

建信沪深 300 指数增强型证券投资基金  
(LOF) (原建信双利策略主题分级股票型  
证券投资基金)  
2020 年第 2 季度报告

2020 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 7 月 20 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 16 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 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	建信沪深 300 指数增强
基金主代码	165310
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 7 日
报告期末基金份额总额	134,963,802.97 份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以沪深 300 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因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，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	建信沪深 300 指数增强 A	建信沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的场内简称	300 增强	-
下属分级基金的交易代码	165310	009208
报告期末下属分级基金的份额总额	133,213,937.36 份	1,749,865.61 份

## 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	建信双利分级股票		
场内简称	建信双利		
基金主代码	165310		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 5 月 6 日		
报告期末基金份额总额	113,430,363.29 份		
投资目标	本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	本基金将通过自上而下的方式，通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题，在前述主题筛选和主题配置的基础上，本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。		
风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。从本基金所分离的两类基金份额来看，建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额；建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征，其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	建信双利分级股票	建信稳健	建信进取
下属分级基金的交易代码	165310	150036	150037
报告期末下属分级基金的份额总额	110,093,957.29 份	820,331.00 份	2,516,075.00 份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。	建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额。	建信进取份额将表现出高风险、高预期收益的显著特征，其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 5 月 7 日-2020 年 6 月 30 日）	报告期（2020 年 5 月 12 日-2020 年 6 月 30 日）
	建信沪深 300 指数增强 A	建信沪深 300 指数增强 C
1. 本期已实现收益	4,324,809.14	35,521.47
2. 本期利润	10,106,351.88	111,311.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0882	0.0820
4. 期末基金资产净值	144,050,663.82	1,891,314.25
5. 期末基金份额净值	1.0813	1.0808

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。

#### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 4 月 1 日-2020 年 5 月 6 日）
1. 本期已实现收益	1,327,855.00
2. 本期利润	8,570,962.60
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1118
4. 期末基金资产净值	113,428,669.32
5. 期末基金份额净值	1.000

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（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

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（转型后）

##### 3.2.1 本报告期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

建信沪深 300 指数增强 A

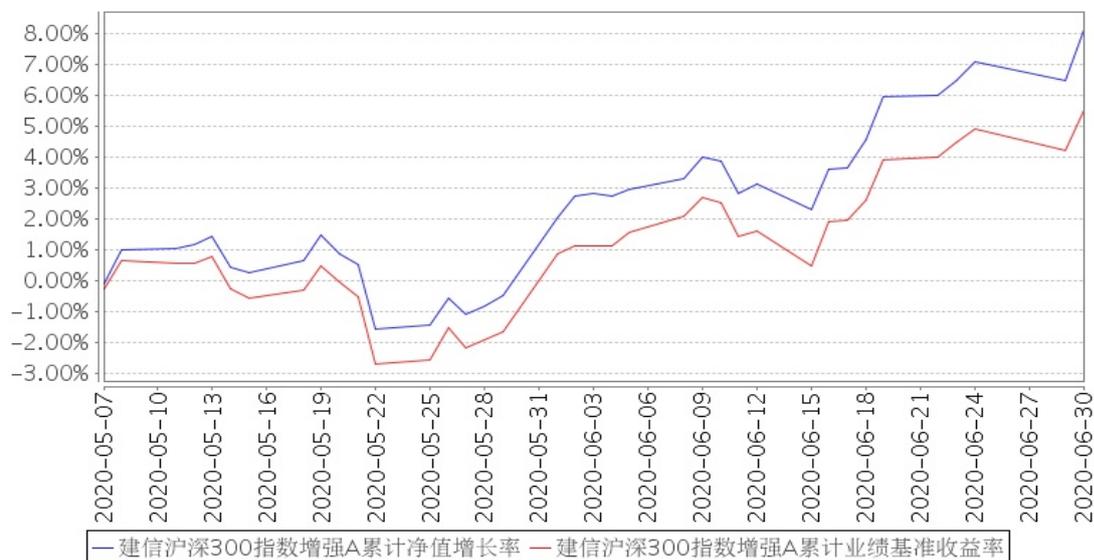
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	8.13%	0.82%	5.50%	0.84%	2.63%	-0.02%

