1,358,850	9,566,304.00	1.47
12	600000	浦发银行	649,537	9,015,573.56	1.38
13	688981	中芯国际	100,389	8,851,298.13	1.36
14	000858	五粮液	72,673	8,640,819.70	1.33
15	601899	紫金矿业	430,800	8,400,600.00	1.29
16	601318	中国平安	138,913	7,706,893.24	1.18
17	601816	京沪高铁	1,307,300	7,516,975.00	1.15
18	600887	伊利股份	267,300	7,452,324.00	1.14
19	300015	爱尔眼科	591,125	7,377,240.00	1.13
20	600690	海尔智家	295,300	7,317,534.00	1.12
21	000100	TCL 科技	1,685,300	7,297,349.00	1.12
22	601138	工业富联	336,889	7,202,686.82	1.10
23	601668	中国建筑	1,194,800	6,893,996.00	1.06
24	601658	邮储银行	1,186,100	6,487,967.00	0.99
25	601166	兴业银行	275,400	6,427,836.00	0.99
26	300059	东方财富	250,000	5,782,500.00	0.89
27	600941	中国移动	48,000	5,402,400.00	0.83
28	600030	中信证券	192,700	5,322,374.00	0.82
29	300760	迈瑞医疗	22,496	5,055,976.00	0.78
30	601169	北京银行	705,600	4,819,248.00	0.74
31	603259	药明康德	69,200	4,812,860.00	0.74
32	000333	美的集团	66,000	4,765,200.00	0.73
33	601229	上海银行	432,600	4,589,886.00	0.70
34	601211	国泰海通	238,400	4,567,744.00	0.70
35	001979	招商蛇口	507,900	4,454,283.00	0.68
36	000425	徐工机械	530,300	4,120,431.00	0.63

37	601225	陕西煤业	210,200	4,044,248.00	0.62
38	002179	中航光电	100,200	4,044,072.00	0.62
39	002352	顺丰控股	82,800	4,037,328.00	0.62
40	600061	国投资本	533,800	4,014,176.00	0.62
41	601066	中信建投	166,000	3,992,300.00	0.61
42	600219	南山铝业	1,007,100	3,857,193.00	0.59
43	601919	中远海控	232,880	3,502,515.20	0.54
44	600011	华能国际	477,500	3,409,350.00	0.52
45	600809	山西汾酒	19,103	3,369,578.17	0.52
46	600918	中泰证券	514,200	3,306,306.00	0.51
47	601995	中金公司	90,500	3,200,080.00	0.49
48	000166	申万宏源	631,000	3,167,620.00	0.49
49	300999	金龙鱼	106,800	3,153,804.00	0.48
50	688111	金山办公	10,600	2,968,530.00	0.46
51	600276	恒瑞医药	56,990	2,957,781.00	0.45
52	002736	国信证券	247,500	2,851,200.00	0.44
53	002475	立讯精密	82,100	2,848,049.00	0.44
54	300124	汇川技术	44,100	2,847,537.00	0.44
55	000792	盐湖股份	165,000	2,818,200.00	0.43
56	003816	中国广核	734,800	2,674,672.00	0.41
57	601988	中国银行	475,900	2,674,558.00	0.41
58	688082	盛美上海	23,200	2,643,408.00	0.41
59	600919	江苏银行	219,200	2,617,248.00	0.40
60	300274	阳光电源	38,300	2,595,591.00	0.40
61	002230	科大讯飞	51,300	2,456,244.00	0.38
62	688012	中微公司	13,400	2,442,820.00	0.37
63	601600	中国铝业	340,700	2,398,528.00	0.37
64	000725	京东方 A	570,300	2,275,497.00	0.35
65	001965	招商公路	187,300	2,247,600.00	0.34
66	600406	国电南瑞	100,200	2,245,482.00	0.34
67	601088	中国神华	54,100	2,193,214.00	0.34
68	300308	中际旭创	14,600	2,129,556.00	0.33
69	601901	方正证券	267,600	2,116,716.00	0.32
70	000408	藏格矿业	47,200	2,014,024.00	0.31
71	600741	华域汽车	113,800	2,008,570.00	0.31
72	000063	中兴通讯	59,600	1,936,404.00	0.30
73	603288	海天味业	49,504	1,926,200.64	0.30
74	600031	三一重工	105,300	1,890,135.00	0.29
75	688256	寒武纪	3,100	1,864,650.00	0.29
76	600795	国电电力	384,456	1,860,767.04	0.29
77	601319	中国人保	203,400	1,771,614.00	0.27
78	601868	中国能建	782,100	1,744,083.00	0.27
79	688271	联影医疗	13,600	1,737,264.00	0.27

