

建信丰融债券型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 2 月 27 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 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	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.11 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信丰融债券型证券投资基金	
基金简称	建信丰融债券	
基金主代码	022657	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 2 月 27 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	1, 173, 923, 026. 40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	建信丰融债券 A	建信丰融债券 C
下属分级基金的交 易代码	022657	022658
报告期末下属分级 基金的份额总额	822, 890, 877. 30 份	351, 032, 149. 10 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
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	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	2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日） - 2025 年 6 月 30 日	
	建信丰融债券 A	建信丰融债券 C
本期已实现收益	9,017,602.13	4,298,303.03
本期利润	10,779,213.40	5,418,141.83
加权平均基金份 额本期利润	0.0064	0.0044
本期加权平均净 值利润率	0.64%	0.44%
本期基金份额净 值增长率	0.70%	0.56%
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	4,818,157.81	1,590,090.92
期末可供分配基 金份额利润	0.0059	0.0045
期末基金资产净 值	828,610,700.72	353,005,910.34

期末基金份额净值	1.0070	1.0056
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	0.70%	0.56%

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。

4、本基金基金合同于 2025 年 2 月 27 日生效，截至报告期末仍处于建仓期。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信丰融债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.31%	0.03%	0.54%	0.05%	-0.23%	-0.02%
过去三个月	0.60%	0.02%	1.17%	0.09%	-0.57%	-0.07%
自基金合同生效起至今	0.70%	0.02%	0.48%	0.11%	0.22%	-0.09%

建信丰融债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.26%	0.03%	0.54%	0.05%	-0.28%	-0.02%
过去三个月	0.50%	0.02%	1.17%	0.09%	-0.67%	-0.07%
自基金合同生效起至今	0.56%	0.02%	0.48%	0.11%	0.08%	-0.09%

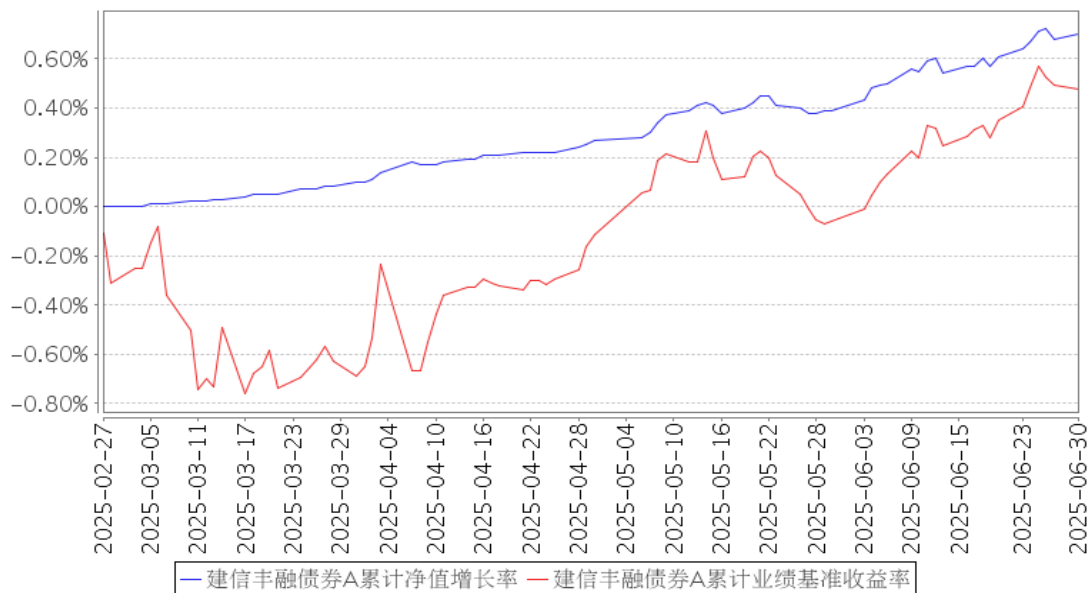
注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深

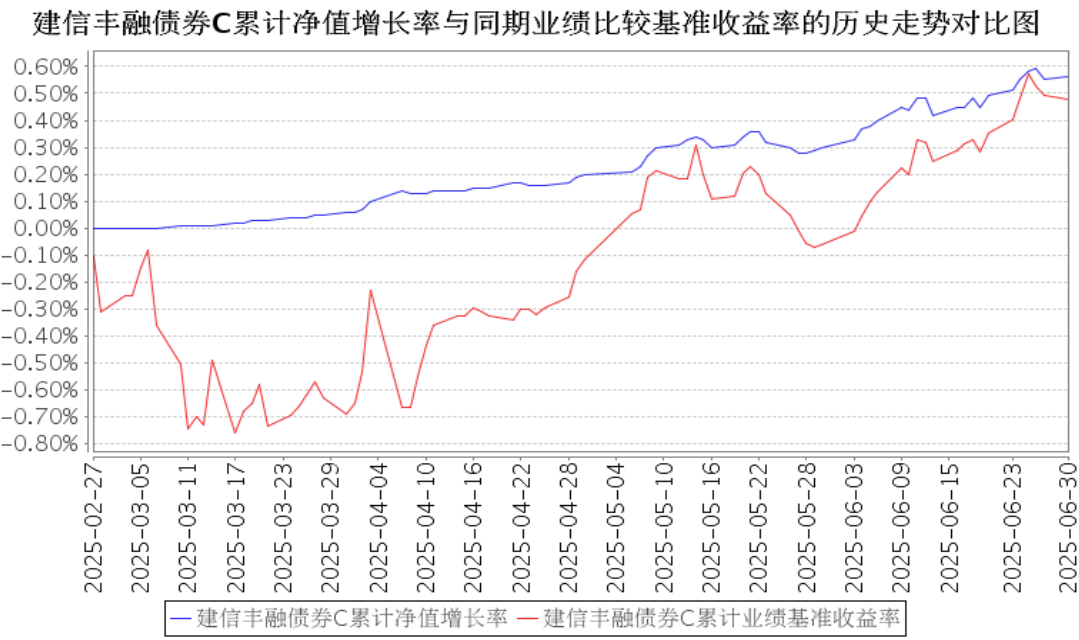
300 指数收益率*8%+恒生指数收益率(经汇率调整)*2%。

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

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

建信丰融债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





注：本基金基金合同于 2025 年 2 月 27 日生效，截至报告期末仍处于建仓期。

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		
李峰	本基金的基金经理	2025 年 2 月 27 日	—	18	李峰先生，硕士。2007 年 5 月至 2012 年 9 月任华夏基金管理公司基金会计业务经理、风控高级经理，2012 年 9 月至 2015 年 6 月任建信基金管理公司交易员、交易主管，2015 年 7 月至 2016 年 6 月任银华基金管理公司询价研究主管。2016 年 6 月至今任建信基金管理公司基金经理助理、基金经理。2017 年 5 月 15 日起任建信信用增强债券型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 15 日起任建信稳定鑫利债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 2 日至 2020 年 3 月 17 日任建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2018 年 3 月 14 日起任建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 3 月 8 日起任建信短债纯债债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 8 月 6 日至 2023 年 2 月 20 日任建信转债增强债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月 23 日至 2022 年 1 月 20 日任建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月 31 日起任建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2020 年 12 月 16 日起任建信利率债策略纯债债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 2 月 20 日起任建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 2 月 27 日起任建信丰融债券型证券投资基金的基金经理。
薛玲	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2025 年 2 月 27 日	—	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 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。
--	--	--	--	--	--

