

建信丰泽债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

资产托管人中国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	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
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.....	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

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	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	53
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.11 本报告期投资基金情况	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	57
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
10.8 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	57
10.9 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信丰泽债券型证券投资基金	
基金简称	建信丰泽债券	
基金主代码	025289	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 10 月 31 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	482, 018, 151. 18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	建信丰泽债券 A	建信丰泽债券 C
下属分级基金的交 易代码	025289	025290
报告期末下属分级 基金的份额总额	254, 400, 604. 11 份	227, 617, 547. 07 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	（一）资产配置策略 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。 （二）债券投资策略 1、久期管理策略 2、期限结构配置策略 3、债券类属配置策略 4、骑乘策略 5、息差放大策略 6、信用债券投资策略 7、可转换债券及可交换债券投资策略 （三）股票投资策略 本基金以量化选股分析框架结合因子模型进行个股选择和投资组合构建。本基金基于财务数据及历史交易数据分析上市公司的基本面价值和过往股价表现，从股票内在价值和市场外生变量等维度构造相关选股因子，如盈利因子、估值因子、成长因子等。精选长期表现优秀且具备经济逻辑的选股因子对个股进行综合评价，最终结合风险控制手段构建投资组合，对个股进行分散化投资。

	（四）国债期货交易策略 国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。国债期货相关交易遵循法律法规及中国证监会的规定。 （五）信用衍生品投资策略 本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，根据风险管理的原则，以风险对冲为目的，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理。 （六）基金投资策略 针对基金投资，本基金仅可投资于全市场的股票型 ETF。本基金通过对标的指数匹配性、跟踪误差、基金资产规模、流动性、运营规则、交易折溢价、交易费用以及基金管理人在被动管理基金上的经验等因素的综合分析，选择合适的股票型 ETF。 未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*89%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率（经汇率调整）*1%。
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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	许俊
	联系电话	010-66228888	010-66596688
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-81-95533; 010-66228000	95566
传真		010-66228001	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		曲寅军	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn

基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的住所
------------	----------------

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	建信丰泽债券 A	建信丰泽债券 C
本期已实现收益	7,955,286.40	7,381,039.23
本期利润	7,901,072.50	7,617,666.17
加权平均基金份 额本期利润	0.0135	0.0133
本期加权平均净 值利润率	1.34%	1.32%
本期基金份额净 值增长率	0.82%	0.65%
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	2,700,118.09	1,879,852.70
期末可供分配基 金份额利润	0.0106	0.0083
期末基金资产净 值	257,209,117.04	229,594,067.40
期末基金份额净 值	1.0110	1.0087
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	1.10%	0.87%

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

建信丰泽债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.24%	0.22%	1.64%	0.14%	-0.40%	0.08%
过去六个月	0.82%	0.21%	1.47%	0.13%	-0.65%	0.08%
自基金合同生效起至今	1.10%	0.18%	0.97%	0.12%	0.13%	0.06%

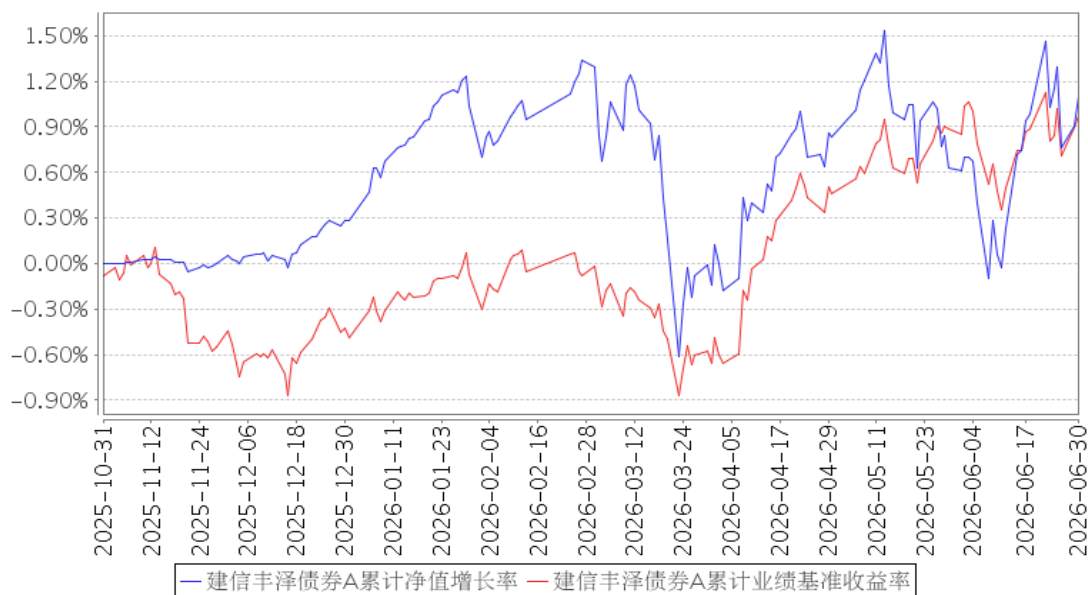
建信丰泽债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.16%	0.22%	1.64%	0.14%	-0.48%	0.08%
过去六个月	0.65%	0.21%	1.47%	0.13%	-0.82%	0.08%
自基金合同生效起至今	0.87%	0.18%	0.97%	0.12%	-0.10%	0.06%

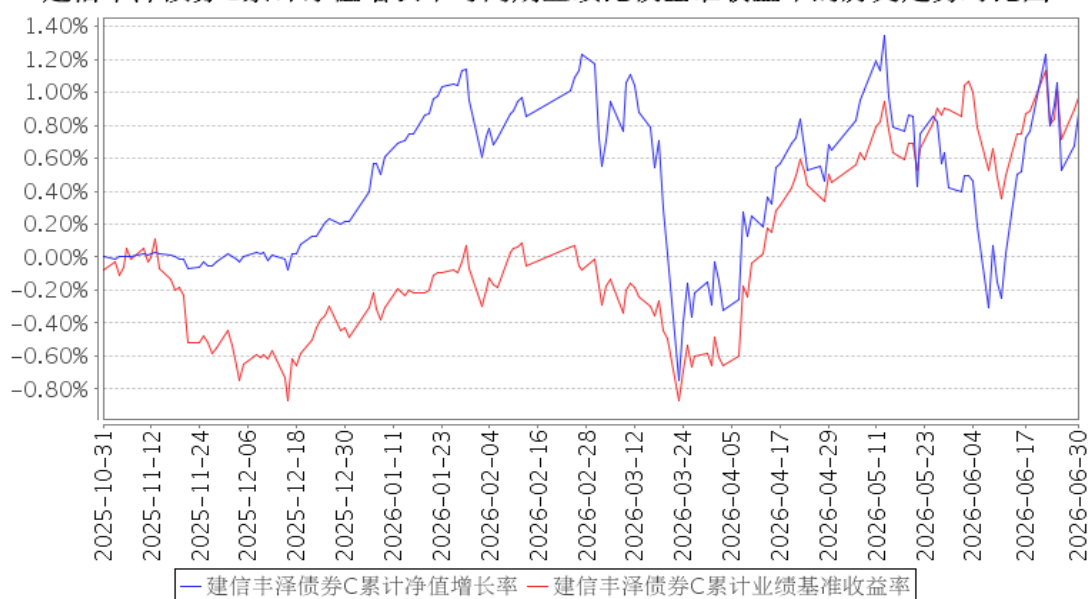
注：本基金业绩比较基准为中债综合全价(总值)指数收益率*89%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率(经汇率调整)*1%。中债综合全价(总值)指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。沪深 300 指数由中证指数有限公司编制，由上海和深圳证券交易所中市值大、流动性好的 300 只股票组成，综合反映中国 A 股市场上市股票价格的整体表现。恒生指数是由恒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