80	600482	中国动力	74,200	1,711,794.00	0.26
81	002001	新 和 成	78,646	1,672,800.42	0.26
82	600019	宝钢股份	253,200	1,668,588.00	0.26
83	601006	大秦铁路	248,600	1,640,760.00	0.25
84	601601	中国太保	42,601	1,597,963.51	0.25
85	603799	华友钴业	43,100	1,595,562.00	0.24
86	300408	三环集团	46,800	1,563,120.00	0.24
87	600176	中国巨石	123,400	1,406,760.00	0.22
88	688041	海光信息	9,900	1,398,771.00	0.21
89	601111	中国国航	176,900	1,395,741.00	0.21
90	603986	兆易创新	10,900	1,379,177.00	0.21
91	600660	福耀玻璃	24,100	1,373,941.00	0.21
92	300033	同花顺	4,900	1,337,749.00	0.21
93	000625	长安汽车	102,000	1,301,520.00	0.20
94	601628	中国人寿	31,101	1,281,050.19	0.20
95	600938	中国海油	42,800	1,117,508.00	0.17
96	300502	新易盛	8,640	1,097,452.80	0.17
97	688009	中国通号	206,737	1,062,628.18	0.16
98	300394	天孚通信	13,160	1,050,694.40	0.16
99	300498	温氏股份	61,300	1,047,004.00	0.16
100	002236	大华股份	65,900	1,046,492.00	0.16
101	600089	特变电工	87,500	1,043,875.00	0.16
102	601998	中信银行	122,400	1,040,400.00	0.16
103	600029	南方航空	174,700	1,030,730.00	0.16
104	000157	中联重科	142,300	1,028,829.00	0.16
105	601012	隆基绿能	68,000	1,021,360.00	0.16
106	000651	格力电器	22,100	992,732.00	0.15
107	002714	牧原股份	22,540	946,905.40	0.15
108	600150	中国船舶	28,300	920,882.00	0.14
109	600025	华能水电	95,800	914,890.00	0.14
110	600989	宝丰能源	53,800	868,332.00	0.13
111	002142	宁波银行	31,500	861,840.00	0.13
112	000938	紫光股份	35,800	858,842.00	0.13
113	000002	万 科 A	132,500	850,650.00	0.13
114	002027	分众传媒	116,200	848,260.00	0.13
115	601818	光大银行	202,400	839,960.00	0.13
116	000538	云南白药	14,600	814,534.00	0.12
117	002415	海康威视	28,800	798,624.00	0.12
118	605499	东鹏饮料	2,390	750,579.50	0.12
119	600066	宇通客车	26,500	658,790.00	0.10
120	000301	东方盛虹	76,400	636,412.00	0.10
121	600111	北方稀土	24,700	615,030.00	0.09
122	600377	宁沪高速	37,800	579,852.00	0.09