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

2025 年上半年，宏观经济受全球贸易政策的影响显著，但在政策发力叠加抢出口的拉动下，经济增长展现出较强的韧性与动能，上半年国内生产总值(GDP)的同比增长 5.3%，较 2024 年同期回升 0.3 个百分点。投资方面，上半年全国固定资产投资累计同比增长 2.8%，比去年全年增速小幅回落。其中，在海外需求偏强以及内部稳增长政策发力的背景下，制造业投资增速与基建投资增速保持了一定的韧性；而房地产投资增速的同比降幅在二季度有所走阔，依然对上半年的经济增长形成一定的拖累。消费方面，受补贴政策的拉动，上半年社会消费品零售总额同比增长 5.0%，增速相比于去年全年增速回升 1.5 个百分点。进出口方面，受到美国大幅加征关税的影响，在抢

出口效应的拉动下，上半年外贸进出口总额同比增长 1.8%，其中出口同比增长 5.9%。整体看，上半年在外部事件冲击以及内部政策对冲的背景下，出口以及基建投资等方面体现出较强的韧性，对冲了地产需求不足对于经济的拖累，宏观经济运行平稳。

通胀方面，受消费品价格以及工业品价格下行的影响，2025 年上半年，消费者价格指数（CPI）同比增速下降 0.1%。其中一季度通胀受节假日服务价格的扰动而波动，二季度后因食品价格走势强于季节性，通胀水平小幅抬升。考虑到下半年基数偏低，CPI 有望继续上行。货币政策方面，上半年资金面总体前紧后松。从公开市场操作上来看，一季度人民银行先在年初停止购买国债，又减量续作 MLF，央行融出资金不足导致资金利率显著上行。进入二季度后，央行开始增量续作 MLF，并通过买断式逆回购投放资金，资金利率再度转为下行。此外，央行在 5 月降息 10bp、降准 0.5 个百分点，并同步调降 1 年期、5 年期 LPR10bp，有效降低了全社会的融资成本。汇率方面，上半年受国内 AI 技术突破，以及稳增长政策的实施，使得人民币相对于美元走强，中间价从年初的 7.2988 升值到上半年末的 7.1656，升值幅度为 1.82%。

在此背景下，债券市场方面，上半年债市收益率围绕货币政策预期以及事件冲击波动加剧。一季度债券收益率开年后先快速下行再大幅回升，二季度受到关税冲击后短期大幅下行，随后转为震荡。整体看 10 年国开债收益率相比 2024 年年末下行 4BP 到 1.69%，而 1 年期国开债相较于去年末上行 27BP 至 1.48%，收益率曲线显著平坦化。权益市场方面，在经济弱复苏背景之下，市场经历了预期和现实的不断交织，上证指数微涨收关。2025 年初受到企业盈利、市场情绪的影响，市场经历了一波下跌之后，震荡上行。在 4 月初受到关税政策扰动的情况下，国内股票市场大幅回调。在此之后市场震荡上行，上证指数区间累计上涨超过 3%。银行板块涨幅超过 10%。从估值角度上考虑，股票市场整体估值处于合理位置。

回顾上半年的基金管理工作，债券方面组合先以中短久期信用债建仓，获取稳定的票息收入以积累安全垫。进入二季度后，随着资金面的好转以及超预期事件冲击，债券收益率出现显著下行，组合提升久期与杠杆水平。权益方面，4 月中旬基金打开申购之后，开始逐步建仓，建仓期间整体操作思路仍以绝对收益为主，到 6 月底基金基本建仓完成。整个建仓期间，基金最大回撤 7bp，实现了较好的风险收益比。

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 0.70%，波动率 0.02%，业绩比较基准收益率 0.48%，波动率 0.11%。本报告期本基金 C 净值增长率 0.56%，波动率 0.02%，业绩比较基准收益率 0.48%，波动率 0.11%。

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，贸易战引发的全球产业链重塑以及地缘风险升级带来的不确定性将对资产价格形成较大的扰动，国内政策的核心依然是如何刺激内需以及部分行业“反内卷”政策的实施。海外方面，贸易谈判的后续推进、演化以及美联储是否会在三季度开启降息，将成为全球风险偏好的重要影响因素。国内方面，随着雅鲁藏布江水电站项目为代表的重大项目开工，基建投资的发力依旧是拉动经济增长的重要力量；随着“反内卷”政策的进一步推进，工业产出品价格以及下游制造业企业的盈利均有望得到改善，进而稳定就业与制造业投资；随着消费刺激政策的适时推出，内需的提振将有效对冲因前期抢出口带来的外需下滑。在此背景下，货币政策预计仍将保持适度宽松，降准、降息的落地在下半年依然可以预期。因此，我们对下半年债券市场持乐观态度。权益方面，目前经济仍然在探底过程中，实体经济数据短时间大幅好转的可能性不大。少数交易板块由于资金的堆积，交易结构相对脆弱。预计指数将在区间内反复震荡，交易中将重点选择盈利有支撑、估值尚且合理的板块。组合管理方面，在继续控制信用风险的前提下积极操作，择机调整组合久期与杠杆水平，密切跟踪宏观微观数据边际变化带来的投资机会，并关注因风险事件、监管政策变化引发收益率波动所带来的交易性机会。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——建信基金管理有限责任公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信丰融债券型证券投资基金

报告截止日：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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	5,899,740.35
结算备付金		637,098.85

存出保证金		27,010.57
交易性金融资产	6.4.7.2	1,464,054,567.17
其中：股票投资		161,292,230.71
基金投资		-
债券投资		1,302,762,336.46
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		58,530.51
应收申购款		2,623,109.99
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		1,473,300,057.44
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30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		230,671,342.33
应付清算款		4,509,487.57
应付赎回款		55,202,266.91
应付管理人报酬		776,162.50
应付托管费		194,040.67
应付销售服务费		168,666.10
应付投资顾问费		-
应交税费		30,106.44
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	131,373.86
负债合计		291,683,446.38
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	1,173,923,026.40
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	7,693,584.66