建信丰泽债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信丰泽债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2025 年 10 月 31 日生效，截至报告期末建仓结束未满一年。本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

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		
彭紫云	本基金的基金经理	2025 年 10 月 31 日	-	12	彭紫云先生，硕士。2013 年 7 月加入建信基金，历任研究部助理研究员、固定收益投资债券研究员、基金经理助理和基金经理。2019 年 7 月 17 日起任建信双债增强债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 7 月 17 日至 2021 年 11 月 10 日任建信双息红利债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 7 月 17 日起任建信纯债债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 1 月 3 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；2020 年 1 月 3 日至 2021 年 11 月 18 日任建信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 10 日至 2021 年 9 月 29 日任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 10 日至 2021 年 3 月 9 日任建信瑞福添利混合型证券投资基金的基金经

					理；2020 年 12 月 18 日至 2022 年 1 月 6 日任建信稳定增利债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 12 月 18 日至 2021 年 11 月 28 日任建信稳定丰利债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 8 月 10 日起任建信鑫悦 90 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金的基金经理；2022 年 5 月 9 日起任建信鑫恒 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理；2022 年 7 月 27 日起任建信鑫福 60 天持有期中短债债券型证券投资基金的基金经理；2022 年 12 月 29 日起任建信鑫和 30 天持有期债券型证券投资基金的基金经理；2023 年 3 月 27 日至 2024 年 3 月 29 日任建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2023 年 8 月 23 日起任建信鑫弘 180 天持有期债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 2 月 26 日起任建信宁远 90 天持有期债券型证券投资基金的基金经理；2025 年 10 月 31 日起任建信丰泽债券型证券投资基金的基金经理；2025 年 11 月 14 日起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。
薛玲	数量投资部副总经理，本基金的基金经理	2025 年 10 月 31 日	-	13	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 日至 2025 年 11 月 17 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；2016 年 7 月 4 日至 2025 年 11 月 17 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；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；2025 年 10 月 31 日起任建信丰泽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《建信丰泽债券型证券投资基金基金合同》的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，出口支撑经济增速，美伊战事对经济形成负面扰动，上半年实现国内生产总值 695704 亿元，按不变价计算同比增长 4.7%。外需表现较强，消费因补贴政策边际效用递减而弱于预期，随着美伊战争冲击逐步显现，生产、消费均受到明显影响，得益于 AI 蓬勃发展拉动补库、油价高企拉动新能源需求以及高通胀下我国商品价格优势凸显，出口增速持续超预期，对经济增长保持较大贡献。

上半年居民消费物价及工业品价格均上行，CPI 低开高走后略有回落，PPI 同比读数持续走高。

货币政策方面，上半年总体偏宽松，6 月设立了隔夜逆回购工具，用于在特殊时点调节流动性，6 月末进行了首次投放；从资金利率来看，资金利率整体先下后上，4、5 月最低，6 月明显走高。

债券市场方面，一季度长端收益率总体震荡，短端收益率震荡下行；二季度长短端收益率均下行后震荡。2026 年二季度末 10 年国债收益率相比于 25 年末 1.85% 的位置下行 11BP 到 1.73%，而 10 年国开债收益率相比 25 年年末 2.00% 的位置下行 22BP 到 1.78%。

回顾上半年的基金管理工作，年初看好资金面宽松，一季度提高了组合的杠杆，并继续大幅增配 3 年内信用债，获取了较好的票息收益和杠杆收益；二季度在资金利率明显下行后拉长了组合的久期，获取了收益率下行的资本利得，组合收益相对较好。未来仍将保持风格特征，实现净值的稳定增长。

股票操作上，年初以来，市场受到春季躁动预期的影响，出现了连续小幅上涨，为更好地给投资者创造收益，及时提高了权益仓位，并增加了权益持仓中成长股的比例，以跟上市场涨幅。整个产品封闭期间，权益仓位不超过 10%。本基金在封闭期结束之前主要通过调整权益结构来获取收益，打开之时绝对收益大约 1%。产品打开之后，由于赎回较多且临近春节，本基金并未立即加仓，赎回导致权益仓位自然上升。春节之后，待赎回金额稳定在千万水平之后，本基金在 2 月底加仓至 20%仓位，权益结构呈均衡配置，红利、质量、成长 1: 1: 1。进入 3 月中旬，市场受到美伊战争的冲击现了较大波动，本基金分步骤下降仓位至 12%。进入二季度，科技股带领 A 股走出了结构性牛市，A 股科技板块的快速上涨从某种程度上导致了其他板块的抽水效应。这种此消彼长的效应导致了 A 股的行业结构上出现了较大的变化，沪深 300、中证 500、中证 1000 等主要指数中电子、通信行业的权重达到 30%左右。二季度的股票操作主要跟随市场结构的变化，在行业配置上跟随市场进行紧密调整，逐步增加电子、通信仓位同时精选个股以获得超越市场的收益。

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 0.82%，波动率 0.21%，业绩比较基准收益率 1.47%，波动率 0.13%。本报告期本基金 C 净值增长率 0.65%，波动率 0.21%，业绩比较基准收益率 1.47%，波动率 0.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，海外重点关注 ai 产业链的资本开支情况，海外下半年大型 IPO 融资情况，以及美联储尤其是沃什的政策变化；国内关注地方财政的进度和后续可能的政策节奏。策略上，优先以票息杠杆策略为主，久期策略做波段。

