

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 年年度报告

2020 年 12 月 31 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

送出日期：2021 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2021 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况 (转型后)	6
2.1 基金基本情况 (转型前)	6
2.2 基金产品说明 (转型后)	7
2.2 基金产品说明 (转型前)	7
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料 (转型后)	9
2.5 其他相关资料 (转型前)	9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标 (转型后)	9
3.1 主要会计数据和财务指标 (转型前)	10
3.2 基金净值表现 (转型后)	11
3.2 基金净值表现 (转型前)	13
3.3 其他指标	15
3.4 过去三年基金的利润分配情况 (转型后)	15
3.4 过去三年基金的利润分配情况 (转型前)	15
§4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	20
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	24
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	24
§5 托管人报告	24
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	24
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	24
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	24
§6 审计报告 (转型后)	24
6.1 审计报告基本信息	24
6.2 审计报告的基本内容	24

§6 审计报告 (转型前)	26
6.1 审计报告基本信息	26
6.2 审计报告的基本内容	26
§7 年度财务报表 (转型后)	28
7.1 资产负债表	28
7.2 利润表	30
7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	30
7.4 报表附注	31
§7 年度财务报表 (转型前)	59
7.1 资产负债表	59
7.2 利润表	60
7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	61
7.4 报表附注	63
§8 投资组合报告 (转型后)	89
8.1 期末基金资产组合情况	89
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	90
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	91
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	96
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	98
8.6 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	98
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	98
8.8 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贵金属投资明细	98
8.9 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	98
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	99
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	99
8.12 投资组合报告附注	99
§8 投资组合报告 (转型前)	100
8.1 期末基金资产组合情况	100
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	101
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	101
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	104
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	107
8.6 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	107
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	107
8.8 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贵金属投资明细	107
8.9 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	107
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	107
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	107
8.12 投资组合报告附注	108
§9 基金份额持有人信息 (转型后)	109
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	109
9.2 期末上市基金前十名持有人	109

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	109
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	110
§9 基金份额持有人信息 (转型前)	110
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	110
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	110
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	111
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	112
§10 开放式基金份额变动 (转型后)	112
§10 开放式基金份额变动 (转型前)	112
§11 重大事件揭示	113
11.1 基金份额持有人大会决议.....	113
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	113
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	113
11.4 基金投资策略的改变.....	113
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	113
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	113
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后).....	113
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前).....	115
11.8 其他重大事件 (转型后)	116
11.8 其他重大事件 (转型前)	117
§12 影响投资者决策的其他重要信息	118
12.1 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	118
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	119
§13 备查文件目录	119
13.1 备查文件目录.....	119
13.2 存放地点.....	119
13.3 查阅方式.....	119

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况 (转型后)

基金名称	建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	建信沪深 300 指数增强 (LOF)	
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	
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	
报告期末基金份 额总额	227,720,681.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	建信沪深 300 指数增强 (LOF) 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	124,626,163.08 份	103,094,518.15 份

2.1 基金基本情况 (转型前)

基金名称	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金
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	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 5 月 6 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		
报告期末基金份额总额	113,430,363.29 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011 年 6 月 8 日		
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

2.2 基金产品说明 (转型后)

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。

2.2 基金产品说明 (转型前)

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，采用自上

	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	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	<p>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。</p> <p>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。</p>		
	建信双利分级股票	建信稳健	建信进取
下属分级基金的风险收益特征	<p>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。</p>	<p>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。</p>	<p>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。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴曙明	张燕
	联系电话	010-66228888	0755—83199084
	电子邮箱	xinzipilu@ccbfund.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95555
传真		010-66228001	0755—83195201
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		孙志晨	繆建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料(转型后)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

2.5 其他相关资料(转型前)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020年5月7日(基金合同生效日) -2020年12月31日	2020年5月12日-2020年12月31日
	建信沪深300指数增强(LOF) A	建信沪深300指数增强 C
本期已实现收益	37,020,262.89	4,634,343.40
本期利润	50,948,746.46	10,935,124.57
加权平均基金份额本期利润	0.4027	0.2521
本期加权平均净值利润率	32.49%	19.15%
本期基金份额净值增长率	39.48%	37.75%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末	
期末可供分配利润	110,447,376.02	40,363,100.17
期末可供分配基金份额利润	0.8862	0.3915
期末基金资产净值	173,826,914.99	143,457,618.32
期末基金份额净值	1.3948	1.3915
3.1.3 累计期	2020年末	

末指标		
基金份额累计 净值增长率	39.48%	37.75%

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 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020年1月1日-2020年5月6日	2019年	2018年
本期已实现收益	4,592,551.65	21,844,473.41	-17,743,521.61
本期利润	2,000,424.55	34,726,795.03	-30,394,426.39
加权平均基金份额本期利润	0.0270	0.4582	-0.3323
本期加权平均净值利润率	1.67%	30.62%	-22.28%
本期基金份额净值增长率	-0.44%	36.23%	-21.97%
3.1.2 期末数据和指标	2020年5月6日	2019年末	2018年末
期末可供分配利润	55,743,301.10	56,986,665.72	31,181,103.99
期末可供分配基金份额利润	0.4914	0.8303	0.3901
期末基金资产净值	113,428,669.32	115,418,217.01	100,357,646.05
期末基金份额净值	1.000	1.682	1.255
3.1.3 累	2020年5月6日	2019年末	2018年末

计期末指标			
基金份额累计净值增长率	96.61%	97.47%	44.96%

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。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

建信沪深 300 指数增强 (LOF) 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
过去三个月	9.52%	0.95%	12.90%	0.94%	-3.38%	0.01%
过去六个月	28.99%	1.29%	23.83%	1.28%	5.16%	0.01%
自基金合同生效起至今	39.48%	1.20%	30.64%	1.19%	8.84%	0.01%

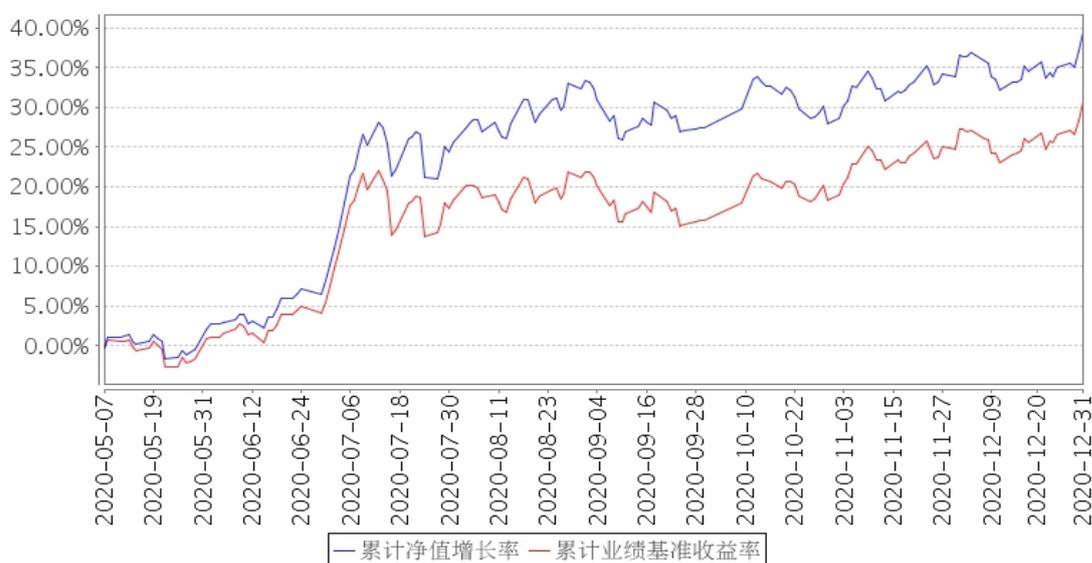
建信沪深 300 指数增强 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

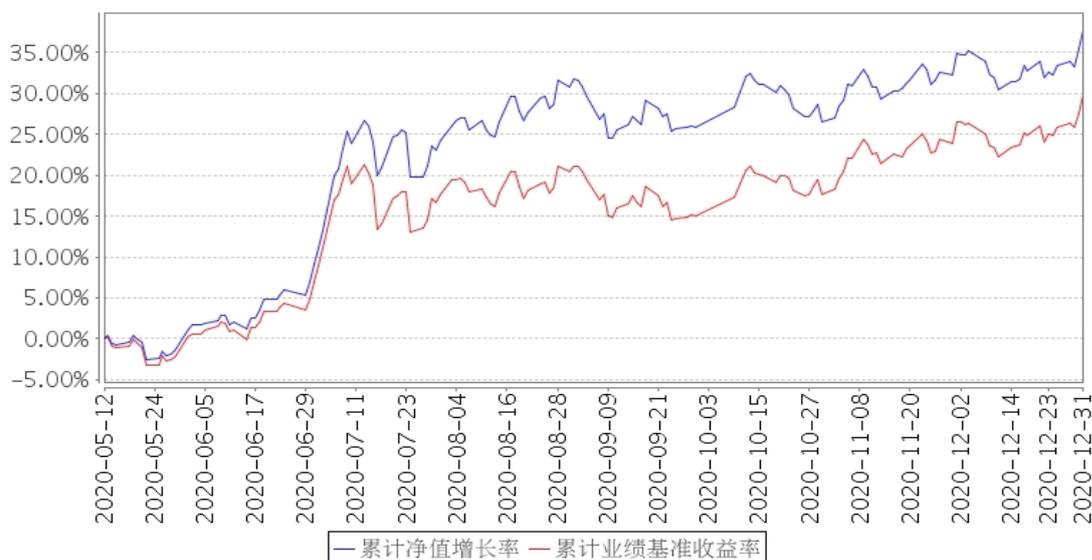
过去三个月	9.40%	0.95%	12.90%	0.94%	-3.50%	0.01%
过去六个月	28.75%	1.29%	23.83%	1.28%	4.92%	0.01%
自基金合同生效起 至今	37.75%	1.21%	29.89%	1.20%	7.86%	0.01%

3.2.2 自基金转型以来基金份额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 (LOF) 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



