建信创业板交易型开放式指数证券投资基金
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：中国银河证券股份有限公司

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。

资产托管人中国银河证券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 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 6
3.3 其他指标 7

§4 管理人报告 7

4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
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 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
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 11

§5 托管人报告 11

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
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 11
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 11

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 11

6.1 资产负债表 11
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 16

§7 投资组合报告 35

7.1 期末基金资产组合情况 35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 36
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 37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 41

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 41
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 41
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 42
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 42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 42
7.12 投资组合报告附注 42
§8 基金份额持有人信息 43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 43
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 43
§9 开放式基金份额变动 44
§10 重大事件揭示 44
10.1 基金份额持有人大会决议 44
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 44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 44
10.4 基金投资策略的改变 44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 45
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 45
10.8 其他重大事件 46
§11 影响投资者决策的其他重要信息 46
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 46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 47
§12 备查文件目录 47
12.1 备查文件目录 47
12.2 存放地点 47
12.3 查阅方式 47

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	建信创业板 ETF
场内简称	创业板 ETF 建信
基金主代码	159956
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 2 月 6 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	40,978,674.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2018 年 3 月 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数，即创业板指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪创业板指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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	中国银河证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	罗新民
	联系电话	010-66228888	010-80927820
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	yhzq_tggz@chinastock.com.cn
客户服务电话		400-81-95533；010-66228000	95551；400-888-8888
传真		010-66228001	010-80928078
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	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101
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	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦
邮政编码		100033	100073

法定代表人	曲寅军	王晟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	22,321,134.05
本期利润	34,162,511.17
加权平均基金份额本期利润	0.7028
本期加权平均净值利润率	31.19%
本期基金份额净值增长率	35.88%
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	56,643,141.86
期末可供分配基金份额利润	1.3823
期末基金资产净值	112,999,214.65
期末基金份额净值	2.7575
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	175.75%

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

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	36.88%	2.23%	36.35%	2.24%	0.53%	-0.01%
过去六个月	35.88%	1.92%	35.58%	1.93%	0.30%	-0.01%
过去一年	102.64%	1.89%	101.70%	1.90%	0.94%	-0.01%
过去三年	104.05%	1.99%	96.06%	2.01%	7.99%	-0.02%
过去五年	34.05%	1.82%	24.89%	1.85%	9.16%	-0.03%
过去七年	219.38%	1.80%	187.31%	1.83%	32.07%	-0.03%
自基金合同生效起至今	175.75%	1.80%	157.23%	1.84%	18.52%	-0.04%

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



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		
葛鲁禹	本基金的基金经理	2022 年 12 月 26 日	-	9	葛鲁禹先生，硕士。2016 年 7 月毕业于北京大学金融学专业，同年 7 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理兼研究员、投资经理助理、投资经理等职务。2022 年 12 月 26 日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2022 年 12 月 26 日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 2 月 20 日起任建信上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 5 月 7 日起任建信上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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《建信创业板交易型开放式指数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

本基金为被动指数型基金，运用完全复制策略进行投资管理，始终保持较高仓位运作。基金跟踪标的指数为创业板指，是从深交所创业板股票中选取市值较大的 100 家公司组成，反映了深交所创业板市场的走势。

在报告期内，基金紧跟基准指数。创业板指在 2026 年一季度整体呈震荡走势，在 3 月初曾一度跌破 3200 点创下年内新低，但是在清明假期过后开启了连续上涨行情，即使 6 月初曾有所回调，但是 6 月下旬再度开始冲刺新高，站稳了 4300 点之上，使得报告期内的收益超过 30%。

在报告期内，本基金继续适当参与了深交所的新股申购，并通过适时卖出来兑现收益。虽然这可能一定程度上扩大跟踪误差，为指数追踪带来了一定的偏离度，但从报告期回顾来看，还是为投资者增厚了收益。同时由于舍入取整等原因，本基金申购赎回清单中股票权重与指数权重会存在些许差异。报告期内国证指数也对于创业板指数进行了上半年度的定期调整，这些也会带来跟踪误差及偏离度的放大。

本基金管理人在量化研究分析的基础上，严格遵照基金合同规定，根据指数公司相关信息及持仓申赎情况，对于组合进行适当调整，控制对于标的指数的跟踪误差，从而实现对于创业板指