下半年 A 股和港股，陆续有存储芯片、AI、机器人等大型公司的股票上市。为推进科技兴国战略，监管层会尽力保持市场稳定，极端情况下，不排除国家队救市的可能。结合目前市场波动率加大的现状，总体判断市场在将在 3800 点至 4200 点宽幅震荡。结构上和二季度相比，相对均衡。具体操作上，跟随市场在科技行业的配置，同时精选红利、高质量的优质个股，从而获得更好的收益。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在建信丰泽债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信丰泽债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	10,642,847.37	4,874,519.21
结算备付金		921,037.36	29,741,514.75
存出保证金		126,983.82	36,052.57
交易性金融资产	6.4.7.2	543,458,880.03	2,357,341,433.77
其中：股票投资		90,804,949.72	238,497,388.46
基金投资		-	-
债券投资		452,653,930.31	2,118,844,045.31
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	10,002,123.30	39,009,887.96
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		13,891.74	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		565,165,763.62	2,431,003,408.26
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		68,073,841.56	-
应付清算款		587,472.98	4,000,000.00
应付赎回款		8,495,338.05	-
应付管理人报酬		276,615.20	1,233,608.95
应付托管费		69,153.78	308,402.28
应付销售服务费		72,848.12	376,614.45
应付投资顾问费		-	-
应交税费		12,560.16	62,656.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	774,749.33	199,705.73
负债合计		78,362,579.18	6,180,987.87
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	482,018,151.18	2,418,759,191.15
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	4,785,033.26	6,063,229.24
净资产合计		486,803,184.44	2,424,822,420.39
负债和净资产总计		565,165,763.62	2,431,003,408.26

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 482,018,151.18 份，其中建信丰泽债券 A 基金份额总额 254,400,604.11 份，基金份额净值人民币 1.0110 元；建信丰泽债券 C 基金份额总额 227,617,547.07 份，基金份额净值人民币 1.0087 元。

6.2 利润表

会计主体：建信丰泽债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		21,406,037.11
1. 利息收入		547,418.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	29,355.25
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		518,063.57
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,674,078.54
其中：股票投资收益	6.4.7.14	10,191,036.12
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.15	9,411,529.11
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	1,071,513.31
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	182,413.04
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	2,126.71
减：二、营业总支出		5,887,298.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,507,697.66
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	876,924.40
3. 销售服务费		1,011,363.76
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		353,782.38
其中：卖出回购金融资产支出		353,782.38
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		17,829.98
8. 其他费用	6.4.7.23	119,700.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,518,738.67
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,518,738.67
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		15,518,738.67

注：本基金基金合同生效日为 2025 年 10 月 31 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：建信丰泽债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,418,759,191.15	-	6,063,229.24	2,424,822,420.39
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2, 418, 759, 191.15	-	6, 063, 229. 24	2, 424, 822, 420. 39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1, 936, 741, 039. 97	-	-1, 278, 195. 98	-1, 938, 019, 235. 95
(一)、综合收益总额	-	-	15, 518, 738. 67	15, 518, 738. 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)	-1, 936, 741, 039. 97	-	-16, 796, 934. 65	-1, 953, 537, 974. 62
其中：1. 基金申购款	7, 983, 844. 82	-	69, 002. 98	8, 052, 847. 80
2. 基金赎回款	-1, 944, 724, 884. 79	-	-16, 865, 937. 63	-1, 961, 590, 822. 42
(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	482, 018, 151. 18	-	4, 785, 033. 26	486, 803, 184. 44

注：本基金基金合同生效日为 2025 年 10 月 31 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

建信丰泽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[2025]1664号《关于准予建信丰泽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《建信丰泽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 2,417,863,794.80 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_A15 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信丰泽债券型证券投资基金基金合同》于 2025 年 10 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,418,759,191.15 份基金份额，其中认购资金利息折合 895,396.35 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，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《建信丰泽债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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”）、经中国证监会依法注册的公开募集证券投资基金（仅包括全市场的股票型 ETF）、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。本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于股票（含存托凭证）、股票型 ETF 以及可转换债券和可交换债券的比例合计为基金资产的 5%-20%，其中投资于境内股票资产的比例不低于基金资产的 5%，港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%；本基金投资于经中国证监会依法注册的公开募集的基

金份额的比例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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 89%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%+恒生指数收益率（经汇率调整） $\times$ 1%。

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。

6.4.6.5 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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	10,642,847.37
等于：本金	10,642,390.98
加：应计利息	456.39

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	10,642,847.37

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		89,344,233.13	-	90,804,949.72	1,460,716.59
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	44,390.97	428.45	59,903.45	15,084.03
	银行间市场	446,786,415.76	5,005,026.86	452,594,026.86	802,584.24
	合计	446,830,806.73	5,005,455.31	452,653,930.31	817,668.27
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		536,175,039.86	5,005,455.31	543,458,880.03	2,278,384.86

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,002,123.30	-
银行间市场	-	-
合计	10,002,123.30	-

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	18.80
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	691,046.77
其中：交易所市场	667,951.71
银行间市场	23,095.06
应付利息	-
预提费用	83,683.76
合计	774,749.33

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信丰泽债券 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,152,610,754.46	1,152,610,754.46
本期申购	1,243,509.14	1,243,509.14
本期赎回（以“-”号填列）	-899,453,659.49	-899,453,659.49
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	254,400,604.11	254,400,604.11

建信丰泽债券 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,266,148,436.69	1,266,148,436.69
本期申购	6,740,335.68	6,740,335.68
本期赎回（以“-”号填列）	-1,045,271,225.30	-1,045,271,225.30
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	227,617,547.07	227,617,547.07

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

建信丰泽债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,243,888.12	999,218.83	3,243,106.95
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,243,888.12	999,218.83	3,243,106.95
本期利润	7,955,286.40	-54,213.90	7,901,072.50
本期基金份额交易产生的变动数	-7,499,056.43	-836,610.09	-8,335,666.52
其中：基金申购款	10,254.58	930.95	11,185.53
基金赎回款	-7,509,311.01	-837,541.04	-8,346,852.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,700,118.09	108,394.84	2,808,512.93

建信丰泽债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,723,369.30	1,096,752.99	2,820,122.29
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,723,369.30	1,096,752.99	2,820,122.29
本期利润	7,381,039.23	236,626.94	7,617,666.17
本期基金份额交易产生的变动数	-7,224,555.83	-1,236,712.30	-8,461,268.13
其中：基金申购款	53,074.15	4,743.30	57,817.45
基金赎回款	-7,277,629.98	-1,241,455.60	-8,519,085.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,879,852.70	96,667.63	1,976,520.33

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	18,670.98
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	10,422.41
其他	261.86
合计	29,355.25

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	10,191,036.12
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	10,191,036.12

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	827,390,383.46
减：卖出股票成本总额	816,029,362.42
减：交易费用	1,169,984.92
买卖股票差价收入	10,191,036.12

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	15,200,684.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,789,155.39
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	9,411,529.11

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,226,626,704.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,210,342,801.13
减：应计利息总额	22,053,121.55

减：交易费用	19,937.43
买卖债券差价收入	-5,789,155.39

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 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	1,071,513.31
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	1,071,513.31