建信沪深 300 指数增强 C

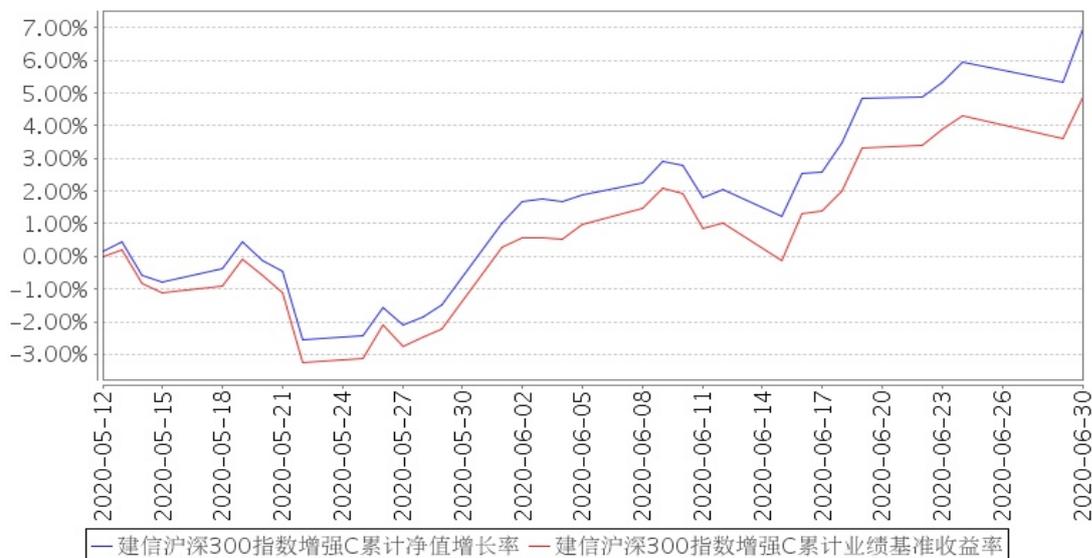
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	6.99%	0.84%	4.89%	0.86%	2.10%	-0.02%

### 3.2.2 自基金转型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

建信沪深300指数增强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



建信沪深300指数增强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



### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 3.2.1 本报告期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	4.35%	1.41%	0.93%	1.49%	3.42%	-0.08%
过去六个月	3.21%	1.39%	-1.09%	1.41%	4.30%	-0.02%
过去一年	17.07%	1.21%	6.60%	1.22%	10.47%	-0.01%
过去三年	30.53%	1.15%	15.87%	1.19%	14.66%	-0.04%
过去五年	15.15%	1.53%	-12.23%	1.46%	27.38%	0.07%
自基金合同生效起至今	97.19%	1.41%	26.09%	1.38%	71.10%	0.03%

