

建信中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

资产托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
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	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	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	20
§ 7 投资组合报告	44
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	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59

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	59
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	59
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	59
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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	63
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 500 指数增强型证券投资基金			
基金简称	建信中证 500 指数增强			
基金主代码	000478			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2014 年 1 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	中信银行股份有限公司			
报告期末基金份 额总额	756, 502, 592. 15 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基 金简称	建信中证 500 指数增 强 A	建信中证 500 指数 增强 C	建信中证 500 指数 增强 E	建信中证 500 指数 增强 Y
下属分级基金的交 易代码	000478	005633	021852	022946
报告期末下属分级 基金的份额总额	707, 504, 778. 91 份	42, 057, 103. 44 份	667, 785. 37 份	6, 272, 924. 43 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，以中证 500 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，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。 在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税前）。
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、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	滕菲菲
	联系电话	010-66228888	4006800000
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-81-95533; 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-85230024
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝 国际金融中心 16 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100033	100020
法定代表人		曲寅军	方合英

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英 蓝国际金融中心 16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1	报告期(2026 年 1 月 1 日 – 2026 年 6 月 30 日)			
期间数 据和指 标	建信中证 500 指数 增强 A	建信中证 500 指数 增强 C	建信中证 500 指数 增强 E	建信中证 500 指数 增强 Y
本期已实 现收益	629,362,038.59	16,253,511.73	432,548.62	3,991,062.29
本期利润	556,819,598.55	13,959,940.39	359,774.10	3,282,066.31
加权平均 基金份额 本期利润	0.5909	0.5721	0.5425	0.5665
本期加权	16.26%	16.35%	15.49%	15.41%

平均净值				
利润率				
本期基金份额净值增长率	17.41%	17.13%	17.13%	17.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026年6月30日)			
期末可供分配利润	2,069,722,680.31	116,208,060.00	1,849,164.86	18,583,855.05
期末可供分配基金份额利润	2.9254	2.7631	2.7691	2.9626
期末基金资产净值	2,777,227,459.22	158,265,163.44	2,516,950.23	24,856,779.48
期末基金份额净值	3.9254	3.7631	3.7691	3.9626
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年6月30日)			
基金份额累计净值增长率	292.54%	58.57%	66.03%	50.41%

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

建信中证 500 指数增强 A

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-----	------	-------	-------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	15.73%	1.44%	17.61%	1.56%	-1.88%	-0.12%
过去六个月	17.41%	1.45%	19.93%	1.58%	-2.52%	-0.13%
过去一年	44.17%	1.25%	49.68%	1.35%	-5.51%	-0.10%
过去三年	45.51%	1.28%	48.15%	1.41%	-2.64%	-0.13%
过去五年	34.71%	1.22%	31.61%	1.30%	3.10%	-0.08%
过去七年	101.88%	1.25%	78.59%	1.29%	23.29%	-0.04%
过去十年	89.19%	1.25%	46.45%	1.28%	42.74%	-0.03%
自基金合同生效起至今	292.54%	1.49%	127.56%	1.49%	164.98%	0.00%

建信中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	15.59%	1.44%	17.61%	1.56%	-2.02%	-0.12%
过去六个月	17.13%	1.45%	19.93%	1.58%	-2.80%	-0.13%
过去一年	43.42%	1.25%	49.68%	1.35%	-6.26%	-0.10%
过去三年	43.31%	1.27%	48.15%	1.41%	-4.84%	-0.14%
过去五年	31.35%	1.22%	31.61%	1.30%	-0.26%	-0.08%
过去七年	94.88%	1.25%	78.59%	1.29%	16.29%	-0.04%
自基金合同生效起至今	58.57%	1.30%	45.74%	1.34%	12.83%	-0.04%

建信中证 500 指数增强 E

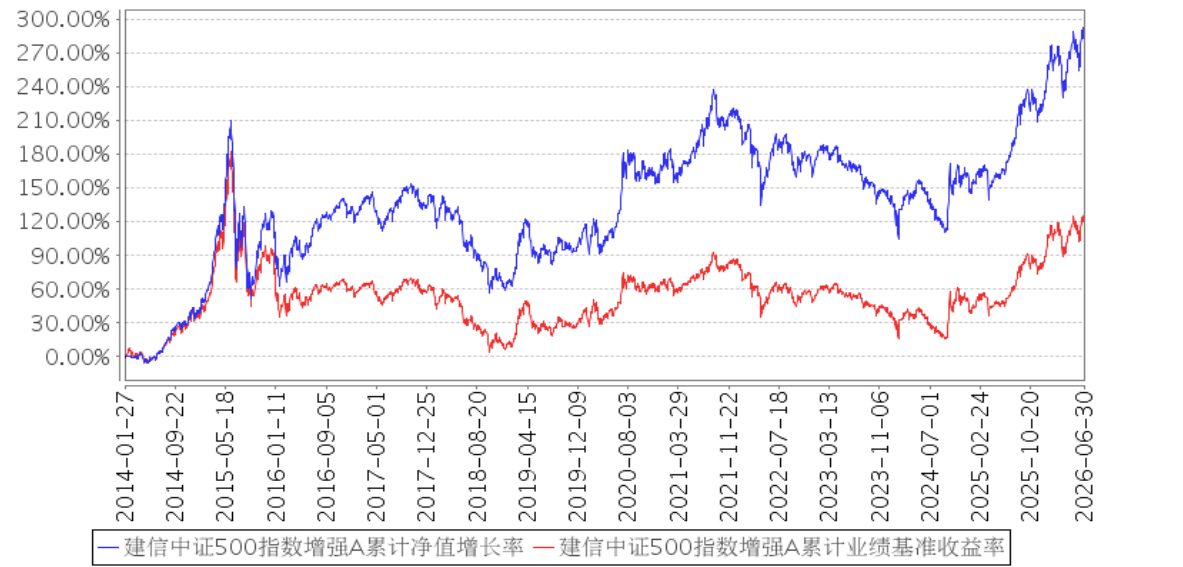
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	15.58%	1.44%	17.61%	1.56%	-2.03%	-0.12%
过去六个月	17.13%	1.45%	19.93%	1.58%	-2.80%	-0.13%
过去一年	43.46%	1.25%	49.68%	1.35%	-6.22%	-0.10%
自基金合同生效起至今	66.03%	1.36%	80.14%	1.50%	-14.11%	-0.14%

建信中证 500 指数增强 Y

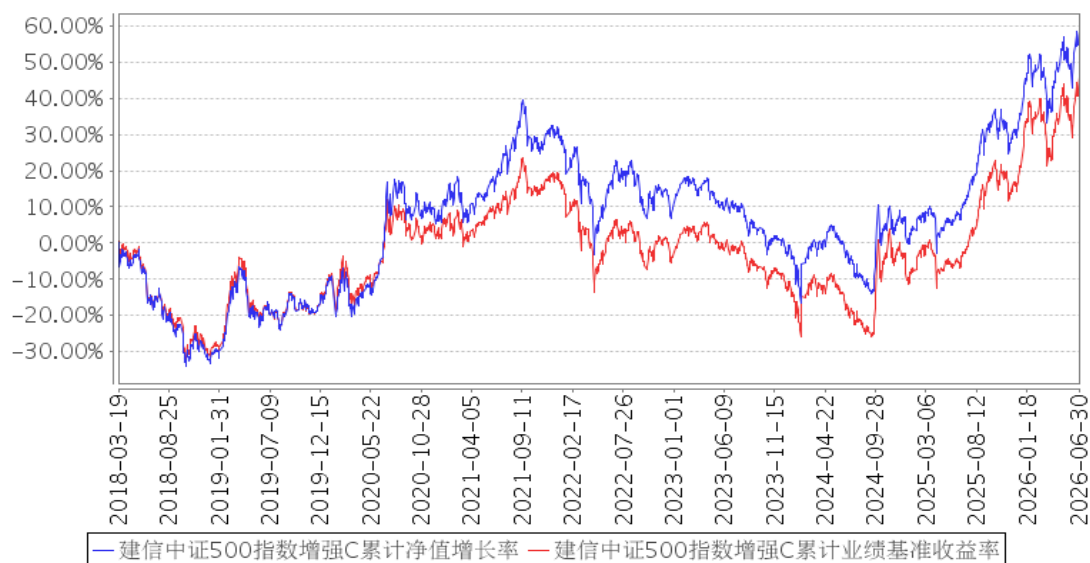
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	15.90%	1.44%	17.61%	1.56%	-1.71%	-0.12%
过去六个月	17.77%	1.45%	19.93%	1.58%	-2.16%	-0.13%
过去一年	45.05%	1.25%	49.68%	1.35%	-4.63%	-0.10%
自基金合同生效起至今	50.41%	1.23%	48.05%	1.33%	2.36%	-0.10%