的有效追踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 35.88%，波动率 1.92%，业绩比较基准收益率 35.58%，波动率 1.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前国内经济温和复苏，2026 年一季度 GDP 增速约 5.0%，经济保持韧性。工业生产、进出口等数据回暖，为上市公司盈利修复提供了基础。海外环境方面，扰动正在减弱，流动性趋于中性。市场对美联储加息的预期反复，美债收益率和美元指数波动，对全球科技股估值形成约束。不过，市场普遍认为，海外地缘与流动性冲击对市场的影响正趋于钝化，A 股和创业板的定价重心正回归国内基本面与产业景气度。宏观环境对市场构成支撑，但非全面牛市背景。指数更可能呈现“盈利驱动+结构性行情”，而非“流动性全面宽松”下的普涨。

2026 年 4 月，证监会发布改革意见，优化创业板上市准入、发行定价等制度，更好地服务于新质生产力。同时，创业板指“优胜劣汰”的成分股调整机制，确保了指数能持续吸纳优质企业，保持活力。创业板正逐步从“题材炒作”转向“业绩驱动”，由 AI 算力、新能源、创新药等“新质生产力”核心赛道支撑，中长期上行空间依然存在。创业板指已从逐渐升级为由细分龙头构成的“创新旗舰”集群。其战略性新兴产业权重超过九成，更是贡献了绝大部分的营业收入和净利润。核心行业高度受益于国家“新质生产力”战略，与 AI 算力、新能源等长期产业趋势深度绑定。2026 年一季度，创业板指公司营收与净利润同比增速均超 20%，经营现金流状况良好。市场预计 2026 年整体利润增速约 50%+，未来两年都将保持高速增长，高成长性为指数提供核心支撑。当前市盈率在历史长周期中看并不算高，其估值分位数也低于同期美股，甚至低于 2025 年 10 月，表明估值在盈利增长中得到了一定的消化。只要这些核心产业的真实需求能够延续，高研发投入能转化为持续的利润增长，创业板指中长期仍有上行空间。

本管理人将严格遵守基金合同，继续采用复制策略，紧密控制跟踪误差，实现对于创业板指的有效追踪。

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，本基金托管人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，对本基金的基金资产净值计算以及利润分配等方面进行了复核审查，对本基金的投资范围、投资比例、投资限制等方面进行了监督，未发现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

本报告期内，本基金托管人依法复核建信基金管理有限责任公司编制和披露的 2026 年度中期报告中财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、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：建信创业板交易型开放式指数证券投资基金

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	441,152.05	578,825.73
结算备付金		6,092.28	2,512.36
存出保证金		3,303.35	4,398.99
交易性金融资产	6.4.7.2	112,591,024.91	108,934,723.50
其中：股票投资		112,591,024.91	108,934,723.50
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		86,926.55	106,103.58
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		113,128,499.14	109,626,564.16
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		-	-
应付管理人报酬		47,418.90	48,029.70
应付托管费		9,483.81	9,605.97
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	72,381.78	23,940.28
负债合计		129,284.49	81,575.95
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	40,978,674.00	53,978,674.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	72,020,540.65	55,566,314.21
净资产合计		112,999,214.65	109,544,988.21
负债和净资产总计		113,128,499.14	109,626,564.16

注:报告截止日 2026 年 06 月 30 日,基金份额净值人民币 2.7575 元,基金份额总额 40,978,674.00 份。

6.2 利润表

会计主体：建信创业板交易型开放式指数证券投资基金

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		34,555,732.90	3,271,268.72
1.利息收入		2,290.41	4,278.46
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,290.41	4,278.46
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）		22,711,169.37	725,426.54
其中：股票投资收益	6.4.7.14	22,045,900.15	-511,744.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	665,269.22	1,237,170.94
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	11,841,377.12	2,541,001.92
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	896.00	561.80
减：二、营业总支出		393,221.73	454,995.58
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	270,656.19	296,532.45
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	54,131.25	59,306.53
3．销售服务费		-	-
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		-	-
8．其他费用	6.4.7.23	68,434.29	99,156.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,162,511.17	2,816,273.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,162,511.17	2,816,273.14
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		34,162,511.17	2,816,273.14