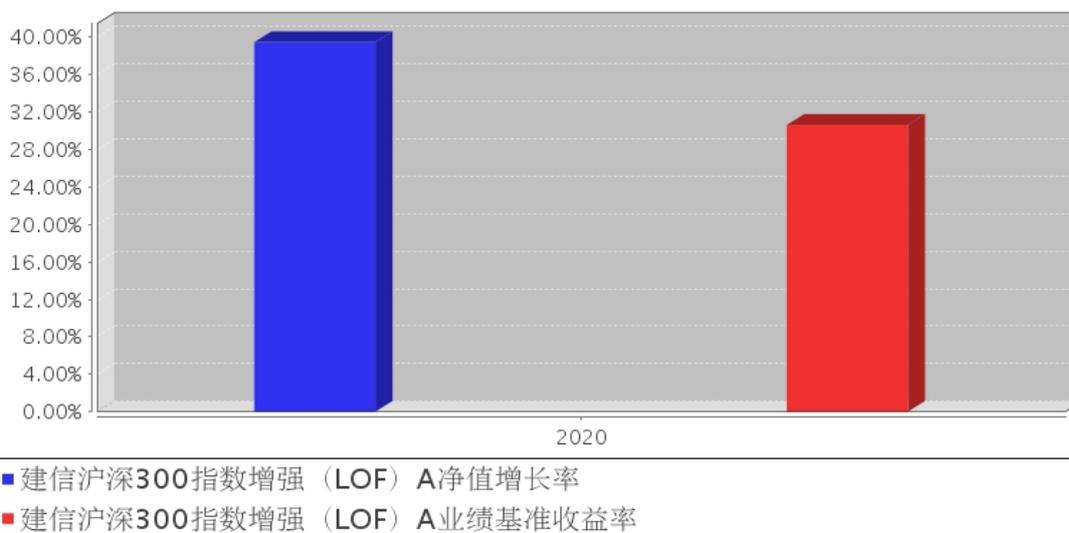
建信沪深300指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



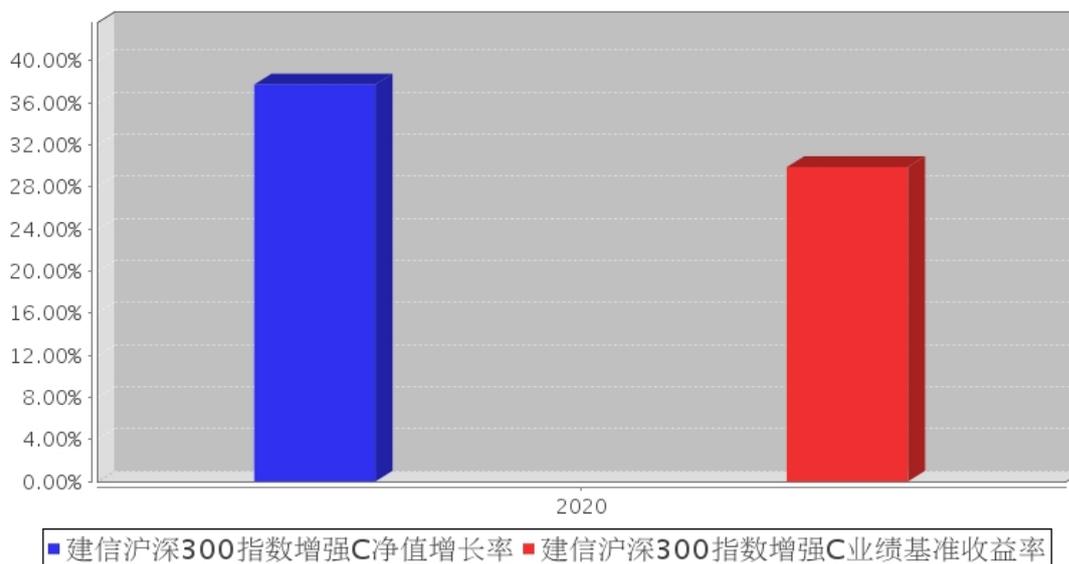
注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.2.3 自基金转型以来基金每年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 (LOF) A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



建信沪深300指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.2 基金净值表现 (转型前)

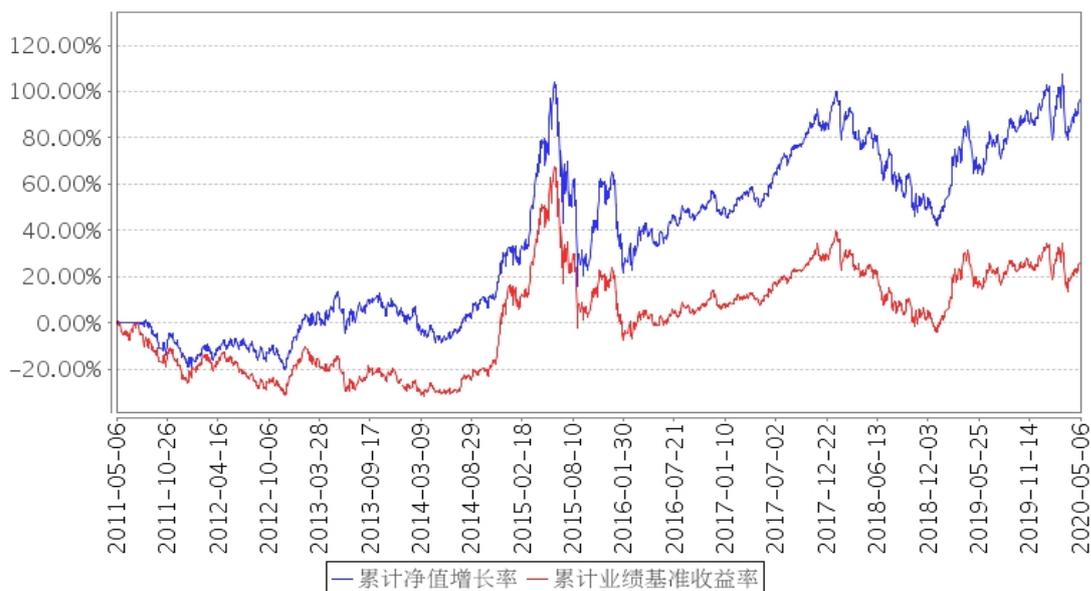
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一年	-0.44%	1.61%	-3.66%	1.65%	3.22%	-0.04%
过去三年	5.84%	1.26%	-1.94%	1.30%	7.78%	-0.04%
过去五年	22.60%	1.19%	5.72%	1.18%	16.88%	0.01%
自基金合同生效起至今	96.61%	1.41%	26.09%	1.38%	70.52%	0.03%

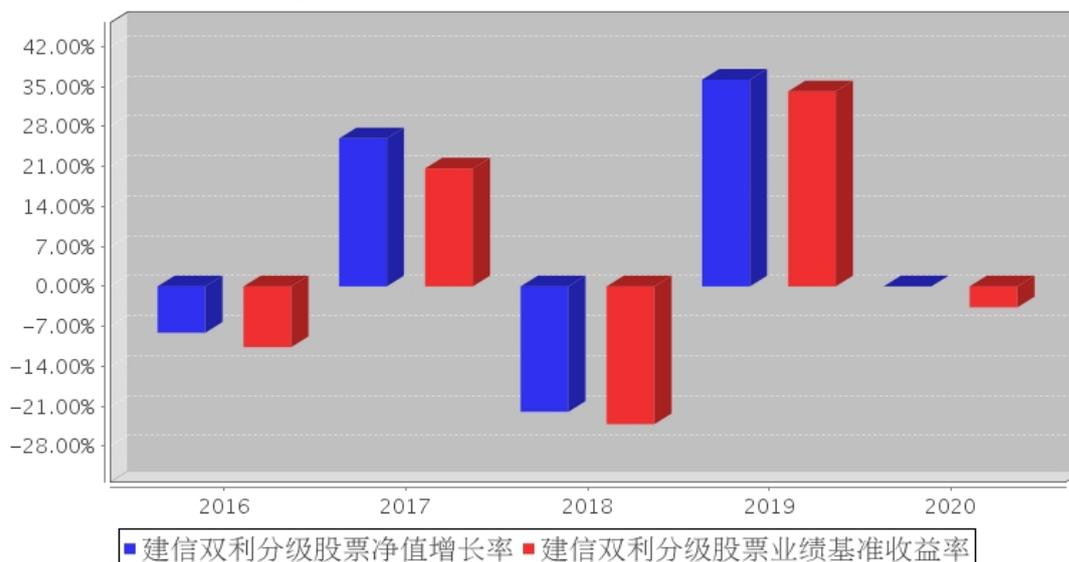
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信双利分级股票基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

注：本基金基金合同于2020年5月7日生效，自合同生效以来，本基金未实施利润分配。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

注：根据本基金基金合同的相关规定，本基金不进行收益分配，也不单独对建信稳健份额与建信进取份额进行收益分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%，信

安金融服务公司出资额占注册资本的 25%中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、海外投资部、资产配置及量化投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、基础设施投资部、网络金融部、人力资源管理部、基金会计部、注册登记部、财务管理部、金融科技部、投资风险管理部、内控合规部和审计部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京、石家庄六个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司以及在香港设立建信资产管理（香港）有限公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家，资产管理行业的领跑者”。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司旗下有建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金、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、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信恒久价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金(FOF)、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金(FOF)、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金、建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信短债债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金(LOF)、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开

放债券型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债债券型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信高股息主题股票型证券投资基金、建信科技创新混合型证券投资基金、建信上海金交易型开放式证券投资基金、建信上海金交易型开放式证券投资基金联接基金、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金、建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、建信中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金、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、建信大安全战略精选股票型证

券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、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、建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信食品饮料行业股票型证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信富时 100 指数型证券投资基金、建信利率债策略纯债债券型证券投资基金共计 131 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 4655.29 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	-	18年	梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理，博士。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。
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的涵含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	18 年	梁洪昀先生，金融工程及指数投资部总经理，博士。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。
--	--	--	--	---

注: ①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的涵含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章, 依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产, 在认真控制投资风险的基础上, 为基金持有人谋求最大利益, 没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

4.3.3 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 5 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在报告期内，召开了持有人大会，实现了基金转型，转为沪深 300 指数增强基金。在转型前，本基金是高仓位运作的股票型基金，管理人按照基金合同规定，需保持 90% 以上的仓位，并进行了比较均衡的行业配置和适度分散的持股，同时辅以新股申购等其他策略，努力增厚投资收益。在一季度末至二季度初的部分交易日，本基金曾比较密集地出现大额申购和赎回，在这一过程中，基金曾短期、被动地出现了较大幅度的仓位变动，在基金规模平稳后，管理人在规定时间内将股票投资比例恢复至正常水平。基金转型后，管理人按照新的合同，对组合进行指数增强管理，组合过渡平稳，在整个报告期内，基金相对于业绩比较基准取得了一定超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 39.48%，波动率 1.20%，业绩比较基准收益率 30.64%，波动率 1.19%；本报告期本基金 C 净值增长率 37.75%，波动率 1.21%，业绩比较基准收益率 29.89%，波动率 1.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年，Covid-19 疫情的余波尚在，但随着疫苗的推出，预计全球经济和生活将从它的巨大