净资产合计		1, 181, 616, 611. 06
负债和净资产总计		1, 473, 300, 057. 44

注：1、本基金合同生效日为 2025 年 02 月 27 日，本报告期自基金合同生效日 2025 年 02 月 27 日起至 2025 年 06 月 30 日止。报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,173,923,026.40 份，其中建信丰融债券 A 基金份额总额 822,890,877.30 份，基金份额净值人民币 1.0070 元；建信丰融债券 C 基金份额总额 351,032,149.10 份，基金份额净值人民币 1.0056 元。

2、本基金基金合同生效日为 2025 年 2 月 27 日，无上年度可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体：建信丰融债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		25, 529, 216. 90
1. 利息收入		8, 709, 177. 60
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	404, 148. 62
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		8, 305, 028. 98
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13, 694, 049. 80
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	-258, 161. 88
基金投资收益		-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	12, 230, 624. 05
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	1, 721, 587. 63
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	2, 881, 450. 07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	244, 539. 43
减：二、营业总支出		9, 331, 861. 67
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	5, 867, 844. 43
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	1, 466, 961. 16

3. 销售服务费		1,642,753.56
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		315,951.00
其中：卖出回购金融资产支出		315,951.00
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		11,905.72
8. 其他费用	6.4.7.23	26,445.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,197,355.23
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,197,355.23
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		16,197,355.23

注：本基金基金合同生效日为 2025 年 2 月 27 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：建信丰融债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,132,091,235.00	-	-	4,132,091,235.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,958,168,208.60	-	7,693,584.66	-2,950,474,623.94
（一）、综合收益总额	-	-	16,197,355.23	16,197,355.23
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,958,168,208.60	-	-8,503,770.57	-2,966,671,979.17
其中：1. 基金申购款	538,386,581.78	-	2,023,027.74	540,409,609.52

2. 基金赎回款	-3, 496, 554, 790. 38	-	-10, 526, 798. 31	-3, 507, 081, 588. 69
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1, 173, 923, 026. 40	-	7, 693, 584. 66	1, 181, 616, 611. 06

注：本基金基金合同生效日为 2025 年 2 月 27 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谢海玉

基金管理人负责人

莫红

主管会计工作负责人

丁颖

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信丰融债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1544 号《关于准予建信丰融债券型证券投资基金注册的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信丰融债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4, 130, 943, 013. 69 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第 70071792_A05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信丰融债券型证券投资基金基金合同》于 2025 年 2 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4, 132, 091, 235. 00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1, 148, 221. 31 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信丰融债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（仅包括全市场的股票型 ETF 及本基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金，不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资基金的基金、货币市场基金、非本基金管理人管理的基金（全市场的股票型 ETF 除外）、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款，定期存款以及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金对股票、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资比例合计不超过基金资产的 20%，其中，港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*8%+恒生指数收益率（经汇率调整）*2%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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 2 月 27 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）起至 2025 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变

动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（5）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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。

6.4.6.5 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	5,899,740.35
等于：本金	5,898,726.74
加：应计利息	1,013.61
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	5,899,740.35

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		158,895,644.48	-	161,292,230.71	2,396,586.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	221,385,429.74	888,594.52	223,040,370.52	766,346.26
	银行间市场	1,071,229,882.42	8,773,565.94	1,079,721,965.94	-281,482.42
	合计	1,292,615,312.16	9,662,160.46	1,302,762,336.46	484,863.84
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,451,510,956.64	9,662,160.46	1,464,054,567.17	2,881,450.07

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.07
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	110,296.19
其中：交易所市场	81,729.55
银行间市场	28,566.64
应付利息	-
预提费用	21,077.60
合计	131,373.86

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信丰融债券 A

项目	本期 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,133,214,466.79	2,133,214,466.79
本期申购	8,472,083.19	8,472,083.19
本期赎回（以“-”号填列）	-1,318,795,672.68	-1,318,795,672.68
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	822,890,877.30	822,890,877.30
-----	----------------	----------------

建信丰融债券 C

项目	本期	
	2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,998,876,768.21	1,998,876,768.21
本期申购	529,914,498.59	529,914,498.59
本期赎回（以“-”号填列）	-2,177,759,117.70	-2,177,759,117.70
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	351,032,149.10	351,032,149.10

注：1、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。

2、本基金于 2025 年 2 月 5 日至 2025 年 2 月 25 日向社会公开募集。截至 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）止，建信丰融债券 A 类基金份额募集的扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 2,132,567,586.54 元，有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币 646,880.25 元；建信丰融债券 C 类基金份额募集的有效净认购金额为人民币 1,998,375,427.15 元，有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币 501,341.06 元。建信丰融债券 A 类基金份额和 C 类基金份额实收基金合计为人民币 4,132,091,235.00 元，折合 4,132,091,235.00 份基金份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

建信丰融债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	9,017,602.13	1,761,611.27	10,779,213.40
本期基金份额交易产生的变动数	-4,199,444.32	-859,945.66	-5,059,389.98
其中：基金申购款	38,377.06	7,003.80	45,380.86
基金赎回款	-4,237,821.38	-866,949.46	-5,104,770.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,818,157.81	901,665.61	5,719,823.42

建信丰融债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,298,303.03	1,119,838.80	5,418,141.83
本期基金份额交易产生的变动数	-2,708,212.11	-736,168.48	-3,444,380.59
其中：基金申购款	1,440,247.30	537,399.58	1,977,646.88
基金赎回款	-4,148,459.41	-1,273,568.06	-5,422,027.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,590,090.92	383,670.32	1,973,761.24

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	357,816.24
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	46,320.34
其他	12.04
合计	404,148.62

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2月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-258,161.88
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	-258,161.88

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 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,825,449.96
减：卖出股票成本总额	12,970,775.48

减：交易费用	112,836.36
买卖股票差价收入	-258,161.88

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2月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	12,983,617.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-752,993.76
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	12,230,624.05

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2月27日（基金合同生效日）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	1,963,322,480.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,936,089,293.90
减：应计利息总额	27,957,354.48
减：交易费用	28,825.41
买卖债券差价收入	-752,993.76

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
	2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,721,587.63
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	1,721,587.63

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 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,881,450.07
股票投资	2,396,586.23
债券投资	484,863.84

资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,881,450.07

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	244,538.18
基金转换费收入	1.25
合计	244,539.43

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 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	12,077.60
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,879.16
银行间账户维护费	9,000.00
其他	400.00
证券组合费	89.04
合计	26,445.80

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

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

$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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

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

$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

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

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

日销售服务费=前一日基金资产净值×约定年费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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 2 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期	5,899,740.35	357,816.24

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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