6.3 净资产变动表

会计主体：建信创业板交易型开放式指数证券投资基金

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	53,978,674.00	-	55,566,314.21	109,544,988.21
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	53,978,674.00	-	55,566,314.21	109,544,988.21
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-13,000,000.00	-	16,454,226.44	3,454,226.44
（一）、综合收益总额	-	-	34,162,511.17	34,162,511.17
（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）	-13,000,000.00	-	-17,708,284.73	-30,708,284.73
其中：1.基金申购款	12,000,000.00	-	14,972,168.64	26,972,168.64
2.基金赎回款	-25,000,000.00	-	-32,680,453.37	-57,680,453.37
（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	40,978,674.00	-	72,020,540.65	112,999,214.65

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	95,978,674.00	-	32,705,347.34	128,684,021.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	95,978,674.00	-	32,705,347.34	128,684,021.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,000,000.00	-	121,944.91	-4,878,055.09
（一）、综合收益总额	-	-	2,816,273.14	2,816,273.14

（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）	-5,000,000.00	-	-2,694,328.23	-7,694,328.23
其中：1.基金申购款	12,000,000.00	-	3,265,317.44	15,265,317.44
2.基金赎回款	-17,000,000.00	-	-5,959,645.67	-22,959,645.67
（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	90,978,674.00	-	32,827,292.25	123,805,966.25

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	莫红	丁颖
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信创业板交易型开放式指数证券投资基金（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[2017]1331 号《关于准予建信创业板交易型开放式指数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《建信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 357,952,000.00 元（含募集股票市值），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（2018）第 0068 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 357,978,674.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 26,674.00 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河证券股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2018]90 号核准，本基金于 2018 年 3 月 7 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围为标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、权证、股指期货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）。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为创业板指数收益率。

本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司以本基金为目标 ETF，募集成立了建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“建信创业板 ETF 联接基金”）。建信创业板 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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第 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的公告》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、税务总局公告 2025 年第 11 号文《财政部　税务总局关于黄金有关税收政策的公告》的规定，会员单位或客户通过上海黄金交易所、上海期货交易所交易标准黄金，卖出方会员单位或客户销售标准黄金时，免征增值税；

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	441,152.05
等于：本金	441,013.40
加：应计利息	138.65
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	441,152.05

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		68,094,223.10	-	112,591,024.91	44,496,801.81
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	68,094,223.10	-	112,591,024.91	44,496,801.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,947.49
其中：交易所市场	3,947.49
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	68,434.29
合计	72,381.78

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,978,674.00	53,978,674.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-25,000,000.00	-25,000,000.00
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	40,978,674.00	40,978,674.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	48,551,248.79	7,015,065.42	55,566,314.21
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	48,551,248.79	7,015,065.42	55,566,314.21
本期利润	22,321,134.05	11,841,377.12	34,162,511.17
本期基金份额交易产生的变动数	-14,229,240.98	-3,479,043.75	-17,708,284.73
其中：基金申购款	12,708,772.38	2,263,396.26	14,972,168.64
基金赎回款	-26,938,013.36	-5,742,440.01	-32,680,453.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,643,141.86	15,377,398.79	72,020,540.65

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	2,270.55
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	13.53
其他	6.33
合计	2,290.41

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	2,684,585.51
股票投资收益——赎回差价收入	19,361,314.64
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	22,045,900.15

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	10,686,449.03
减：卖出股票成本总额	7,990,867.66
减：交易费用	10,995.86
买卖股票差价收入	2,684,585.51

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	57,680,453.37
减：现金支付赎回款总额	50,041.37
减：赎回股票成本总额	38,269,097.36
减：交易费用	-
赎回差价收入	19,361,314.64

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 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

无。

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	665,269.22
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	665,269.22

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	11,841,377.12
股票投资	11,841,377.12
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	-
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	11,841,377.12

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	-
替代损益	896.00
合计	896.00

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	8,926.92
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	68,434.29

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、基金销售机构
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	基金托管人、基金销售机构
建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“建信创业板 ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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	270,656.19	296,532.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,751.01	5,581.83
应支付基金管理人的净管理费	257,905.18	290,950.62

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 0.50%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×0.50%/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	54,131.25	59,306.53

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	29,967,900.00	73.13	45,100,000.00	83.55

