

建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF） 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 26 日

§1 重要提示

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

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

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信福泽安泰混合（FOF）
基金主代码	005217
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 11 月 2 日
报告期末基金份额总额	758,666,379.48 份
投资目标	本基金以多元资产配置为核心驱动力，通过优化配置各类资产实现投资组合的风险分散和长期稳健增长。同时本基金通过精选各类基金并构造分散的基金组合，力求实现投资组合的稳健超额收益和风险再分散。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的基金筛选。具体由大类资产配置策略、基金筛选策略、股票/债券投资策略、资产支持证券投资策略四部分组成。
业绩比较基准	中债-综合财富（总值）指数收益率*75%+中证红利指数收益率*10%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率*5%+标普 500 指数（S&P 500 Index）收益率*5%+活期存款基准利率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金及货币型基金中基金。同时，本基金为目标风险系列基金中基金中风险收益特征相对稳健的基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司

基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信福泽安泰混合 (FOF) A	建信福泽安泰混合 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	005217	015442
报告期末下属分级基金的份额总额	481, 219, 737. 05 份	277, 446, 642. 43 份

注：自 2026 年 7 月 27 日起，本基金的业绩比较基准由“中债综合财富指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*20%”变更为“中债-综合财富（总值）指数收益率*75%+中证红利指数收益率*10%+上海黄金交易所 Au99. 99 现货实盘合约价格收益率*5%+标普 500 指数（S&P 500 Index）收益率*5%+活期存款基准利率*5%”。

§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）	
	建信福泽安泰混合 (FOF) A	建信福泽安泰混合 (FOF) C
1. 本期已实现收益	-1, 189, 592. 83	-1, 126, 929. 63
2. 本期利润	10, 687, 472. 03	7, 610, 430. 28
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0210	0. 0228
4. 期末基金资产净值	625, 306, 223. 66	358, 195, 202. 89
5. 期末基金份额净值	1. 2994	1. 2910

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

建信福泽安泰混合 (FOF) 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④	①—③	②—④
过去三个月	1. 55%	0. 17%	-0. 67%	0. 24%	2. 22%	-0. 07%
过去六个月	0. 54%	0. 17%	2. 98%	0. 26%	-2. 44%	-0. 09%
过去一年	0. 34%	0. 27%	3. 73%	0. 24%	-3. 39%	0. 03%
过去三年	6. 00%	0. 33%	17. 49%	0. 23%	-11. 49%	0. 10%
过去五年	-0. 08%	0. 32%	19. 11%	0. 22%	-19. 19%	0. 10%
过去七年	24. 21%	0. 37%	34. 95%	0. 23%	-10. 74%	0. 14%
自基金合同生效起至今	29. 94%	0. 36%	45. 23%	0. 24%	-15. 29%	0. 12%

建信福泽安泰混合(FOF) 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	1.51%	0.17%	-0.67%	0.24%	2.18%	-0.07%
过去六个月	0.47%	0.17%	2.98%	0.26%	-2.51%	-0.09%
过去一年	0.02%	0.27%	3.73%	0.24%	-3.71%	0.03%
过去三年	5.53%	0.33%	17.49%	0.23%	-11.96%	0.10%
自基金合同生效起至今	2.40%	0.32%	20.32%	0.22%	-17.92%	0.10%

注：自 2026 年 7 月 27 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合财富指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*20%”变更为“中债-综合财富(总值)指数收益率*75%+中证红利指数收益率*10%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率*5%+标普 500 指数(S&P 500 Index)收益率*5%+活期存款基准利率*5%”。业绩比较基准设定的原因

（1）基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别，本基金主要投资于权益类资产、商品类资产、固定收益类资产及现金类资产等，相应选取与之匹配的 A 股指数、境外股票指数、商品指数、债券指数、活期存款基准利率作为基准要素。同时基于投资证券投资基金占基金资产的比例不低于 80%，权益类资产（包括股票、股票型基金、混合型基金）的战略配置比例为 20%，固定收益类资产（包括债券、债券型基金、货币市场基金等）的战略配置比例 80%等投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将固定收益类资产、权益类资产、商品类资产、现金类资产所对应的基准要素权重分别设置为 75%、15%、5%与 5%，其中将权益类资产中的境内权益类资产、境外权益类资产所对应的基准要素权重分别设置为 10%与 5%。