123	000596	古井贡酒	4,200	559,230.00	0.09
124	600436	片仔癀	2,700	540,027.00	0.08
125	002371	北方华创	1,200	530,652.00	0.08
126	002709	天赐材料	29,100	527,292.00	0.08
127	601888	中国中免	8,200	499,954.00	0.08
128	601117	中国化学	65,100	499,317.00	0.08
129	002648	卫星化学	28,200	488,706.00	0.07
130	601825	沪农商行	50,200	486,940.00	0.07
131	001289	龙源电力	29,600	478,928.00	0.07
132	688036	传音控股	5,800	462,260.00	0.07
133	600010	宝钢股份	257,800	461,462.00	0.07
134	688396	华润微	9,600	452,736.00	0.07
135	000568	泸州老窖	3,900	442,260.00	0.07
136	603501	豪威集团	3,400	434,010.00	0.07
137	000977	浪潮信息	8,500	432,480.00	0.07
138	603833	欧派家居	6,900	389,505.00	0.06
139	300442	润泽科技	7,700	381,381.00	0.06
140	688126	沪硅产业	18,700	350,064.00	0.05
141	600160	巨化股份	11,000	315,480.00	0.05
142	600460	士兰微	12,500	310,250.00	0.05
143	000895	双汇发展	12,300	300,243.00	0.05
144	300014	亿纬锂能	6,300	288,603.00	0.04
145	601865	福莱特	17,900	272,259.00	0.04
146	600332	白云山	8,900	234,604.00	0.04
147	600600	青岛啤酒	3,300	229,218.00	0.04
148	600009	上海机场	7,200	228,744.00	0.04
149	600585	海螺水泥	10,300	221,141.00	0.03
150	600309	万华化学	2,800	151,928.00	0.02
151	600048	保利发展	10,700	86,670.00	0.01
152	300979	华利集团	900	47,313.00	0.01
153	688187	时代电气	1,000	42,650.00	0.01
154	300759	康龙化成	200	4,908.00	0.00
155	300413	芒果超媒	200	4,364.00	0.00
156	600905	三峡能源	900	3,834.00	0.00
157	600674	川投能源	200	3,208.00	0.00
158	600015	华夏银行	400	3,164.00	0.00
159	600886	国投电力	200	2,948.00	0.00
160	000617	中油资本	400	2,920.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000987	越秀资本	965,700	6,624,702.00	1.02
2	688819	天能股份	172,700	4,794,152.00	0.74

3	002673	西部证券	564,054	4,444,745.52	0.68
4	300207	欣旺达	194,600	3,903,676.00	0.60
5	300708	聚灿光电	323,500	3,882,000.00	0.60
6	002637	赞宇科技	384,300	3,835,314.00	0.59
7	603989	艾华集团	236,900	3,648,260.00	0.56
8	688315	诺禾致源	233,300	3,294,196.00	0.51
9	688612	威迈斯	108,800	2,909,312.00	0.45
10	688708	佳驰科技	40,900	2,261,361.00	0.35
11	600873	梅花生物	198,200	2,118,758.00	0.32
12	600862	中航高科	66,200	1,726,496.00	0.26
13	300251	光线传媒	73,900	1,497,953.00	0.23
14	000050	深天马 A	171,200	1,458,624.00	0.22
15	688235	百济神州	6,000	1,401,840.00	0.21
16	688376	美埃科技	37,200	1,386,444.00	0.21
17	603939	益丰药房	53,206	1,301,950.82	0.20
18	300866	安克创新	11,200	1,272,320.00	0.20
19	002632	道明光学	135,700	1,262,010.00	0.19
20	601777	千里科技	147,200	1,249,728.00	0.19
21	002128	电投能源	62,600	1,238,228.00	0.19
22	688570	天玛智控	53,300	1,091,584.00	0.17
23	002517	恺英网络	55,400	1,069,774.00	0.16
24	301103	何氏眼科	48,000	1,065,600.00	0.16
25	000728	国元证券	126,200	995,718.00	0.15
26	002007	华兰生物	62,880	985,329.60	0.15
27	002282	博深股份	131,200	980,064.00	0.15
28	603408	建霖家居	88,600	971,942.00	0.15
29	600197	伊力特	64,200	957,864.00	0.15
30	000688	国城矿业	71,400	950,334.00	0.15
31	002056	横店东磁	63,100	892,865.00	0.14
32	600170	上海建工	367,700	878,803.00	0.13
33	002025	航天电器	17,000	873,970.00	0.13
34	601727	上海电气	116,600	861,674.00	0.13
35	688234	天岳先进	14,500	848,975.00	0.13
36	002271	东方雨虹	78,600	843,378.00	0.13
37	002595	豪迈科技	14,200	840,924.00	0.13
38	600060	海信视像	36,500	840,230.00	0.13
39	688181	八亿时空	26,100	812,232.00	0.12
40	002532	天山铝业	97,000	806,070.00	0.12
41	000933	神火股份	46,400	772,096.00	0.12
42	688107	安路科技	26,802	756,888.48	0.12
43	002521	齐峰新材	82,500	754,050.00	0.12
44	688100	威胜信息	19,800	733,590.00	0.11
45	688114	华大智造	11,000	713,130.00	0.11