冲击中逐渐恢复。各国央行为应对疫情冲击，均实施了力度很大的宽松货币政策，在经济恢复过程中此前释放的流动性是否能够恰当回收，对通胀水平的发展变化将产生直接影响，进而影响资产价格波动。2021 年在美国大选尘埃落定后，国际形势新的发展变化及其对国际经贸关系和政治关系产生的作用，可能形成中短期的扰动因素。A 股市场的波动性较之 2020 年下半年预计有所放大，少数行业板块“集中抱团”的现象预计会明显弱化。管理人将继续优化和改进量化模型，力争在适当控制跟踪误差的基础上，持续获得相对于业绩比较基准的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司内控合规部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总裁和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施：

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备定期监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由内控合规部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司年度监察稽核工作计划，实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发违法违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，

并对整改情况进行跟踪检查,促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设,充分发挥了系统自动监控的作用,尽量减少人工干预可能诱发的合规风险,提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报,加强了风险管理的宣传,强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面,注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈,重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见,并按部门一一沟通,认真进行整改、落实。

8、高度重视与信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流,以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求,认真做好本基金的信息披露工作,确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的原则,秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,以充分保障持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[2017]13号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产估值委员会,主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜,确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、投资风险管理部和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作,熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金和理财类基金);对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或

挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》, 并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性折扣, 对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

转型后报告期内, 本基金未实施利润分配, 符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

转型前报告期内, 根据相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定, 本基金不进行收益分配, 也不单独对建信稳健份额与建信进取份额进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度, 我行在履行托管职责中, 严格遵守有关法律法规、托管协议的规定, 尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款, 对托管产品的投资行为进行监督, 并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则, 独立地设置、登录和保管本产品的全套账册, 进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 61490173_A24 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 5 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 5 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p>

	<p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	王珊珊	贺耀
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2021 年 03 月 22 日	

§ 6 审计报告(转型前)

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2021)审字第 61490173_A133 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的财务报表,包括 2020 年 5 月 6 日(基金合同失效前日)的资产负债表,2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了建信双利策略主题分级股票型证券投资基金 2020 年 5 月 6 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过

	<p>程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对建信双利策略主题分级股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致建信双利策略主题分级股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注</p>

	的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	王珊珊	贺耀
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2021 年 03 月 22 日	

§ 7 年度财务报表 (转型后)

7.1 资产负债表

会计主体：建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	23,607,017.26
结算备付金		1,176,829.92
存出保证金		72,383.01
交易性金融资产	7.4.7.2	286,523,038.56
其中：股票投资		286,509,038.62
基金投资		-
债券投资		13,999.94
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		626,284.34
应收利息	7.4.7.5	2,944.25
应收股利		-
应收申购款		16,765,015.72
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		328,773,513.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		7,135,938.35
应付赎回款		515,066.40
应付管理人报酬		247,921.63

应付托管费		49,584.30
应付销售服务费		40,937.90
应付交易费用	7.4.7.7	3,149,214.76
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	350,316.41
负债合计		11,488,979.75
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	166,474,057.12
未分配利润	7.4.7.10	150,810,476.19
所有者权益合计		317,284,533.31
负债和所有者权益总计		328,773,513.06

注：1、报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 227,720,681.23 份，其中建信沪深 300 指数增强 (LOF) A 基金份额总额为 124,626,163.08 份，基金份额净值 1.3948 元；建信沪深 300 指数增强 C 基金份额总额为 103,094,518.15 份，基金份额净值 1.3915 元。

2、本财务报表的实际编制期间为 2020 年 5 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2020 年 5 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 5 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		66,727,495.06
1. 利息收入		54,699.92
其中：存款利息收入	7.4.7.11	54,699.73
债券利息收入		0.19
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		46,384,672.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	43,726,079.28
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-

贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	2,658,593.58
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.17	20,229,264.74
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	58,857.54
减: 二、费用		4,843,624.03
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,390,233.32
2. 托管费	7.4.10.2.2	278,046.61
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	147,876.32
4. 交易费用	7.4.7.19	2,766,190.73
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	261,277.05
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		61,883,871.03
减: 所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		61,883,871.03

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	57,685,368.22	55,743,301.10	113,428,669.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	61,883,871.03	61,883,871.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	108,788,688.90	33,183,304.06	141,971,992.96
其中: 1. 基金申购款	172,166,506.40	73,658,605.61	245,825,112.01
2. 基金赎回款	-63,377,817.50	-40,475,301.55	-103,853,119.05

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	166,474,057.12	150,810,476.19	317,284,533.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

吴灵玲

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)是由原建信双利策略主题分级股票型证券投资基金转型而来。根据原建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司发布的《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，转型日为 2020 年 5 月 7 日，基金名称相应变更为“建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)”，建信双利策略主题分级股票型证券投资基金份额转换为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 份额。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。自 2020 年 5 月 7 日起《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 托管协议》生效，原《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金托管协议》自同一起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间可以互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券 (包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券等)、货币市场工具 (含同业存单)、银行存款、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人可在履行适当程序后, 将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为: 本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%, 投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%; 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率 \times 95%+银行活期存款税后利率 \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2021 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定 (以下统称“企业会计准则”) 编制, 同时, 对于在具体会计核算和信息披露方面, 也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 5 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分

别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，

只能选择现金分红的方式。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定相关投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利

收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	23,607,017.26
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	23,607,017.26

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	260,248,853.00	286,509,038.62	26,260,185.62
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	13,999.94	13,999.94
	银行间市场	-	-
	合计	13,999.94	13,999.94
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	260,262,852.94	286,523,038.56	26,260,185.62

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,325.69
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	582.56
应收债券利息	0.25
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	35.75
合计	2,944.25

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	3,149,214.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,149,214.76

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	816.41
应付证券出借违约金	-
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	299,500.00
合计	350,316.41

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

建信沪深 300 指数增强 (LOF) A

项目	本期 2020 年 5 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	113,430,363.29	57,685,368.22
2020 年 5 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日基金份额折算调整	-	-
2020 年 5 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日未领取红利份额折算 调整	-	-
2020 年 5 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日集中申购募集资金本 金及利息	-	-
2020 年 5 月 7 日(基金合同生效日)至	-	-

2020 年 12 月 31 日基金拆分和集中申购完成后		
本期申购	50,608,774.67	25,737,904.94
本期赎回 (以“-”号填列)	-39,412,974.88	-20,043,734.19
本期末	124,626,163.08	63,379,538.97

建信沪深 300 指数增强 C

项目	本期 2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日基金份额折算调整	-	-
2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日未领取红利份额折算调整	-	-
2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	146,428,601.46	146,428,601.46
本期赎回 (以“-”号填列)	-43,334,083.31	-43,334,083.31
本期末	103,094,518.15	103,094,518.15

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。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

建信沪深 300 指数增强 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生	82,151,688.95	-26,408,387.85	55,743,301.10

效日			
本期利润	37,020,262.89	13,928,483.57	50,948,746.46
本期基金份额交易产生的变动数	7,238,582.03	-3,483,253.57	3,755,328.46
其中：基金申购款	41,576,333.97	-10,401,184.18	31,175,149.79
基金赎回款	-34,337,751.94	6,917,930.61	-27,419,821.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	126,410,533.87	-15,963,157.85	110,447,376.02

建信沪深 300 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,634,343.40	6,300,781.17	10,935,124.57
本期基金份额交易产生的变动数	48,948,485.97	-19,520,510.37	29,427,975.60
其中：基金申购款	70,245,739.31	-27,762,283.49	42,483,455.82
基金赎回款	-21,297,253.34	8,241,773.12	-13,055,480.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,582,829.37	-13,219,729.20	40,363,100.17

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月7日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	41,217.98
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,830.17
其他	2,651.58
合计	54,699.73

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年5月7日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	43,726,079.28
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	43,726,079.28

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年5月7日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	869,884,017.28
减：卖出股票成本总额	826,157,938.00
买卖股票差价收入	43,726,079.28

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,658,593.58
其中: 证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,658,593.58

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	20,229,264.74
股票投资	20,229,264.74
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	20,229,264.74

7.4.7.18 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	57,620.91
基金转换费收入	1,172.16
其他	64.47
合计	58,857.54

7.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,766,190.73
银行间市场交易费用	-
合计	2,766,190.73

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	32,650.53
信息披露费	78,360.51
证券出借违约金	-
银行划款手续费	8,875.88
指数使用费	129,670.33
银行间账户维护费	11,719.80
合计	261,277.05

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司 (“建信基金”)	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司 (“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司 (“中国建设银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
建信资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的子公司
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,390,233.32
其中：支付销售机构的客户维护费	325,589.34

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	278,046.61

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020 年 5 月 7 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	建信沪深 300 指数增强 C	合计
建信基金	-	67,023.33	67,023.33
中国建设银行	-	3,404.46	3,404.46
合计	-	70,427.79	70,427.79

注：“支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.4%。销售服务费的计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。”$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年5月7日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	23,607,017.26	41,217.98

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新发未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新发未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新发未上市	43.76	51.10	209	9,145.84	10,679.90	-
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月25日	新发未上市	71.71	90.85	91	6,525.61	8,267.35	-
300867	圣元环保	2020年8月12日	2021年3月3日	新发未上市	19.34	31.97	622	12,029.48	19,885.34	-
300869	康泰医学	2020年8月12日	2021年2月24日	新发未上市	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300870	欧陆通	2020年8月13日	2021年2月24日	新发未上市	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-

300871	回盛生物	2020年8月13日	2021年2月24日	新发未上市	33.61	38.70	323	10,856.03	12,500.10	-
300872	天阳科技	2020年8月14日	2021年2月25日	新发未上市	21.34	37.84	363	7,746.42	13,735.92	-
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	新发未上市	30.72	41.32	229	7,034.88	9,462.28	-
300876	蒙泰高新	2020年8月14日	2021年2月25日	新发未上市	20.09	36.62	346	6,951.14	12,670.52	-
300877	金春股份	2020年8月17日	2021年3月3日	新发未上市	30.54	50.85	296	9,039.84	15,051.60	-
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年3月3日	新发未上市	41.34	48.72	218	9,012.12	10,620.96	-
300879	大叶股份	2020年8月25日	2021年3月1日	新发未上市	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300881	盛德鑫泰	2020年8月25日	2021年3月5日	新发未上市	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新发未上市	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020年11月5日	2021年5月12日	新发未上市	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	新发未上市	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	新发未上市	44.47	74.52	184	8,182.48	13,711.68	-
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	新发未上市	27.97	30.12	335	9,369.95	10,090.20	-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月18日	新发未上市	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月	新发未上市	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-