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

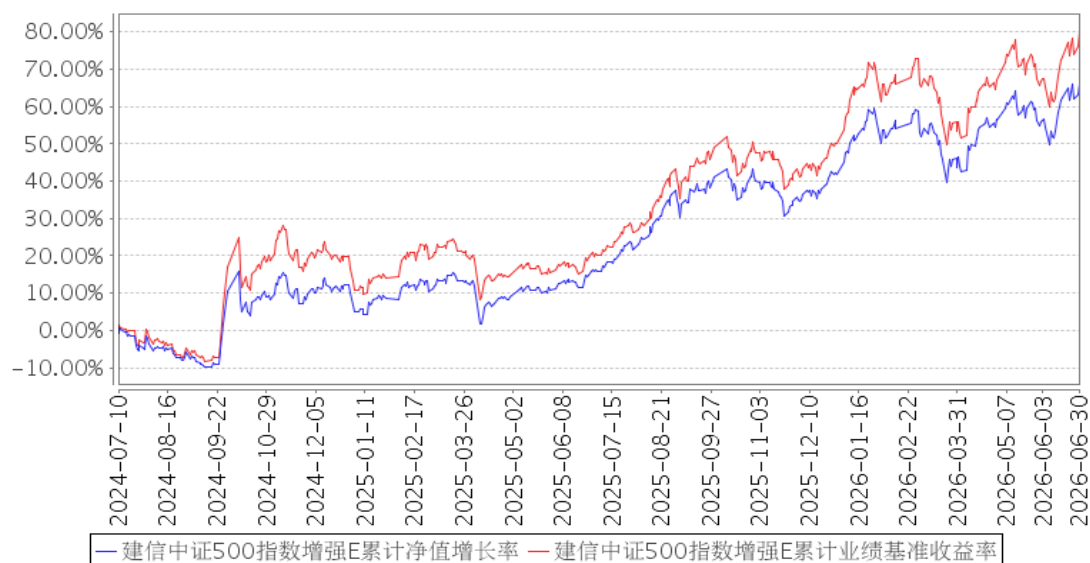
建信中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



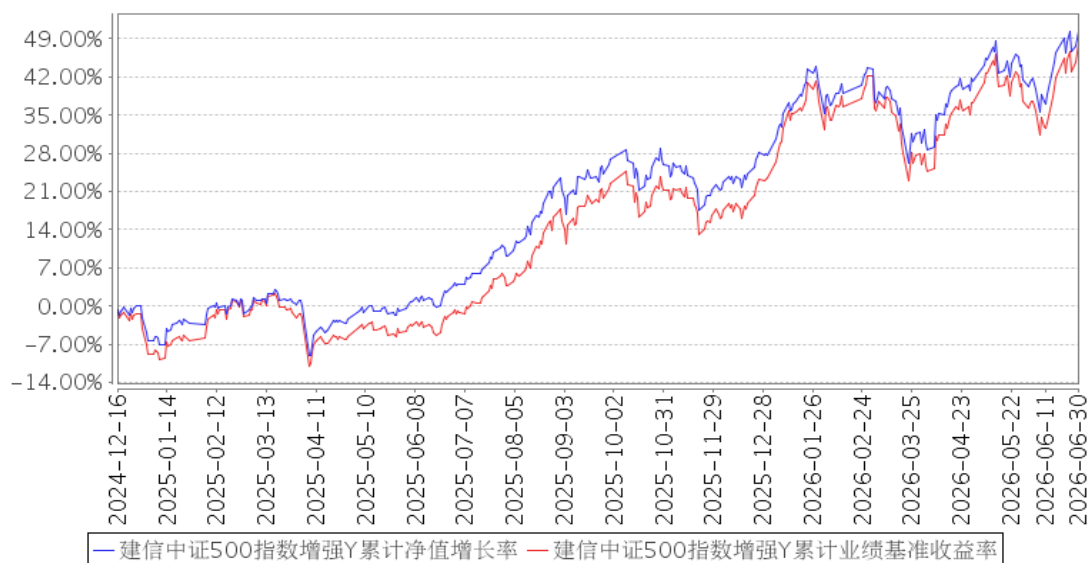
建信中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信中证500指数增强E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



建信中证500指数增强Y累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，由中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团产融控股有限公司合资设立，注册资本2亿元。

公司拥有公开募集证券投资基金、私募资产管理计划、QDII、保险资金受托等业务资格，总部设在北京，下设北京、上海、广州、成都、深圳、南京、武汉七家分公司，并分别在上海和香港设立了子公司——建信资本管理有限责任公司、建信资产管理（香港）有限公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家，资产管理行业的领跑者”。

公司以持续优秀的管理能力、完善周到的服务，为超过1.15万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至2026年6月30日，公司管理运作193只公开募集证券投资基金以及多个私募资产管理计划，资产管理规模1.24余万亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶乐天	数量投资部副总经理（主持工作），本基金的基金经理	2014 年 1 月 27 日	-	18	叶乐天先生，数量投资部副总经理（主持工作），博士。曾任中国国际金融有限公司市场风险管理分析员、量化分析经理。2011 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理。2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 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；2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 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；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理，该基金于 2021 年 1 月 1 日起转型为建信央视财经 50 指数证券投资基金（LOF），叶乐天继续担任该基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 9 日至 2025 年 11 月 14 日任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 4 月 18 日至 2023 年 11 月 17 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；2017 年 5 月 22 日至 2024 年 2 月 5 日任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 1 月 10 日至 2022 年 8 月 9 日任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 8 月 24 日至 2022 年 11 月 17 日任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日起任建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日起任建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 15 日起任建信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 12 月 23 日起任建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 3 月 25 日起任建信中证 A 股指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；

					2025 年 6 月 3 日起任建信中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理；2026 年 6 月 9 日起任建信丰汇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《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年 A 股呈现结构性分化行情，中证 500 指数年内上涨 20.97%，大幅跑赢沪深 300、

上证 50 等大盘宽基指数。指数成分聚焦中盘制造、电子信息、新材料等新质生产力赛道，受益 AI 产业链景气扩张与国产替代需求释放，一季度成分股归母净利润同比增长 18.8%，盈利修复领先市场。上半年指数冲高后，7 月伴随科技赛道拥挤交易降温出现回调，估值泡沫有序出清，配置性价比回归合理区间。

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 17.41%，波动率 1.45%，业绩比较基准收益率 19.93%，波动率 1.58%。本报告期本基金 C 净值增长率 17.13%，波动率 1.45%，业绩比较基准收益率 19.93%，波动率 1.58%。本报告期本基金 E 净值增长率 17.13%，波动率 1.45%，业绩比较基准收益率 19.93%，波动率 1.58%。本报告期本基金 Y 净值增长率 17.77%，波动率 1.45%，业绩比较基准收益率 19.93%，波动率 1.58%。

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，政策持续扶持专精特新与高端制造，上市公司中报业绩将成为行情核心锚点。指数行业结构契合产业转型方向，盈利兑现确定性较强，市场波动或有所放大，但中长期配置价值稳固。本基金将严格恪守指数跟踪规则，并通过多因子量化模型，争取为投资者实现稳健的超额收益。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对建信中证 500 指数增强型证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在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建信中证 500 指数增强型证券投资基金的投资运作、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报告期内的财务指标、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，未发现有关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：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	161,776,559.09	231,749,240.86
结算备付金		265,328,160.10	424,068,647.32
存出保证金		38,364,241.55	46,137,055.80
交易性金融资产	6.4.7.2	2,466,822,715.26	3,243,074,599.58
其中：股票投资		2,466,822,715.26	3,243,074,599.58
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		56,475,991.83	4,573,085.19
应收股利		-	-
应收申购款		1,609,076.03	1,446,224.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,990,376,743.86	3,951,048,853.07
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		20,474,361.57	15,022,253.20
应付管理人报酬		2,431,834.10	3,279,774.35
应付托管费		486,366.87	655,954.87
应付销售服务费		40,442.32	37,884.78
应付投资顾问费		-	-
应交税费		499,510.33	200,852.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	3,577,876.30	4,896,145.35
负债合计		27,510,391.49	24,092,864.74
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	756,502,592.15	1,175,669,448.35
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,206,363,760.22	2,751,286,539.98
净资产合计		2,962,866,352.37	3,926,955,988.33
负债和净资产总计		2,990,376,743.86	3,951,048,853.07

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 756,502,592.15 份，其中建信中证 500 指数增强 A 基金份额总额 707,504,778.91 份，基金份额净值人民币 3.9254 元；建信中证 500 指数增强 C 基金份额总额 42,057,103.44 份，基金份额净值人民币 3.7631 元；建信中证 500 指数增强 E 基金份额总额 667,785.37 份，基金份额净值人民币 3.7691 元；建信中证 500 指数增强 Y 基金份额总额 6,272,924.43 份，基金份额净值人民币 3.9626 元。

6.2 利润表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		595,994,877.79	272,883,128.06
1. 利息收入		2,462,165.88	3,096,358.99
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,462,165.88	3,096,358.99
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		668,601,885.88	150,511,288.62
其中：股票投资收益	6.4.7.14	578,910,567.74	99,559,345.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	71,632,553.83	7,115,216.14
股利收益	6.4.7.19	18,058,764.31	43,836,726.80
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	-75, 617, 781. 88	119, 124, 862. 42
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	548, 607. 91	150, 618. 03
减：二、营业总支出		21, 573, 498. 44	28, 723, 832. 39
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	17, 502, 050. 95	22, 460, 579. 93
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	3, 500, 410. 40	4, 492, 116. 04
3. 销售服务费		216, 826. 23	1, 439, 179. 49
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		258, 175. 28	58, 983. 52
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	96, 035. 58	272, 973. 41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		574, 421, 379. 35	244, 159, 295. 67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		574, 421, 379. 35	244, 159, 295. 67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		574, 421, 379. 35	244, 159, 295. 67