6.4.7.21 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	182,413.04
股票投资	-2,982,178.19
债券投资	3,164,591.23
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	182,413.04

6.4.7.22 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	1,975.75
基金转换费收入	150.96
合计	2,126.71

6.4.7.23 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.24 信用减值损失

无。

6.4.7.25 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	14,876.39

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	26,603.69
银行间账户维护费	18,600.00
其他	100.00
存托服务费	12.81
合计	119,700.26

6.4.7.26 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

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 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
当期发生的基金应支付的管理费	3,507,697.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,511,553.11
应支付基金管理人的净管理费	1,996,144.55

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 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%/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
当期发生的基金应支付的托管费	876,924.40

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/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		
	建信丰泽债券 A	建信丰泽债券 C	合计
建信基金	-	300.63	300.63
中国建设银行	-	698,433.43	698,433.43
中国银行	-	308,066.26	308,066.26
合计	-	1,006,800.32	1,006,800.32

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 0.35%。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

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	164,518,779.86	-	-	-	-

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
	10,642,847.37	18,670.98
中国银行-活期		

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	600	298,764.67	527,718.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 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 68,073,841.56 元，是以如下债券作为质押：

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
092280069	22 华夏银行二级资本债 01	2026 年 7 月 1 日	104.43	373,000	38,951,010.41
102484934	24 云能投 MTN026	2026 年 7 月 1 日	103.32	100,000	10,331,917.81
102485326	24 津保投 MTN007	2026 年 7 月 1 日	102.48	200,000	20,496,455.89
102580779	25 豫航空港 MTN002	2026 年 7 月 1 日	102.59	50,000	5,129,534.25
合计				723,000	74,908,918.36

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
--------	------------------------	--------------------------

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	579,759,033.48
合计	-	579,759,033.48

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	197,226,332.60
合计	-	197,226,332.60

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	289,428,255.90	911,796,828.37
AAA 以下	59,903.45	50,932,316.61
未评级	132,666,349.04	379,129,534.25
合计	422,154,508.39	1,341,858,679.23

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,642,847.37	-	-	-	10,642,847.37
结算备付金	921,037.36	-	-	-	921,037.36
存出保证金	126,983.82	-	-	-	126,983.82
交易性金融资产	40,901,878.79	411,752,051.52	-	90,804,949.72	543,458,880.03
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	10,002,123.30	-	-	-	10,002,123.30
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,891.74	13,891.74
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	62,594,870.64	411,752,051.52	-	90,818,841.46	565,165,763.62
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	68,073,841.56	-	-	-	68,073,841.56
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	587,472.98	587,472.98
应付赎回款	-	-	-	8,495,338.05	8,495,338.05
应付管理人报酬	-	-	-	276,615.20	276,615.20
应付托管费	-	-	-	69,153.78	69,153.78
应付销售服务费	-	-	-	72,848.12	72,848.12
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	12,560.16	12,560.16
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	774,749.33	774,749.33
负债总计	68,073,841.56	-	-	10,288,737.62	78,362,579.18
利率敏感度缺口	-5,478,970.92	411,752,051.52	-	80,530,103.84	486,803,184.44
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	4,874,519.21	-	-	-	4,874,519.21
结算备付金	29,741,514.75	-	-	-	29,741,514.75
存出保证金	36,052.57	-	-	-	36,052.57
交易性金融资产	1,208,035,420.05	910,743,522.99	65,102.27	238,497,388.46	2,357,341,433.77
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	39,009,887.96	-	-	-	39,009,887.96
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,281,697,394.54	910,743,522.99	65,102.27	238,497,388.46	2,431,003,408.26
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	-	-	-	4,000,000.00	4,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,233,608.95	1,233,608.95
应付托管费	-	-	-	308,402.28	308,402.28
应付销售服务费	-	-	-	376,614.45	376,614.45
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	62,656.46	62,656.46
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	199,705.73	199,705.73
负债总计	-	-	-	6,180,987.87	6,180,987.87
利率敏感度缺口	1,281,697,394.54	910,743,522.99	65,102.27	232,316,400.59	2,424,822,420.39

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	2,015,925.50	4,700,971.96
	市场利率上升 25 个基点	-1,999,541.80	-4,671,162.68

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	90,804,949.72	18.65	238,497,388.46	9.84
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	452,653,930.31	92.98	2,118,844,045.31	87.38
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	543,458,880.03	111.64	2,357,341,433.77	97.22

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	90,337,135.17	238,055,417.61
第二层次	453,121,744.86	2,119,286,016.16
第三层次	—	—
合计	543,458,880.03	2,357,341,433.77

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	90,804,949.72	16.07
	其中：股票	90,804,949.72	16.07
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	452,653,930.31	80.09
	其中：债券	452,653,930.31	80.09
	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	10,002,123.30	1.77

	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	11,563,884.73	2.05
8	其他各项资产	140,875.56	0.02
9	合计	565,165,763.62	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,164,910.00	0.86
C	制造业	59,434,879.80	12.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,858,201.00	0.38
E	建筑业	298,048.00	0.06
F	批发和零售业	1,455,243.40	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	2,012,234.00	0.41
H	住宿和餐饮业	59,367.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,163,141.32	1.27
J	金融业	12,107,023.80	2.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,065,900.40	0.22
M	科学研究和技术服务业	1,164,763.00	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	629,114.00	0.13
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	392,124.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	90,804,949.72	18.65

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002558	巨人网络	31,700	873,652.00	0.18
2	600549	厦门钨业	10,000	852,000.00	0.18
3	600183	生益科技	4,800	832,320.00	0.17