无。

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

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 230,671,342.33 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
230023	23 付息国债 23	2025 年 7 月 1 日	124.78	620,000	77,364,311.47
230202	23 国开 02	2025 年 7 月 1 日	101.79	830,000	84,488,519.73
2128028	21 邮储银行二级 01	2025 年 7 月 2 日	104.85	454,000	47,602,987.11
2128039	21 中国银行二级 03	2025 年 7 月 2 日	104.72	600,000	62,832,673.97
合计				2,504,000	272,288,492.28

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 2025 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	100,583,978.08
合计	100,583,978.08

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 2025 年 6 月 30 日
AAA	651,786,096.85
AAA 以下	6,020,308.63
未评级	218,567,462.89
合计	876,373,868.37

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、

资产支持证券及同业存单等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	5,899,740.35	-	-	-	5,899,740.35
结算备付金	637,098.85	-	-	-	637,098.85
存出保证金	27,010.57	-	-	-	27,010.57
交易性金融资产	307,497,476.86	605,698,201.66	389,566,657.94	161,292,230.71	1,464,054,567.17
应收股利	-	-	-	58,530.51	58,530.51
应收申购款	-	-	-	2,623,109.99	2,623,109.99
资产总计	314,061,326.63	605,698,201.66	389,566,657.94	163,973,871.21	1,473,300,057.44
负债					
卖出回购金融资产款	230,671,342.33	-	-	-	230,671,342.33
应付清算款	-	-	-	4,509,487.57	4,509,487.57
应付赎回款	-	-	-	55,202,266.91	55,202,266.91
应付管理人报酬	-	-	-	776,162.50	776,162.50
应付托管费	-	-	-	194,040.67	194,040.67
应付销售服务费	-	-	-	168,666.10	168,666.10
应交税费	-	-	-	30,106.44	30,106.44
其他负债	-	-	-	131,373.86	131,373.86
负债总计	230,671,342.33	-	-	61,012,104.05	291,683,446.38
利率敏感度缺口	83,389,984.30	605,698,201.66	389,566,657.94	102,961,767.16	1,181,616,611.06

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）
	市场利率下降 25 个基点	15,525,256.31
	市场利率上升 25 个基点	-14,960,346.88

	基点	
--	----	--

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	11,123,179.12	-	11,123,179.12
资产合计	-	11,123,179.12	-	11,123,179.12
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	11,123,179.12	-	11,123,179.12

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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）
	所有外币相对人民币升值 5%	556,158.96
	所有外币相对人民币贬值 5%	-556,158.96

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	161,292,230.71	13.65
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,302,762,336.46	110.25
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	1,464,054,567.17	123.90

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。

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
第一层次	172,875,064.25
第二层次	1,291,179,502.92
第三层次	—
合计	1,464,054,567.17

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	161,292,230.71	10.95
	其中：股票	161,292,230.71	10.95
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,302,762,336.46	88.42
	其中：债券	1,302,762,336.46	88.42
	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	6,536,839.20	0.44
8	其他各项资产	2,708,651.07	0.18
9	合计	1,473,300,057.44	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 11,123,179.12 元，占期末基金资产净值比例为 0.94%。

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	439,462.00	0.04
B	采矿业	10,338,812.00	0.87
C	制造业	69,298,609.84	5.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,249,563.00	0.44
E	建筑业	2,762,680.00	0.23
F	批发和零售业	3,348,306.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	11,129,332.00	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,791,123.25	0.49
J	金融业	34,014,533.50	2.88
K	房地产业	1,542,598.00	0.13
L	租赁和商务服务业	1,524,053.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	2,476,979.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	216,715.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	358,176.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	1,678,109.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	150,169,051.59	12.71

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
Materials 材料	243,198.82	0.02
Consumer Staples 日常生活消费品	336,473.08	0.03
Consumer Discretionary 非日常消费品	2,539,749.76	0.21

Energy 能源	847, 206. 11	0. 07
Financials 金融	1, 403, 828. 47	0. 12
Health Care 医疗保健	260, 507. 64	0. 02
Industrials 工业	80, 730. 38	0. 01
Real Estate 房地产	389, 794. 79	0. 03
Information Technology 信息技术	2, 175, 780. 47	0. 18
Telecommunication Services 通讯服务	2, 817, 319. 97	0. 24
Utilities 公用事业	28, 589. 63	0. 00
合计	11, 123, 179. 12	0. 94

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

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	600000	浦发银行	194, 300	2, 696, 884. 00	0. 23
2	600519	贵州茅台	1, 700	2, 396, 184. 00	0. 20
3	601169	北京银行	301, 400	2, 058, 562. 00	0. 17
4	300476	胜宏科技	15, 300	2, 056, 014. 00	0. 17
5	601857	中国石油	211, 800	1, 810, 890. 00	0. 15
5	00857	中国石油股份	10, 000	61, 556. 63	0. 01
6	601229	上海银行	157, 400	1, 670, 014. 00	0. 14
7	00700	腾讯控股	3, 600	1, 651, 359. 06	0. 14
8	600900	长江电力	52, 800	1, 591, 392. 00	0. 13
9	601328	交通银行	192, 800	1, 542, 400. 00	0. 13
9	03328	交通银行	5, 000	33, 286. 18	0. 00
10	601658	邮储银行	280, 100	1, 532, 147. 00	0. 13
10	01658	邮储银行	5, 000	24, 987. 43	0. 00
11	601166	兴业银行	65, 800	1, 535, 772. 00	0. 13
12	600919	江苏银行	127, 700	1, 524, 738. 00	0. 13
13	002891	中宠股份	24, 000	1, 484, 880. 00	0. 13
14	300972	万辰集团	8, 200	1, 477, 968. 00	0. 13
15	601318	中国平安	24, 200	1, 342, 616. 00	0. 11
15	02318	中国平安	2, 500	113, 651. 77	0. 01
16	601668	中国建筑	240, 800	1, 389, 416. 00	0. 12
17	601919	中远海控	90, 800	1, 365, 632. 00	0. 12
18	601009	南京银行	117, 200	1, 361, 864. 00	0. 12
19	601988	中国银行	205, 100	1, 152, 662. 00	0. 10
19	03988	中国银行	40, 000	166, 339. 68	0. 01
20	000333	美的集团	16, 500	1, 191, 300. 00	0. 10
20	00300	美的集团	1, 000	67, 894. 68	0. 01
21	600941	中国移动	6, 600	742, 830. 00	0. 06