6.3 净资产变动表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1, 175, 669, 448. 35	-	2, 751, 286, 539. 98	3, 926, 955, 988. 33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	1, 175, 669, 448.	-	2, 751, 286, 539.	3, 926, 955, 988. 3

资产	35		98	3
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-419,166,856.20	-	-544,922,779.76	-964,089,635.96
(一)、综合收益总额	-	-	574,421,379.35	574,421,379.35
(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)	-419,166,856.20	-	-1,119,344,159.11	-1,538,511,015.31
其中：1. 基金申购款	105,905,089.97	-	279,893,460.28	385,798,550.25
2. 基金赎回款	-525,071,946.17	-	-1,399,237,619.39	-1,924,309,565.56
(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	756,502,592.15	-	2,206,363,760.22	2,962,866,352.37
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,867,902,194.77	-	2,921,124,529.66	4,789,026,724.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,867,902,194.77	-	2,921,124,529.66	4,789,026,724.43
三、本期增减变	-222,812,258.6	-	-104,122,889.6	-326,935,148.31

动额(减少以“-”号填列)	4		7	
(一)、综合收益总额	-	-	244,159,295.67	244,159,295.67
(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)	-222,812,258.64	-	-348,282,185.34	-571,094,443.98
其中：1. 基金申购款	69,140,323.73	-	108,449,784.69	177,590,108.42
2. 基金赎回款	-291,952,582.37	-	-456,731,970.03	-748,684,552.40
(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	1,645,089,936.13	-	2,817,001,639.99	4,462,091,576.12

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

建信中证 500 指数增强型证券投资基金（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[2013]615 号《关于核准建信中证 500 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数增强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 308,106,805.84 元，业经普华永

道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2014）第 039 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2014 年 1 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 308,165,342.91 份基金份额，其中认购资金利息折合 58,537.07 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《建信中证 500 指数增强型证券投资基金新增 C 类基金份额及修改基金合同的公告》并报证监会备案，本基金于 2018 年 3 月 16 日起根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同，将本基金基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取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；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。2018 年 3 月 16 日前原有的基金份额在开放申购赎回后，全部转换为建信中证 500 指数增强 A 类基金份额。

根据《建信中证 500 指数增强型证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，自 2024 年 7 月 9 日起本基金新增 E 类基金份额，从本类别基金资产中计提销售服务费，且在投资人认购/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。根据更新的《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《建信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金份额包括建信中证 500 指数增强基金之 A 类份额、建信中证 500 指数增强基金之 C 类份额和建信中证 500 指数增强基金之 E 类份额。本基金各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

根据《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》与《关于建信中证 500 指数增强型证券投资基金增加个人养老金基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》并报证监会备案，本基金于 2024 年 12 月 13 日起增加个人养老金基金份额（以下简称“Y 类基金份额”）。本基金 Y 类基金份额对基金管理费和基金托管费实施一定费率优惠。由于基金费用的不同，本基金 A 类、C 类、E 类、Y 类基金份额分别设置代码，并将分别计算基金份额净值。投资人可自行选择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《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、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)。本基金的投资组合比例为:本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为不低于 90%,其中投资于中证 500 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%;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。本基金投资股指期货以套期保值为目的,股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为 $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率(税前)}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

6.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

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

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

6.4.6.3 企业所得税

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	161,776,559.09
等于：本金	161,724,011.20
加：应计利息	52,547.89
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	161, 776, 559. 09

6. 4. 7. 2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2, 325, 173, 583. 41	-	2, 466, 822, 715. 26	141, 649, 131. 85
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2, 325, 173, 583. 41	-	2, 466, 822, 715. 26	141, 649, 131. 85

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 2026 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	307, 837, 560. 00	-	-	-
其中：股指期货投资	307, 837, 560. 00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	307,837,560.00	-	-	-
----	----------------	---	---	---

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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
IC2607	IC2607	147.00	262,489,080.00	6,560,760.00
IM2607	IM2607	30.00	52,137,600.00	228,360.00
合计				6,789,120.00
减：可抵销期货暂收款				6,789,120.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,887.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,485,113.63
其中：交易所市场	3,485,113.63
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,875.64
合计	3,577,876.30

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 500 指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,144,311,813.05	1,144,311,813.05
本期申购	73,583,959.89	73,583,959.89
本期赎回（以“-”号填列）	-510,390,994.03	-510,390,994.03
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	707,504,778.91	707,504,778.91

建信中证 500 指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,808,107.88	26,808,107.88
本期申购	28,131,139.12	28,131,139.12

本期赎回（以“-”号填列）	-12,882,143.56	-12,882,143.56
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	42,057,103.44	42,057,103.44

建信中证 500 指数增强 E

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	655,021.19	655,021.19
本期申购	40,659.82	40,659.82
本期赎回（以“-”号填列）	-27,895.64	-27,895.64
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	667,785.37	667,785.37

建信中证 500 指数增强 Y

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,894,506.23	3,894,506.23
本期申购	4,149,331.14	4,149,331.14
本期赎回（以“-”号填列）	-1,770,912.94	-1,770,912.94
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	6,272,924.43	6,272,924.43

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

建信中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,753,612,331.95	-72,308,318.64	2,681,304,013.31
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	2,753,612,331.95	-72,308,318.64	2,681,304,013.31
本期利润	629,362,038.59	-72,542,440.04	556,819,598.55
本期基金份额交易产生的变动数	-1,193,254,899.96	24,853,968.41	-1,168,400,931.55
其中：基金申购款	199,731,187.15	-5,938,705.16	193,792,481.99
基金赎回款	-1,392,986,087.11	30,792,673.57	-1,362,193,413.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,189,719,470.58	-119,996,790.27	2,069,722,680.31

建信中证 500 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	61,000,857.89	-1,680,363.46	59,320,494.43
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	61,000,857.89	-1,680,363.46	59,320,494.43
本期利润	16,253,511.73	-2,293,571.34	13,959,940.39
本期基金份额交易产生的变动数	45,883,588.63	-2,955,963.45	42,927,625.18
其中：基金申购款	78,674,813.00	-3,580,648.20	75,094,164.80
基金赎回款	-32,791,224.37	624,684.75	-32,166,539.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	123,137,958.25	-6,929,898.25	116,208,060.00

建信中证 500 指数增强 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,493,534.81	-40,736.82	1,452,797.99
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,493,534.81	-40,736.82	1,452,797.99
本期利润	432,548.62	-72,774.52	359,774.10
本期基金份额交易产生的变动数	32,899.24	3,693.53	36,592.77
其中：基金申购款	105,352.53	-3,871.55	101,480.98
基金赎回款	-72,453.29	7,565.08	-64,888.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,958,982.67	-109,817.81	1,849,164.86

建信中证 500 指数增强 Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,454,652.39	-245,418.14	9,209,234.25
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	9,454,652.39	-245,418.14	9,209,234.25

本期利润	3,991,062.29	-708,995.98	3,282,066.31
本期基金份额交易产生的变动数	6,206,668.67	-114,114.18	6,092,554.49
其中：基金申购款	11,123,521.52	-218,189.01	10,905,332.51
基金赎回款	-4,916,852.85	104,074.83	-4,812,778.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,652,383.35	-1,068,528.30	18,583,855.05

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	951,066.83
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	1,509,815.25
其他	1,283.80
合计	2,462,165.88

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	578,910,567.74
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	578,910,567.74

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	6,133,108,496.68
减：卖出股票成本总额	5,548,337,411.21
减：交易费用	5,860,517.73
买卖股票差价收入	578,910,567.74

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	71,632,553.83

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	18,058,764.31
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	18,058,764.31

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-69,577,101.88
股票投资	-69,577,101.88
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	-6,040,680.00
权证投资	—
期货投资	-6,040,680.00
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	-75,617,781.88

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	540,730.66
基金转换费收入	7,877.25
合计	548,607.91

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	15,868.27
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	11,659.94
银行间账户维护费	9,000.00
合计	96,035.58

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	17,502,050.95	22,460,579.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,571,678.90	8,729,800.89
应支付基金管理人的净管理费	9,930,372.05	13,730,779.04

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额、C 类基金份额、E 类基金份额约定的基金管理费年费率为 1.00%，Y 类基金份额约定的基金管理费年费率为 0.50%。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×约定年费率/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,500,410.40	4,492,116.04

注：支付基金托管人的托管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。A 类基金份额、C 类基金份额、E 类基金份额约定的基金托管费年费率为 0.20%，Y 类基金份额约定的基金托管费年费率为 0.10%。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×约定年费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C	建信中证 500 指数增强 E	建信中证 500 指数增强 Y	合计