46	601005	重庆钢铁	530,600	673,862.00	0.10
47	688147	微导纳米	22,200	669,996.00	0.10
48	301150	中一科技	30,880	662,684.80	0.10
49	002945	华林证券	45,200	649,524.00	0.10
50	603786	科博达	11,700	648,297.00	0.10
51	600352	浙江龙盛	63,700	647,192.00	0.10
52	601369	陕鼓动力	72,400	634,948.00	0.10
53	600637	东方明珠	83,000	620,010.00	0.10
54	000875	吉电股份	122,300	618,838.00	0.09
55	603877	太平鸟	41,300	598,850.00	0.09
56	600535	天士力	37,900	593,135.00	0.09
57	002032	苏泊尔	11,200	586,768.00	0.09
58	000401	冀东水泥	133,800	586,044.00	0.09
59	600299	安迪苏	60,000	579,000.00	0.09
60	300850	新强联	15,700	562,374.00	0.09
61	601869	长飞光纤	13,500	549,720.00	0.08
62	300712	永福股份	22,500	540,675.00	0.08
63	601168	西部矿业	32,000	532,160.00	0.08
64	600062	华润双鹤	28,100	524,346.00	0.08
65	603529	爱玛科技	14,300	491,920.00	0.08
66	603876	鼎胜新材	53,000	481,770.00	0.07
67	601231	环旭电子	31,900	466,697.00	0.07
68	600166	福田汽车	166,200	450,402.00	0.07
69	300738	奥飞数据	21,400	447,902.00	0.07
70	688118	普元信息	19,800	442,530.00	0.07
71	688617	惠泰医疗	1,450	430,650.00	0.07
72	603699	纽威股份	13,800	430,146.00	0.07
73	300476	胜宏科技	3,100	416,578.00	0.06
74	688290	景业智能	7,700	401,324.00	0.06
75	600641	万业企业	28,200	391,416.00	0.06
76	000828	东莞控股	36,400	389,116.00	0.06
77	002469	三维化学	44,100	366,471.00	0.06
78	301045	天禄科技	15,900	364,110.00	0.06
79	300496	中科创达	6,200	354,764.00	0.05
80	002993	奥海科技	8,100	335,907.00	0.05
81	002483	润邦股份	51,600	322,500.00	0.05
82	688198	佰仁医疗	2,800	287,532.00	0.04
83	688469	芯联集成	60,200	287,154.00	0.04
84	301180	万祥科技	18,300	269,559.00	0.04
85	002208	合肥城建	38,500	269,500.00	0.04
86	301358	湖南裕能	8,500	265,115.00	0.04
87	603819	神力股份	19,000	254,790.00	0.04
88	688686	奥普特	2,500	239,050.00	0.04

89	301678	新恒汇	3,817	220,366.28	0.03
90	688578	艾力斯	2,000	186,080.00	0.03
91	301365	矩阵股份	10,600	181,684.00	0.03
92	688278	特宝生物	2,200	158,642.00	0.02
93	601456	国联民生	13,900	143,865.00	0.02
94	603078	江化微	7,700	143,528.00	0.02
95	600861	北京人力	6,900	133,170.00	0.02
96	688522	纳睿雷达	2,400	122,928.00	0.02
97	002251	步步高	25,100	122,237.00	0.02
98	688582	芯动联科	1,800	120,960.00	0.02
99	003022	联泓新科	6,100	96,563.00	0.01
100	603063	禾望电气	2,700	91,422.00	0.01
101	603079	圣达生物	4,500	77,175.00	0.01
102	002653	海思科	1,400	59,108.00	0.01
103	600583	海油工程	10,800	58,968.00	0.01
104	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
105	002953	日丰股份	4,400	45,672.00	0.01
106	688685	迈信林	800	44,680.00	0.01
107	600380	健康元	3,300	36,399.00	0.01
108	603400	华之杰	569	31,875.73	0.00
109	688352	顾中科技	2,400	26,952.00	0.00
110	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
111	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
112	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
113	688657	浩辰软件	400	16,988.00	0.00
114	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
115	301080	百普赛斯	200	14,306.00	0.00
116	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
117	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
118	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
119	688172	燕东微	700	13,762.00	0.00
120	603049	中策橡胶	314	13,454.90	0.00
121	600745	闻泰科技	400	13,412.00	0.00
122	603194	中力股份	291	13,208.49	0.00
123	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
124	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
125	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
126	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
127	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
128	603202	天有为	107	9,700.62	0.00
129	688088	虹软科技	200	9,650.00	0.00
130	301585	蓝宇股份	273	9,363.90	0.00
131	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00