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

无。

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
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新发未上市	18.38	16.78	39	716.82	654.42	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新发未上市	26.66	50.96	69	1,839.54	3,516.24	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新发未上市	13.91	32.47	132	1,836.12	4,286.04	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新发未上市	46.08	463.33	166	7,649.28	76,912.78	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新发未上市	24.68	86.80	69	1,702.92	5,989.20	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对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	441,152.05	-	-	-	441,152.05
结算备付金	6,092.28	-	-	-	6,092.28
存出保证金	3,303.35	-	-	-	3,303.35
交易性金融资产	-	-	-	112,591,024.91	112,591,024.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	86,926.55	86,926.55
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	450,547.68	-	-	112,677,951.46	113,128,499.14
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	47,418.90	47,418.90
应付托管费	-	-	-	9,483.81	9,483.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	72,381.78	72,381.78
负债总计	-	-	-	129,284.49	129,284.49
利率敏感度缺口	450,547.68	-	-	112,548,666.97	112,999,214.65
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	578,825.73	-	-	-	578,825.73
结算备付金	2,512.36	-	-	-	2,512.36
存出保证金	4,398.99	-	-	-	4,398.99
交易性金融资产	-	-	-	108,934,723.50	108,934,723.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	106,103.58	106,103.58
债权投资	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	585,737.08	-	-	109,040,827.08	109,626,564.16
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	48,029.70	48,029.70
应付托管费	-	-	-	9,605.97	9,605.97
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	23,940.28	23,940.28
负债总计	-	-	-	81,575.95	81,575.95
利率敏感度缺口	585,737.08	-	-	108,959,251.13	109,544,988.21

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	112,591,024.91	99.64	108,934,723.50	99.44
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	112,591,024.91	99.64	108,934,723.50	99.44

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%	5,598,374.59	5,410,639.82
	业绩比较基准下降 5%	-5,598,374.59	-5,410,639.82

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	112,499,666.23	108,829,577.40
第二层次	-	-
第三层次	91,358.68	105,146.10
合计	112,591,024.91	108,934,723.50

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	112,591,024.91	99.52
	其中：股票	112,591,024.91	99.52
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	447,244.33	0.40
8	其他各项资产	90,229.90	0.08
9	合计	113,128,499.14	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,015,352.80	0.90
B	采矿业	-	-
C	制造业	97,126,146.25	85.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,742,774.00	1.54
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,462,919.10	3.95
J	金融业	5,421,058.52	4.80
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	733,408.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	1,082,233.50	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	545,829.06	0.48
R	文化、体育和娱乐业	367,376.20	0.33
S	综合	-	-
	合计	112,497,097.43	99.56

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	-	-
C	制造业	93,927.48	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	93,927.48	0.08

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	300308	中际旭创	12,892	16,372,840.00	14.49
2	300750	宁德时代	38,800	15,248,788.00	13.49
3	300502	新易盛	18,560	11,265,920.00	9.97
4	300059	东方财富	190,614	3,884,713.32	3.44
5	300274	阳光电源	21,981	3,495,418.62	3.09
6	300476	胜宏科技	9,100	3,152,513.00	2.79

7	300408	三环集团	18,582	3,101,335.80	2.74
8	300394	天孚通信	9,250	2,799,790.00	2.48
9	301308	江波龙	3,500	2,463,300.00	2.18
10	300604	长川科技	6,700	2,287,514.00	2.02
11	300124	汇川技术	29,811	1,977,363.63	1.75
12	300857	协创数据	4,760	1,617,924.00	1.43
13	300433	蓝思科技	28,798	1,545,300.68	1.37
14	300475	香农芯创	5,000	1,500,000.00	1.33
15	300136	信维通信	11,900	1,419,075.00	1.26
16	300014	亿纬锂能	21,244	1,381,497.32	1.22
17	300223	北京君正	5,300	1,319,170.00	1.17
18	300285	国瓷材料	12,550	1,294,909.00	1.15
19	300760	迈瑞医疗	9,000	1,222,470.00	1.08
20	300666	江丰电子	3,100	1,142,660.00	1.01
21	300054	鼎龙股份	10,300	1,091,491.00	0.97
22	300033	同花顺	4,260	1,026,660.00	0.91
23	300498	温氏股份	82,415	1,015,352.80	0.90
24	300548	长芯博创	3,400	945,200.00	0.84
25	300757	罗博特科	1,500	928,500.00	0.82
26	300567	精测电子	2,900	921,040.00	0.82
27	300661	圣邦股份	6,134	880,106.32	0.78
28	300442	润泽科技	10,300	855,621.00	0.76
29	300395	菲利华	6,300	842,499.00	0.75
30	300346	南大光电	8,720	807,908.00	0.71
31	300390	天华新能	8,500	794,835.00	0.70
32	301526	国际复材	16,500	770,055.00	0.68
33	300058	蓝色光标	53,300	733,408.00	0.65
34	300620	光库科技	1,900	718,580.00	0.64
35	300672	国科微	2,300	678,500.00	0.60
36	300373	扬杰科技	4,300	676,089.00	0.60
37	300037	新宙邦	7,200	668,520.00	0.59
38	300450	先导智能	16,276	662,758.72	0.59
39	300751	迈为股份	2,276	642,878.96	0.57
40	301217	铜冠铜箔	3,500	577,745.00	0.51
41	300782	卓胜微	5,090	557,762.20	0.49
42	301377	鼎泰高科	1,000	550,900.00	0.49
43	300316	晶盛机电	9,060	547,224.00	0.48
44	300015	爱尔眼科	66,081	545,829.06	0.48
45	300418	昆仑万维	13,100	528,716.00	0.47
46	300803	指南针	5,560	509,685.20	0.45
47	301358	湖南裕能	6,600	500,742.00	0.44
48	300339	润和软件	11,300	435,163.00	0.39
49	300017	网宿科技	32,400	421,524.00	0.37