		日	17 日								
300892	品渥食品	2020年9月11日	2021年3月24日	新发未上市	26.66	60.01	262	6,984.92	15,722.62		-
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	新发未上市	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08		-
300894	火星入	2020年12月24日	2021年7月1日	新发未上市	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16		-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	新发未上市	118.27	603.36	81	9,579.87	48,872.16		-
300903	科翔股份	2020年10月29日	2021年5月6日	新发未上市	13.06	30.47	4,775	62,361.50	145,494.25		-
300907	康平科技	2020年11月11日	2021年5月18日	新发未上市	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05		-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新发未上市	39.74	60.44	253	10,054.22	15,291.32		-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	新发未上市	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54		-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新发未上市	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14		-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	新发未上市	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22		-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新发未上市	24.60	61.51	351	8,634.60	21,590.01		-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新发未上市	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46		-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	新发未上市	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49		-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新发未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00		-
300926	博俊	2020年	2021	新发未	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84		-

	科技	12月29日	2020年7月7日	上市							
300999	金龙鱼	2020年9月29日	2021年4月15日	新发未上市	25.70	88.29	1,242	31,919.40	109,656.18		-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新发未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65		-
688095	福昕软件	2020年9月1日	2021年3月8日	新发未上市	238.53	228.79	364	86,824.92	83,279.56		-
688551	科威尔	2020年9月1日	2021年3月10日	新发未上市	37.94	33.34	1,695	64,308.30	56,511.30		-
688571	杭华股份	2020年12月2日	2021年6月11日	新发未上市	5.33	7.92	8,200	43,706.00	64,944.00		-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月7日	新发未上市	74.46	74.46	1,204	89,649.84	89,649.84		-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113616	韦尔转债	2020年12月28日	2021年1月22日	新发未上市	100.00	100.00	140	13,999.94	13,999.94	-

注：上述可流通日取自截至审计报告日的上市公司相关公告。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、内控合规部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和内控合规部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	13,999.94
未评级	-
合计	13,999.94

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险

。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工

以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对于基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,607,017.26	0.00			23,607,017.26
结算备付金	1,176,829.92				1,176,829.92
存出保证金	72,383.01				72,383.01
交易性金融资产	0.00	0.00	13,999.94	286,509,038.62	286,523,038.56
衍生金融资产					0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00			0.00
应收证券清算款				626,284.34	626,284.34
应收利息				2,944.25	2,944.25
应收股利				0.00	0.00
应收申购款	16,700,000.00			65,015.72	16,765,015.72
其他资产				0.00	0.00
资产总计	41,556,230.19	0.00	13,999.94	287,203,282.93	328,773,513.06
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	0.00			0.00
短期借款					0.00
交易性金融负债					0.00
衍生金融负债					0.00
应付证券清算款				7,135,938.35	7,135,938.35
应付赎回款				515,066.40	515,066.40
应付管理人报酬				247,921.63	247,921.63
应付托管费				49,584.30	49,584.30
应付销售服务费				40,937.90	40,937.90
应付交易费用				3,149,214.76	3,149,214.76
应交税费				0.00	0.00
应付利息				0.00	0.00
应付利润				0.00	0.00
其他负债				350,316.41	350,316.41
负债总计	0.00	0.00	0.00	11,488,979.75	11,488,979.75
利率敏感度缺口	41,556,230.19	0.00	13,999.94	275,714,303.18	317,284,533.31

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

无。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	286,509,038.62	90.30
交易性金融资产—基金投资	-	-

交易性金融资产—债券投资	13,999.94	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	286,523,038.56	90.30

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金转型后不满一年，尚无足够经验数据。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 285,347,956.18 元，属于第二层次的余额为人民币 164,003.16 元，属于第三层次的余额为人民币 1,011,079.22 元。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发

生变动。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

无。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 年度财务报表 (转型前)

7.1 资产负债表

会计主体：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 5 月 6 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 5 月 6 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	7,749,069.76	8,988,456.67
结算备付金		2,171,109.10	335,543.25
存出保证金		48,660.09	23,149.39
交易性金融资产	7.4.7.2	107,450,658.28	108,674,239.02
其中：股票投资		107,450,658.28	108,597,241.05
基金投资		-	-
债券投资		-	76,997.97
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		35,634.57	-
应收利息	7.4.7.5	15,396.23	2,194.99
应收股利		-	-
应收申购款		6,559.52	7,833.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		117,477,087.55	118,031,417.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 5 月 6 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,133,471.39	410,427.12
应付管理人报酬		177,987.49	144,229.91
应付托管费		29,664.57	24,038.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,276,645.14	1,704,354.53
应交税费		-	0.57
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	430,649.64	330,149.59
负债合计		4,048,418.23	2,613,200.02
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	57,685,368.22	58,431,551.29
未分配利润	7.4.7.10	55,743,301.10	56,986,665.72
所有者权益合计		113,428,669.32	115,418,217.01
负债和所有者权益总计		117,477,087.55	118,031,417.03

注：报告截止日 2020 年 5 月 6 日，基金份额总额 113,430,363.29 份，其中建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健收益类份额的份额净值 1.000 元，基金份额总额 820,331.00 份；建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额的份额净值 1.000 元，基金份额总额 2,516,075.00 份；建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额的份额净值 1.000 元，基金份额总额 110,093,957.29 份。

7.2 利润表

会计主体：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		3,914,931.27	39,387,352.72
1. 利息收入		53,908.33	77,269.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	33,734.99	77,134.82
债券利息收入		14.41	58.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收		20,158.93	75.91

入			
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		6,322,577.28	26,413,799.43
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	6,312,427.68	24,506,258.80
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	15,498.63	35,012.34
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-5,349.03	1,872,528.29
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-2,592,127.10	12,882,321.62
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	130,572.76	13,962.07
减: 二、费用		1,914,506.72	4,660,557.69
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	626,101.54	1,699,316.05
2. 托管费	7.4.10.2.2	104,350.26	283,219.29
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	950,672.21	2,304,679.68
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.05	0.08
7. 其他费用	7.4.7.20	233,382.66	373,342.59
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		2,000,424.55	34,726,795.03
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		2,000,424.55	34,726,795.03

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

本报告期: 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	58,431,551.29	56,986,665.72	115,418,217.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,000,424.55	2,000,424.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-746,183.07	-3,243,789.17	-3,989,972.24
其中: 1. 基金申购款	66,122,586.83	54,826,321.92	120,948,908.75
2. 基金赎回款	-66,868,769.90	-58,070,111.09	-124,938,880.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	57,685,368.22	55,743,301.10	113,428,669.32
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	69,176,542.06	31,181,103.99	100,357,646.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	34,726,795.03	34,726,795.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-10,744,990.77	-8,921,233.30	-19,666,224.07
其中: 1. 基金申购款	4,750,600.84	3,714,259.87	8,464,860.71
2. 基金赎回款	-15,495,591.61	-12,635,493.17	-28,131,084.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-	-

净值变动 (净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	58,431,551.29	56,986,665.72	115,418,217.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

吴灵玲

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信双利策略主题分级股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]355号《关于核准建信双利策略主题分级股票型证券投资基金募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司（以下简称“建信基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,973,543,800.59 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字（2011）第 161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 5 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,974,508,248.97 份基金份额，其中认购资金利息折合 964,448.38 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的基金份额包括建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额（以下简称“建信双利基金份额”）、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健收益类份额（以下简称“建信稳健份额”）及建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额（简称“建信进取份额”）。本基金通过场外、场内两种方式公开发售建信双利基金份额。投资人场外认购所得的建信双利基金份额，不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的建信双利基金份额，将按 4:6 的基金份额配比自动分离为建信稳健份额和建信进取份额。建信稳健份额和建信进取份额的数量保持 4:6 的比例不变。基金合同生效后，建信双利基金份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下，建信稳健份额和建信进取份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内建信双利基金份额与建信稳健份额和建信进取份额之

间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 10 份场内建信双利基金份额按照 4: 6 的份额配比转换成 4 份建信稳健份额与 6 份建信进取份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 4 份建信稳健份额与 6 份建信进取份额按照 4: 6 的基金份额配比转换成 10 份场内建信双利基金份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：建信双利基金份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额数量的总和。本基金每 4 份建信稳健份额与每 6 份建信进取份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 10 份建信双利基金份额的基金份额净值之和。建信稳健份额的约定年收益率为一年期同期银行定期存款利率+3.5%，建信稳健份额的份额净值每日按该约定年收益率逐日计算，计算出建信稳健份额的基金份额参考净值后，根据建信双利基金份额的基金份额净值与建信稳健份额、建信进取份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出建信进取份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内的每个会计年度（除基金合同生效日所在会计年度外）第一个工作日，本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算后建信稳健份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额折算基准日折算前建信稳健份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为场内建信双利基金份额分配给建信稳健份额持有人。建信双利基金份额持有人持有的每 10 份建信双利基金份额将按 4 份建信稳健份额获得新增建信双利基金份额的分配。持有场外建信双利基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外建信双利基金份额的分配；持有场内建信双利基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内建信双利基金份额的分配。经过上述份额折算后，建信双利基金份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，建信稳健份额和建信进取份额的份额配比保持 4: 6 的比例。建信进取份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变建信进取份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上定期份额折算外，当建信双利基金份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时，或当建信进取份额的基金份额参考净值小于或等于 0.200 元时，本基金将以该日后的次一交易日为本基金不定期折算基准日，进行不定期份额折算：份额折算后本基金将确保建信稳健份额和建信进取份额的比例为 4: 6，份额折算后建信稳健份额的基金份额参考净值、建信进取份额的基金份额参考净值和建信双利基金份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当建信双利基金份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时，基金份额折算基准日折算前建信双利基金份额的基金份额净值及建信稳健份额、建信进取份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分均将折算为建信双利基金

份额分别分配给建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额的持有人。当建信进取份额的基金份额参考净值小于或等于 0.200 元时，建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2011]168 号核准，本基金建信稳健份额 37,344,064.00 份基金份额与建信进取份额 56,016,098.00 份基金份额于 2011 年 6 月 8 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的建信双利基金份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为建信稳健份额和建信进取份额即可上市流通；对于托管在场外的建信双利基金份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为建信稳健份额和建信进取份额即可上市流通。

根据基金管理人于 2020 年 4 月 1 日发布的《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金实施转型的提示性公告》及《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2020 年 3 月 31 日表决通过了《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》，自份额转换基准日（2020 年 5 月 6 日）次日起，本基金名称将由“建信双利策略主题分级股票型证券投资基金”更名为“建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)”。《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效，《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》同日失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的股票投资比例范围为基金资产的 90%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2021 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金