132	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
133	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
134	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
135	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
136	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
137	603737	三棵树	140	5,159.00	0.00
138	300677	英科医疗	200	4,736.00	0.00
139	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
140	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
141	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
142	600967	内蒙一机	200	3,870.00	0.00
143	603688	石英股份	100	3,522.00	0.00
144	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
145	300447	全信股份	200	3,134.00	0.00
146	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
147	600598	北大荒	200	2,884.00	0.00
148	601163	三角轮胎	200	2,810.00	0.00
149	603367	辰欣药业	200	2,804.00	0.00
150	603090	宏盛股份	100	2,437.00	0.00
151	600323	瀚蓝环境	100	2,435.00	0.00
152	301339	通行宝	140	2,398.20	0.00
153	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
154	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
155	002395	双象股份	100	1,770.00	0.00
156	000623	吉林敖东	100	1,695.00	0.00
157	000598	兴蓉环境	200	1,442.00	0.00
158	002782	可立克	100	1,298.00	0.00
159	600125	铁龙物流	200	1,132.00	0.00
160	301025	读客文化	100	1,100.00	0.00
161	002685	华东重机	100	753.00	0.00
162	600694	大商股份	20	371.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601328	交通银行	26,151,124.00	3.82
2	601398	工商银行	22,221,329.00	3.24
3	688981	中芯国际	16,126,959.04	2.35
4	600000	浦发银行	15,815,126.00	2.31
5	600519	贵州茅台	15,158,992.71	2.21
6	600031	三一重工	13,544,011.00	1.98
7	601766	中国中车	13,453,740.00	1.96

8	000333	美的集团	13,126,863.00	1.92
9	002475	立讯精密	12,965,200.00	1.89
10	300750	宁德时代	12,951,098.00	1.89
11	600900	长江电力	12,915,995.00	1.88
12	300207	欣旺达	12,199,126.00	1.78
13	601899	紫金矿业	11,422,374.00	1.67
14	000338	潍柴动力	11,334,297.00	1.65
15	002179	中航光电	10,885,909.00	1.59
16	600926	杭州银行	10,851,131.47	1.58
17	600030	中信证券	10,748,365.00	1.57
18	002714	牧原股份	10,552,854.20	1.54
19	601618	中国中冶	10,473,699.00	1.53
20	601169	北京银行	10,463,964.00	1.53

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	000333	美的集团	23,735,423.86	3.46
2	601318	中国平安	21,354,564.57	3.12
3	002475	立讯精密	20,062,590.01	2.93
4	601398	工商银行	17,199,737.00	2.51
5	601988	中国银行	16,704,478.00	2.44
6	300750	宁德时代	15,934,977.56	2.33
7	601319	中国人保	14,620,678.00	2.13
8	002594	比亚迪	13,506,919.00	1.97
9	601899	紫金矿业	13,435,972.50	1.96
10	601658	邮储银行	13,057,790.00	1.91
11	601328	交通银行	12,906,056.00	1.88
12	600519	贵州茅台	12,803,005.00	1.87
13	601288	农业银行	12,686,072.00	1.85
14	600031	三一重工	12,478,621.00	1.82
15	300433	蓝思科技	12,244,911.92	1.79
16	600030	中信证券	12,050,463.00	1.76
17	002027	分众传媒	11,937,601.00	1.74
18	601688	华泰证券	11,859,211.00	1.73
19	600000	浦发银行	11,654,972.00	1.70
20	600926	杭州银行	11,644,231.84	1.70

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	1,315,963,309.92
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,360,938,858.94
--------------	------------------

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	14,177,880.55	2.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,177,880.55	2.17