（2）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的固定收益类资产投资方面，本基金从基金分类、长期业绩、归因分析、基金经理和基金管理人五大维度对全市场基金进行综合评判和打分，甄选出具有业绩可持续性的优秀固定收益类基金作为投资标的；在进行债券投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略和资产支持证券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，本基金选取中债-综合财富（总值）指数作为固定收益类资产的业绩比较基准要素。

中债-综合财富（总值）指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，是具有代表性的债券市场指数，适合作为本基金固定收益类资产的业绩比较基准要素。

（3）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的权益类资产投资方面，本基金从基金分类、长期业绩、归因分析、基金经理和基金管理人五大维度对全市场基金进行综合评判和打

分，甄选出具有业绩可持续性的优秀权益类基金作为投资标的；在进行股票投资时，本基金将结合定性分析和定量分析，充分发挥“自下而上”的主动选股能力，选择具有长期持续增长能力的公司。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及指数盘别/市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，本基金选取中证红利指数和标普 500 指数（S&P 500 Index）分别作为境内权益类资产和境外权益类资产的业绩比较基准要素。

中证红利指数选取 100 只现金股息率高、分红较为稳定，并具有一定规模及流动性的上市公司证券作为指数样本，以反映高股息率上市公司证券的整体表现，适合作为本基金境内权益类资产的业绩比较基准要素。

标普 500 指数（S&P 500 Index）由美国市场市值较大、流动性较好的 500 只代表性股票构成，反映美国市场大中型上市公司证券的整体表现。指数样本覆盖面广、行业分布均衡，适合作为本基金境外权益类资产的业绩比较基准要素。

（4）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金可适度配置商品基金（包括但不限于商品期货基金和黄金 ETF）等商品类资产。综合考虑基准要素与产品定位和投资风格的匹配度，本基金选取上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格作为商品类资产的业绩比较基准要素。

上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约为在上海黄金交易所交易，代表黄金资产的现货合约，适合作为本基金商品类资产的业绩比较基准要素。

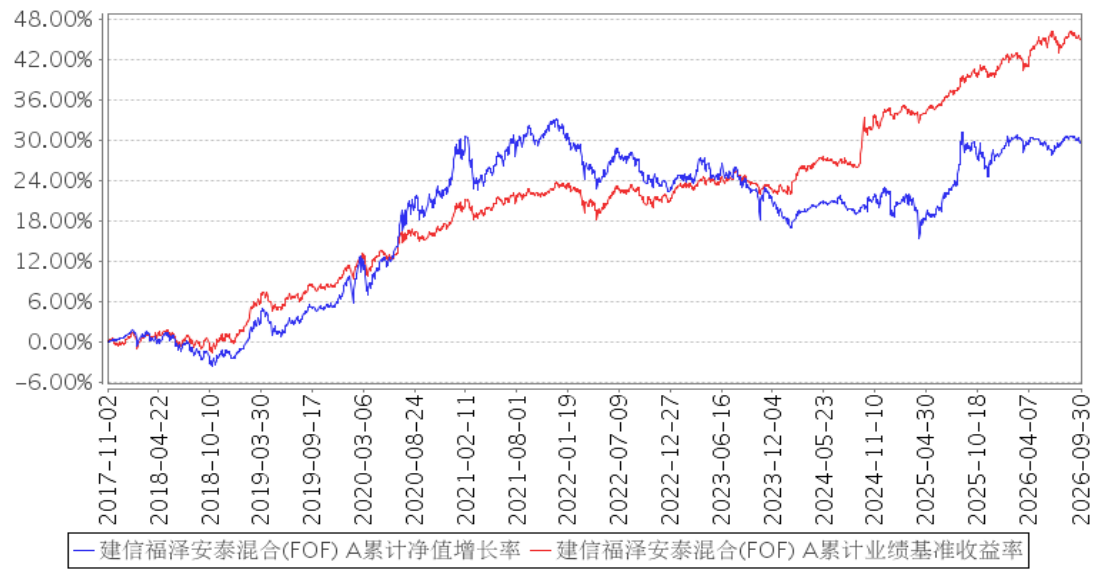
（5）活期存款基准利率具有较强的权威性和市场影响力，适合作为本基金现金类资产部分的业绩比较基准要素。