会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日（基金合同失效前日）止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 5 月 6 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日（基金合同失效前日）止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息

支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在存续期内，本基金（包括建信双利基金份额、建信稳健份额、建信进取份额）不进行收益分配。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定相关投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50% 计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 5 月 6 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	7,749,069.76	8,988,456.67
定期存款	-	-
其中:存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-

存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	7,749,069.76	8,988,456.67

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 5 月 6 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	101,419,737.40	107,450,658.28	6,030,920.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	101,419,737.40	107,450,658.28	6,030,920.88
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	99,974,193.07	108,597,241.05	8,623,047.98
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	76,997.97	76,997.97
	银行间市场	-	-
	合计	76,997.97	76,997.97
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	100,051,191.04	108,674,239.02	8,623,047.98

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年5月6日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	11,750.68	2,006.54
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,558.10	166.10
应收债券利息	-	10.80
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	87.45	11.55
合计	15,396.23	2,194.99

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年5月6日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,276,645.14	1,704,354.53
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,276,645.14	1,704,354.53

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年5月6日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,621.47	63.07
应付证券出借违约金	-	-

预提费用	429,028.17	330,086.52
合计	430,649.64	330,149.59

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年5月6日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	68,631,132.02	58,431,551.29
本期申购	12,570.10	10,703.82
本期赎回(以“-”号填列)	-24,415.67	-20,790.64
2020-01-02 基金拆分/份额折算前	68,619,286.45	58,421,464.47
基金拆分/份额折算调整	814,563.70	-
本期申购	123,445,396.56	66,111,883.01
本期赎回(以“-”号填列)	-79,448,883.42	-66,847,979.26
本期末	113,430,363.29	57,685,368.22

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)根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登结”）的规定，本基金以2020年1月2日为份额折算基准日，对建信双利基金份额以及建信稳健份额实施了定期份额折算。具体情况详见本基金管理人的相关公告。

(3)根据基金合同规定，投资者可申购、赎回建信双利基金份额，建信稳健份额和建信进取份额只可在深交所上市交易，因此上表不再单独披露建信稳健份额和建信进取份额的情况。

(4)本期申购123,445,396.56份中，包含本基金于2020年5月6日（转换基准日）对各类基金份额进行折算并转换为建信沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)A类基金份额时，所增加的份额44,872,854.08份。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	77,495,502.73	-20,508,837.01	56,986,665.72
本期利润	4,592,551.65	-2,592,127.10	2,000,424.55
本期基金份额交易产生的变动数	63,634.57	-3,307,423.74	-3,243,789.17
其中：基金申购款	94,326,644.73	-39,500,322.81	54,826,321.92
基金赎回款	-94,263,010.16	36,192,899.07	-58,070,111.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	82,151,688.95	-26,408,387.85	55,743,301.10

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年5月6日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	26,493.38	67,107.78
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	5,337.21	9,535.52
其他	1,904.40	491.52
合计	33,734.99	77,134.82

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年5月6日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	6,312,427.68	24,506,258.80
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	6,312,427.68	24,506,258.80

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年5月6日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	314,595,461.94	765,497,070.90
减：卖出股票成本总额	308,283,034.26	740,990,812.10
买卖股票差价收入	6,312,427.68	24,506,258.80

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年5月6日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	15,498.63	35,012.34
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	15,498.63	35,012.34

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年5月6日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	92,522.25	453,063.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	76,997.97	417,997.17
减：应收利息总额	25.65	53.55
买卖债券差价收入	15,498.63	35,012.34

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	-5,349.03	1,872,528.29
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	-5,349.03	1,872,528.29

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-2,592,127.10	12,882,321.62
股票投资	-2,592,127.10	12,882,321.62
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-2,592,127.10	12,882,321.62

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	130,551.87	13,761.03
基金转换费收入	20.89	201.04
合计	130,572.76	13,962.07

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	950,672.21	2,304,679.68

银行间市场交易费用	-	-
合计	950,672.21	2,304,679.68

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年5月6日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	17,349.47	50,000.00
信息披露费	141,639.49	239,833.72
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	3,113.50	5,508.87
银行间账户维护费	6,280.20	18,000.00
持有人大会费用	45,000.00	-
上市费	20,000.00	60,000.00
合计	233,382.66	373,342.59

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
建信资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年5 月6日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	626,101.54	1,699,316.05
其中：支付销售机构的客户维护费	214,312.02	655,886.76

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	104,350.26	283,219.29

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年5月6日		2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	7,749,069.76	26,493.38	8,988,456.67	67,107.78

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2020 年 5 月 6 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300831	派瑞股份	2020年4月24日	2020年5月7日	新发未上市	3.98	3.98	1,716	6,829.68	6,829.68	-
300832	新产业	2020年4月30日	2020年5月12日	新发未上市	31.39	31.39	882	27,685.98	27,685.98	-
688039	当虹科技	2019年12月4日	2020年6月11日	新发未上市	50.48	87.96	2,805	141,596.40	246,727.80	-
688080	映翰通	2020年2月3日	2020年8月12日	新发未上市	27.63	56.62	1,786	49,347.18	101,123.32	-
688196	卓越新能	2019年11月13日	2020年5月21日	新发未上市	42.93	35.74	6,957	298,664.01	248,643.18	-
688222	成都先导	2020年4月3日	2020年10月16日	新发未上市	20.52	30.14	6,468	132,723.36	194,945.52	-
688588	凌志软件	2020年4月28日	2020年5月11日	新发未上市	11.49	11.49	11,748	134,984.52	134,984.52	-

注：上述可流通日取自截至审计报告日的上市公司相关公告。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和
控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、
内控合规部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的
督察长和内控合规部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人
出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基
金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算
，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证
券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发
行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计
及汇总。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，

则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 5 月 6 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	76,997.97
未评级	-	-
合计	-	76,997.97

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于

市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 5 月 6 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,749,069.76	0.00			7,749,069.76
结算备付金	2,171,109.10				2,171,109.10
存出保证金	48,660.09				48,660.09
交易性金融资产				107,450,658.28	107,450,658.28
衍生金融资产					0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00			0.00
应收证券清算款				35,634.57	35,634.57
应收利息				15,396.23	15,396.23
应收股利				0.00	0.00
应收申购款				6,559.52	6,559.52
其他资产				0.00	0.00
资产总计	9,968,838.95			107,508,248.60	117,477,087.55
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	0.00			0.00
短期借款					0.00
交易性金融负债					0.00
衍生金融负债					0.00
应付证券清算款				0.00	0.00
应付赎回款				1,133,471.39	1,133,471.39
应付管理人报酬				177,987.49	177,987.49
应付托管费				29,664.57	29,664.57
应付销售服务费				0.00	0.00
应付交易费用				2,276,645.14	2,276,645.14
应交税费				0.00	0.00
应付利息				0.00	0.00
应付利润				0.00	0.00
其他负债				430,649.64	430,649.64
负债总计	-			4,048,418.23	4,048,418.23
利率敏感度缺口	9,968,838.95	0.00	0.00	103,459,830.37	113,428,669.32
上年度末 2019 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	8,988,456.67	-	-	-	8,988,456.67
结算备付金	335,543.25	-	-	-	335,543.25
存出保证金	23,149.39	-	-	-	23,149.39

交易性金融资产	-	-	76,997.97	108,597,241.05	108,674,239.02
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,194.99	2,194.99
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,833.71	7,833.71
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,347,149.31	-	76,997.97	108,607,269.75	118,031,417.03
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	410,427.12	410,427.12
应付管理人报酬	-	-	-	144,229.91	144,229.91
应付托管费	-	-	-	24,038.30	24,038.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,704,354.53	1,704,354.53
应交税费	-	-	-	0.57	0.57
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	330,149.59	330,149.59
负债总计	-	-	-	2,613,200.02	2,613,200.02
利率敏感度缺口	9,347,149.31	-	76,997.97	105,994,069.73	115,418,217.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票、基金和衍生工具，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例范围为基金总资产的 90%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%；固定收益类证券和现金投资比例范围为基金总资产的 5%-10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年5月6日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	107,450,658.28	94.73	108,597,241.05	94.09
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	76,997.97	0.07
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	107,450,658.28	94.73	108,674,239.02	94.16

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2020 年 5 月 6 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	5,463,585.11	5,608,824.35
	业绩比较基准下降 5%	-5,463,585.11	-5,608,824.35

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其因剩余期限不长, 公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 5 月 6 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 106,489,718.28 元, 属于第二层次的余额为人民币 169,500.18 元, 属于第三层次的余额为人民币 791,439.82 元 (于 2019 年 12 月 31 日, 属于第一层次的余额为人民币 105,910,082.91 元, 属于第二层次的余额为人民币 1,001,363.01 元, 属于第三层次的余额为人民币 1,762,793.10 元)。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属

于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

根据基金管理人于 2020 年 4 月 1 日发布的《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金实施转型的提示性公告》及《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2020 年 3 月 31 日表决通过了《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》，自份额转换基准日（2020 年 5 月 6 日）次日起，本基金名称由“建信双利策略主题分级股票型证券投资基金”更名为“建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)”。《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效，《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》同日失效。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告（转型后）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	286,509,038.62	87.14
	其中：股票	286,509,038.62	87.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,999.94	0.00
	其中：债券	13,999.94	0.00
	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	24,783,847.18	7.54
8	其他各项资产	17,466,627.32	5.31
9	合计	328,773,513.06	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	2,067,822.00	0.65
B	采矿业	7,690,011.57	2.42
C	制造业	121,752,802.80	38.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,750,140.00	3.70
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,504,678.71	3.00
G	交通运输、仓储和邮政业	541,740.00	0.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,724,918.20	1.17
J	金融业	75,660,374.84	23.85
K	房地产业	10,791,518.00	3.40
L	租赁和商务服务业	4,844,679.00	1.53
M	科学研究和技术服务业	4,302,016.00	1.36
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	484,794.00	0.15
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	47,008.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	253,162,503.12	79.79

8.2.2 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	-	-
C	制造业	22,030,496.44	6.94

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	651,744.00	0.21
F	批发和零售业	1,133,954.62	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	782,303.28	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,627,134.97	1.77
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,927,186.82	0.61
L	租赁和商务服务业	223,944.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	13,711.68	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	28,152.69	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	575,904.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	352,003.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	33,346,535.50	10.51

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	183,534	15,963,787.32	5.03
2	000858	五粮液	54,073	15,781,205.05	4.97