4	603986	兆易创新	1,000	815,000.00	0.17
5	002027	分众传媒	164,900	798,116.00	0.16
6	688256	寒武纪	500	797,775.00	0.16
7	000807	云铝股份	35,300	781,542.00	0.16
8	002156	通富微电	10,200	773,874.00	0.16
9	002281	光迅科技	3,000	770,820.00	0.16
10	688002	睿创微纳	4,800	742,512.00	0.15
11	688396	华润微	7,463	728,015.65	0.15
12	688012	中微公司	1,537	720,084.50	0.15
13	601138	工业富联	9,800	707,070.00	0.15
14	300502	新易盛	1,120	679,840.00	0.14
15	000776	广发证券	28,838	674,809.20	0.14
16	002916	深南电路	1,400	641,060.00	0.13
17	002463	沪电股份	4,100	626,480.00	0.13
18	002353	杰瑞股份	4,100	625,250.00	0.13
19	601168	西部矿业	22,600	613,364.00	0.13
20	600522	中天科技	9,900	600,732.00	0.12
21	601169	北京银行	118,100	578,690.00	0.12
22	600803	新奥股份	36,500	576,700.00	0.12
23	000408	藏格矿业	8,300	575,356.00	0.12
24	601688	华泰证券	27,900	575,298.00	0.12
25	600498	烽火通信	7,800	574,080.00	0.12
26	002532	天山铝业	53,500	574,055.00	0.12
27	000538	云南白药	12,114	573,840.18	0.12
28	601077	渝农商行	93,600	571,896.00	0.12
29	300373	扬杰科技	3,400	534,582.00	0.11
30	688072	拓荆科技	600	527,718.00	0.11
31	001389	广合科技	2,200	521,950.00	0.11
32	600489	中金黄金	28,600	516,230.00	0.11
33	300308	中际旭创	400	508,000.00	0.10
34	300033	同花顺	2,100	506,100.00	0.10
35	002709	天赐材料	9,800	504,014.00	0.10
36	300394	天孚通信	1,660	502,448.80	0.10
37	301377	鼎泰高科	900	495,810.00	0.10
38	301308	江波龙	700	492,660.00	0.10
39	002128	电投能源	20,800	480,896.00	0.10
40	300475	香农芯创	1,600	480,000.00	0.10
41	601872	招商轮船	27,300	479,661.00	0.10
42	000423	东阿阿胶	10,500	476,280.00	0.10
43	688233	神工股份	1,910	409,542.20	0.08
44	603259	药明康德	3,100	385,981.00	0.08
45	603129	春风动力	1,500	383,700.00	0.08
46	300476	胜宏科技	1,100	381,073.00	0.08

47	301217	铜冠铜箔	2,300	379,661.00	0.08
48	001309	德明利	400	377,160.00	0.08
49	688472	阿特斯	34,300	371,126.00	0.08
50	300054	鼎龙股份	3,500	370,895.00	0.08
51	600885	宏发股份	10,400	358,696.00	0.07
52	600150	中国船舶	10,600	358,174.00	0.07
53	688019	安集科技	1,055	358,130.30	0.07
54	688409	富创精密	1,100	336,875.00	0.07
55	002409	雅克科技	1,500	336,750.00	0.07
56	600066	宇通客车	12,400	332,444.00	0.07
57	600961	株冶集团	10,100	327,139.00	0.07
58	000661	长春高新	4,800	319,680.00	0.07
59	688111	金山办公	1,500	319,575.00	0.07
60	600487	亨通光电	2,900	317,086.00	0.07
61	600233	圆通速递	20,000	315,000.00	0.06
62	002384	东山精密	1,200	314,820.00	0.06
63	300750	宁德时代	800	314,408.00	0.06
64	002460	赣锋锂业	4,800	313,920.00	0.06
65	688271	联影医疗	3,100	313,813.00	0.06
66	688169	石头科技	3,300	313,401.00	0.06
67	002466	天齐锂业	5,100	312,732.00	0.06
68	000301	东方盛虹	27,200	311,440.00	0.06
69	600010	宝钢股份	139,600	311,308.00	0.06
70	000858	五粮液	4,200	310,800.00	0.06
71	600188	兖矿能源	17,400	309,198.00	0.06
72	600196	复星医药	13,700	307,839.00	0.06
73	300604	长川科技	900	307,278.00	0.06
74	600009	上海机场	13,300	307,230.00	0.06
75	600025	华能水电	34,400	305,816.00	0.06
76	002001	新和成	10,700	304,094.00	0.06
77	300620	光库科技	800	302,560.00	0.06
78	600346	恒力石化	17,000	301,070.00	0.06
79	000983	山西焦煤	51,700	299,860.00	0.06
80	000725	京东方 A	34,500	299,460.00	0.06
81	603124	江南新材	1,600	299,168.00	0.06
82	002304	洋河股份	7,800	297,570.00	0.06
83	688126	沪硅产业	7,407	295,465.23	0.06
84	605358	立昂微	3,800	294,880.00	0.06
85	600426	华鲁恒升	12,200	291,824.00	0.06
86	002436	兴森科技	5,700	290,415.00	0.06
87	600105	永鼎股份	4,300	290,164.00	0.06
88	002493	荣盛石化	26,700	287,025.00	0.06
89	002155	湖南黄金	11,900	284,053.00	0.06

90	300017	网宿科技	21,800	283,618.00	0.06
91	600026	中远海能	15,600	279,864.00	0.06
92	002595	豪迈科技	5,975	278,435.00	0.06
93	600036	招商银行	7,800	276,900.00	0.06
94	601628	中国人寿	7,800	275,730.00	0.06
95	002352	顺丰控股	8,800	275,088.00	0.06
96	688630	芯碁微装	500	274,695.00	0.06
97	688322	奥比中光	2,100	274,155.00	0.06
98	601869	长飞光纤	500	272,950.00	0.06
99	601658	邮储银行	55,200	272,136.00	0.06
100	601318	中国平安	5,700	272,118.00	0.06
101	601166	兴业银行	16,400	271,584.00	0.06
102	600000	浦发银行	31,500	271,215.00	0.06
103	601398	工商银行	38,300	270,781.00	0.06
104	003031	中瓷电子	1,500	270,450.00	0.06
105	000157	中联重科	38,800	270,436.00	0.06
106	601998	中信银行	39,000	270,270.00	0.06
107	002142	宁波银行	9,100	270,179.00	0.06
108	601328	交通银行	42,000	270,060.00	0.06
109	601229	上海银行	31,100	269,948.00	0.06
110	000999	华润三九	12,000	269,880.00	0.06
111	600690	海尔智家	13,200	269,412.00	0.06
112	000001	平安银行	26,800	269,340.00	0.06
113	000783	长江证券	27,600	269,100.00	0.06
114	688347	华虹宏力	800	269,040.00	0.06
115	600019	宝钢股份	49,500	268,785.00	0.06
116	601336	新华保险	4,500	268,470.00	0.06
117	600887	伊利股份	11,200	268,352.00	0.06
118	688266	泽璟制药	2,300	268,318.00	0.06
119	601288	农业银行	44,200	268,294.00	0.06
120	600958	东方证券	28,400	268,096.00	0.06
121	601601	中国太保	9,400	268,088.00	0.06
122	600028	中国石化	60,100	268,046.00	0.06
123	600050	中国联通	67,000	268,000.00	0.06
124	600919	江苏银行	24,800	267,344.00	0.05
125	601838	成都银行	15,100	267,270.00	0.05
126	600015	华夏银行	41,800	267,102.00	0.05
127	300408	三环集团	1,600	267,040.00	0.05
128	688582	芯动联科	4,104	266,760.00	0.05
129	601818	光大银行	92,200	266,458.00	0.05
130	600926	杭州银行	18,400	265,880.00	0.05
131	002371	北方华创	300	265,368.00	0.05
132	600016	民生银行	82,200	264,684.00	0.05