综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。

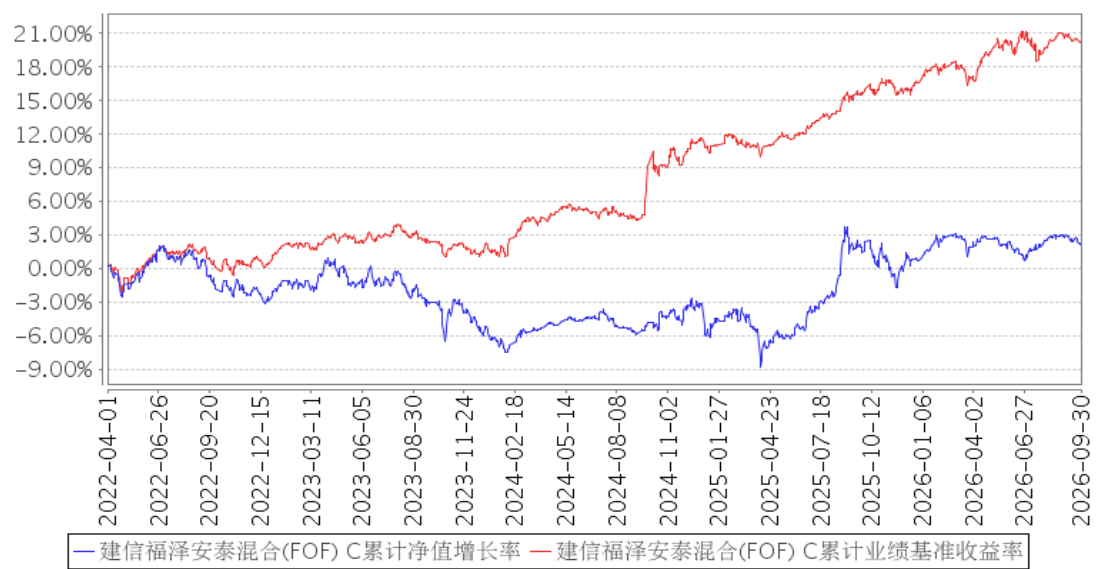
基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

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

建信福泽安泰混合(FOF) 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



建信福泽安泰混合(FOF) 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：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王志鹏	本基金的基金经理	2023 年 8 月 31 日	—	13	王志鹏先生，硕士。曾任博时基金管理有限公司研究员、华夏基金管理有限公司风

					险经理、建信资本管理有限责任公司风险合规部风险经理、资本管理一部副总裁、业务总监、资本管理部投资经理等职务。2022 年 12 月加入建信基金，现任数量投资部基金经理。2023 年 8 月 31 日起任建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2023 年 8 月 31 日起任建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2023 年 8 月 31 日起任建信龙祥稳进 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2023 年 8 月 31 日起任建信添福悠享稳健养老目标一年持有期债券型基金中基金（FOF）的基金经理；2026 年 2 月 13 日起任建信泓泰多元配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理。
姜华	资产配置与投顾业务部高级基金经理, 本基金的基金经理	2019 年 1 月 10 日	-	18	姜华先生, 资产配置与投顾业务部高级基金经理, 硕士。曾任中国农业银行大连中山支行担任信贷部经理、新华人寿保险股份有限公司精算部资产负债管理高级专员、安永（中国）企业咨询有限公司北京分公司高级精算咨询顾问、新华资产管理股份有限公司投资经理、量化投资负责人。2017 年 2 月加入我公司, 历任资产配置及量化投资部投资经理、FOF 基金经理、资产配置及量化投资部首席 FOF 投资官、高级基金经理等职务。2019 年 1 月 10 日起任建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2019 年 8 月 6 日至 2023 年 2 月 15 日任建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2021 年 1 月 26 日至 2024 年 6 月 27 日任建信智汇优选一年持有期混合型基金管理人中管理人（MOM）证券投资基金的基金经理；2023 年 2 月 15 日至 2024 年 6 月 27 日任建信优享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；2023 年 2 月 15 日至 2025 年 8 月 25 日任建信普泽养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；2023 年 2 月 15 日至 2025 年 8 月 25 日任建信龙祥稳进 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2023 年 2 月 15 日至 2024 年 6 月 27 日任建信优享进取养老目标五年持有期混合型发

					起式基金中基金（FOF）的基金经理；2023 年 3 月 29 日起任建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理；2023 年 6 月 29 日至 2026 年 9 月 28 日任建信添福悠享稳健养老目标一年持有期债券型基金中基金（FOF）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《建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）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