注：过去三个月：2020年4月1日-2020年5月6日；

过去六个月：2020年1月1日-2020年5月6日；

过去一年：2019年7月1日-2020年5月6日；

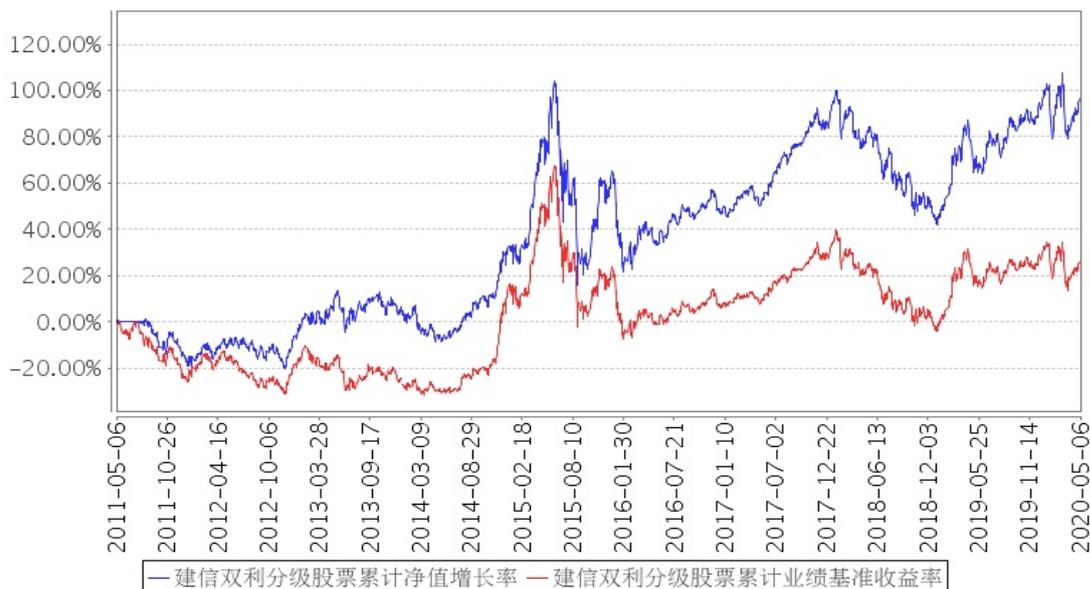
过去三年：2017年7月1日-2020年5月6日；

过去五年：2015年7月1日-2020年5月6日。

#### 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

建信双利分级股票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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理，本基金的基金经理	2020年5月7日	-	17年	梁洪昀先生，博士，金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师（CFA）。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金（LOF）的基金经理；2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2011年9月8日至2016年7月20日任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金（ETF）及其联接基金的基金经理；2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金的基金经理；2015年3月25日起任建信双

				利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理，该基金自 2020 年 5 月 7 日转型为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF），梁洪昀继续担任该基金的基金经理；2015 年 7 月 31 日至 2018 年 7 月 31 日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 6 日至 2016 年 10 月 25 日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 6 日至 2019 年 11 月 25 日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；2018 年 6 月 13 日至 2019 年 11 月 25 日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；2018 年 2 月 7 日起任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 4 月 19 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 5 月 16 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通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。
--	--	--	--	---

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理，本基金的基金经理	2015 年 3 月 25 日	2020 年 5 月 6 日	17 年	梁洪昀先生，博士，金融工程及指数投资部总经理。特许金融分析师（CFA）。2003 年 1 月至 2005 年 8 月就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005 年 8 月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部执行总监、金融工程及指数投资部总监。2009 年 11 月 5 日起任建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理；2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2011 年 9 月 8 日至 2016 年 7 月 20 日任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金（ETF）及其联接基金的基金经理；2012 年 3 月 16 日起任建信深证 100 指数增强型证券投资基金的

				<p>基金经理；2015 年 3 月 25 日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理，该基金自 2020 年 5 月 7 日转型为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF），梁洪昀继续担任该基金的基金经理；2015 年 7 月 31 日至 2018 年 7 月 31 日任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 6 日至 2016 年 10 月 25 日任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 6 日至 2019 年 11 月 25 日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；2018 年 6 月 13 日至 2019 年 11 月 25 日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；2018 年 2 月 7 日起任建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 4 月 19 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 5 月 16 日起任建信 MSCI 中国 A 股国际通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。</p>
--	--	--	--	---

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定。

## 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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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

报告期内，本基金按照持有人大会决议，实现了转型，由原先的建信双利策略主题分级基金转换为建信沪深 300 指数增强基金。

本基金在新基金合同生效后，根据量化模型，进行了指数增强管理。投资组合采取与基准指数相近的行业配置和适度分散的持股策略，在报告期内比较平稳地累积了一定的超额收益。

在报告期后期，沪深 300 指数进行了成分股调整，基金据此适当地进行了投资组合的调整，基金的超额收益和跟踪误差基本保持平稳。

管理人将继续保持对量化模型的跟踪和改进，以期在未来继续使基金获得超额收益。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 转型后净值增长率 8.13%，波动率 0.82%，业绩比较基准收益率 5.50%，波动率 0.84%；本报告期本基金 C 转型后净值增长率 6.99%，波动率 0.84%，业绩比较基准收益率 4.89%，波动率 0.86%。

### 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（转型后）

### 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	137,062,249.43	91.73
	其中：股票	137,062,249.43	91.73
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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	12,125,751.08	8.12
8	其他资产	229,292.28	0.15
9	合计	149,417,292.79	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	3,561,388.00	2.44
B	采矿业	1,988,160.00	1.36
C	制造业	52,702,564.47	36.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	634,206.00	0.43
E	建筑业	3,505,802.00	2.40
F	批发和零售业	1,944,093.00	1.33
G	交通运输、仓储和邮政业	1,077,590.00	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,189,802.00	1.50
J	金融业	40,102,920.36	27.48
K	房地产业	6,430,910.72	4.41
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	616,140.00	0.42
S	综合	-	-
	合计	114,753,576.55	78.63