21	00941	中国移动	6,500	516,300.49	0.04
22	000651	格力电器	26,600	1,194,872.00	0.10
23	603766	隆鑫通用	92,900	1,185,404.00	0.10
24	601006	大秦铁路	177,800	1,173,480.00	0.10
25	600015	华夏银行	147,300	1,165,143.00	0.10
26	600177	雅戈尔	158,500	1,157,050.00	0.10
27	600016	民生银行	239,700	1,138,575.00	0.10
28	601077	渝农商行	157,700	1,125,978.00	0.10
29	603893	瑞芯微	7,400	1,123,764.00	0.10
30	601127	赛力斯	8,300	1,114,856.00	0.09
31	600114	东睦股份	54,600	1,110,564.00	0.09
32	603565	中谷物流	115,500	1,103,025.00	0.09
33	601818	光大银行	258,400	1,072,360.00	0.09
34	603337	杰克股份	29,700	1,065,636.00	0.09
35	300054	鼎龙股份	37,000	1,061,160.00	0.09
36	603501	豪威集团	8,200	1,046,730.00	0.09
37	000729	燕京啤酒	80,100	1,035,693.00	0.09
38	300035	中科电气	61,300	1,034,744.00	0.09
39	600028	中国石化	175,700	990,948.00	0.08
39	00386	中国石油化工股份	10,000	37,481.15	0.00
40	01810	小米集团-W	18,800	1,027,822.37	0.09
41	002245	蔚蓝锂芯	79,400	1,018,702.00	0.09
42	300926	博俊科技	38,400	1,016,448.00	0.09
43	002468	申通快递	93,500	999,515.00	0.08
44	603129	春风动力	4,500	974,250.00	0.08
45	600031	三一重工	53,000	951,350.00	0.08
46	002475	立讯精密	27,300	947,037.00	0.08
47	600988	赤峰黄金	37,700	937,976.00	0.08
48	601963	重庆银行	86,300	937,218.00	0.08
49	002299	圣农发展	65,000	928,850.00	0.08
50	601088	中国神华	21,100	855,394.00	0.07
50	01088	中国神华	2,500	69,422.19	0.01
51	688208	道通科技	30,154	922,712.40	0.08
52	00981	中芯国际	13,500	550,316.23	0.05
52	688981	中芯国际	4,200	370,314.00	0.03
53	688596	正帆科技	27,000	915,840.00	0.08
54	601998	中信银行	107,700	915,450.00	0.08
55	688213	思特威	8,800	899,536.00	0.08
56	000725	京东方 A	219,300	875,007.00	0.07
57	600901	江苏金租	143,500	869,610.00	0.07
58	600350	山东高速	80,200	854,932.00	0.07
59	603259	药明康德	12,200	848,510.00	0.07
60	688131	皓元医药	17,500	846,125.00	0.07

61	300308	中际旭创	5,800	845,988.00	0.07
62	601899	紫金矿业	43,100	840,450.00	0.07
63	601838	成都银行	41,800	840,180.00	0.07
64	002532	天山铝业	100,700	836,817.00	0.07
65	600690	海尔智家	28,300	701,274.00	0.06
65	06690	海尔智家	6,200	126,934.32	0.01
66	300850	新强联	23,000	823,860.00	0.07
67	002928	华夏航空	98,200	816,042.00	0.07
68	600036	招商银行	14,800	680,060.00	0.06
68	03968	招商银行	2,500	125,051.14	0.01
69	600143	金发科技	77,700	801,087.00	0.07
70	09988	阿里巴巴-W	8,000	801,056.88	0.07
71	688183	生益电子	15,000	768,000.00	0.06
72	00388	香港交易所	2,000	763,849.32	0.06
73	002594	比亚迪	2,300	763,393.00	0.06
74	603379	三美股份	15,800	760,296.00	0.06
75	002487	大金重工	23,000	756,700.00	0.06
76	000858	五粮液	6,300	749,070.00	0.06
77	002595	豪迈科技	12,500	740,250.00	0.06
78	002701	奥瑞金	124,200	738,990.00	0.06
79	300373	扬杰科技	14,000	726,600.00	0.06
80	600377	宁沪高速	47,200	724,048.00	0.06
81	605499	东鹏饮料	2,300	722,315.00	0.06
82	688256	寒武纪	1,200	721,800.00	0.06
83	601000	唐山港	177,500	720,650.00	0.06
84	000429	粤高速 A	53,900	718,487.00	0.06
85	600064	南京高科	91,600	706,236.00	0.06
86	601825	沪农商行	72,800	706,160.00	0.06
87	688582	芯动联科	10,500	705,600.00	0.06
88	002597	金禾实业	29,926	704,757.30	0.06
89	601398	工商银行	80,700	612,513.00	0.05
89	01398	工商银行	16,000	90,757.26	0.01
90	603612	索通发展	38,200	702,116.00	0.06
91	03690	美团-W	6,100	697,030.74	0.06
92	000893	亚钾国际	22,800	687,192.00	0.06
93	688088	虹软科技	14,221	686,163.25	0.06
94	601138	工业富联	31,800	679,884.00	0.06
95	002048	宁波华翔	36,900	679,329.00	0.06
96	301031	中熔电气	8,500	677,025.00	0.06
97	688008	澜起科技	8,200	672,400.00	0.06
98	688018	乐鑫科技	4,560	666,216.00	0.06
99	600061	国投资本	88,400	664,768.00	0.06
100	002273	水晶光电	33,000	659,010.00	0.06

101	601728	中国电信	84,600	655,650.00	0.06
102	600866	星湖科技	94,800	655,068.00	0.06
103	000100	TCL 科技	148,100	641,273.00	0.05
104	300573	兴齐眼药	12,300	637,017.00	0.05
105	600066	宇通客车	25,400	631,444.00	0.05
106	001979	招商蛇口	70,100	614,777.00	0.05
107	00883	中国海洋石油	38,000	614,070.65	0.05
108	688099	晶晨股份	8,600	610,686.00	0.05
109	605376	博迁新材	15,800	605,614.00	0.05
110	600060	海信视像	26,200	603,124.00	0.05
111	001339	智微智能	12,400	599,292.00	0.05
112	601225	陕西煤业	31,100	598,364.00	0.05
113	601766	中国中车	84,800	596,992.00	0.05
114	600755	厦门国贸	98,300	594,715.00	0.05
115	300783	三只松鼠	21,900	593,709.00	0.05
116	603317	天味食品	53,300	592,696.00	0.05
117	601997	贵阳银行	94,800	591,552.00	0.05
118	600012	皖通高速	34,600	587,508.00	0.05
119	600153	建发股份	56,400	584,868.00	0.05
120	601702	华峰铝业	35,800	568,862.00	0.05
121	300570	太辰光	5,900	568,642.00	0.05
122	000987	越秀资本	82,100	563,206.00	0.05
123	605333	沪光股份	20,300	557,235.00	0.05
124	600039	四川路桥	54,800	542,520.00	0.05
125	601577	长沙银行	54,400	540,736.00	0.05
126	002984	森麒麟	28,700	538,125.00	0.05
127	601098	中南传媒	40,900	536,608.00	0.05
128	002948	青岛银行	107,200	533,856.00	0.05
129	600461	洪城环境	53,700	517,668.00	0.04
130	600008	首创环保	170,800	515,816.00	0.04
131	688315	诺禾致源	36,500	515,380.00	0.04
132	300708	聚灿光电	42,700	512,400.00	0.04
133	600398	海澜之家	71,400	496,944.00	0.04
134	688278	特宝生物	6,800	490,348.00	0.04
135	688041	海光信息	3,400	480,386.00	0.04
136	601319	中国人保	55,100	479,921.00	0.04
137	601689	拓普集团	10,000	472,500.00	0.04
138	01024	快手-W	7,900	456,038.84	0.04
139	000983	山西焦煤	70,000	448,000.00	0.04
140	002807	江阴银行	93,300	443,175.00	0.04
141	600642	申能股份	51,300	441,180.00	0.04
142	002966	苏州银行	49,100	431,098.00	0.04
143	600546	山煤国际	49,000	427,770.00	0.04