建信基金	-	536.95	0.39	-	537.34
中信银行	-	2,785.53	-	-	2,785.53
合计	-	3,322.48	0.39	-	3,322.87
获得销售服务费 的各关联方名称	上年度可比期间				
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	建信中证 500 指数增强 A	建信中证 500 指数增强 C	建信中证 500 指数增强 E	建信中证 500 指数增强 Y	合计
建信基金	-	338,562.79	255.04	-	338,817.83
合计	-	338,562.79	255.04	-	338,817.83

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 类基金份额和 Y 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额和 E 类基金份额的销售服务费年费率均为 0.50%。销售服务费的计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

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	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行-活期	161, 776, 559. 09	951, 066. 83	237, 336, 806. 71	1, 093, 522. 65

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

6. 4. 10. 7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6. 4. 10. 8 其他关联交易事项的说明

无。

6. 4. 11 利润分配情况

无。

6. 4. 12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6. 4. 12. 1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6. 4. 12. 1. 1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新发未上市	53. 26	58. 74	285	15, 179. 10	16, 740. 90	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新发未上市	10. 12	27. 73	6, 488	65, 658. 56	179, 912. 24	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新发未上市	26. 66	50. 96	138	3, 679. 08	7, 032. 48	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新发未上市	13. 91	32. 47	433	6, 023. 03	14, 059. 51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新发未上市	46. 08	463. 33	1, 220	56, 217. 60	565, 262. 60	-
301696	三瑞智	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新发未上市	24. 68	86. 80	216	5, 330. 88	18, 748. 80	-

	能									
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新发未上市	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新发未上市	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新发未上市	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新发未上市	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新发未上市	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603722	阿科力	2026 年 6 月 29 日	重大事项	39.60	2026 年 7 月 6 日	43.56	125,500	4,685,807.61	4,969,800.00	-
688121	*ST 卓然	2026 年 5 月 6 日	重大事项	6.48	2026 年 7 月 7 日	5.18	9,221	154,292.93	59,752.08	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	161,776,559.09	-	-	-	161,776,559.09
结算备付金	265,328,160.10	-	-	-	265,328,160.10
存出保证金	38,364,241.55	-	-	-	38,364,241.55
交易性金融资产	-	-	-	2,466,822,715.26	2,466,822,715.26
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	56,475,991.83	56,475,991.83
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,609,076.03	1,609,076.03
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	465,468,960.74	-	-	2,524,907,783.12	2,990,376,743.86
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	-	-	-	20,474,361.57	20,474,361.57
应付管理人报酬	-	-	-	2,431,834.10	2,431,834.10
应付托管费	-	-	-	486,366.87	486,366.87
应付销售服务费	-	-	-	40,442.32	40,442.32
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	499,510.33	499,510.33
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,577,876.30	3,577,876.30
负债总计	-	-	-	27,510,391.49	27,510,391.49
利率敏感度缺口	465,468,960.74	-	-	-2,497,397,391.	2,962,866,352.37

				63	
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	231,749,240.86	-	-	-	231,749,240.86
结算备付金	424,068,647.32	-	-	-	424,068,647.32
存出保证金	46,137,055.80	-	-	-	46,137,055.80
交易性金融资产	-	-	-	3,243,074,599.58	3,243,074,599.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	4,573,085.19	4,573,085.19
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,446,224.32	1,446,224.32
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	701,954,943.98	-	-	3,249,093,909.09	3,951,048,853.07
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	-	-	-	15,022,253.20	15,022,253.20
应付管理人报酬	-	-	-	3,279,774.35	3,279,774.35
应付托管费	-	-	-	655,954.87	655,954.87
应付销售服务费	-	-	-	37,884.78	37,884.78
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	200,852.19	200,852.19
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,896,145.35	4,896,145.35
负债总计	-	-	-	24,092,864.74	24,092,864.74
利率敏感度缺口	701,954,943.98	-	-	3,225,001,044.35	3,926,955,988.33

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,466,822,715.26	83.26	3,243,074,599.58	82.58
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,466,822,715.26	83.26	3,243,074,599.58	82.58

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	133,884,550.28	178,811,487.31

	业绩比较基准下降 5%	-133, 884, 550. 28	-178, 811, 487. 31
--	----------------	--------------------	--------------------

6. 4. 13. 4. 4 采用风险价值法管理风险

无。

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	2, 460, 908, 426. 65	3, 241, 679, 766. 92
第二层次	5, 029, 552. 08	986, 798. 56
第三层次	884, 736. 53	408, 034. 10
合计	2, 466, 822, 715. 26	3, 243, 074, 599. 58

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	2,466,822,715.26	82.49
	其中：股票	2,466,822,715.26	82.49
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	427,104,719.19	14.28
8	其他各项资产	96,449,309.41	3.23
9	合计	2,990,376,743.86	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	5,614,036.00	0.19
B	采矿业	77,701,177.83	2.62
C	制造业	1,609,687,772.48	54.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,270,162.91	1.73
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	58,712,665.19	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	45,782,205.34	1.55
H	住宿和餐饮业	4,706,184.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	132,860,525.24	4.48
J	金融业	125,163,381.75	4.22
K	房地产业	24,497,758.32	0.83

L	租赁和商务服务业	11,047,516.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	8,102,338.14	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	21,499,392.00	0.73
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	13,117,289.00	0.44
S	综合	—	—
	合计	2,189,762,404.20	73.91

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	—	—
B	采矿业	10,885,580.52	0.37
C	制造业	222,713,885.48	7.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,636,700.00	0.09
E	建筑业	25,980.00	0.00
F	批发和零售业	2,977,622.99	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	2,705,623.00	0.09
H	住宿和餐饮业	94,848.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,617,335.01	0.46
J	金融业	15,977,823.00	0.54
K	房地产业	238,400.00	0.01
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	2,342,935.06	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	2,536,860.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	152,250.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	—	—

S	综合	154,468.00	0.01
	合计	277,060,311.06	9.35

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	300857	协创数据	127,880	43,466,412.00	1.47
2	002008	大族激光	269,909	40,516,039.99	1.37
3	300223	北京君正	142,700	35,518,030.00	1.20
4	002281	光迅科技	128,500	33,016,790.00	1.11
5	001389	广合科技	129,100	30,628,975.00	1.03
6	600105	永鼎股份	415,300	28,024,444.00	0.95
7	688361	中科飞测	64,276	27,638,680.00	0.93
8	688498	源杰科技	11,965	22,565,990.00	0.76
9	600601	方正科技	1,585,900	21,948,856.00	0.74
10	300395	菲利华	157,900	21,115,967.00	0.71
11	601108	财通证券	2,417,730	20,913,364.50	0.71
12	300373	扬杰科技	132,400	20,817,252.00	0.70
13	300475	香农芯创	68,799	20,639,700.00	0.70
14	002266	浙富控股	3,965,000	20,062,900.00	0.68
15	600663	陆家嘴	3,191,344	20,041,640.32	0.68
16	601000	唐山港	4,736,600	19,656,890.00	0.66
17	688213	思特威	182,948	19,588,242.36	0.66
18	000729	燕京啤酒	1,933,090	19,582,201.70	0.66
19	600563	法拉电子	101,800	19,423,440.00	0.66
20	300604	长川科技	55,600	18,982,952.00	0.64
21	688052	纳芯微	64,208	18,511,808.48	0.62
22	002851	麦格米特	109,300	18,272,774.00	0.62
23	688469	芯联集成	1,714,500	18,190,845.00	0.61
24	688002	睿创微纳	116,696	18,051,704.24	0.61
25	603979	金诚信	303,409	17,910,233.27	0.60
26	600497	驰宏锌锗	1,472,100	17,827,131.00	0.60
27	688220	翱捷科技	143,123	17,793,051.36	0.60
28	600909	华安证券	1,564,987	17,387,005.57	0.59
29	301200	大族数控	47,700	17,203,005.00	0.58
30	603345	安井食品	214,500	17,200,755.00	0.58
31	000423	东阿阿胶	375,900	17,050,824.00	0.58
32	002436	兴森科技	334,100	17,022,395.00	0.57
33	603659	璞泰来	580,280	16,787,500.40	0.57