2026 年 3 季度，权益市场自高位下跌、成交量萎缩，板块轮动加快。固收市场方面，债市震荡走强，收益率曲线趋平。

权益方面，3 季度资本市场整体下跌，结构上科技领跌，2 季度以来的极致分化格局有所修复。

地缘局势方面，美伊双方撕毁 6 月停火备忘录，霍尔木兹海峡通行再度受阻，胡塞武装袭击沙特能源设施并威胁红海航运，乌克兰加大对俄罗斯炼油厂的打击。多重因素作用下，油价重回 100 美元附近，部分化工品价格突破 2 季度高点。宏观流动性方面，市场大幅定价未来加息空间，9 月中旬美联储加息 25BP，欧洲和日本亦相继加息，美债收益率与美元走强，全球大类资产分母端整体承压。国内方面，内需延续疲弱但出口保持高增，总量层面增量政策相对有限。此外 9 月中美元首年内第二次会晤，双方达成一定合作但成果有限，市场风险偏好短期提振后未能持续改善。3 季度，上证指数、沪深 300、创业板指分别下跌 6.16%、12.49%和 27.80%，偏股公募基金指数下跌 13.41%；节奏上先大幅调整，后超跌修复，再二次调整、缩量寻底。结构方面，从科技成长向红利、周期方向再平衡。申万一级行业中，煤炭、农林牧渔、石油石化和银行表现最好，上涨超过 14%，主要得益于红利属性、油价上行及通胀预期；表现最弱的为电子、通信、建材，下跌超过 26%，主要是受科技板块拥挤交易出清、估值去泡沫及海外流动性收紧等影响。

固收方面，在基本面偏弱、资金面偏松、政策加码有限以及机构配置需求支撑下，3 季度债市整体呈现震荡走强态势，长端利率震荡下行，短端利率小幅上行。央行 3 季度公开市场净投放超 7000 亿元，呈现短端回笼、中长端投放态势；季度来看资金面波动下降、资金价格中枢下移，9 月 DR007、R007 全月均值在 1.40%、1.42%左右，较 6 月的 1.44%、1.46%降低。利率走势方面，长短端分化明显，10 年期国债收益率自 6 月末的 1.73%震荡下行 5BP 至 9 月末的 1.68%附近，而 1 年期国债收益率自 6 月末的 1.12%上行 10BP 至 9 月末的 1.22%左右。信用方面，信用债整体表现强劲，收益率先上后下，多数品种信用利差收窄。

展望后市，权益方面，4 季度影响市场的关键在于海外加息预期、地缘局势的边际变化，以及 A 股流动性格局、国内政策发力等因素。全球流动性方面，美联储利率路径整体上移，年内大概率仅在 12 月有一次加息，短期扰动有所收敛；美债收益率或阶段性见顶但维持高位震荡，仍将对全球市场估值形成一定压制。此外，中东、俄乌局势反复，美国中期选举以及 AI 产业叙事等因素可能带来外部不确定性，对市场风险偏好形成扰动。国内方面，总量层面政策预计仍将保持定力，后续投资端改善更来自延后的财政进度，但内需偏弱格局较难得到扭转。产业趋势上，AI 景气度依然占优，但科技板块在经历前期的拥挤交易后，仍需面对估值再定价和业绩验证。4 季度来看，考虑到在指数调整之后，市场风险得到出清，A 股进一步大幅下行的风险相对有限；但当前市场面临盈利与估值的双重压制，增量资金入场意愿不足，短期或将处于底部震荡之中，修复行情的开启需要看到业绩兑现或地缘缓和带来的风险偏好改善。结构方面，4 季度或考虑均衡偏防御配置，以银行和红利板块作为配置底仓，同时关注业绩兑现能力强的科技细分板块、航运等

独立景气方向，以及创新药等具备估值修复潜力的方向，耐心等待形势变化。

固收方面，流动性来看，3 季度货币政策例会延续适度宽松基调，预计 4 季度流动性总体平稳，资金价格中枢仍维持低位。考虑到前期政府债发行进度偏慢，后续政府债供给或对债市形成短期扰动。政策方面，9 月末 PSL 利率下调并加速投放新型政策性金融工具，精准支持重点领域；房地产贴息政策出台，聚焦首套刚需，托底地产销售；宽松货币政策配合准财政工具发力，稳增长举措有望逐步显效，但总量政策未见超预期加码。基本面来看，内需短期难有显著改善，国内经济弱修复+宽货币环境延续，整体对债市偏利好。叠加新批摊余债基支撑下债市仍有需求增量，资产荒格局延续，总体上对偏低的利率水平仍有支撑，密切关注总量政策层面及央行公开市场操作、债市监管态度的变化。