144	600729	重庆百货	14,000	417,620.00	0.04
145	001965	招商公路	34,700	416,400.00	0.04
146	600033	福建高速	117,600	416,304.00	0.04
147	688696	极米科技	3,600	411,696.00	0.03
148	600098	广州发展	65,800	411,250.00	0.03
149	600820	隧道股份	67,400	411,140.00	0.03
150	600256	广汇能源	68,000	409,360.00	0.03
151	603323	苏农银行	72,450	406,444.50	0.03
152	601699	潞安环能	38,500	406,175.00	0.03
153	600295	鄂尔多斯	45,500	396,305.00	0.03
154	002839	张家港行	86,400	388,800.00	0.03
155	600926	杭州银行	22,500	378,450.00	0.03
156	600373	中文传媒	36,700	376,909.00	0.03
157	600971	恒源煤电	56,000	369,600.00	0.03
158	600019	宝钢股份	56,000	369,040.00	0.03
159	600459	贵研铂业	23,400	362,934.00	0.03
160	601298	青岛港	41,700	362,373.00	0.03
161	000830	鲁西化工	35,000	360,500.00	0.03
162	300015	爱尔眼科	28,700	358,176.00	0.03
163	600273	嘉化能源	42,000	355,320.00	0.03
164	300750	宁德时代	1,400	353,108.00	0.03
165	601168	西部矿业	21,000	349,230.00	0.03
166	600057	厦门象屿	49,000	344,470.00	0.03
167	600188	兖矿能源	28,000	340,760.00	0.03
168	002601	龙佰集团	21,000	340,410.00	0.03
169	601666	平煤股份	45,500	337,155.00	0.03
170	00688	中国海外发展	26,500	329,150.11	0.03
171	600348	华阳股份	49,000	326,340.00	0.03
172	002415	海康威视	11,700	324,441.00	0.03
173	02015	理想汽车-W	3,300	322,009.55	0.03
174	601360	三六零	31,500	321,300.00	0.03
175	600123	兰花科创	49,000	319,480.00	0.03
176	600908	无锡银行	50,500	318,655.00	0.03
177	600985	淮北矿业	28,000	317,520.00	0.03
178	688819	天能股份	11,400	316,464.00	0.03
179	300207	欣旺达	15,700	314,942.00	0.03
180	002673	西部证券	39,000	307,320.00	0.03
181	600674	川投能源	19,000	304,760.00	0.03
182	002714	牧原股份	7,200	302,472.00	0.03
183	002179	中航光电	7,400	298,664.00	0.03
184	002637	赞宇科技	29,900	298,402.00	0.03
185	002563	森马服饰	56,000	294,560.00	0.02
186	000895	双汇发展	12,000	292,920.00	0.02

187	600928	西安银行	73,900	289,688.00	0.02
188	603989	艾华集团	18,800	289,520.00	0.02
189	09868	小鹏汽车-W	4,400	283,288.15	0.02
190	688608	恒玄科技	800	278,384.00	0.02
191	000157	中联重科	38,500	278,355.00	0.02
192	002867	周大生	21,000	276,780.00	0.02
193	000425	徐工机械	35,400	275,058.00	0.02
194	600011	华能国际	38,500	274,890.00	0.02
195	601216	君正集团	49,700	274,344.00	0.02
196	601928	凤凰传媒	24,500	273,665.00	0.02
197	600741	华域汽车	15,500	273,575.00	0.02
198	600887	伊利股份	9,800	273,224.00	0.02
199	600886	国投电力	18,200	268,268.00	0.02
200	600219	南山铝业	70,000	268,100.00	0.02
201	601860	紫金银行	89,000	267,000.00	0.02
202	600030	中信证券	9,600	265,152.00	0.02
203	600757	长江传媒	27,900	258,912.00	0.02
204	300999	金龙鱼	8,600	253,958.00	0.02
205	601101	昊华能源	35,000	253,400.00	0.02
206	002416	爱施德	21,000	252,420.00	0.02
207	003816	中国广核	68,100	247,884.00	0.02
208	000156	华数传媒	30,000	238,200.00	0.02
209	600782	新钢股份	66,700	236,118.00	0.02
210	600585	海螺水泥	9,300	199,671.00	0.02
210	00914	海螺水泥	2,000	36,405.04	0.00
211	000932	华菱钢铁	53,200	234,080.00	0.02
212	601019	山东出版	24,500	232,015.00	0.02
213	601636	旗滨集团	45,500	227,955.00	0.02
214	600269	赣粤高速	44,800	226,688.00	0.02
215	603236	移远通信	2,600	223,080.00	0.02
216	600352	浙江龙盛	21,900	222,504.00	0.02
217	600325	华发股份	45,500	221,585.00	0.02
218	600323	瀚蓝环境	8,900	216,715.00	0.02
219	002275	桂林三金	15,000	214,650.00	0.02
220	601211	国泰海通	10,700	205,012.00	0.02
221	002932	明德生物	10,500	204,330.00	0.02
222	002737	葵花药业	12,800	201,216.00	0.02
223	600236	桂冠电力	31,800	199,386.00	0.02
224	601187	厦门银行	27,600	187,404.00	0.02
225	601717	中创智领	11,000	182,820.00	0.02
226	002233	塔牌集团	24,500	181,300.00	0.02
227	000568	泸州老窖	1,500	170,100.00	0.01
228	601669	中国电建	33,000	160,710.00	0.01

