建信中证A股交易型开放式指数证券投资基金
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	建信中证 A 股 ETF
场内简称	A 股 ETF 建信
基金主代码	159066
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2026 年 6 月 24 日
报告期末基金份额总额	198,733,027.00 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 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。 1、股票投资策略 为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人可根据基金运作及指数情况决定本基金采用抽样复制投资策略或完全复制投资策略。本基金优先采用抽样复制投资策略。 本基金采用抽样复制投资策略时，基金管理人将运用指数化的投资方法，基于数量化投资分析等方法构建投资组合，追求投资组合与标的指数的风险收益特征尽可能相近，以达到紧密跟踪标的指数的目的。 本基金采用完全复制策略时，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。但因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的，尽量降低跟踪误差。 如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差

	超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市等风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 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。其他投资策略包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、股指期货交易策略、股票期权投资策略、国债期货交易策略、信用衍生品投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略
业绩比较基准	中证 A 股指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征相似。
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

§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）
1.本期已实现收益	-6,541,930.17
2.本期利润	-26,473,268.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1185
4.期末基金资产净值	178,369,525.26
5.期末基金份额净值	0.8975

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

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	-10.96%	1.56%	-13.75%	1.59%	2.79%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-10.25%	1.51%	-12.84%	1.59%	2.59%	-0.08%

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 2026 年 6 月 24 日生效，截至报告期末仍处于建仓期。

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		
张溢麟	本基金的基金经理	2026 年 6 月 24 日	-	10	张溢麟先生，硕士。2016 年 5 月毕业于美国芝加哥大学统计专业，同年 9 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、投资经理等职务。2023 年 1 月 4 日起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 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；2025 年 3 月 20 日起任建信上证智选科创板创新价值交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 6 月 20 日起任建信上证智选科创板创新价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2025 年 9 月 30 日起任建信中证 A 股指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 11 月 17 日起任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理；2025 年 11 月 17 日起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；2025 年 11 月 17 日起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；2026 年 6 月 24 日起任建信中证 A 股交易型开放式指数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《建信中证A股交易型开放式指数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

本基金跟踪的对应指数是中证A股指数，它选取上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所市场符合条件的A股作为指数样本，反映A股价格的整体表现。本基金采用抽样复制策略，运用指数化的投资方法，基于数量化投资分析等方法构建投资组合。模型严格控制相关参数，使得投资组合与标的指数的风险收益特征尽可能相近，进而达到紧密跟踪标的指数的目的。三季度股市风格大幅切换，受市场整体影响，本基金三季度震荡下行。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率-10.96%，波动率1.56%，业绩比较基准收益率-13.75%，波动率1.59%。

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	172,586,049.75	96.65
	其中：股票	172,586,049.75	96.65
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	5,948,015.86	3.33
8	其他资产	33,717.49	0.02
9	合计	178,567,783.10	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	1,323,972.00	0.74
B	采矿业	8,823,637.00	4.95
C	制造业	108,182,245.22	60.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,513,203.00	3.09
E	建筑业	3,180,599.00	1.78
F	批发和零售业	1,966,001.00	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	4,563,680.00	2.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,721,462.73	6.01
J	金融业	20,948,089.00	11.74
K	房地产业	636,975.00	0.36
L	租赁和商务服务业	744,563.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	1,812,013.80	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	684,744.00	0.38

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	158,490.00	0.09
Q	卫生和社会工作	1,055,247.00	0.59
R	文化、体育和娱乐业	2,021,178.00	1.13
S	综合	249,950.00	0.14
	合计	172,586,049.75	96.76

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	300308	中际旭创	3,800	3,072,072.00	1.72
2	600519	贵州茅台	2,400	3,020,688.00	1.69
3	300750	宁德时代	9,700	2,823,767.00	1.58
4	600036	招商银行	48,700	2,009,362.00	1.13
5	300502	新易盛	5,000	1,945,000.00	1.09
6	601899	紫金矿业	63,000	1,876,770.00	1.05
7	601318	中国平安	34,800	1,854,492.00	1.04
8	601398	工商银行	197,300	1,633,644.00	0.92
9	600030	中信证券	59,700	1,543,842.00	0.87
10	603259	药明康德	9,220	1,542,874.80	0.86

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	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	33,717.49
8	其他	-
9	合计	33,717.49

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

报告期期初基金份额总额	272,733,027.00
报告期期间基金总申购份额	18,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	92,000,000.00
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	198,733,027.00

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。

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；

2、《建信中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《建信中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

4、《建信中证 A 股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。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 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