50	300759	康龙化成	14,550	420,931.50	0.37
51	300458	全志科技	10,560	416,697.60	0.37
52	300001	特锐德	10,700	404,781.00	0.36
53	301611	珂玛科技	2,200	396,154.00	0.35
54	301236	软通动力	9,300	394,785.00	0.35
55	300115	长盈精密	14,000	391,160.00	0.35
56	300207	欣旺达	20,100	381,699.00	0.34
57	300347	泰格医药	7,800	374,400.00	0.33
58	301200	大族数控	1,000	360,650.00	0.32
59	301269	华大九天	3,000	358,260.00	0.32
60	300454	深信服	3,705	356,421.00	0.32
61	300024	机器人	18,000	347,940.00	0.31
62	300866	安克创新	3,280	342,760.00	0.30
63	301536	星宸科技	2,600	334,646.00	0.30
64	300496	中科创达	5,200	321,308.00	0.28
65	300432	富临精工	15,600	313,404.00	0.28
66	300748	金力永磁	10,016	308,993.60	0.27
67	300474	景嘉微	5,100	308,448.00	0.27
68	300763	锦浪科技	3,275	295,896.25	0.26
69	300073	当升科技	6,000	288,240.00	0.26
70	300012	华测检测	20,700	286,902.00	0.25
71	300724	捷佳伟创	4,000	282,400.00	0.25
72	300919	中伟新材	6,247	273,306.25	0.24
73	300953	震裕科技	2,000	267,400.00	0.24
74	300383	光环新网	21,200	263,728.00	0.23
75	300677	英科医疗	6,300	246,771.00	0.22
76	300972	万辰集团	1,400	242,774.00	0.21
77	302132	中航成飞	4,100	239,112.00	0.21
78	300628	亿联网络	7,070	239,107.40	0.21
79	300699	光威复材	8,020	229,773.00	0.20
80	300251	光线传媒	20,700	229,563.00	0.20
81	300255	常山药业	9,800	229,516.00	0.20
82	300487	蓝晓科技	3,850	226,572.50	0.20
83	300832	新产业	5,300	222,600.00	0.20
84	300002	神州泰岳	27,900	217,899.00	0.19
85	300627	华测导航	7,460	211,864.00	0.19
86	300003	乐普医疗	17,506	207,446.10	0.18
87	301550	斯菱智驱	2,200	201,146.00	0.18
88	300122	智飞生物	16,650	194,638.50	0.17
89	300999	金龙鱼	8,300	193,058.00	0.17
90	300253	卫宁健康	26,140	175,922.20	0.16
91	300896	爱美客	1,960	170,912.00	0.15
92	301165	锐捷网络	2,080	167,336.00	0.15

93	300765	石药创新	5,500	149,765.00	0.13
94	300144	宋城演艺	23,720	137,813.20	0.12
95	300413	芒果超媒	9,130	133,571.90	0.12
96	300718	长盛轴承	2,000	121,940.00	0.11
97	300979	华利集团	2,800	83,300.00	0.07
98	301301	川宁生物	9,500	75,430.00	0.07
99	300888	稳健医疗	2,620	73,333.80	0.06
100	301498	乖宝宠物	1,400	56,826.00	0.05