34	688017	绿的谐波	39,034	16,310,747.24	0.55
35	000893	亚钾国际	389,600	15,930,744.00	0.54
36	300953	震裕科技	118,840	15,888,908.00	0.54
37	000034	神州数码	556,000	15,429,000.00	0.52
38	600901	江苏金租	2,633,028	15,139,911.00	0.51
39	600873	梅花生物	2,050,100	15,068,235.00	0.51
40	002273	水晶光电	418,900	14,862,572.00	0.50
41	603444	吉比特	41,400	14,838,588.00	0.50
42	000960	锡业股份	338,800	14,463,372.00	0.49
43	001309	德明利	15,300	14,426,370.00	0.49
44	000598	兴蓉环境	2,240,500	14,384,010.00	0.49
45	000703	恒逸石化	1,055,703	14,325,889.71	0.48
46	002568	百润股份	845,160	14,300,107.20	0.48
47	600801	华新建材	877,740	13,692,744.00	0.46
48	000683	博源化工	2,347,700	13,522,752.00	0.46
49	300054	鼎龙股份	126,800	13,436,996.00	0.45
50	002850	科达利	69,700	13,194,210.00	0.45
51	002299	圣农发展	869,333	13,179,088.28	0.44
52	300037	新宙邦	140,000	12,999,000.00	0.44
53	601699	潞安环能	902,880	12,893,126.40	0.44
54	301536	星辰科技	98,000	12,613,580.00	0.43
55	002138	顺络电子	169,203	12,368,739.30	0.42
56	003022	联泓新科	473,100	12,253,290.00	0.41
57	002487	大金重工	208,180	12,068,194.60	0.41
58	600256	广汇能源	2,410,900	11,909,846.00	0.40
59	601567	三星电气	797,069	11,908,210.86	0.40
60	601019	山东出版	1,839,200	11,770,880.00	0.40
61	301358	湖南裕能	153,800	11,668,806.00	0.39
62	600885	宏发股份	337,438	11,638,236.62	0.39
63	688475	萤石网络	421,400	11,525,290.00	0.39
64	002517	恺英网络	690,100	11,214,125.00	0.38
65	688166	博瑞医药	318,300	11,143,683.00	0.38
66	300735	光弘科技	483,700	10,999,338.00	0.37
67	603920	世运电路	228,800	10,991,552.00	0.37
68	688578	艾力斯	99,298	10,843,341.60	0.37
69	300285	国瓷材料	103,600	10,689,448.00	0.36
70	002414	高德红外	799,090	10,595,933.40	0.36
71	002821	凯莱英	65,400	10,594,800.00	0.36
72	600177	雅戈尔	1,358,100	10,226,493.00	0.35
73	000783	长江证券	1,045,664	10,195,224.00	0.34
74	300390	天华新能	108,200	10,117,782.00	0.34
75	003031	中瓷电子	55,700	10,042,710.00	0.34
76	688301	奕瑞科技	80,880	10,029,120.00	0.34

77	300458	全志科技	253,636	10,008,476.56	0.34
78	600642	申能股份	1,120,700	9,783,711.00	0.33
79	002432	九安医疗	137,100	9,690,228.00	0.33
80	688347	华虹宏力	28,600	9,618,180.00	0.32
81	603175	超颖电子	107,600	9,586,084.00	0.32
82	601608	中信重工	1,977,150	9,431,005.50	0.32
83	600498	烽火通信	128,000	9,420,800.00	0.32
84	603256	宏和科技	35,300	9,366,149.00	0.32
85	601577	长沙银行	1,065,600	9,281,376.00	0.31
86	300620	光库科技	24,200	9,152,440.00	0.31
87	600704	物产中大	1,933,800	9,127,536.00	0.31
88	601156	东航物流	556,800	8,975,616.00	0.30
89	688582	芯动联科	137,782	8,955,830.00	0.30
90	600060	海信视像	318,858	8,886,572.46	0.30
91	002032	苏泊尔	220,600	8,735,760.00	0.29
92	000415	渤海租赁	2,127,600	8,659,332.00	0.29
93	300432	富临精工	430,000	8,638,700.00	0.29
94	600095	湘财股份	1,127,500	8,490,075.00	0.29
95	002756	永兴材料	149,880	8,489,203.20	0.29
96	000629	钒钛股份	2,529,900	8,449,866.00	0.29
97	600927	永安期货	669,200	8,331,540.00	0.28
98	600988	赤峰黄金	315,200	8,296,064.00	0.28
99	600369	西南证券	2,052,500	8,251,050.00	0.28
100	002738	中矿资源	139,500	8,229,105.00	0.28
101	300548	长芯博创	29,400	8,173,200.00	0.28
102	688099	晶晨股份	78,400	8,067,360.00	0.27
103	603338	浙江鼎力	184,735	7,851,237.50	0.26
104	300017	网宿科技	593,500	7,721,435.00	0.26
105	603699	纽威股份	152,520	7,671,756.00	0.26
106	688336	三生国健	143,483	7,618,947.30	0.26
107	300957	贝泰妮	241,300	7,603,363.00	0.26
108	600380	健康元	802,612	7,560,605.04	0.26
109	600499	科达制造	545,800	7,532,040.00	0.25
110	688188	柏楚电子	70,577	7,530,565.90	0.25
111	603605	珀莱雅	125,100	7,495,992.00	0.25
112	000937	冀中能源	1,882,142	7,490,925.16	0.25
113	000060	中金岭南	981,100	7,426,927.00	0.25
114	300567	精测电子	23,300	7,400,080.00	0.25
115	002508	老板电器	493,600	7,216,432.00	0.24
116	688385	复旦微电	100,986	7,199,291.94	0.24
117	603658	安图生物	247,160	7,172,583.20	0.24
118	000039	中集集团	883,700	7,166,807.00	0.24
119	688281	华秦科技	140,000	7,032,200.00	0.24

120	000733	振华科技	123,700	7,006,368.00	0.24
121	300757	罗博特科	11,300	6,994,700.00	0.24
122	002120	韵达股份	1,074,600	6,834,456.00	0.23
123	688778	厦钨新能	124,474	6,771,385.60	0.23
124	300558	贝达药业	102,100	6,643,647.00	0.22
125	601233	桐昆股份	304,600	6,594,590.00	0.22
126	300346	南大光电	68,500	6,346,525.00	0.21
127	601799	星宇股份	66,900	6,062,478.00	0.20
128	000883	湖北能源	1,395,300	6,027,696.00	0.20
129	601665	齐鲁银行	1,036,200	5,978,874.00	0.20
130	301377	鼎泰高科	10,700	5,894,630.00	0.20
131	002429	兆驰股份	565,200	5,872,428.00	0.20
132	688349	三一重能	384,670	5,839,290.60	0.20
133	600131	国网信通	395,200	5,769,920.00	0.19
134	002152	广电运通	614,100	5,760,258.00	0.19
135	600816	建元信托	2,339,800	5,709,112.00	0.19
136	688692	达梦数据	23,248	5,679,253.92	0.19
137	600598	北大荒	517,900	5,614,036.00	0.19
138	600535	天士力	422,600	5,590,998.00	0.19
139	600166	福田汽车	1,902,100	5,535,111.00	0.19
140	601869	长飞光纤	9,900	5,404,410.00	0.18
141	688819	天能股份	243,273	5,400,660.60	0.18
142	002410	广联达	639,500	5,218,320.00	0.18
143	601298	青岛港	647,900	5,215,595.00	0.18
144	002409	雅克科技	23,200	5,208,400.00	0.18
145	603486	科沃斯	101,800	5,166,350.00	0.17
146	300570	太辰光	20,800	5,131,568.00	0.17
147	002025	航天电器	66,000	5,030,520.00	0.17
148	601106	中国一重	1,521,900	5,022,270.00	0.17
149	688615	合合信息	44,380	5,019,378.00	0.17
150	688629	华丰科技	26,113	4,896,448.63	0.17
151	688676	金盘科技	57,400	4,858,336.00	0.16
152	002064	华峰化学	511,300	4,852,237.00	0.16
153	688617	惠泰医疗	26,633	4,835,487.48	0.16
154	300136	信维通信	40,500	4,829,625.00	0.16
155	600435	北方导航	430,200	4,818,240.00	0.16
156	300001	特锐德	127,300	4,815,759.00	0.16
157	600754	锦江酒店	261,600	4,706,184.00	0.16
158	300454	深信服	48,600	4,675,320.00	0.16
159	603737	三棵树	193,560	4,664,796.00	0.16
160	601216	君正集团	1,016,400	4,533,144.00	0.15
161	000887	中鼎股份	251,656	4,502,125.84	0.15
162	000951	中国重汽	230,300	4,493,153.00	0.15

163	600098	广州发展	756,601	4,471,511.91	0.15
164	600208	衢州发展	1,574,600	4,456,118.00	0.15
165	000050	深天马 A	443,500	4,395,085.00	0.15
166	600352	浙江龙盛	351,444	4,255,986.84	0.14
167	600316	洪都航空	151,500	4,232,910.00	0.14
168	688563	航材股份	82,300	4,216,229.00	0.14
169	300474	景嘉微	68,400	4,136,832.00	0.14
170	601991	大唐发电	574,000	4,063,920.00	0.14
171	601958	金钼股份	142,800	4,014,108.00	0.14
172	300012	华测检测	283,550	3,930,003.00	0.13
173	603650	彤程新材	39,700	3,889,806.00	0.13
174	300207	欣旺达	203,300	3,860,667.00	0.13
175	600595	中孚实业	677,000	3,804,740.00	0.13
176	688266	泽璟制药	32,400	3,779,784.00	0.13
177	002340	格林美	565,900	3,740,599.00	0.13
178	300623	捷捷微电	81,800	3,680,182.00	0.12
179	000539	粤电力 A	516,700	3,518,727.00	0.12
180	688777	中控技术	29,941	3,518,067.50	0.12
181	300073	当升科技	72,600	3,487,704.00	0.12
182	001696	宗申动力	167,400	3,483,594.00	0.12
183	002624	完美世界	279,500	3,471,390.00	0.12
184	688169	石头科技	36,300	3,447,411.00	0.12
185	002262	恩华药业	182,200	3,416,250.00	0.12
186	002841	视源股份	98,120	3,388,083.60	0.11
187	605358	立昂微	43,400	3,367,840.00	0.11
188	601666	平煤股份	466,700	3,336,905.00	0.11
189	000062	深圳华强	101,600	3,232,912.00	0.11
190	603766	隆鑫通用	265,200	3,163,836.00	0.11
191	002271	东方雨虹	260,200	3,088,574.00	0.10
192	600685	中船防务	118,520	3,015,148.80	0.10
193	600578	京能电力	465,300	3,001,185.00	0.10
194	603156	养元饮品	61,100	2,998,177.00	0.10
195	002444	巨星科技	94,020	2,924,022.00	0.10
196	600141	兴发集团	61,700	2,898,049.00	0.10
197	300627	华测导航	102,000	2,896,800.00	0.10
198	688772	珠海冠宇	146,500	2,875,795.00	0.10
199	002984	森麒麟	218,400	2,854,488.00	0.10
200	688322	奥比中光	21,800	2,845,990.00	0.10
201	300972	万辰集团	16,400	2,843,924.00	0.10
202	300142	沃森生物	211,500	2,747,385.00	0.09
203	002402	和而泰	105,300	2,719,899.00	0.09
204	600004	白云机场	372,600	2,705,076.00	0.09
205	300919	中伟新材	61,800	2,703,750.00	0.09

