建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 26 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信沪深 300 指数（LOF）
场内简称	沪深 300LOF 建信
基金主代码	165309
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 11 月 5 日
报告期末基金份额总额	174,081,394.69 份
投资目标	本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。 原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	4,957,486.01
2.本期利润	-37,962,087.34
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2166
4.期末基金资产净值	323,082,738.79
5.期末基金份额净值	1.8559

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。

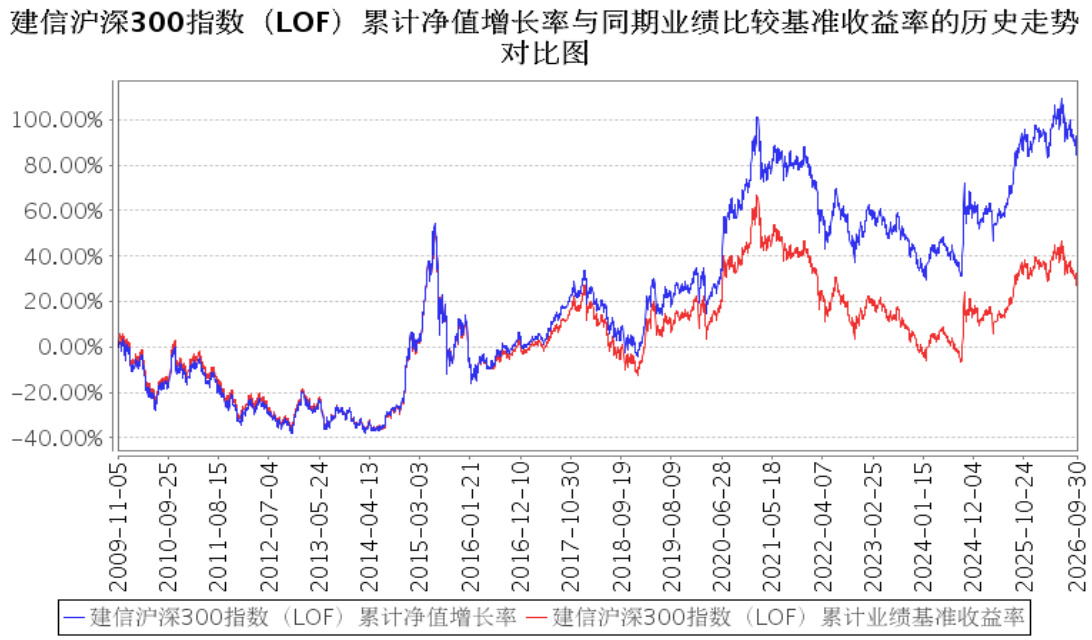
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-10.49%	1.21%	-11.88%	1.22%	1.39%	-0.01%
过去六个月	0.68%	1.21%	-1.92%	1.22%	2.60%	-0.01%
过去一年	-2.93%	1.07%	-5.72%	1.08%	2.79%	-0.01%
过去三年	25.70%	1.08%	17.46%	1.09%	8.24%	-0.01%
过去五年	3.08%	1.05%	-9.55%	1.07%	12.63%	-0.02%
过去七年	50.34%	1.11%	14.26%	1.12%	36.08%	-0.01%
过去十年	89.38%	1.08%	33.28%	1.10%	56.10%	-0.02%
自基金合同生效起至今	85.59%	1.29%	27.39%	1.29%	58.20%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁洪昀	数量投资部高级基金经理，本基金的基金经理	2009 年 11 月 5 日	-	23	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。

4.1.1 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遵规守信情况的说明

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 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的约定。

4.3 公平交易专项说明

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。

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 2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，基金管理人严格遵循基金合同的有关规定，将基金资产净值的 90%以上配置于沪深 300 指数成分股及其备选成分股，并按照指数化投资策略开展日常管理，致力于保持基金组合与标的指数之间较高的匹配程度，实现对指数的紧密跟踪。

