建信北证50成份指数型发起式证券投资基金
2026年第3季度报告

2026年9月30日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：国信证券股份有限公司

报告送出日期：2026年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信北证50成份指数发起
基金主代码	024828
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年7月29日
报告期末基金份额总额	47,926,320.09份
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	在正常市场情况下，本基金追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。 1、股票投资策略 本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。 2、存托凭证的投资策略 本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然参与存托凭证投资。 3、港股通标的股票投资策略 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。考虑到香港股票市场与A股股票市

	场的差异，对于港股通标的股票，本基金除按照上述“自下而上”的个股精选策略，还将结合公司基本面、国内经济和相关行业发展前景、香港市场资金面和投资者行为，以及世界主要经济体经济发展前景和货币政策、主流资本市场对投资者的相对吸引力等因素，精选符合本基金投资目标的港股通标的股票。基金资产并非必然参与港股通标的股票投资。 4、债券投资策略 本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。 5、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。 6、可转债及可交换债投资策略 本基金可投资于可转债债券、分离交易可转债、可交换债券以及其他含权债券等，该类债券赋予债券投资者某种期权，比普通债券投资更加灵活。 7、股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金参与股指期货的交易策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。 8、股票期权投资策略 基金管理人在进行股票期权投资前将建立股票期权投资决策小组，负责股票期权投资管理的相关事项。本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。 9、融资及转融通证券出借业务投资策略 本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。 10、国债期货投资策略 基金管理人在进行国债期货投资前将建立国债期货投资决策小组，负责国债期货投资管理的相关事项。 11、信用衍生品投资策略 本基金投资信用衍生品，按照风险管理原则，以风险对冲为目的，对所投资的资产组合进行风险管理。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，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。	
业绩比较基准	北证50成份指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%	
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，理论上预期风险和预期收益高于债券型证券投资基金和货币市场基金。本基金为指数基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，理论上具有与标的指数，以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。 本基金投资北京证券交易所股票，将承担因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金如投资港股通标的股票的，需承担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。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	国信证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信北证50成份指数发起A	建信北证50成份指数发起C
下属分级基金的交易代码	024828	024829
报告期末下属分级基金的份额总额	23,523,527.07份	24,402,793.02份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026年7月1日-2026年9月30日）	
	建信北证50成份指数发起A	建信北证50成份指数发起C
1.本期已实现收益	-1,523,993.31	-1,563,172.85
2.本期利润	-3,399,762.79	-3,611,299.72
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1487	-0.1489
4.期末基金资产净值	16,926,053.21	17,476,885.65
5.期末基金份额净值	0.7195	0.7162

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信北证50成份指数发起A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④

				④		
过去三个月	-17.40%	1.88%	-16.08%	1.88%	-1.32%	0.00%
过去六个月	-16.62%	1.90%	-15.84%	1.90%	-0.78%	0.00%
过去一年	-31.53%	1.82%	-30.51%	1.82%	-1.02%	0.00%
自基金合同生效起至今	-28.05%	1.78%	-27.16%	1.81%	-0.89%	-0.03%

建信北证 50 成份指数发起 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-17.48%	1.88%	-16.08%	1.88%	-1.40%	0.00%
过去六个月	-16.78%	1.90%	-15.84%	1.90%	-0.94%	0.00%
过去一年	-31.80%	1.82%	-30.51%	1.82%	-1.29%	0.00%
自基金合同生效起至今	-28.38%	1.78%	-27.16%	1.81%	-1.22%	-0.03%

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

注：本基金基金合同于 2025 年 7 月 29 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘明辉	本基金的基金经理	2025 年 7 月 29 日	-	11	刘明辉先生，硕士。2015 年 7 月毕业于北京大学应用统计专业，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、研究员兼投资经理助理、投资经理、基金经理职务。2021 年 10 月 27 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2022 年 10 月 17 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；2022 年 12 月 23 日起任建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 7 月 29 日起任建信北证 50 成份指数型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 12 月 24 日起任建信恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 12 月 30 日起任建信创业板综合

					增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2026 年 2 月 11 日起任建信恒生生物科技指数型证券投资基金的基金经理。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 2 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金是跟踪北证 50 指数的被动指数基金。北证 50 指数由北交所规模大、流动性好的具代表性的 50 支上市公司股票构成。2026 年三季度北证 50 整体低位震荡修复，行情呈现明显的结构性特征。经历前期持续调整后，指数估值回归合理区间，具备修复基础，但整体市场增量资金相对有限，叠加板块个股业绩分化、市场资金偏好大盘核心赛道，指数反弹力度偏弱，整体以区间震荡磨底为主，阶段性出现超跌修复行情，但持续性不足，整体表现弱于主流宽基指数。

本基金在报告期内运行稳健。投资方面，本基金亿被动复制指数成分股的跟踪策略，紧密贴合北证50指数走势，持续跟踪指数成分股调整、权重变动等动态，及时调整持仓结构、优化个股配比，精准贴合指数编制规则与运行节奏。报告期内严格把控组合运作风险，保持了较低的跟踪误差，有效实现紧密跟踪标的指数的运作目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金A净值增长率-17.40%，波动率1.88%，业绩比较基准收益率-16.08%，波动率1.88%。本报告期本基金C净值增长率-17.48%，波动率1.88%，业绩比较基准收益率-16.08%，波动率1.88%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	32,547,788.47	94.18
	其中：股票	32,547,788.47	94.18
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	1,973,467.76	5.71
8	其他资产	37,892.20	0.11
9	合计	34,559,148.43	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	591,728.00	1.72
C	制造业	28,587,627.04	83.10
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	488,424.00	1.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,880,009.43	8.37
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	32,547,788.47	94.61

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	920045	蘅东光	6,157	3,158,541.00	9.18
2	920438	戈碧迦	22,200	2,450,880.00	7.12
3	920185	贝特瑞	86,718	1,790,726.70	5.21
4	920982	锦波生物	11,662	1,654,604.56	4.81
5	920599	同力股份	70,400	1,223,552.00	3.56
6	920493	并行科技	9,251	987,729.27	2.87
7	920077	吉林碳谷	74,600	983,228.00	2.86
8	920808	曙光数创	15,200	865,336.00	2.52
9	920809	安达科技	121,600	848,768.00	2.47
10	920368	连城数控	35,800	811,944.00	2.36

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投

资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

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

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	37,892.20
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	37,892.20

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信北证50成份指数发起A	建信北证50成份指数发起C
报告期期初基金份额总额	22,276,956.82	24,409,003.46
报告期期间基金总申购份额	2,550,357.95	8,373,254.47
减:报告期期间基金总赎回份额	1,303,787.70	8,379,464.91

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	23,523,527.07	24,402,793.02

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

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,003,111.42
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,003,111.42
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	20.87

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,003,111.42	20.87	10,003,111.42	20.87	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,003,111.42	20.87	10,003,111.42	20.87	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	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（%）
机构	1	2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日	10,003,111.42	-	-	10,003,111.42	20.87
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信北证 50 成份指数型发起式证券投资基金设立的文件；

2、《建信北证 50 成份指数型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《建信北证 50 成份指数型发起式证券投资基金招募说明书》；

4、《建信北证 50 成份指数型发起式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。

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

10.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2026 年 10 月 26 日