3	601166	兴业银行	587,992	12,271,393.04	3.87
4	600519	贵州茅台	6,100	12,187,800.00	3.84
5	600900	长江电力	499,300	9,566,588.00	3.02
6	300059	东方财富	256,600	7,954,600.00	2.51
7	002594	比亚迪	33,900	6,586,770.00	2.08
8	600276	恒瑞医药	58,948	6,570,344.08	2.07
9	601211	国泰君安	369,700	6,480,841.00	2.04
10	300124	汇川技术	65,200	6,083,160.00	1.92
11	001979	招商蛇口	438,600	5,828,994.00	1.84
12	600809	山西汾酒	15,000	5,629,350.00	1.77
13	601288	农业银行	1,735,400	5,449,156.00	1.72
14	002475	立讯精密	95,760	5,374,051.20	1.69
15	601012	隆基股份	57,500	5,301,500.00	1.67
16	002024	苏宁易购	580,501	4,475,662.71	1.41
17	601888	中国中免	15,800	4,462,710.00	1.41
18	000002	万科A	150,100	4,307,870.00	1.36
19	000001	平安银行	218,000	4,216,120.00	1.33
20	601555	东吴证券	420,618	4,147,293.48	1.31
21	603833	欧派家居	30,100	4,048,450.00	1.28
22	601818	光大银行	952,200	3,799,278.00	1.20
23	600887	伊利股份	81,100	3,598,407.00	1.13
24	600019	宝钢股份	604,500	3,596,775.00	1.13
25	000333	美的集团	35,500	3,494,620.00	1.10
26	601899	紫金矿业	370,600	3,442,874.00	1.09
27	600584	长电科技	78,800	3,354,516.00	1.06
28	600309	万华化学	36,000	3,277,440.00	1.03
29	600893	航发动力	49,300	2,925,955.00	0.92
30	600998	九州通	160,100	2,907,416.00	0.92
31	601066	中信建投	67,700	2,843,400.00	0.90
32	002422	科伦药业	144,208	2,803,403.52	0.88
33	603259	药明康德	20,100	2,707,872.00	0.85
34	600031	三一重工	77,100	2,696,958.00	0.85
35	000725	京东方A	437,300	2,623,800.00	0.83
36	600000	浦发银行	257,100	2,488,728.00	0.78
37	601377	兴业证券	281,800	2,446,024.00	0.77
38	600489	中金黄金	265,597	2,339,909.57	0.74
39	600705	中航资本	524,300	2,296,434.00	0.72
40	002493	荣盛石化	81,800	2,258,498.00	0.71
41	600011	华能国际	487,400	2,183,552.00	0.69
42	601838	成都银行	201,800	2,153,206.00	0.68
43	601607	上海医药	110,500	2,121,600.00	0.67
44	002714	牧原股份	26,820	2,067,822.00	0.65

45	002602	世纪华通	283,000	2,012,130.00	0.63
46	603288	海天味业	9,900	1,985,346.00	0.63
47	300122	智飞生物	13,000	1,922,830.00	0.61
48	601225	陕西煤业	204,200	1,907,228.00	0.60
49	600015	华夏银行	302,600	1,891,250.00	0.60
50	002241	歌尔股份	42,800	1,597,296.00	0.50
51	000651	格力电器	25,756	1,595,326.64	0.50
52	300676	华大基因	12,400	1,594,144.00	0.50
53	002508	老板电器	35,495	1,447,486.10	0.46
54	300014	亿纬锂能	17,100	1,393,650.00	0.44
55	002410	广联达	16,580	1,305,509.20	0.41
56	601009	南京银行	155,800	1,258,864.00	0.40
57	600438	通威股份	32,300	1,241,612.00	0.39
58	300142	沃森生物	29,470	1,136,363.20	0.36
59	603501	韦尔股份	4,900	1,132,390.00	0.36
60	002311	海大集团	16,900	1,106,950.00	0.35
61	603799	华友钴业	13,200	1,046,760.00	0.33
62	000708	中信特钢	46,276	1,008,354.04	0.32
63	000895	双汇发展	20,200	948,188.00	0.30
64	600183	生益科技	30,400	856,064.00	0.27
65	600104	上汽集团	33,200	811,408.00	0.26
66	000786	北新建材	20,151	807,047.55	0.25
67	000568	泸州老窖	3,300	746,328.00	0.24
68	002456	欧菲光	50,400	664,272.00	0.21
69	600848	上海临港	32,700	654,654.00	0.21
70	600741	华域汽车	19,200	553,344.00	0.17
71	002607	中公教育	13,800	484,794.00	0.15
72	000661	长春高新	1,000	448,910.00	0.14
73	002153	石基信息	13,100	407,279.00	0.13
74	002027	分众传媒	38,700	381,969.00	0.12
75	300529	健帆生物	5,400	366,228.00	0.12
76	600018	上港集团	79,200	361,944.00	0.11
77	002414	高德红外	7,600	317,300.00	0.10
78	600346	恒力石化	9,186	256,932.42	0.08
79	600233	圆通速递	14,100	162,150.00	0.05
80	600299	安迪苏	7,200	82,872.00	0.03
81	300003	乐普医疗	1,900	51,642.00	0.02
82	002739	万达电影	2,600	47,008.00	0.01
83	300601	康泰生物	200	34,900.00	0.01
84	002352	顺丰控股	200	17,646.00	0.01

8.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	300666	江丰电子	51,400	2,544,814.00	0.80
2	300679	电连技术	64,700	2,197,859.00	0.69
3	002268	卫士通	128,300	2,142,610.00	0.68
4	300523	辰安科技	58,900	1,921,907.00	0.61
5	603345	安井食品	9,900	1,909,413.00	0.60
6	600266	城建发展	351,196	1,784,075.68	0.56
7	002701	奥瑞金	355,100	1,754,194.00	0.55
8	002591	恒大高新	237,500	1,330,000.00	0.42
9	002734	利民股份	100,500	1,277,355.00	0.40
10	002616	长青集团	158,500	1,204,600.00	0.38
11	000906	浙商中拓	167,400	1,118,232.00	0.35
12	300760	迈瑞医疗	2,500	1,065,000.00	0.34
13	002745	木林森	69,500	1,014,005.00	0.32
14	300508	维宏股份	39,600	934,560.00	0.29
15	002293	罗莱生活	71,100	885,195.00	0.28
16	603713	密尔克卫	5,900	772,841.00	0.24
17	603238	诺邦股份	23,600	749,300.00	0.24
18	002375	亚厦股份	87,600	651,744.00	0.21
19	300548	博创科技	18,200	630,630.00	0.20
20	000039	中集集团	39,200	587,608.00	0.19
21	300244	迪安诊断	16,800	575,904.00	0.18
22	300640	德艺文创	75,700	552,610.00	0.17
23	600803	新奥股份	35,500	482,445.00	0.15
24	002705	新宝股份	10,400	439,400.00	0.14
25	300145	中金环境	126,286	388,960.88	0.12
26	300788	中信出版	8,300	352,003.00	0.11
27	002847	盐津铺子	3,000	330,660.00	0.10
28	688608	恒玄科技	845	279,695.00	0.09
29	300354	东华测试	18,600	267,840.00	0.08
30	300573	兴齐眼药	2,700	257,121.00	0.08
31	603378	亚士创能	5,800	247,718.00	0.08
32	300737	科顺股份	11,100	238,206.00	0.08
33	600057	厦门象屿	37,200	223,944.00	0.07
34	603887	城地香江	12,300	215,988.00	0.07
35	300036	超图软件	8,400	154,896.00	0.05
36	002405	四维图新	10,300	146,981.00	0.05

37	002890	弘宇股份	6,000	146,700.00	0.05
38	300903	科翔股份	4,775	145,494.25	0.05
39	002314	南山控股	32,400	134,136.00	0.04
40	300999	金龙鱼	1,242	109,656.18	0.03
41	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.03
42	688617	惠泰医疗	1,204	89,649.84	0.03
43	688095	福昕软件	364	83,279.56	0.03
44	002793	罗欣药业	6,800	70,516.00	0.02
45	688571	杭华股份	8,200	64,944.00	0.02
46	603566	普莱柯	3,100	64,263.00	0.02
47	688551	科威尔	1,695	56,511.30	0.02
48	300515	三德科技	4,800	50,064.00	0.02
49	300896	爱美客	81	48,872.16	0.02
50	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
51	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.01
52	002345	潮宏基	7,100	29,110.00	0.01
53	300894	火星人	628	23,217.16	0.01
54	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
55	300919	中伟股份	351	21,590.01	0.01
56	300867	圣元环保	622	19,885.34	0.01
57	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
58	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.01
59	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
60	300892	品渥食品	262	15,722.62	0.00
61	300908	仲景食品	253	15,291.32	0.00
62	300877	金春股份	296	15,051.60	0.00
63	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
64	300872	天阳科技	363	13,735.92	0.00
65	300887	谱尼测试	184	13,711.68	0.00
66	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
67	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
68	300876	蒙泰高新	346	12,670.52	0.00
69	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
70	300871	回盛生物	323	12,500.10	0.00
71	002019	亿帆医药	600	11,358.00	0.00
72	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
73	300861	美畅股份	209	10,679.90	0.00
74	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
75	300878	维康药业	218	10,620.96	0.00
76	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
77	300889	爱克股份	335	10,090.20	0.00
78	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
79	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00

80	300873	海晨股份	229	9,462.28	0.00
81	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
82	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
83	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
84	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
85	300864	南大环境	91	8,267.35	0.00
86	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
87	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
88	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	19,399,804.56	6.11
2	600000	浦发银行	16,479,035.69	5.19
3	601166	兴业银行	15,941,128.00	5.02
4	601818	光大银行	13,237,221.00	4.17
5	600030	中信证券	13,067,589.00	4.12
6	002475	立讯精密	12,675,718.12	4.00
7	000001	平安银行	12,429,290.00	3.92
8	300059	东方财富	12,398,863.41	3.91
9	000651	格力电器	11,959,559.00	3.77
10	000858	五粮液	11,914,725.00	3.76
11	600519	贵州茅台	11,365,295.97	3.58
12	600900	长江电力	10,934,022.00	3.45
13	001979	招商蛇口	10,423,639.76	3.29
14	000002	万科A	10,160,876.00	3.20
15	600919	江苏银行	10,121,805.71	3.19
16	601288	农业银行	10,004,109.00	3.15
17	000333	美的集团	9,053,114.17	2.85
18	601229	上海银行	8,631,787.10	2.72
19	601688	华泰证券	8,278,231.00	2.61
20	600016	民生银行	8,222,801.00	2.59
21	601211	国泰君安	8,130,081.00	2.56
22	600015	华夏银行	8,114,186.00	2.56
23	600346	恒力石化	7,906,477.38	2.49
24	600584	长电科技	7,818,347.99	2.46
25	002410	广联达	7,792,083.82	2.46

