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
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：国泰海通证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰海通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

2.1 基金基本情况

基金简称	建信上证智选科创板创新价值 ETF 联接
基金主代码	024350
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 6 月 20 日
报告期末基金份额总额	38,059,934.18 份
投资目标	通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数即上证智选科创板创新价值指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要通过投资于目标 ETF，实现对指数的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金力争与业绩比较基准之间的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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致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误差进一步扩大。
业绩比较基准	上证智选科创板创新价值指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，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。 同时，本基金为被动式投资的股票指数基金，跟踪上证智选科创板创新价值指数，其预期风险与预期收益高于债券型基金、混合型基金、货币市场基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司

基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信上证智选科创板创新价值 ETF 联接 A	建信上证智选科创板创新价值 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	024350	024351
报告期末下属分级基金的份额总额	20,287,237.80 份	17,772,696.38 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	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
基金主代码	588910
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 3 月 20 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 4 月 7 日
基金管理人名称	建信基金管理有限责任公司
基金托管人名称	国泰海通证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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	（一）完全复制策略 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。 （二）衍生金融产品投资策略 本基金可参与国债期货、股指期货、股票期权交易、信用衍生品和投资其他经中国证监会允许的衍生金融产品。 （三）债券投资策略 本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券投资组合。 （四）资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。 （五）融资及转融通证券出借策略 基金管理人遵守审慎经营原则运用基金财产参与转融通证券出借业务，加强转融通证券出借业务信用风险管理，分析市场情况、投资者类型与结构、历史申赎数据、出借证券流动性情况等因素，合理确定出借证券的范围、期限和比例，分散出借期限与借券证券公司的集中度。 （六）可转换债券投资策略 可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深入挖掘以明确该可转债的债底保护，防范信用风险，另一方面，还会进一步分析公司的盈利和成长能力以确定可转债中长期的上涨空间。 （七）存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

	（八）未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，经履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	上证智选科创板创新价值指数收益率。
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。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，跟踪标的指数，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。

§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）	
	建信上证智选科创板创新价值 ETF 联接 A	建信上证智选科创板创新价值 ETF 联接 C
1.本期已实现收益	385,851.72	352,989.37
2.本期利润	-5,459,390.12	-5,597,057.46
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2882	-0.3096
4.期末基金资产净值	26,485,140.80	23,112,722.35
5.期末基金份额净值	1.3055	1.3005

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

建信上证智选科创板创新价值 ETF 联接 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	-19.16%	2.32%	-19.36%	2.37%	0.20%	-0.05%
过去六个月	9.49%	2.18%	10.40%	2.22%	-0.91%	-0.04%
过去一年	8.08%	2.00%	9.49%	2.03%	-1.41%	-0.03%
自基金合同生效起至今	30.55%	1.85%	53.49%	1.91%	-22.94%	-0.06%