206	603129	春风动力	10,400	2,660,320.00	0.09
207	002185	华天科技	118,900	2,652,659.00	0.09
208	688728	格科微	125,600	2,642,624.00	0.09
209	000987	越秀资本	337,806	2,641,642.92	0.09
210	002423	中粮资本	319,500	2,629,485.00	0.09
211	600884	杉杉股份	193,100	2,616,505.00	0.09
212	600511	国药股份	94,700	2,465,988.00	0.08
213	600171	上海贝岭	77,200	2,465,768.00	0.08
214	688387	信科移动	122,786	2,436,074.24	0.08
215	000021	深科技	37,700	2,422,979.00	0.08
216	603885	吉祥航空	232,600	2,393,454.00	0.08
217	600390	五矿资本	523,600	2,387,616.00	0.08
218	300748	金力永磁	77,000	2,375,450.00	0.08
219	600038	中直股份	93,600	2,367,144.00	0.08
220	300676	华大基因	67,300	2,359,538.00	0.08
221	002130	沃尔核材	124,100	2,352,936.00	0.08
222	300699	光威复材	81,400	2,332,110.00	0.08
223	688411	海博思创	7,960	2,317,952.00	0.08
224	300058	蓝色光标	168,400	2,317,184.00	0.08
225	603290	斯达半导	14,940	2,284,923.60	0.08
226	002465	海格通信	178,000	2,273,060.00	0.08
227	300763	锦浪科技	25,000	2,258,750.00	0.08
228	600312	平高电气	127,000	2,242,820.00	0.08
229	002126	银轮股份	44,800	2,231,040.00	0.08
230	603298	杭叉集团	89,923	2,145,562.78	0.07
231	603077	和邦生物	913,100	2,118,392.00	0.07
232	603308	应流股份	35,000	2,114,000.00	0.07
233	000997	新大陆	129,602	2,112,512.60	0.07
234	002155	湖南黄金	88,400	2,110,108.00	0.07
235	600282	南钢股份	456,500	2,095,335.00	0.07
236	600295	鄂尔多斯	191,500	2,052,880.00	0.07
237	600998	九州通	435,714	2,043,498.66	0.07
238	600546	山煤国际	186,100	2,034,073.00	0.07
239	002261	拓维信息	71,700	2,008,317.00	0.07
240	603786	科博达	48,600	1,988,226.00	0.07
241	000528	柳工	260,100	1,963,755.00	0.07
242	001286	陕西能源	193,400	1,961,076.00	0.07
243	600109	国金证券	222,400	1,952,672.00	0.07
244	603606	东方电缆	45,500	1,888,705.00	0.06
245	688120	华海清科	5,800	1,868,644.00	0.06
246	300339	润和软件	47,800	1,840,778.00	0.06
247	603233	大参林	121,451	1,825,408.53	0.06
248	600711	盛屯矿业	165,600	1,816,632.00	0.06

249	600562	国睿科技	84,800	1,799,456.00	0.06
250	688599	天合光能	126,500	1,786,180.00	0.06
251	601555	东吴证券	223,153	1,767,371.76	0.06
252	688187	时代电气	25,700	1,764,562.00	0.06
253	002603	以岭药业	117,200	1,758,000.00	0.06
254	601717	中创智领	125,575	1,746,748.25	0.06
255	002065	东华软件	244,500	1,745,730.00	0.06
256	300496	中科创达	28,200	1,742,478.00	0.06
257	603225	新凤鸣	87,900	1,727,235.00	0.06
258	603816	顾家家居	76,700	1,715,012.00	0.06
259	603160	汇顶科技	27,700	1,709,367.00	0.06
260	300759	康龙化成	58,900	1,703,977.00	0.06
261	600132	重庆啤酒	40,600	1,676,780.00	0.06
262	603858	步长制药	110,071	1,607,036.60	0.05
263	000009	中国宝安	256,700	1,599,241.00	0.05
264	600348	华阳股份	207,500	1,587,375.00	0.05
265	000825	太钢不锈	460,200	1,569,282.00	0.05
266	000027	深圳能源	251,900	1,561,780.00	0.05
267	000513	丽珠集团	53,760	1,553,126.40	0.05
268	002078	太阳纸业	124,000	1,548,760.00	0.05
269	600699	均胜电子	69,200	1,495,412.00	0.05
270	000400	许继电气	68,600	1,488,620.00	0.05
271	000723	美锦能源	429,700	1,439,495.00	0.05
272	600583	海油工程	285,800	1,437,574.00	0.05
273	603568	伟明环保	93,400	1,436,492.00	0.05
274	600985	淮北矿业	101,900	1,431,695.00	0.05
275	603379	三美股份	18,700	1,419,143.00	0.05
276	688561	奇安信	59,000	1,414,820.00	0.05
277	002773	康弘药业	69,048	1,412,031.60	0.05
278	301526	国际复材	30,100	1,404,767.00	0.05
279	600298	安琪酵母	37,200	1,346,640.00	0.05
280	300679	电连技术	21,600	1,295,784.00	0.04
281	000983	山西焦煤	218,200	1,265,560.00	0.04
282	002812	恩捷股份	18,900	1,264,599.00	0.04
283	000932	华菱钢铁	356,900	1,238,443.00	0.04
284	600363	联创光电	34,600	1,237,988.00	0.04
285	601997	贵阳银行	237,100	1,216,323.00	0.04
286	600392	盛和资源	40,500	1,205,685.00	0.04
287	000739	普洛药业	71,200	1,186,192.00	0.04
288	600906	财达证券	154,100	1,149,586.00	0.04
289	601139	深圳燃气	202,000	1,143,320.00	0.04
290	600483	福能股份	109,000	1,110,710.00	0.04
291	603728	鸣志电器	18,000	1,096,560.00	0.04

292	603939	益丰药房	56,000	1,006,880.00	0.03
293	601928	凤凰传媒	85,900	755,061.00	0.03
294	603806	福斯特	44,200	742,118.00	0.03
295	600299	安迪苏	92,200	723,770.00	0.02
296	688318	财富趋势	9,108	649,491.48	0.02
297	300751	迈为股份	2,200	621,412.00	0.02
298	688343	云天励飞	6,400	522,624.00	0.02
299	002739	儒意电影	40,200	385,920.00	0.01
300	600707	彩虹股份	14,300	241,527.00	0.01
301	600977	中国电影	15,900	205,428.00	0.01
302	000898	鞍钢股份	90,700	169,609.00	0.01
303	002683	广东宏大	5,700	166,953.00	0.01
304	600765	中航重机	12,900	166,668.00	0.01
305	600688	上海石化	50,700	148,551.00	0.01
306	002797	第一创业	21,600	141,912.00	0.00
307	000591	太阳能	28,300	130,180.00	0.00
308	600008	首创环保	41,300	112,336.00	0.00
309	688248	南网科技	1,573	108,820.14	0.00
310	600655	豫园股份	23,800	97,818.00	0.00
311	300003	乐普医疗	7,800	92,430.00	0.00
312	000785	居然智家	35,500	71,000.00	0.00
313	600332	白云山	3,400	68,136.00	0.00
314	603092	德力佳	146	7,879.62	0.00
315	001221	悍高集团	160	6,435.20	0.00
316	603565	中谷物流	114	1,118.34	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	688525	佰维存储	68,100	33,691,113.00	1.14
2	000657	中钨高新	185,031	17,711,167.32	0.60
3	603083	剑桥科技	57,100	14,553,077.00	0.49
4	600549	厦门钨业	170,600	14,535,120.00	0.49
5	688208	道通科技	523,693	13,191,826.67	0.45
6	002484	江海股份	123,700	12,988,500.00	0.44
7	301550	斯菱智驱	135,485	12,387,393.55	0.42
8	301308	江波龙	15,300	10,768,140.00	0.36
9	688059	华锐精密	53,659	10,716,238.89	0.36
10	601988	中国银行	1,706,900	9,763,468.00	0.33
11	002558	巨人网络	282,800	7,793,968.00	0.26
12	002384	东山精密	26,100	6,847,335.00	0.23
13	000426	兴业银锡	206,300	6,799,648.00	0.23
14	301086	鸿富瀚	27,400	5,734,272.00	0.19
15	300450	先导智能	122,900	5,004,488.00	0.17