26	601838	成都银行	7,568,376.56	2.39
27	601012	隆基股份	7,311,762.00	2.30
28	300498	温氏股份	7,195,187.19	2.27
29	000786	北新建材	7,178,502.07	2.26
30	300124	汇川技术	7,170,937.00	2.26
31	600887	伊利股份	6,991,440.00	2.20
32	600848	上海临港	6,907,912.58	2.18
33	002714	牧原股份	6,731,556.00	2.12
34	603259	药明康德	6,723,603.53	2.12
35	600309	万华化学	6,678,322.80	2.10
36	002024	苏宁易购	6,601,005.20	2.08
37	601668	中国建筑	6,490,526.00	2.05

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600000	浦发银行	14,278,030.00	4.50
2	600030	中信证券	13,907,441.00	4.38
3	601318	中国平安	12,992,811.61	4.10
4	601818	光大银行	12,234,167.00	3.86
5	000333	美的集团	11,869,996.70	3.74
6	300059	东方财富	11,671,107.64	3.68
7	000651	格力电器	11,045,805.36	3.48
8	002475	立讯精密	10,634,537.82	3.35
9	601166	兴业银行	10,122,626.62	3.19
10	000001	平安银行	10,112,399.72	3.19
11	600919	江苏银行	10,023,741.77	3.16
12	600346	恒力石化	9,950,638.15	3.14
13	601229	上海银行	8,232,225.32	2.59
14	601688	华泰证券	8,195,473.25	2.58
15	000157	中联重科	7,959,143.00	2.51
16	600016	民生银行	7,945,707.00	2.50
17	601390	中国中铁	7,780,761.62	2.45
18	002714	牧原股份	7,694,850.40	2.43
19	000858	五粮液	7,432,785.11	2.34
20	300498	温氏股份	7,398,243.40	2.33
21	600519	贵州茅台	7,200,449.00	2.27
22	601668	中国建筑	7,054,810.00	2.22
23	000786	北新建材	6,967,904.58	2.20

24	601336	新华保险	6,820,978.00	2.15
25	002410	广联达	6,710,241.94	2.11
26	000002	万科A	6,548,830.90	2.06
27	600848	上海临港	6,520,833.20	2.06

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	984,987,053.60
卖出股票收入（成交）总额	869,884,017.28

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	13,999.94	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,999.94	0.00

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113616	韦尔转债	140	13,999.94	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 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贵金属投资明细

无。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	72,383.01
2	应收证券清算款	626,284.34
3	应收股利	-
4	应收利息	2,944.25
5	应收申购款	16,765,015.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,466,627.32

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 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。

§ 8 投资组合报告 (转型前)

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	106,250.41	0.09
9	合计	117,477,087.55	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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
11	601818	光大银行	716,300	2,643,147.00	2.33
12	601390	中国中铁	440,300	2,580,158.00	2.27
13	601881	中国银河	257,200	2,561,712.00	2.26
14	600025	华能水电	666,200	2,371,672.00	2.09
15	002797	第一创业	333,300	2,329,767.00	2.05
16	601857	中国石油	520,500	2,326,635.00	2.05
17	002475	立讯精密	48,500	2,304,235.00	2.03
18	601377	兴业证券	367,600	2,220,304.00	1.96
19	000069	华侨城 A	347,200	2,204,720.00	1.94
20	600436	片仔癀	14,500	2,109,605.00	1.86
21	002142	宁波银行	80,800	2,097,568.00	1.85
22	600958	东方证券	207,600	1,941,060.00	1.71

23	600079	人福医药	83,000	1,809,400.00	1.60
24	600031	三一重工	89,400	1,807,668.00	1.59
25	000157	中联重科	270,800	1,779,156.00	1.57
26	603288	海天味业	12,200	1,551,718.00	1.37
27	002024	苏宁易购	175,200	1,508,472.00	1.33
28	600606	绿地控股	254,900	1,437,636.00	1.27
29	000563	陕国投A	400,000	1,436,000.00	1.27
30	000568	泸州老窖	16,500	1,303,995.00	1.15
31	601186	中国铁建	132,100	1,302,506.00	1.15
32	002415	海康威视	39,000	1,255,800.00	1.11
33	603160	汇顶科技	4,910	1,188,220.00	1.05
34	300750	宁德时代	6,800	991,372.00	0.87
35	601225	陕西煤业	126,900	928,908.00	0.82
36	300498	温氏股份	30,000	908,100.00	0.80
37	603993	洛阳钼业	201,800	736,570.00	0.65
38	002555	三七互娱	20,000	719,000.00	0.63
39	300751	迈为股份	4,000	702,280.00	0.62
40	600837	海通证券	51,900	665,877.00	0.59
41	002092	中泰化学	125,700	597,075.00	0.53
42	603899	晨光文具	11,100	582,750.00	0.51
43	600346	恒力石化	40,500	575,910.00	0.51
44	000001	平安银行	41,300	568,701.00	0.50
45	601336	新华保险	11,800	534,894.00	0.47
46	000876	新希望	16,300	529,098.00	0.47
47	002223	鱼跃医疗	14,100	495,756.00	0.44
48	300122	智飞生物	6,100	493,185.00	0.43
49	603986	兆易创新	1,600	488,960.00	0.43
50	000063	中兴通讯	11,600	486,272.00	0.43
51	000961	中南建设	58,500	470,925.00	0.42
52	601668	中国建筑	86,800	454,832.00	0.40
53	300709	精研科技	4,400	441,584.00	0.39
54	000895	双汇发展	10,500	435,645.00	0.38
55	600183	生益科技	12,900	425,184.00	0.37
56	000651	格力电器	6,900	375,774.00	0.33
57	000625	长安汽车	34,000	357,680.00	0.32
58	002685	华东重机	72,500	337,850.00	0.30
59	002607	中公教育	12,401	320,069.81	0.28
60	603690	至纯科技	8,200	318,980.00	0.28
61	600486	扬农化工	4,100	315,823.00	0.28
62	000550	江铃汽车	26,000	310,960.00	0.27
63	300602	飞荣达	5,900	308,570.00	0.27
64	002602	世纪华通	21,100	295,822.00	0.26

65	002353	杰瑞股份	11,400	287,850.00	0.25
66	603259	药明康德	2,608	261,425.92	0.23
67	300118	东方日升	21,000	254,100.00	0.22
68	688196	卓越新能	6,957	248,643.18	0.22
69	688039	当虹科技	2,805	246,727.80	0.22
70	300397	天和防务	5,100	241,791.00	0.21
71	601985	中国核电	55,400	240,990.00	0.21
72	601012	隆基股份	7,800	238,134.00	0.21
73	300454	深信服	1,200	229,560.00	0.20
74	002252	上海莱士	25,900	222,222.00	0.20
75	603063	禾望电气	26,700	218,940.00	0.19
76	600819	耀皮玻璃	48,400	216,348.00	0.19
77	002912	中新赛克	1,100	211,508.00	0.19
78	600547	山东黄金	5,500	200,530.00	0.18
79	600104	上汽集团	10,200	200,124.00	0.18
80	688222	成都先导	6,468	194,945.52	0.17
81	601899	紫金矿业	48,800	193,248.00	0.17
82	000667	美好置业	61,700	173,377.00	0.15
83	002456	欧菲光	10,000	158,000.00	0.14
84	603609	禾丰牧业	10,100	154,429.00	0.14
85	000725	京东方 A	39,000	148,980.00	0.13
86	002869	金溢科技	1,900	135,508.00	0.12
87	688588	凌志软件	11,748	134,984.52	0.12
88	600521	华海药业	4,500	124,830.00	0.11
89	000661	长春高新	200	122,340.00	0.11
90	002634	棒杰股份	19,900	119,798.00	0.11
91	300383	光环新网	3,700	106,671.00	0.09
92	002422	科伦药业	5,200	102,544.00	0.09
93	688080	映翰通	1,786	101,123.32	0.09
94	002655	共达电声	9,600	89,760.00	0.08
95	300537	广信材料	3,500	53,725.00	0.05
96	600661	昂立教育	3,000	47,460.00	0.04
97	300552	万集科技	600	45,258.00	0.04
98	002878	元隆雅图	1,400	43,694.00	0.04
99	601628	中国人寿	1,500	41,850.00	0.04
100	300654	世纪天鸿	3,200	37,760.00	0.03
101	002985	北摩高科	782	30,693.50	0.03
102	000002	万科 A	1,100	28,886.00	0.03
103	300832	新产业	882	27,685.98	0.02
104	601933	永辉超市	2,400	24,408.00	0.02
105	000949	新乡化纤	6,300	23,562.00	0.02
106	300829	金丹科技	574	22,202.32	0.02

107	603019	中科曙光	400	20,800.00	0.02
108	300726	宏达电子	700	18,263.00	0.02
109	002983	芯瑞达	660	16,414.20	0.01
110	002352	顺丰控股	300	14,064.00	0.01
111	603392	万泰生物	785	11,971.25	0.01
112	603212	赛伍技术	715	11,847.55	0.01
113	603439	贵州三力	797	11,221.76	0.01
114	300188	美亚柏科	500	10,990.00	0.01
115	300830	金现代	1,671	10,594.14	0.01
116	300831	派瑞股份	1,716	6,829.68	0.01
117	603129	春风动力	100	4,180.00	0.00
118	002459	晶澳科技	200	3,088.00	0.00
119	000425	徐工机械	500	2,865.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	6,488,406.77	5.62
2	601211	国泰君安	6,326,034.00	5.48
3	600000	浦发银行	5,917,611.00	5.13
4	600958	东方证券	5,433,142.53	4.71
5	600276	恒瑞医药	5,273,465.79	4.57
6	601766	中国中车	4,943,755.00	4.28
7	601186	中国铁建	4,807,489.00	4.17
8	000333	美的集团	4,649,388.56	4.03
9	000568	泸州老窖	4,497,585.00	3.90
10	601628	中国人寿	4,497,002.00	3.90
11	601288	农业银行	4,435,635.00	3.84
12	601998	中信银行	4,297,818.07	3.72
13	600436	片仔癀	4,253,411.14	3.69
14	601881	中国银河	4,216,207.00	3.65
15	601818	光大银行	4,077,800.00	3.53
16	603259	药明康德	4,023,894.81	3.49
17	002714	牧原股份	3,781,933.00	3.28
18	601166	兴业银行	3,706,490.00	3.21
19	300059	东方财富	3,590,857.00	3.11
20	601398	工商银行	3,588,159.00	3.11
21	601857	中国石油	3,585,747.00	3.11