229	601326	秦港股份	49,700	160,531.00	0.01
230	601985	中国核电	17,000	158,440.00	0.01
231	601665	齐鲁银行	24,800	156,736.00	0.01
232	09633	农夫山泉	4,200	153,590.62	0.01
233	600737	中粮糖业	15,800	149,310.00	0.01
234	600862	中航高科	5,700	148,656.00	0.01
235	688009	中国通号	28,721	147,625.94	0.01
236	000598	兴蓉环境	19,900	143,479.00	0.01
237	01801	信达生物	2,000	142,993.76	0.01
238	601018	宁波港	38,000	139,080.00	0.01
239	600502	安徽建工	29,400	138,180.00	0.01
240	00992	联想集团	16,000	137,449.10	0.01
241	600598	北大荒	9,500	136,990.00	0.01
242	03323	中国建材	40,000	136,792.50	0.01
243	603878	武进不锈	24,800	134,416.00	0.01
244	02382	舜宇光学科技	2,100	132,811.84	0.01
245	600572	康恩贝	30,300	132,714.00	0.01
246	000623	吉林敖东	7,600	128,820.00	0.01
247	600710	苏美达	12,900	123,969.00	0.01
248	000090	天健集团	34,100	120,714.00	0.01
249	600717	天津港	26,100	119,016.00	0.01
250	605368	蓝天燃气	12,000	118,080.00	0.01
251	600873	梅花生物	11,000	117,590.00	0.01
252	600582	天地科技	19,300	115,607.00	0.01
253	601369	陕鼓动力	13,000	114,010.00	0.01
254	06618	京东健康	2,900	113,720.17	0.01
255	688117	圣诺生物	3,360	113,064.00	0.01
256	600368	五洲交通	25,000	106,000.00	0.01
257	688073	毕得医药	1,800	104,436.00	0.01
258	09626	哔哩哔哩-W	680	103,995.13	0.01
259	600332	白云山	3,900	102,804.00	0.01
260	301107	瑜欣电子	3,360	99,960.00	0.01
261	301312	智立方	2,400	95,280.00	0.01
262	301125	腾亚精工	5,400	95,202.00	0.01
263	688328	深科达	4,200	95,130.00	0.01
264	301221	光庭信息	1,800	93,546.00	0.01
265	301408	华人健康	6,000	91,260.00	0.01
266	301389	隆扬电子	3,600	88,632.00	0.01
267	301289	国缆检测	1,800	87,840.00	0.01
268	02020	安踏体育	1,000	86,179.28	0.01
269	02628	中国人寿	5,000	85,905.69	0.01
270	301199	迈赫股份	3,360	85,747.20	0.01
271	600125	铁龙物流	15,000	84,900.00	0.01

272	00268	金蝶国际	6,000	84,483.05	0.01
273	000166	申万宏源	16,500	82,830.00	0.01
274	300606	金太阳	4,200	82,824.00	0.01
275	301555	惠柏新材	3,000	82,590.00	0.01
276	301045	天禄科技	3,600	82,440.00	0.01
277	003015	日久光电	4,800	82,320.00	0.01
278	300959	线上线下	1,800	81,846.00	0.01
279	002339	积成电子	10,200	80,784.00	0.01
280	002780	三夫户外	6,000	80,340.00	0.01
281	002546	新联电子	14,400	79,056.00	0.01
282	00020	商汤-W	58,000	78,810.72	0.01
283	301020	密封科技	3,600	78,588.00	0.01
284	603798	康普顿	7,200	78,336.00	0.01
285	300713	英可瑞	4,200	77,028.00	0.01
286	603172	万丰股份	4,800	76,464.00	0.01
287	300843	胜蓝股份	2,400	76,056.00	0.01
288	001268	联合精密	3,000	75,930.00	0.01
289	002209	达意隆	6,000	75,300.00	0.01
290	603860	中公高科	2,400	74,688.00	0.01
291	03888	金山软件	2,000	74,597.51	0.01
292	002395	双象股份	4,200	74,340.00	0.01
293	002380	科远智慧	3,000	73,350.00	0.01
294	301361	众智科技	2,400	73,272.00	0.01
295	003037	三和管桩	10,200	73,236.00	0.01
296	000570	苏常柴A	12,600	72,954.00	0.01
297	001216	华瓷股份	5,400	72,900.00	0.01
298	00175	吉利汽车	5,000	72,773.61	0.01
299	603811	诚意药业	7,800	71,994.00	0.01
300	00241	阿里健康	16,000	69,162.29	0.01
301	002953	日丰股份	6,600	68,508.00	0.01
302	00762	中国联通	8,000	67,849.08	0.01
303	06160	百济神州	500	67,393.11	0.01
304	605080	浙江自然	2,400	66,720.00	0.01
305	03668	兖煤澳大利亚	2,400	64,675.49	0.01
306	600527	江南高纤	30,600	63,342.00	0.01
307	603238	诺邦股份	3,500	61,390.00	0.01
308	01109	华润置地	2,500	60,644.68	0.01
309	601727	上海电气	8,000	59,120.00	0.01
310	00285	比亚迪电子	2,000	58,000.02	0.00
311	00780	同程旅行	3,200	57,139.14	0.00
312	000685	中山公用	6,500	57,070.00	0.00
313	688606	奥泰生物	800	53,760.00	0.00
314	600062	华润双鹤	2,700	50,382.00	0.00

315	02273	固生堂	1,600	50,120.77	0.00
316	00267	中信股份	5,000	49,154.11	0.00
317	01818	招金矿业	2,000	37,207.56	0.00
318	601989	中国重工	7,500	34,800.00	0.00
319	01378	中国宏桥	2,000	32,793.72	0.00
320	02057	中通快递-W	250	31,576.27	0.00
321	00522	ASMPT	600	31,489.63	0.00
322	000828	东莞控股	2,900	31,001.00	0.00
323	02688	新奥能源	500	28,589.63	0.00
324	601607	上海医药	1,500	26,820.00	0.00
325	002736	国信证券	2,300	26,496.00	0.00
326	02313	申洲国际	500	25,443.41	0.00
327	00772	阅文集团	800	21,777.37	0.00
328	301338	凯格精机	300	14,313.00	0.00
329	300092	科新机电	1,000	13,970.00	0.00
330	600694	大商股份	400	7,420.00	0.00
331	000567	海德股份	900	5,328.00	0.00
332	600017	日照港	1,200	3,720.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,847,231.00	0.24
2	600000	浦发银行	2,426,229.00	0.21
3	601169	北京银行	1,920,224.00	0.16
4	601857	中国石油	1,774,854.00	0.15
5	00700	腾讯控股	1,706,635.39	0.14
6	601229	上海银行	1,701,364.00	0.14
7	600900	长江电力	1,596,683.00	0.14
8	300476	胜宏科技	1,583,339.00	0.13
9	601009	南京银行	1,517,994.00	0.13
10	601658	邮储银行	1,503,926.00	0.13
11	002891	中宠股份	1,493,769.11	0.13
12	601328	交通银行	1,484,253.00	0.13
13	601166	兴业银行	1,483,639.00	0.13
14	601077	渝农商行	1,438,032.00	0.12
15	601919	中远海控	1,393,274.00	0.12
16	300972	万辰集团	1,388,150.00	0.12
17	600919	江苏银行	1,378,821.00	0.12
18	601668	中国建筑	1,372,305.00	0.12
19	601318	中国平安	1,294,897.00	0.11
20	601963	重庆银行	1,236,050.00	0.10