16	603722	阿科力	125,500	4,969,800.00	0.17
17	000776	广发证券	197,100	4,612,140.00	0.16
18	002156	通富微电	48,497	3,679,467.39	0.12
19	688685	迈信林	50,190	2,755,431.00	0.09
20	000958	电投产融	467,500	2,636,700.00	0.09
21	002080	中材科技	28,800	2,592,000.00	0.09
22	601061	中信金属	228,900	2,465,253.00	0.08
23	688503	聚和材料	18,048	2,394,969.60	0.08
24	603516	淳中科技	17,700	2,382,597.00	0.08
25	300816	艾可蓝	31,500	2,305,800.00	0.08
26	301316	慧博云通	56,600	2,228,908.00	0.08
27	601168	西部矿业	80,318	2,179,830.52	0.07
28	688677	海泰新光	21,300	2,154,069.00	0.07
29	300438	鹏辉能源	24,100	1,996,685.00	0.07
30	300529	健帆生物	126,300	1,945,020.00	0.07
31	300408	三环集团	11,300	1,885,970.00	0.06
32	603986	兆易创新	2,300	1,874,500.00	0.06
33	002629	仁智股份	422,500	1,816,750.00	0.06
34	301217	铜冠铜箔	11,000	1,815,770.00	0.06
35	600183	生益科技	10,100	1,751,340.00	0.06
36	600487	亨通光电	15,500	1,694,770.00	0.06
37	603259	药明康德	13,400	1,668,434.00	0.06
38	601231	环旭电子	51,100	1,655,640.00	0.06
39	688368	晶丰明源	7,000	1,515,640.00	0.05
40	000933	神火股份	70,100	1,486,120.00	0.05
41	688257	新锐股份	14,560	1,483,664.00	0.05
42	002532	天山铝业	137,600	1,476,448.00	0.05
43	600026	中远海能	79,500	1,426,230.00	0.05
44	688177	百奥泰	83,800	1,409,516.00	0.05
45	300661	圣邦股份	9,800	1,406,104.00	0.05
46	688095	福昕软件	22,423	1,332,598.89	0.04
47	301626	苏州天脉	3,400	1,305,464.00	0.04
48	002346	柘中股份	59,900	1,281,261.00	0.04
49	301580	爱迪特	19,420	1,249,288.60	0.04
50	002353	杰瑞股份	7,900	1,204,750.00	0.04
51	601211	国泰海通	62,700	1,141,140.00	0.04
52	601872	招商轮船	58,700	1,031,359.00	0.03
53	688028	沃尔德	6,500	1,013,155.00	0.03
54	301391	卡莱特	15,600	890,760.00	0.03
55	605376	博迁新材	3,200	868,160.00	0.03
56	003043	华亚智能	8,500	844,815.00	0.03
57	300946	恒而达	18,400	724,776.00	0.02
58	002988	豪美新材	30,900	681,654.00	0.02

59	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.02
60	300905	宝丽迪	9,700	490,820.00	0.02
61	688182	灿勤科技	7,100	305,797.00	0.01
62	301360	荣旗科技	3,760	257,522.40	0.01
63	600895	张江高科	6,400	238,400.00	0.01
64	001399	惠科股份	7,918	234,509.64	0.01
65	301571	国科天成	3,499	228,064.82	0.01
66	603301	振德医疗	2,600	226,616.00	0.01
67	301566	达利凯普	5,755	213,395.40	0.01
68	300823	建科智能	14,420	210,243.60	0.01
69	605133	嵘泰股份	5,330	209,842.10	0.01
70	605507	国邦医药	13,720	203,056.00	0.01
71	301013	利和兴	2,800	202,300.00	0.01
72	688338	赛科希德	6,716	198,189.16	0.01
73	688310	迈得医疗	12,846	197,443.02	0.01
74	301016	雷尔伟	14,112	197,144.64	0.01
75	688329	艾隆科技	9,600	194,016.00	0.01
76	301395	仁信新材	14,640	192,516.00	0.01
77	002779	中坚科技	2,400	188,544.00	0.01
78	600386	北巴传媒	57,700	180,024.00	0.01
79	002625	光启技术	5,916	179,373.12	0.01
80	002706	良信股份	16,400	178,924.00	0.01
81	688276	百克生物	12,806	178,515.64	0.01
82	002976	瑞玛精密	7,020	176,904.00	0.01
83	002533	金杯电工	16,500	176,055.00	0.01
84	688088	虹软科技	4,900	174,195.00	0.01
85	300931	通用电梯	11,500	169,855.00	0.01
86	600156	华升股份	19,700	163,904.00	0.01
87	301222	浙江恒威	5,460	163,581.60	0.01
88	688205	德科立	780	162,388.20	0.01
89	601456	国联民生	17,800	157,352.00	0.01
90	603583	捷昌驱动	6,884	156,955.20	0.01
91	688622	*ST 禾信	1,200	155,760.00	0.01
92	688092	爱科科技	7,280	154,627.20	0.01
93	600673	东阳光	4,600	154,468.00	0.01
94	301239	普瑞眼科	5,000	152,250.00	0.01
95	002826	易明医药	10,100	151,803.00	0.01
96	688729	屹唐股份	3,505	150,715.00	0.01
97	688757	胜科纳米	2,257	150,541.90	0.01
98	301187	欧圣电气	10,360	148,251.60	0.01
99	688129	东来技术	5,633	147,528.27	0.00
100	600550	保变电气	12,300	144,279.00	0.00
101	688071	华依科技	3,900	142,116.00	0.00

102	603459	红板科技	1,300	136,669.30	0.00
103	001872	招商港口	6,900	134,067.00	0.00
104	603348	文灿股份	10,000	133,900.00	0.00
105	002736	国信证券	13,400	133,866.00	0.00
106	601137	博威合金	5,900	131,747.00	0.00
107	600055	万东医疗	12,800	130,816.00	0.00
108	002160	常铝股份	35,600	130,296.00	0.00
109	605599	菜百股份	9,500	130,150.00	0.00
110	688323	瑞华泰	2,300	129,950.00	0.00
111	301656	联合动力	7,395	127,415.85	0.00
112	300329	海伦钢琴	10,100	126,250.00	0.00
113	002549	凯美特气	5,900	124,195.00	0.00
114	002906	华阳集团	4,900	122,304.00	0.00
115	001369	双欣材料	8,966	121,220.32	0.00
116	002331	皖通科技	16,100	118,979.00	0.00
117	688311	盟升电子	4,500	117,855.00	0.00
118	688255	凯尔达	4,220	117,316.00	0.00
119	600268	国电南自	10,080	117,129.60	0.00
120	600720	中交设计	24,300	117,126.00	0.00
121	601127	赛力斯	1,900	116,375.00	0.00
122	000089	深圳机场	18,900	113,967.00	0.00
123	688533	上声电子	5,197	108,409.42	0.00
124	301499	维科精密	3,709	108,228.62	0.00
125	300070	碧水源	33,500	106,865.00	0.00
126	600827	百联股份	14,231	105,451.71	0.00
127	605255	天普股份	1,600	105,264.00	0.00
128	300384	三联虹普	9,000	102,600.00	0.00
129	688509	正元地信	23,800	101,864.00	0.00
130	301632	广东建科	6,557	101,502.36	0.00
131	688796	百奥赛图	922	100,866.80	0.00
132	600199	金种子酒	16,400	100,204.00	0.00
133	600416	湘电股份	10,100	98,980.00	0.00
134	688159	有方科技	2,184	96,947.76	0.00
135	603282	亚光股份	6,700	95,609.00	0.00
136	603113	金能科技	23,100	95,172.00	0.00
137	603367	辰欣药业	7,400	94,942.00	0.00
138	000428	华天酒店	31,200	94,848.00	0.00
139	301513	尚水智能	1,379	93,244.75	0.00
140	301456	盘古智能	4,061	91,697.38	0.00
141	600346	恒力石化	5,100	90,321.00	0.00
142	605086	龙高股份	3,600	89,352.00	0.00
143	001227	兰州银行	44,400	88,800.00	0.00
144	301015	百洋医药	4,600	87,676.00	0.00