22	601012	隆基股份	3,368,471.70	2.92
23	600048	保利地产	3,337,949.00	2.89
24	002142	宁波银行	3,217,823.52	2.79
25	600025	华能水电	3,132,246.00	2.71
26	600031	三一重工	3,127,287.99	2.71
27	000069	华侨城 A	3,090,883.00	2.68
28	000001	平安银行	3,081,221.00	2.67
29	300498	温氏股份	3,047,682.57	2.64
30	601985	中国核电	2,858,543.00	2.48
31	002024	苏宁易购	2,685,836.00	2.33
32	601169	北京银行	2,648,043.00	2.29
33	601988	中国银行	2,622,430.00	2.27
34	601668	中国建筑	2,618,195.00	2.27
35	002475	立讯精密	2,501,433.34	2.17
36	000563	陕国投 A	2,487,562.00	2.16
37	600346	恒力石化	2,457,190.00	2.13
38	601390	中国中铁	2,430,407.00	2.11
39	002797	第一创业	2,408,980.00	2.09
40	300402	宝色股份	2,400,273.00	2.08
41	002415	海康威视	2,397,626.00	2.08
42	000157	中联重科	2,362,529.00	2.05
43	002607	中公教育	2,354,151.36	2.04
44	600837	海通证券	2,336,475.00	2.02
45	601377	兴业证券	2,310,061.00	2.00

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600000	浦发银行	9,839,766.55	8.53
2	601318	中国平安	8,114,214.67	7.03
3	601211	国泰君安	6,313,326.00	5.47
4	601288	农业银行	5,936,753.00	5.14
5	601766	中国中车	5,755,396.00	4.99
6	000568	泸州老窖	5,672,912.46	4.92
7	601012	隆基股份	5,237,853.00	4.54
8	603259	药明康德	5,031,150.68	4.36
9	000002	万科 A	4,790,894.00	4.15
10	300498	温氏股份	4,638,654.81	4.02
11	601998	中信银行	4,418,676.20	3.83

12	600837	海通证券	4,382,288.00	3.80
13	000001	平安银行	4,277,086.40	3.71
14	601628	中国人寿	4,229,577.00	3.66
15	601668	中国建筑	3,886,333.00	3.37
16	601688	华泰证券	3,869,235.48	3.35
17	000333	美的集团	3,787,677.00	3.28
18	300059	东方财富	3,638,650.80	3.15
19	601229	上海银行	3,616,495.00	3.13
20	600958	东方证券	3,558,538.00	3.08
21	601186	中国铁建	3,516,610.00	3.05
22	002607	中公教育	3,485,788.00	3.02
23	601398	工商银行	3,321,823.00	2.88
24	601166	兴业银行	3,183,520.00	2.76
25	002415	海康威视	3,123,670.00	2.71
26	603288	海天味业	3,010,149.61	2.61
27	600276	恒瑞医药	2,738,731.00	2.37
28	002299	圣农发展	2,648,827.44	2.29
29	601988	中国银行	2,647,731.00	2.29
30	600346	恒力石化	2,635,804.00	2.28
31	300402	宝色股份	2,603,769.00	2.26
32	601985	中国核电	2,490,141.97	2.16
33	603977	国泰集团	2,484,967.92	2.15
34	600031	三一重工	2,442,266.00	2.12
35	000651	格力电器	2,379,849.00	2.06

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	309,728,578.59
卖出股票收入（成交）总额	314,595,461.94

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 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贵金属投资明细

无。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
建信沪深 300 指数增强(LOF) A	4,195	29,708.26	45,108,624.22	36.20	79,517,538.86	63.80
建信沪深 300 指数增强 C	2,713	38,000.19	96,164,734.98	93.28	6,929,783.17	6.72
合计	6,908	32,964.78	141,273,359.20	62.04	86,447,322.03	37.96

9.2 期末上市基金前十名持有人

建信沪深 300 指数增强 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	纪嘉伦	416,067.00	10.97
2	高其铭	312,477.00	8.24
3	刘新	253,000.00	6.67
4	官文举	194,296.00	5.12
5	柴旭麟	182,803.00	4.82
6	颜风云	133,482.00	3.52
7	张中芬	127,209.00	3.36
8	黄崇安	124,820.00	3.29
9	尹德荣	101,936.00	2.69
10	周旺余	100,000.00	2.64

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	17,640.40	0.01
	建信沪深 300 指数增强 C	79,804.38	0.08
	合计	97,444.78	0.04

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信沪深 300 指数增强(LOF) A	0~10
	建信沪深 300 指数增强 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	建信沪深 300 指数增强(LOF) A	-
	建信沪深 300 指数增强 C	-
	合计	-

§ 9 基金份额持有人信息 (转型前)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
建信双利分级股票	3,337	32,991.90	19,492,997.26	17.71	90,600,960.03	82.29
建	145	5,657.46	-	-	820,331.00	100.00

信 稳 健						
建 信 进 取	152	16,553.13	-	-	2,516,075.00	100.00
合 计	3,634	31,213.64	19,492,997.26	17.19	93,937,366.03	82.82

9.2 期末上市基金前十名持有人

建信双利分级股票

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	官文举	194,296.00	17.32
2	高其铭	35,590.00	3.17
3	赵建民	35,264.00	3.14
4	王佐杰	33,735.00	3.01
5	张晓霞	29,212.00	2.60
6	白喆	20,984.00	1.87
7	孙晓燕	19,440.00	1.73
8	白锐	18,454.00	1.64
9	黄斌	18,452.00	1.64
10	何金光	17,685.00	1.58

建信稳健

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	颜风云	133,482.00	16.27
2	胡劲松	75,987.00	9.26
3	林云钦	73,761.00	8.99
4	李惠莲	47,737.00	5.82
5	高其铭	30,944.00	3.77
6	梁金花	28,080.00	3.42
7	白喆	22,790.00	2.78
8	肖巧云	20,348.00	2.48
9	许秀成	20,348.00	2.48
10	陈沛	18,313.00	2.23

建信进取

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	纪嘉伦	416,067.00	16.54
2	刘新	253,593.00	10.08
3	高其铭	245,943.00	9.77
4	柴旭麟	182,803.00	7.27
5	周旺余	142,711.00	5.67

6	张中芬	127,208.00	5.06
7	黄崇安	124,820.00	4.96
8	尹德荣	101,936.00	4.05
9	王国光	97,360.00	3.87
10	许立军	92,367.00	3.67

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信双利分级股票	174.69	0.00
	建信稳健	-	-
	建信进取	-	-
	合计	174.69	0.00

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金

§ 10 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 (LOF) 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	50,608,774.67	146,428,601.46
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	39,412,974.88	43,334,083.31
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)		
本报告期末基金份额总额	124,626,163.08	103,094,518.15

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。

§ 10 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
基金合同生效日 (2011 年 5 月 6 日) 基金份额总额	2,881,148,086.97	37,344,064.00	56,016,098.00
本报告期期初基金份额总额	66,465,380.02	866,300.00	1,299,452.00
本报告期基金总申购份额	78,585,112.58	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	79,473,299.09	-	-
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	44,516,763.78	-45,969.00	1,216,623.00
本报告期末基金份额总额	110,093,957.29	820,331.00	2,516,075.00

注：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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金基金份额持有人大会于 2020 年 3 月 31 日表决通过了《关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

自 2020 年 8 月 28 日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本年度审计费用为人民币 50000 元。该会计师事务所自 2019 年起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	586,781,385.56	31.84%	534,731.27	31.52%	-
国泰君安	1	388,126,429.09	21.06%	361,464.16	21.31%	-
中金财富证券	1	321,439,307.90	17.44%	299,359.69	17.65%	-
中信证券	1	256,426,983.60	13.91%	233,681.65	13.77%	-
中信建投	1	148,493,778.16	8.06%	135,326.47	7.98%	-
广发证券	1	141,640,279.96	7.69%	131,913.34	7.78%	-
九州证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为；

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；

（4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	14,000.00	100.00%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	233,340,050.99	37.51%	217,312.73	37.97%	-
招商证券	1	199,530,382.19	32.07%	181,840.55	31.77%	-
中信建投	1	92,610,110.56	14.89%	84,389.57	14.75%	-
银河证券	1	62,184,405.73	10.00%	56,668.58	9.90%	-
广发证券	1	34,444,169.99	5.54%	32,079.18	5.61%	-
九州证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

(1) 财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；

(4) 佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	30,902.25	33.40%	-	-	-	-
招商证券	-	-	20,000,000.00	12.20%	-	-
中信建投	-	-	144,000,000.00	87.80%	-	-
银河证券	61,620.00	66.60%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、转换转入和定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-11-10
2	关于增加玄元保险代理有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-11-04
3	建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 暂停大额申购、转换转入和定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-10-28
4	关于增加民商基金销售 (上海) 有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-09-18
5	关于新增泛华普益基金销售有限公司为建信丰裕多策略灵活配置混合 (LOF) 等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-08-05
6	建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同修订对照表	指定报刊和/或公司网站	2020-06-11
7	关于建信基金管理有限责任公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管	指定报刊和/或公司网站	2020-06-11

	理办法》修改旗下部分证券投资基金基金合同的公告		
8	建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额新增代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-08

11.8 其他重大事件 (转型前)

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之建信稳健份额、建信进取份额终止上市的提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-30
2	关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金办理基金份额转换业务期间暂停申购、赎回、定期定额投资及转托管业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-28
3	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之建信稳健份额、建信进取份额的终止上市公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-28
4	关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金转型后基金名称、基金简称变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-28
5	关于新增珠海盈米基金销售有限公司为建信优化配置等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-24
6	关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金实施转型的提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-01
7	关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-01
8	关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之建信稳健份额、建信进取份额自基金份额持有人大会计票日开始停牌的提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2020-03-31
9	建信基金管理有限责任公司关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金开展直销渠道赎回费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-03-20
10	关于召开建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会的补充公告	指定报刊和/或公司网站	2020-03-12
11	关于以通讯方式召开建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2020-03-02
12	关于以通讯方式召开建信双利策略主	指定报刊和/或公司网站	2020-02-29

	题分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告		
13	关于以通讯方式召开建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-02-28
14	关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-01-06
15	关于建信双利策略主题分级股票型证券投资基金办理定期份额折算业务期间建信稳健份额停复牌的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-01-03

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 10 月 14 日, 2020 年 11 月 16 日-2020 年 12 月 30 日	9,679,273.37	35,429,350.85	-	45,108,624.22	19.81
	2	2020 年 09 月 28 日-2020 年 11 月 02 日, 2020 年 11 月 04 日-2020 年 12 月 31 日	-	47,273,873.31	-	47,273,873.31	20.76
产品特有风险							
<p>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。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

13.3 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

2021 年 3 月 30 日