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600548	深高速	585,476.00	0.05
2	002327	富安娜	571,244.00	0.05
3	600694	大商股份	552,184.10	0.05
4	002032	苏泊尔	435,137.00	0.04
5	600968	海油发展	366,968.00	0.03
6	002966	苏州银行	331,820.00	0.03
7	002948	青岛银行	319,274.00	0.03
8	600967	内蒙一机	318,881.00	0.03
9	601077	渝农商行	297,177.00	0.03
10	601163	三角轮胎	288,761.00	0.02
11	000429	粤高速 A	278,819.00	0.02
12	600642	申能股份	278,021.00	0.02
13	601963	重庆银行	269,111.00	0.02
14	600050	中国联通	267,208.00	0.02
15	601009	南京银行	264,040.00	0.02
16	601211	国泰海通	253,948.00	0.02
17	601577	长沙银行	245,569.00	0.02
18	600350	山东高速	243,227.00	0.02
19	002807	江阴银行	242,356.00	0.02
20	601998	中信银行	241,215.00	0.02

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	171,866,419.96
卖出股票收入（成交）总额	12,825,449.96

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	124,781,147.54	10.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	712,506,448.11	60.30
	其中：政策性金融债	201,023,342.47	17.01
4	企业债券	20,142,876.71	1.70

5	企业短期融资券	100,583,978.08	8.51
6	中期票据	333,165,052.48	28.20
7	可转债（可交换债）	11,582,833.54	0.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,302,762,336.46	110.25

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	230023	23 附息国债 23	1,000,000	124,781,147.54	10.56
2	230202	23 国开 02	1,000,000	101,793,397.26	8.61
3	012580690	25 东航 SCP001	1,000,000	100,583,978.08	8.51
4	250205	25 国开 05	1,000,000	99,229,945.21	8.40
5	2128042	21 兴业银行二级 02	800,000	83,767,732.60	7.09

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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	27,010.57
2	应收清算款	-
3	应收股利	58,530.51
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,623,109.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,708,651.07

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	1,961,792.79	0.17
2	113052	兴业转债	995,932.05	0.08
3	113042	上银转债	459,699.78	0.04
4	127020	中金转债	430,981.37	0.04
5	127040	国泰转债	413,000.96	0.03
6	113062	常银转债	385,750.19	0.03
7	110087	天业转债	378,372.05	0.03
8	127025	冀东转债	371,883.63	0.03
9	113037	紫银转债	342,250.68	0.03
10	127102	浙建转债	330,665.50	0.03
11	110064	建工转债	323,379.98	0.03
12	127086	恒邦转债	316,912.47	0.03
13	127017	万青转债	316,403.22	0.03
14	110093	神马转债	310,694.04	0.03
15	113068	金铜转债	307,263.19	0.03
16	123048	应急转债	302,419.85	0.03
17	113054	绿动转债	296,735.62	0.03
18	110062	烽火转债	287,512.33	0.02
19	123108	乐普转 2	274,092.26	0.02
20	127028	英特转债	271,106.43	0.02
21	127084	柳工转 2	266,220.74	0.02
22	113688	国检转债	249,345.32	0.02
23	110089	兴发转债	232,936.16	0.02
24	113046	金田转债	227,456.93	0.02
25	127016	鲁泰转债	222,347.67	0.02
26	113631	皖天转债	194,358.90	0.02
27	113056	重银转债	188,928.90	0.02
28	110085	通 22 转债	169,211.30	0.01

29	118034	晶能转债	103,674.68	0.01
30	113641	华友转债	62,953.77	0.01
31	123107	温氏转债	61,530.42	0.01
32	110073	国投转债	58,067.19	0.00
33	127089	晶澳转债	52,542.55	0.00
34	127045	牧原转债	48,539.61	0.00
35	127049	希望转 2	45,301.55	0.00

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 (%)
建信丰融 债券 A	3,720	221,207.23	19,451,129.00	2.36	803,439,748.30	97.64
建信丰融 债券 C	2,372	147,989.94	24,571,429.59	7.00	326,460,719.51	93.00
合计	6,092	192,699.12	44,022,558.59	3.75	1,129,900,467.81	96.25

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	建信丰融债券 A	59,636.22	0.01
	建信丰融债券 C	5,023.55	0.00
	合计	64,659.77	0.01

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信丰融债券 A	建信丰融债券 C
基金合同生效日 (2025 年 2 月 27 日) 基金份额总额	2,133,214,466.79	1,998,876,768.21
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	8,472,083.19	529,914,498.59
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	1,318,795,672.68	2,177,759,117.70
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	822,890,877.30	351,032,149.10

注：1、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。

2、本基金基金合同于 2025 年 2 月 27 日生效。

§ 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。

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁；2025 年 3 月，中国农

业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁；2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

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 (%)	
华福证券	1	92,020,778.72	49.82	40,112.91	49.08	—
华创证券	2	49,699,589.25	26.91	22,161.47	27.12	—
广发证券	1	24,050,159.21	13.02	10,483.32	12.83	—
银河证券	1	12,450,094.74	6.74	6,151.76	7.53	—
国泰海通证券	1	6,471,248.00	3.50	2,820.09	3.45	—
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	—	—	—	—	—
国金证券	1	—	—	—	—	—
华鑫证券	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(%)
华福证券	24,001.70	0.03	280,587,000.00	0.92	-	-
华创证券	3,820,704.07	4.16	-	-	-	-

广发证 券	7,655,546.1 8	8.34	-	-	-	-
银河证 券	132,083.01	0.14	-	-	-	-
国泰海 通证券	80,171,047. 32	87.33	30,202,539,0 00.00	99.08	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 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	关于新增中信证券股份有限公司等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 6 月 25 日
2	关于新增平安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 6 月 11 日
3	关于新增华西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 4 月 18 日
4	建信丰融债券型证券投资基金基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 4 月 16 日
5	建信丰融债券型证券投资基金基金合同生效公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 2 月 28 日
6	关于新增华宝证券股份有限公司为建信丰融债券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 2 月 18 日
7	建信丰融债券型证券投资基金基金份额发售公告	指定报刊和/或公司网站	2025 年 1 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2025 年 8 月 29 日