133	600741	华域汽车	17,000	263,840.00	0.05
134	601319	中国人保	39,000	263,640.00	0.05
135	601009	南京银行	26,600	263,074.00	0.05
136	002273	水晶光电	7,400	262,552.00	0.05
137	601825	沪农商行	34,800	260,652.00	0.05
138	688082	盛美上海	600	259,200.00	0.05
139	601728	中国电信	49,900	258,981.00	0.05
140	688100	威胜信息	8,400	256,956.00	0.05
141	600219	南山铝业	64,000	255,360.00	0.05
142	688469	芯联集成	24,019	254,841.59	0.05
143	300903	科翔股份	2,500	253,275.00	0.05
144	688048	长光华芯	500	251,000.00	0.05
145	300012	华测检测	17,900	248,094.00	0.05
146	688008	澜起科技	800	247,920.00	0.05
147	002056	横店东磁	8,100	246,888.00	0.05
148	601916	浙商银行	93,400	245,642.00	0.05
149	300661	圣邦股份	1,700	243,916.00	0.05
150	002517	恺英网络	14,900	242,125.00	0.05
151	003010	若羽臣	9,700	235,710.00	0.05
152	605117	德业股份	2,200	233,596.00	0.05
153	688150	莱特光电	3,400	233,308.00	0.05
154	688107	安路科技	5,100	232,560.00	0.05
155	603629	利通电子	1,300	232,453.00	0.05
156	688766	普冉股份	300	229,980.00	0.05
157	002947	恒铭达	3,000	228,150.00	0.05
158	688262	国芯科技	5,257	227,260.11	0.05
159	603606	东方电缆	5,460	226,644.60	0.05
160	601100	恒立液压	2,100	225,876.00	0.05
161	688183	生益电子	1,700	225,080.00	0.05
162	688213	思特威	2,100	224,847.00	0.05
163	300223	北京君正	900	224,010.00	0.05
164	300628	亿联网络	6,600	223,212.00	0.05
165	300735	光弘科技	9,800	222,852.00	0.05
166	688257	新锐股份	2,176	221,734.40	0.05
167	688313	仕佳光子	1,200	221,580.00	0.05
168	002938	鹏鼎控股	2,100	221,298.00	0.05
169	300458	全志科技	5,600	220,976.00	0.05
170	601108	财通证券	25,400	219,710.00	0.05
171	688059	华锐精密	1,100	219,681.00	0.05
172	603040	新坐标	3,480	219,483.60	0.05
173	600584	长电科技	2,100	217,455.00	0.04
174	000792	盐湖股份	7,200	217,368.00	0.04
175	002555	三七互娱	11,500	217,005.00	0.04

176	301200	大族数控	600	216,390.00	0.04
177	605118	力鼎光电	6,200	216,318.00	0.04
178	600143	金发科技	14,000	216,300.00	0.04
179	002472	双环传动	5,200	215,852.00	0.04
180	000895	双汇发展	9,600	215,040.00	0.04
181	600236	桂冠电力	24,400	214,232.00	0.04
182	301665	泰禾股份	10,200	213,792.00	0.04
183	603233	大参林	14,100	211,923.00	0.04
184	603132	金徽股份	13,600	211,888.00	0.04
185	002444	巨星科技	6,800	211,480.00	0.04
186	002484	江海股份	2,000	210,000.00	0.04
187	600298	安琪酵母	5,800	209,960.00	0.04
188	002847	盐津铺子	4,700	209,620.00	0.04
189	002170	芭田股份	19,200	208,512.00	0.04
190	300672	国科微	700	206,500.00	0.04
191	688981	中芯国际	1,300	206,466.00	0.04
192	001337	四川黄金	5,600	205,296.00	0.04
193	601198	东兴证券	15,100	205,209.00	0.04
194	601555	东吴证券	25,900	205,128.00	0.04
195	002648	卫星化学	8,700	204,363.00	0.04
196	002402	和而泰	7,900	204,057.00	0.04
197	300857	协创数据	600	203,940.00	0.04
198	000933	神火股份	9,600	203,520.00	0.04
199	601600	中国铝业	24,700	203,034.00	0.04
200	688172	燕东微	2,400	200,784.00	0.04
201	600699	均胜电子	9,200	198,812.00	0.04
202	601899	紫金矿业	7,900	198,606.00	0.04
203	603993	洛阳钼业	11,300	198,315.00	0.04
204	688525	佰维存储	400	197,892.00	0.04
205	603317	天味食品	15,200	197,752.00	0.04
206	002138	顺络电子	2,700	197,370.00	0.04
207	603979	金诚信	3,300	194,799.00	0.04
208	601958	金钼股份	6,900	193,959.00	0.04
209	688195	腾景科技	1,000	192,580.00	0.04
210	600060	海信视像	6,900	192,303.00	0.04
211	000975	山金国际	11,200	190,400.00	0.04
212	688777	中控技术	1,600	188,000.00	0.04
213	688205	德科立	900	187,371.00	0.04
214	601128	常熟银行	32,080	186,705.60	0.04
215	000551	创元科技	8,600	177,418.00	0.04
216	002078	太阳纸业	14,100	176,109.00	0.04
217	688127	蓝特光学	1,800	175,680.00	0.04
218	300323	华灿光电	8,500	173,400.00	0.04

219	601577	长沙银行	19,800	172,458.00	0.04
220	600563	法拉电子	900	171,720.00	0.04
221	600909	华安证券	15,400	171,094.00	0.04
222	688052	纳芯微	591	170,391.21	0.04
223	301321	翰博高新	3,800	167,770.00	0.03
224	300548	长芯博创	600	166,800.00	0.03
225	605289	罗曼股份	1,140	165,300.00	0.03
226	300001	特锐德	4,300	162,669.00	0.03
227	300434	金石亚药	14,300	160,589.00	0.03
228	688221	前沿生物	6,900	154,560.00	0.03
229	688456	有研粉材	1,100	153,560.00	0.03
230	300596	利安隆	2,900	152,192.00	0.03
231	002134	天津普林	5,000	152,100.00	0.03
232	301319	唯特偶	890	148,923.70	0.03
233	001314	亿道信息	2,400	148,320.00	0.03
234	300570	太辰光	600	148,026.00	0.03
235	688787	海天瑞声	1,100	147,895.00	0.03
236	300980	祥源新材	5,000	147,050.00	0.03
237	301606	绿联科技	2,400	146,448.00	0.03
238	002354	天娱数科	15,700	146,010.00	0.03
239	603920	世运电路	3,000	144,120.00	0.03
240	002609	捷顺科技	18,900	144,018.00	0.03
241	603399	永杉锂业	6,400	143,872.00	0.03
242	600288	大恒科技	10,800	143,640.00	0.03
243	301571	国科天成	2,200	143,396.00	0.03
244	605016	百龙创园	5,500	142,175.00	0.03
245	301031	中熔电气	1,184	141,428.80	0.03
246	300487	蓝晓科技	2,400	141,240.00	0.03
247	688275	万润新能	1,100	140,305.00	0.03
248	688215	瑞晟智能	3,490	140,158.40	0.03
249	301349	信德新材	1,900	139,840.00	0.03
250	300397	天和防务	9,200	139,288.00	0.03
251	002318	久立特材	5,800	138,620.00	0.03
252	301345	涛涛车业	600	138,600.00	0.03
252	688680	海优新材	3,300	138,600.00	0.03
253	601665	齐鲁银行	24,000	138,480.00	0.03
254	688373	盟科药业	30,537	138,332.61	0.03
255	300700	岱勒新材	6,500	138,320.00	0.03
256	300860	锋尚文化	5,400	138,240.00	0.03
257	688031	星环科技	1,200	138,216.00	0.03
258	601991	大唐发电	19,500	138,060.00	0.03
259	002901	大博医疗	3,300	137,874.00	0.03
260	601717	中创智领	9,900	137,709.00	0.03