### 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

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	443,744.00	0.30
C	制造业	11,632,957.63	7.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,424,445.00	0.98
E	建筑业	536,216.00	0.37
F	批发和零售业	691,416.00	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	3,519,615.00	2.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	776,166.00	0.53
J	金融业	931,500.65	0.64

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	672,426.60	0.46
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	1,580,310.00	1.08
R	文化、体育和娱乐业	99,876.00	0.07
S	综合		
	合计	22,308,672.88	15.29

### 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 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

#### 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	600519	贵州茅台	6,300	9,216,144.00	6.31
2	000333	美的集团	116,269	6,951,723.51	4.76
3	000858	五粮液	39,173	6,703,283.76	4.59
4	601166	兴业银行	379,092	5,982,071.76	4.10
5	000002	万科A	221,400	5,787,396.00	3.97
6	300059	东方财富	275,200	5,559,040.00	3.81
7	601318	中国平安	74,434	5,314,587.60	3.64
8	000001	平安银行	411,800	5,271,040.00	3.61
9	002475	立讯精密	93,032	4,777,193.20	3.27
10	601336	新华保险	96,900	4,290,732.00	2.94

#### 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

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	600017	日照港	1,413,500	3,519,615.00	2.41
2	000516	国际医学	390,200	1,580,310.00	1.08
3	300435	中泰股份	145,500	1,424,445.00	0.98
4	300119	瑞普生物	56,500	1,262,775.00	0.87
5	603611	诺力股份	54,800	1,176,008.00	0.81

### 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未超出基金合同规定的投资范围。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	60,213.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,378.21
5	应收申购款	167,700.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	229,292.28

### 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。

## § 5 投资组合报告（转型前）

### 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	107,450,658.28	91.47
	其中：股票	107,450,658.28	91.47
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	9,920,178.86	8.44
8	其他资产	106,250.41	0.09
9	合计	117,477,087.55	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	4,201,180.00	3.70
B	采矿业	4,385,891.00	3.87
C	制造业	46,181,899.67	40.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,612,662.00	2.30
E	建筑业	4,337,496.00	3.82
F	批发和零售业	1,532,880.00	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	14,064.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,011,115.46	1.77
J	金融业	33,937,270.90	29.92
K	房地产业	7,330,844.00	6.46
L	租赁和商务服务业	43,694.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	456,371.44	0.40
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	367,529.81	0.32
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	37,760.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	107,450,658.28	94.73

### 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 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	601318	中国平安	93,534	6,903,744.54	6.09
2	600276	恒瑞医药	49,440	4,767,004.80	4.20
3	000858	五粮液	32,773	4,529,556.33	3.99
4	000333	美的集团	83,469	4,524,019.80	3.99
5	601166	兴业银行	264,892	4,325,686.36	3.81
6	600519	贵州茅台	3,100	4,030,000.00	3.55
7	002714	牧原股份	26,600	3,293,080.00	2.90
8	600048	保利地产	190,000	3,015,300.00	2.66
9	601169	北京银行	609,100	3,008,954.00	2.65
10	300059	东方财富	144,300	2,658,006.00	2.34

### 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未超出基金合同规定的投资范围。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	48,660.09
2	应收证券清算款	35,634.57
3	应收股利	-
4	应收利息	15,396.23
5	应收申购款	6,559.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,250.41

### 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

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（转型后）

单位：份

项目	建信沪深 300 指数增强 A	建信沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日(2020 年 5 月 7 日)基金份额总额	113,430,363.29	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	31,647,397.29	1,835,700.16
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	11,863,823.22	85,834.55
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	133,213,937.36	1,749,865.61

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 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	建信双利分级股票	建信稳健	建信进取
报告期期初基金份额总额	87,279,929.14	822,976.00	1,234,466.00
报告期期间基金总申购份额	88,168.33	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	20,868,030.26	-	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	43,593,890.08	-2,645.00	1,281,609.00
报告期期末基金份额总额	110,093,957.29	820,331.00	2,516,075.00

注：1、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。

2、拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

#### 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。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 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

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	2020 年 06 月 15 日 - 2020 年 06 月 30 日	9,679,273.37	35,429,350.85		-45,108,624.22	33.42

#### 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。

### 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沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）设立的文件；

- 2、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）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

2020 年 7 月 20 日