## 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	019749	24 国债 15	140,000	14,177,880.55	2.17

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货系根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑基差成本、流动性等因素选择合适的合约。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

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	1,757,886.44
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	310,901.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,068,787.96

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份



份额级别	持有人 户数 （户）	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 （%）	持有份额	占总 份额 比例 （%）
建信沪深 300 指 数 增 强 （LOF）A	110,400	3,144.64	86,041,921.49	24.78	261,126,107.70	75.22
建信沪深 300 指 数 增强 C	4,873	37,887.67	158,690,386.70	85.95	25,936,241.90	14.05
合计	115,273	4,613.35	244,732,308.19	46.02	287,062,349.60	53.98

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 期末上市基金前十名持有人

建信沪深 300 指数增强（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	纪嘉伦	416,067.00	15.82
2	高其铭	312,477.00	11.88
3	官文举	194,296.00	7.39
4	刘新	143,000.00	5.44
5	张中芬	127,209.00	4.84
6	黄崇安	124,820.00	4.75
7	冀更其	78,012.00	2.97
8	甘遵义	59,385.00	2.26
9	丁一宁	58,345.00	2.22
10	魏梅	42,984.00	1.63

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	建信沪深 300 指数增强（LOF） A	6,251.11	0.00
	建信沪深 300 指数增强 C	499,798.31	0.27
	合计	506,049.42	0.10

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）。

8.4 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信沪深 300 指数增强（LOF）A	0
	建信沪深 300 指数增强 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	建信沪深 300 指数增强（LOF）A	0~10
	建信沪深 300 指数增强 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信沪深 300 指数增强（LOF）A	建信沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日 （2020 年 5 月 7 日） 基金份额总额	113,430,363.29	—
本报告期期初基金份额总额	369,444,355.07	195,002,897.78
本报告期基金总申购份额	53,188,332.32	8,764,366.89
减：本报告期基金总赎回份额	75,464,658.20	19,140,636.07
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	347,168,029.19	184,626,628.60

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 2025 年 1 月 25 日发布公告，自 2025 年 1 月 24 日起聘任张铮

先生担任建信基金管理有限责任公司副总裁。上述事项已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内，基金托管人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

本报告期内无其他涉及本基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投	1	1,632,129,753.09	61.01	303,414.12	59.75	-
国泰海通证券	1	787,962,435.32	29.45	154,364.18	30.40	-
广发证券	2	255,309,744.37	9.54	50,016.38	9.85	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、公司选择证券公司的标准

(1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 10 亿元人民币；

- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，研究业务线最近两年未因发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要，并能为基础金提供全面的信息服务；
- (6) 能及时为公司提供高质量的研究服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走势分析、个股分析报告及其他专门报告。

2、证券公司服务评价程序

- (1) 证券公司服务的评价包括定期的证券公司评价打分以及对证券公司投研支持服务的定额激励。
- (2) 公司对证券公司实行“核心名单”管理。在所有公司合作机构中筛选部分机构进入“核心名单”。公司的评价打分仅针对进入“核心名单”的机构，“核心名单”定期调整、动态优化。
- (3) 定期的证券公司评价打分：根据证券公司服务记录，投研人员定期在投研系统平台对核心名单的证券公司服务进行评价打分。
- (4) 证券公司服务的定额激励：根据证券公司服务记录，投研各部门可提出定额激励作为对证券公司投研支持服务的补充激励。证券公司投研支持服务的范围包括但不限于：重点推荐、定向路演邀请、投研课题委托、产业链调研、数据模型及支持等服务内容。
- (5) 证券公司服务评价、交易佣金分配建议等证券公司服务的定期考核评价结果，由研究部进行汇总，提交公司投资决策委员会授权的投研部门总经理联席会议审议。

3、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信建投	25,496,755.00	100.00	5,000,000.00	100.00	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
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	关于新增邮储银行为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 5 月 24 日
2	关于建信基金管理有限责任公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 3 月 19 日
3	关于新增海通证券股份有限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	2025 年 2 月 21 日
4	关于新增方正证券有限公司为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 1 月 6 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	2025 年 01 月 01 日-2025 年 06 月 30 日	158,690,386.70	-	-	158,690,386.70	29.84
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沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 2、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2025 年 8 月 29 日