261	002174	游族网络	10,900	137,449.00	0.03
262	600323	瀚蓝环境	5,000	137,300.00	0.03
263	603668	天马科技	10,800	136,728.00	0.03
264	603508	思维列控	6,400	136,704.00	0.03
265	688339	亿华通	7,300	136,510.00	0.03
266	300098	高新兴	29,700	136,323.00	0.03
267	300627	华测导航	4,800	136,320.00	0.03
268	300404	博济医药	15,500	135,780.00	0.03
269	000880	潍柴重机	5,900	135,759.00	0.03
270	300801	泰和科技	4,200	135,660.00	0.03
271	300283	温州宏丰	6,600	135,630.00	0.03
272	688365	光云科技	8,600	135,622.00	0.03
273	300504	天邑股份	8,400	135,492.00	0.03
274	603980	吉华集团	20,400	135,456.00	0.03
275	002488	金固股份	15,200	135,432.00	0.03
276	300226	上海钢联	8,840	135,340.40	0.03
277	603933	睿能科技	6,000	135,300.00	0.03
278	603966	法兰泰克	16,600	135,290.00	0.03
279	301215	中汽股份	26,000	134,940.00	0.03
280	300839	博汇股份	11,500	134,665.00	0.03
281	301608	博实结	2,678	134,596.28	0.03
282	003029	吉大正元	8,400	134,568.00	0.03
283	001316	润贝航科	4,080	134,558.40	0.03
284	301201	诚达药业	3,700	134,532.00	0.03
285	688188	柏楚电子	1,260	134,442.00	0.03
286	603285	键邦股份	3,000	134,430.00	0.03
287	603803	瑞斯康达	11,400	133,836.00	0.03
288	002867	周大生	12,000	133,800.00	0.03
289	002287	奇正藏药	7,100	133,764.00	0.03
290	002020	京新药业	10,700	133,643.00	0.03
291	300768	迪普科技	9,700	133,569.00	0.03
292	300853	申昊科技	4,300	132,827.00	0.03
293	605178	时空科技	1,400	132,748.00	0.03
294	300797	钢研纳克	10,000	132,600.00	0.03
295	002391	长青股份	27,200	132,464.00	0.03
296	300662	科锐国际	7,800	132,444.00	0.03
297	000885	城发环境	11,000	132,330.00	0.03
298	603025	大豪科技	9,700	132,308.00	0.03
299	002640	跨境通	43,900	132,139.00	0.03
300	301019	宁波色母	7,400	131,942.00	0.03
301	300816	艾可蓝	1,800	131,760.00	0.03
302	301329	信音电子	5,400	131,166.00	0.03
303	603162	海通发展	14,600	130,962.00	0.03

304	301109	军信股份	10,500	130,830.00	0.03
305	688128	中国电研	5,500	130,570.00	0.03
306	001332	锡装股份	3,320	130,376.40	0.03
307	600822	上海物贸	17,100	130,131.00	0.03
308	301339	通行宝	12,700	129,921.00	0.03
309	605298	必得科技	2,500	129,875.00	0.03
310	002085	万丰奥威	11,700	129,753.00	0.03
311	600825	新华传媒	28,700	129,724.00	0.03
312	603013	亚普股份	8,200	129,478.00	0.03
313	301176	逸豪新材	1,900	129,200.00	0.03
314	603817	海峡环保	25,200	128,772.00	0.03
315	603345	安井食品	1,600	128,304.00	0.03
316	301428	世纪恒通	3,700	127,909.00	0.03
317	600166	福田汽车	43,900	127,749.00	0.03
318	603888	新华网	7,500	127,725.00	0.03
319	000987	越秀资本	16,300	127,466.00	0.03
320	301136	招标股份	11,600	127,368.00	0.03
321	688617	惠泰医疗	700	127,092.00	0.03
322	002946	新乳业	9,000	126,720.00	0.03
323	603579	荣泰健康	7,400	125,578.00	0.03
324	002673	西部证券	19,300	125,257.00	0.03
325	301190	善水科技	7,800	125,034.00	0.03
326	002824	和胜股份	3,600	124,488.00	0.03
327	301025	读客文化	16,000	124,160.00	0.03
328	002943	宇晶股份	2,800	123,844.00	0.03
329	600901	江苏金租	21,300	122,475.00	0.03
330	600230	沧州大化	9,400	122,388.00	0.03
331	300697	电工合金	7,700	116,655.00	0.02
332	301511	德福科技	800	115,080.00	0.02
333	002831	裕同科技	3,226	114,716.56	0.02
334	000887	中鼎股份	6,200	110,918.00	0.02
335	600642	申能股份	12,700	110,871.00	0.02
336	603939	益丰药房	6,100	109,678.00	0.02
337	001696	宗申动力	5,200	108,212.00	0.02
338	601799	星宇股份	1,100	99,682.00	0.02
339	600737	中粮糖业	8,000	98,640.00	0.02
340	600282	南钢股份	21,300	97,767.00	0.02
341	603568	伟明环保	6,300	96,894.00	0.02
342	688772	珠海冠宇	4,900	96,187.00	0.02
343	601000	唐山港	22,400	92,960.00	0.02
344	000750	国海证券	24,900	91,632.00	0.02
345	600535	天士力	6,900	91,287.00	0.02
346	600578	京能电力	13,900	89,655.00	0.02