在组合构建及实际运作过程中，受相关投资限制的影响，部分指数成分股无法直接纳入基金持仓，管理人通过配置具有相近风险收益特征的其他股票进行适当替代，由此产生的差异成为基金跟踪误差的重要来源之一。针对上述情况，基金管理人运用量化分析方法，对替代证券的选择及配置比例进行综合评估，并结合组合运行情况持续优化替代策略，尽可能降低相关限制对指数跟踪效果的影响。

报告期内标的指数总体呈现窄幅震荡态势，主要在相对有限的区间内波动，未有明显的趋势性行情。基金管理人根据市场运行情况及组合实际状况，持续做好日常投资管理与风险监控工作，在保持组合结构相对稳定的同时，合理安排证券交易及资金配置，努力减少交易成本、现金头寸等因素对基金跟踪效果的影响。报告期内，基金整体运作平稳，跟踪偏离度及跟踪误差均控制在基金合同约定的范围之内，较好地实现了对标的指数的跟踪。

后续运作中，基金管理人将继续坚持被动指数化投资理念，持续完善组合管理及风险控制措施，密切监测基金与标的指数之间的收益差异，并根据实际投资需要适时优化持仓结构，力求进一步提升指数跟踪的准确性和基金运作的稳定性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率-10.49%，波动率 1.21%，业绩比较基准收益率-11.88%，波动率

1.22%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	298,790,206.55	92.17
	其中：股票	298,790,206.55	92.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,199,995.59	7.77
8	其他资产	165,170.02	0.05
9	合计	324,155,372.16	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	2,394,873.00	0.74
B	采矿业	16,966,409.87	5.25
C	制造业	171,927,572.67	53.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,074,227.00	2.81
E	建筑业	3,932,990.00	1.22
F	批发和零售业	513,591.60	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	8,776,260.80	2.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,882,435.65	4.61
J	金融业	59,419,803.38	18.39
K	房地产业	1,379,719.60	0.43
L	租赁和商务服务业	1,564,156.48	0.48

M	科学研究和技术服务业	5,031,244.44	1.56
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	451,899.42	0.14
R	文化、体育和娱乐业	195,266.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	296,510,449.91	91.78

5.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,401,236.38	0.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	112,911.26	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	765,609.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,279,756.64	0.71

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	13,600	10,994,784.00	3.40

2	600519	贵州茅台	7,645	9,622,149.90	2.98
3	300750	宁德时代	32,160	9,362,097.60	2.90
4	601318	中国平安	129,832	6,918,747.28	2.14
5	300502	新易盛	16,976	6,603,664.00	2.04
6	600036	招商银行	150,680	6,217,056.80	1.92
7	601899	紫金矿业	200,792	5,981,593.68	1.85
8	603259	药明康德	30,066	5,031,244.44	1.56
9	000333	美的集团	59,240	4,745,124.00	1.47
10	600900	长江电力	149,000	4,252,460.00	1.32

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	600377	宁沪高速	58,893	765,609.00	0.24
2	688825	长鑫科技	16,945	654,924.25	0.20
3	301666	大普微	558	184,776.12	0.06
4	001248	华润新能源	12,089	112,911.26	0.03
5	001399	惠科股份	4,816	99,044.80	0.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,769.11
2	应收证券清算款	105,203.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	55,197.49
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	165,170.02

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	654,924.25	0.20	新发未上市
2	301666	大普微	184,776.12	0.06	新发未上市
3	001248	华润新能源	112,911.26	0.03	新发未上市
4	001399	惠科股份	37,595.77	0.01	新发未上市

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	175,332,294.44
报告期期间基金总申购份额	8,620,693.19
减：报告期期间基金总赎回份额	9,871,592.94
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	174,081,394.69

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）设立的文件；

2、《建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；

4、《建信沪深 300 指数证券投资基金（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。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2026 年 10 月 26 日