145	002557	洽洽食品	4,866	87,393.36	0.00
146	688712	北芯生命	2,332	86,618.72	0.00
147	300810	中科海讯	3,400	86,292.00	0.00
148	688157	松井股份	3,220	84,975.80	0.00
149	001260	坤泰股份	5,400	84,510.00	0.00
150	688716	中研股份	2,668	83,855.24	0.00
151	003020	立方制药	5,616	83,172.96	0.00
152	301696	三瑞智能	757	82,678.77	0.00
153	688118	普元信息	4,101	82,512.12	0.00
154	600066	宇通客车	3,075	82,440.75	0.00
155	000617	中油资本	12,300	81,057.00	0.00
156	300523	辰安科技	4,400	80,872.00	0.00
157	688050	爱博医疗	2,129	77,602.05	0.00
158	605333	沪光股份	4,400	75,020.00	0.00
159	301322	绿通科技	1,400	74,690.00	0.00
160	301599	理奇智能	1,725	72,432.07	0.00
161	688066	*ST 航图	5,800	69,774.00	0.00
162	301270	汉仪股份	2,700	69,336.00	0.00
163	603435	嘉德利	1,031	68,134.86	0.00
164	300168	万达信息	14,000	64,260.00	0.00
165	001237	惠康科技	947	64,219.54	0.00
166	688121	*ST 卓然	9,221	59,752.08	0.00
167	002028	思源电气	300	51,900.00	0.00
168	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
169	603293	埃泰克	716	28,924.24	0.00
170	002081	金螳螂	6,000	25,980.00	0.00
171	600330	天通股份	600	18,504.00	0.00
172	301491	汉桑科技	245	9,621.15	0.00
173	301609	山大电力	277	9,199.17	0.00
174	301563	云汉芯城	52	9,068.28	0.00
175	603418	友升股份	139	6,139.63	0.00
176	301668	昊创瑞通	165	5,428.50	0.00
177	301575	艾芬达	176	4,718.56	0.00
178	603262	技源集团	155	3,816.10	0.00
179	603334	丰倍生物	88	3,126.64	0.00
180	603370	华新精科	82	2,950.36	0.00
181	001388	信通电子	94	2,582.18	0.00
182	301018	申菱环境	20	2,312.20	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	002738	中矿资源	50,976,377.00	1.30

2	002266	浙富控股	50,322,124.00	1.28
3	600601	方正科技	50,254,448.00	1.28
4	688469	芯联集成	47,379,485.06	1.21
5	688525	佰维存储	40,486,643.32	1.03
6	603444	吉比特	38,514,718.16	0.98
7	002281	光迅科技	37,541,393.64	0.96
8	688615	合合信息	36,008,096.01	0.92
9	603225	新凤鸣	32,072,552.00	0.82
10	601615	明阳智能	31,029,655.00	0.79
11	002153	石基信息	30,722,583.80	0.78
12	002756	永兴材料	28,955,392.80	0.74
13	600563	法拉电子	28,375,035.34	0.72
14	603920	世运电路	27,558,542.00	0.70
15	300136	信维通信	27,424,250.80	0.70
16	600105	永鼎股份	26,866,825.09	0.68
17	300567	精测电子	26,722,391.00	0.68
18	000657	中钨高新	26,489,201.02	0.67
19	600663	陆家嘴	26,064,350.40	0.66
20	600637	东方明珠	25,784,355.00	0.66

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000987	越秀资本	66,717,586.84	1.70
2	600995	南网储能	64,506,315.66	1.64
3	300604	长川科技	62,835,600.37	1.60
4	601615	明阳智能	52,227,848.62	1.33
5	688525	佰维存储	50,349,172.66	1.28
6	688183	生益电子	50,212,478.72	1.28
7	000050	深天马 A	47,650,878.00	1.21
8	301200	大族数控	47,240,728.39	1.20
9	603379	三美股份	46,827,193.84	1.19
10	600549	厦门钨业	44,338,675.40	1.13
11	600141	兴发集团	43,348,520.81	1.10
12	600487	亨通光电	42,879,599.00	1.09
13	688002	睿创微纳	42,355,444.61	1.08
14	601168	西部矿业	40,096,444.54	1.02
15	688469	芯联集成	38,657,714.93	0.98
16	688017	绿的谐波	35,795,385.96	0.91
17	301308	江波龙	35,498,005.66	0.90
18	300857	协创数据	34,435,677.88	0.88
19	001286	陕西能源	33,247,927.00	0.85
20	603699	纽威股份	33,062,580.44	0.84

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	4,841,662,628.77
卖出股票收入（成交）总额	6,133,108,496.68

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。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约定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的投资范围。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	38,364,241.55
2	应收清算款	56,475,991.83
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,609,076.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	96,449,309.41

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 (%)
建信中证 500 指数 增强 A	263,440	2,685.64	36,789,118.97	5.20	670,715,659.94	94.80

建信中证 500 指数增强 C	11,317	3,716.28	20,477,185.09	48.69	21,579,918.35	51.31
建信中证 500 指数增强 E	25	26,711.41	585,109.52	87.62	82,675.85	12.38
建信中证 500 指数增强 Y	2,789	2,249.17	0.00	0.00	6,272,924.43	100.00
合计	277,571	2,725.44	57,851,413.58	7.65	698,651,178.57	92.35

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	建信中证 500 指数增强 A	282,760.39	0.04
	建信中证 500 指数增强 C	1,665.09	0.00
	建信中证 500 指数增强 E	0.00	0.00
	建信中证 500 指数增强 Y	123,692.04	1.97
	合计	408,117.52	0.05

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信中证 500 指数增强 A	0~10
	建信中证 500 指数增强 C	—
	建信中证 500 指数增强 E	—
	建信中证 500 指数增强 Y	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	建信中证 500 指数增强 A	—
	建信中证 500 指数增强 C	—
	建信中证 500 指数增强 E	—
	建信中证 500 指数增强 Y	—
	合计	—

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 500 指数 增强 A	建信中证 500 指数 增强 C	建信中证 500 指数 增强 E	建信中证 500 指数 增强 Y
基金合同 生效日 (2014 年 1 月 27 日) 基金份额 总额	308,165,342.91	—	—	—
本报告期 期初基金 份额总额	1,144,311,813.05	26,808,107.88	655,021.19	3,894,506.23
本报告期 基金总申 购份额	73,583,959.89	28,131,139.12	40,659.82	4,149,331.14
减：本报告 期基金总 赎回份额	510,390,994.03	12,882,143.56	27,895.64	1,770,912.94
本报告期 基金拆分 变动份额	—	—	—	—
本报告期 期末基金 份额总额	707,504,778.91	42,057,103.44	667,785.37	6,272,924.43

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2026 年 1 月 17 日发布公告，自 2026 年 1 月 16 日起聘任安晔先生担任建信基金管理有限责任公司首席信息官；基金管理人于 2026 年 5 月 27 日发布公告，自 2026 年 5 月 25 日起聘任曲寅军先生担任建信基金管理有限责任公司董事长，生柳荣先生不再担任建信基金管理有限责任公司董事长。上述事项已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案。

2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银

行资产托管部总经理职务。2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

经建信基金管理有限责任公司董事会审议通过，自 2026 年 8 月 14 日起，本基金改聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计服务。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中金公司	2	1,425,401,821.63	12.99	272,930.84	13.06	-
中信建投	1	1,402,571,723.72	12.78	260,725.14	12.47	-
东北证券	2	1,397,636,206.80	12.74	259,826.94	12.43	-
华泰证券	1	1,329,876,556.15	12.12	247,205.71	11.83	-

长江证券	2	1,199,364,214 .98	10.93	234,960.54	11.24	-
招商证券	1	1,189,824,221 .72	10.84	221,190.91	10.58	-
广发证券	2	1,151,538,899 .58	10.49	225,589.34	10.79	-
中泰证券	1	785,045,751.2 1	7.15	153,796.11	7.36	-
方正证券	1	670,818,824.8 2	6.11	131,418.01	6.29	-
申万宏源	1	421,996,150.3 5	3.85	82,669.34	3.95	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联民生 证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
天府证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、公司选择证券公司的标准

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 10 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，研究业务线最近两年未因发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作的要求；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；

(6) 能及时为公司提供高质量的研究服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走势分析、个股分析报告及其他专门报告。

2、证券公司服务评价程序

(1) 证券公司服务的评价包括定期的证券公司评价打分以及对证券公司投研支持服务的定额激励。

(2) 公司对证券公司实行“核心名单”管理。在所有公司合作机构中筛选部分机构进入“核心名单”。公司的评价打分仅针对进入“核心名单”的机构，“核心名单”定期调整、动态优化。

(3) 定期的证券公司评价打分：根据证券公司服务记录，投研人员定期在投研系统平台对核心名单的证券公司服务进行评价打分。

(4) 证券公司服务的定额激励：根据证券公司服务记录，投研各部门可提出定额激励作为对证券公司投研支持服务的补充激励。证券公司投研支持服务的范围包括但不限于：重点推荐、定向路演邀请、投研课题委托、产业链调研、数据模型及支持等服务内容。

(5) 证券公司服务评价、交易佣金分配建议等证券公司服务的定期考核评价结果，由研究部进行汇总，提交公司投资决策委员会授权的投研部门总经理联席会议审议。

3、本基金本报告期内剔除国新证券一个交易单元，无新增交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

招商证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联民 生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
天府证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-

浙商证券	-	-	-	-	-	-
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	关于新增深圳前海微众银行股份有限公司为建信双债增强债券型证券投资基金等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2026 年 4 月 20 日
2	关于新增工商银行作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	2026 年 1 月 29 日
3	关于新增华创证券有限责任公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2026 年 1 月 21 日
4	关于新增易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为建信消费升级混合型证券投资基金等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2026 年 1 月 7 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2026 年 8 月 28 日