347	000921	海信家电	3,200	87,424.00	0.02
348	000513	丽珠集团	3,000	86,670.00	0.02
349	002926	华西证券	10,500	85,785.00	0.02
350	603341	龙旗科技	2,000	84,980.00	0.02
351	000598	兴蓉环境	12,600	80,892.00	0.02
352	600038	中直股份	3,000	75,870.00	0.02
353	600004	白云机场	10,400	75,504.00	0.02
354	688521	芯原股份	200	74,228.00	0.02
355	601061	中信金属	6,700	72,159.00	0.01
356	600483	福能股份	7,000	71,330.00	0.01
357	002773	康弘药业	3,400	69,530.00	0.01
358	002508	老板电器	4,400	64,328.00	0.01
359	000883	湖北能源	14,800	63,936.00	0.01
360	603529	爱玛科技	3,100	60,481.00	0.01
361	600754	锦江酒店	3,300	59,367.00	0.01
362	600517	国网英大	12,300	57,564.00	0.01
363	000429	粤高速 A	4,100	55,965.00	0.01
364	600062	华润双鹤	3,200	51,328.00	0.01
365	300650	太龙股份	3,500	50,855.00	0.01
366	600906	财达证券	6,700	49,982.00	0.01
367	300718	长盛轴承	800	48,776.00	0.01
368	600098	广州发展	7,700	45,507.00	0.01
369	688475	萤石网络	1,200	32,820.00	0.01
370	002608	江苏国信	4,700	32,430.00	0.01
371	603688	石英股份	200	16,522.00	0.00
372	300442	润泽科技	100	8,307.00	0.00
373	601995	中金公司	200	7,230.00	0.00
374	603045	福达合金	100	7,139.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600549	厦门钨业	4,000,143.00	0.16
2	601872	招商轮船	3,987,356.00	0.16
3	601168	西部矿业	3,663,520.00	0.15
4	002532	天山铝业	3,190,743.00	0.13
5	603993	洛阳钼业	3,085,328.00	0.13
6	600096	云天化	2,950,462.00	0.12
7	603986	兆易创新	2,862,395.00	0.12
8	688111	金山办公	2,851,806.06	0.12
9	300750	宁德时代	2,846,546.00	0.12
10	002916	深南电路	2,793,844.00	0.12
11	600989	宝丰能源	2,771,191.00	0.11

12	002156	通富微电	2,764,008.00	0.11
13	002558	巨人网络	2,741,728.00	0.11
14	688002	睿创微纳	2,731,517.82	0.11
15	601600	中国铝业	2,680,884.00	0.11
16	000933	神火股份	2,630,814.00	0.11
17	300373	扬杰科技	2,576,870.00	0.11
18	301308	江波龙	2,528,815.00	0.10
19	600690	海尔智家	2,503,967.00	0.10
20	000792	盐湖股份	2,468,443.00	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	603993	洛阳钼业	6,012,437.03	0.25
2	601899	紫金矿业	5,109,568.00	0.21
3	601872	招商轮船	4,420,706.00	0.18
4	002916	深南电路	4,067,983.00	0.17
5	300750	宁德时代	3,796,571.00	0.16
6	601336	新华保险	3,612,933.00	0.15
7	601601	中国太保	3,578,255.00	0.15
8	600989	宝丰能源	3,569,599.00	0.15
9	603259	药明康德	3,482,423.00	0.14
10	001337	四川黄金	3,474,288.00	0.14
11	600183	生益科技	3,458,997.00	0.14
12	600549	厦门钨业	3,448,806.76	0.14
13	601319	中国人保	3,401,292.00	0.14
14	600690	海尔智家	3,390,887.00	0.14
15	300033	同花顺	3,254,182.00	0.13
16	600096	云天化	3,230,823.00	0.13
17	601169	北京银行	3,223,930.00	0.13
18	601117	中国化学	3,217,406.00	0.13
19	600926	杭州银行	3,206,833.00	0.13
20	300394	天孚通信	3,167,196.00	0.13

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	671,319,101.87
卖出股票收入（成交）总额	827,390,383.46

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	319,927,677.82	65.72
	其中：政策性金融债	30,499,421.92	6.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	132,666,349.04	27.25
7	可转债（可交换债）	59,903.45	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	452,653,930.31	92.98

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	092280069	22 华夏银行二级资本债 01	400,000	41,770,520.55	8.58
2	232480003	24 恒丰银行二级资本债 01	400,000	41,764,000.00	8.58
3	092280065	22 工行二级资本债 03A	400,000	41,712,721.10	8.57
4	312510001	25 交行 TLAC 非资本债 01A(BC)	400,000	40,207,539.73	8.26
5	092200008	22 农行二级资本债 02A	300,000	31,246,844.38	6.42

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 本报告期投资基金情况

7.11.1 投资政策及风险说明

无。

7.11.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

无。

7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，恒丰银行股份有限公司于 2025 年 9 月 12 日发布公告称公司于近日收到国家金融监督管理总局行政处罚决定书，因公司相关贷款、票据、理财等业务管理不审慎，监管数据报送不合规等，被处以 6150 万元罚款。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合基金管理人投资制度的规定。

7.12.2 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	126,983.82
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,891.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,875.56

7.12.4 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	118011	银微转债	59,903.45	0.01
---	--------	------	-----------	------

7.12.5 期末前十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 (%)
建信丰泽 债券 A	1,389	183,153.78	7,027,015.60	2.76	247,373,588.51	97.24
建信丰泽 债券 C	1,869	121,785.74	10,003.11	0.00	227,607,543.96	100.00
合计	3,258	147,949.09	7,037,018.71	1.46	474,981,132.47	98.54

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	建信丰泽债券 A	0.00	0.00
	建信丰泽债券 C	13,201.58	0.01
	合计	13,201.58	0.00

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	建信丰泽债券 A	建信丰泽债券 C
基金合同生效日 (2025 年 10 月 31 日) 基金份额总额	1, 152, 610, 754. 46	1, 266, 148, 436. 69
本报告期期初基金份额总额	1, 152, 610, 754. 46	1, 266, 148, 436. 69
本报告期基金总申购份额	1, 243, 509. 14	6, 740, 335. 68
减：本报告期基金总赎回份额	899, 453, 659. 49	1, 045, 271, 225. 30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	254, 400, 604. 11	227, 617, 547. 07

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.8 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

10.8.1 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 (%)	
招商证券	1	674,278,256.43	44.99	293,921.04	44.52	-
兴业证券	1	377,298,482.71	25.17	168,241.24	25.48	-
广发证券	1	310,225,421.35	20.70	138,333.44	20.95	-
中信证券	2	136,907,324.84	9.14	59,677.30	9.04	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

注：1、公司选择证券公司的标准

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 10 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，研究业务线最近两年未因发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；
- (6) 能及时为公司提供高质量的研究服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走势分析、个股分析报告及其他专门报告。

2、证券公司服务评价程序

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

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

10.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
招商证券	13,745,743.35	43.31	2,533,000,000.00	99.26	-	-	-	-

兴业证券	224,811.88	0.71	-	-	-	-	-	-
广发证券	17,768,406.98	55.98	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	19,000,000.00	0.74	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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	建信丰泽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	2026 年 1 月 28 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泽债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信丰泽债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信丰泽债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信丰泽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住所。

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