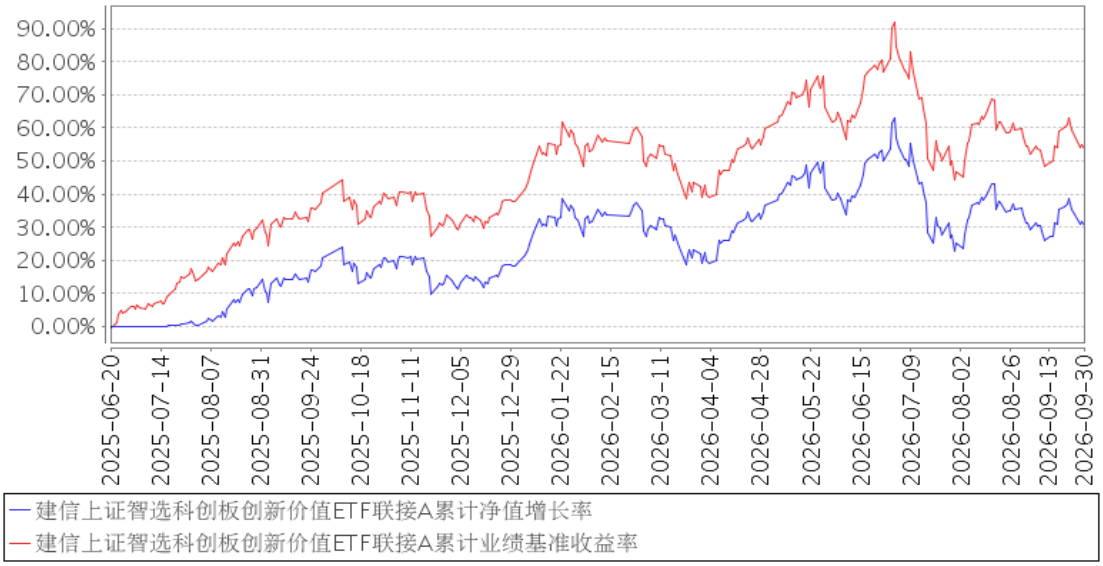
建信上证智选科创板创新价值 ETF 联接 C

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	①－③	②－④

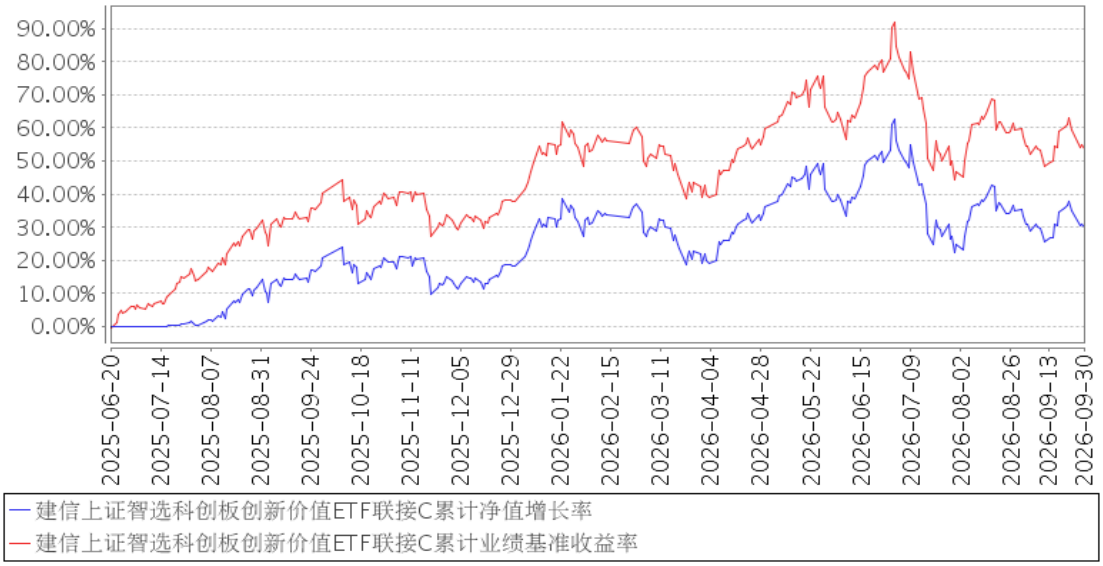
				④		
过去三个月	-19.22%	2.32%	-19.36%	2.37%	0.14%	-0.05%
过去六个月	9.32%	2.18%	10.40%	2.22%	-1.08%	-0.04%
过去一年	7.76%	2.00%	9.49%	2.03%	-1.73%	-0.03%
自基金合同生效起至今	30.05%	1.85%	53.49%	1.91%	-23.44%	-0.06%

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

建信上证智选科创板创新价值ETF联接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



建信上证智选科创板创新价值ETF联接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 6 月 20 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		
张溢麟	本基金的基金经理	2025 年 6 月 20 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

三季度是科技主线走出了估值消化的阶段，产业大逻辑并未证伪，但交易拥挤、估值过高、资金风格切换叠加外部扰动，引发高位算力硬件股深度回调。行情从上半年普涨行情，切换为强分化结构行情。本基金完全被动跟踪对应指数，绝大部分仓位投资对应的建信上证智选科创板创新价值 ETF，运作中努力降低跟踪误差。本基金跟踪的对应指数是上证智选科创板创新价值指数，它从科创板各行业上市公司中，选取 100 只科技创新能力较强、估值较低且盈利质量较好的上市公司证券作为指数样本，反映科创板创新主题上市公司证券的整体表现。本基金受市场整体影响，三季度走势震荡下行。

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-19.16%，波动率 2.32%，业绩比较基准收益率-19.36%，波动率 2.37%。本报告期本基金 C 净值增长率-19.22%，波动率 2.32%，业绩比较基准收益率-19.36%，波动率 2.37%。

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	-	-

	其中：股票	-	-
2	基金投资	45,941,966.37	92.40
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	2,745,492.97	5.52
8	其他资产	1,033,423.52	2.08
9	合计	49,720,882.86	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

无。

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

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	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	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	股票型指数基金	交易型开放式	建信基金管理有限责任公司	45,941,966.37	92.63

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

无。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 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	1,033,423.52
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,033,423.52

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.12.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信上证智选科创板创新价值 ETF 联接 A	建信上证智选科创板创新价值 ETF 联接 C
报告期期初基金份额总额	18,267,927.43	17,726,850.31
报告期期间基金总申购份额	5,908,552.29	3,816,917.54
减:报告期期间基金总赎回份额	3,889,241.92	3,771,071.47
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	20,287,237.80	17,772,696.38

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设立的文件；

2、《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基金合同》；

3、《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招募说明书》；

4、《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