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	301666	大普微	166	76,912.78	0.07
2	301696	三瑞智能	69	5,989.20	0.01
3	301599	理奇智能	132	4,286.04	0.00
4	301513	尚水智能	69	3,516.24	0.00
5	001369	双欣材料	190	2,568.80	0.00
6	001312	福恩股份	39	654.42	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	300475	香农芯创	1,040,183.00	0.95
2	300757	罗博特科	1,026,186.10	0.94
3	300394	天孚通信	965,945.00	0.88
4	300390	天华新能	909,414.00	0.83
5	301308	江波龙	822,301.00	0.75
6	300672	国科微	732,433.00	0.67
7	300620	光库科技	675,374.00	0.62
8	301217	铜冠铜箔	555,565.00	0.51
9	301526	国际复材	517,921.00	0.47
10	301377	鼎泰高科	516,240.00	0.47
11	300953	震裕科技	332,721.00	0.30
12	301550	斯菱智驱	250,316.00	0.23
13	300750	宁德时代	173,205.00	0.16
14	300502	新易盛	171,739.00	0.16
15	300751	迈为股份	126,571.00	0.12
16	300014	亿纬锂能	125,871.00	0.11
17	300604	长川科技	109,304.00	0.10
18	300308	中际旭创	103,999.00	0.09
19	301611	珂玛科技	100,509.00	0.09
20	301358	湖南裕能	90,952.00	0.08

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	300308	中际旭创	1,069,935.00	0.98
2	300394	天孚通信	999,689.00	0.91
3	300750	宁德时代	880,567.00	0.80
4	300502	新易盛	822,840.00	0.75
5	300476	胜宏科技	325,335.00	0.30
6	300142	沃森生物	323,627.80	0.30
7	300059	东方财富	277,789.00	0.25
8	300274	阳光电源	271,607.00	0.25
9	300679	电连技术	263,162.00	0.24
10	300558	贝达药业	233,244.00	0.21
11	300408	三环集团	176,931.00	0.16
12	300146	汤臣倍健	167,478.00	0.15
13	300100	双林股份	157,250.00	0.14
14	300760	迈瑞医疗	156,205.00	0.14
15	300676	华大基因	155,671.00	0.14
16	300601	康泰生物	134,891.36	0.12
17	300735	光弘科技	131,528.00	0.12
18	300529	健帆生物	123,298.60	0.11
19	300124	汇川技术	117,760.00	0.11
20	300757	罗博特科	115,786.00	0.11

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	11,130,485.31
卖出股票收入（成交）总额	10,686,449.03

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

无。

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	3,303.35
2	应收清算款	86,926.55
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,229.90

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	76,912.78	0.07	新发未上市
2	301696	三瑞智能	5,989.20	0.01	新发未上市
3	301599	理奇智能	4,286.04	0.00	新发未上市
4	301513	尚水智能	3,516.24	0.00	新发未上市

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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
816	50,218.96	36,434,150.00	88.91	4,544,524.00	11.09

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	29,967,900.00	73.13

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截至本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

基金合同生效日（2018 年 2 月 6 日）基金份额总额	357,978,674.00
本报告期期初基金份额总额	53,978,674.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	25,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	40,978,674.00

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。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：自 2026 年 2 月 10 日起，戴景平不再担任中国银河证券股份有限公司托管总部副总经理职务。

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

报告期内本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及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

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

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(%)	
方正证券	1	21,737,181.13	100.00	4,258.27	100.00	-
银河证券	3	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 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(%)
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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	关于调整建信创业板交易型开放式指数证券投资基金主流动性服务商为一般流动性服务商的公告	指定报刊和/或公司网站	2026 年 4 月 22 日
2	关于新增申万宏源证券有限公司等为建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的申购赎回代理券商的公告	指定报刊和/或公司网站	2026 年 1 月 29 日
3	关于建信创业板交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定报刊和/或公司网站	2026 年 1 月 28 日
4	关于建信创业板交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	指定报刊和/或公司网站	2026 年 1 月 27 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日	45,100,000.00	900,000.00	16,032,100.00	29,967,900.00	73.13
产品特有风险							

注：本基金本报告期申购、赎回份额中包含了买入、卖出份额。

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创业板交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；

2、《建信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《建信创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

4、《建信创业板交易型开放式指数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