权益策略：策略核心仓位配置于红利资产、美股宽基和黄金资产；并通过 ETF 轮动适度追求超额收益。

固收策略：紧密跟踪本基金的固收基准指数，报告期内抓住科创板新股的红利期，使用偏债基金为策略贡献了部分正收益。

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 1.55%，波动率 0.17%，业绩比较基准收益率-0.67%，波动率 0.24%。本报告期本基金 C 净值增长率 1.51%，波动率 0.17%，业绩比较基准收益率-0.67%，波动率 0.24%。

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	4,849.00	0.00
	其中：股票	4,849.00	0.00
2	基金投资	886,982,692.35	89.56
3	固定收益投资	57,578,440.37	5.81
	其中：债券	57,578,440.37	5.81
	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	45,430,951.42	4.59
8	其他资产	372,344.17	0.04
9	合计	990,369,277.31	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	4,849.00	0.00
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	4,849.00	0.00

5.2.2 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	920162	莫森泰克	200	3,474.00	0.00
2	920157	宇特光电	100	1,375.00	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	57,475,364.15	5.84
2	央行票据	—	—
3	金融债券	103,076.22	0.01
	其中：政策性金融债	103,076.22	0.01
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	57,578,440.37	5.85

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019827	26 国债 01	245,000	24,712,096.16	2.51
2	019792	25 国债 19	131,000	13,275,155.97	1.35
3	019742	24 特国 01	63,000	6,939,040.93	0.71
4	102317	国债 2519	40,000	4,053,482.74	0.41
5	019771	25 国债 06	20,000	2,021,424.66	0.21

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	245,012.34
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	723.73
4	应收利息	—
5	应收申购款	83,046.04
6	其他应收款	43,562.06
7	其他	—
8	合计	372,344.17

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	920162	莫森泰克	3,474.00	0.00	新发未上市
2	920157	宇特光电	1,375.00	0.00	新发未上市

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	021951	建信中短债纯债债券 F	契约型开放式	84,505,980.14	90,345,343.37	9.19	是
2	531028	建信短债债券 A	契约型开放式	73,884,906.11	86,814,764.68	8.83	是
3	531021	建信纯债债券 C	契约型开放式	51,657,936.48	83,799,504.56	8.52	是
4	021930	建信纯债债券 F	契约型开放式	45,859,596.74	78,108,065.17	7.94	是
5	006989	建信中短债纯债债券 A	契约型开放式	66,032,590.69	70,714,301.37	7.19	是
6	007094	建信中债 3-5 年国开行债券指数 A	契约型开放式	67,767,884.77	70,315,957.24	7.15	是
7	008022	建信短债债券 F	契约型开放式	48,463,789.30	56,872,256.74	5.78	是
8	511220	海富通上证城投债 ETF	交易型开放式 (ETF)	4,330,000.00	45,218,190.00	4.60	否
9	518880	华安黄金 ETF	交易型开放式 (ETF)	4,582,100.00	39,557,269.30	4.02	否
10	007095	建信中债 3-5 年国开行债券指数 C	契约型开放式	37,091,622.91	38,616,088.61	3.93	是

6.1.1 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公开募集不动产投资信托基金投资明细

无。

6.1.2 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。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2026 年 7 月 1 日至 2026 年 9 月 30 日	其中：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
当期交易基金产生的申购费(元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	166,414.89	138,375.01
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	843,278.57	465,291.01
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	223,892.17	146,577.56
当期交易基金产生的交易费(元)	28,230.24	-

注：上述当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费，是根据被投资基金的实际持仓情况和被投资基金的基金合同约定费率估算得出。该三项费用根据被投资基金的基金合同约定已经作为费用计入被投资基金的基金份额净值，已在本基金持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，本基金不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，本基金的托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF 除外）的，应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书规定应当收取并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，相关销售服务费由基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信福泽安泰混合(FOF) A	建信福泽安泰混合(FOF) C
报告期期初基金份额总额	540,664,465.98	387,944,404.18
报告期期间基金总申购份额	3,111,648.31	7,054,824.79
减:报告期期间基金总赎回份额	62,556,377.24	117,552,586.54

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	481,219,737.05	277,446,642.43

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

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 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

无。

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福泽安泰混合型基金中基金（FOF）设立的文件；
- 2、《建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）招募说明书》；
- 4、《建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）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