

建信沪深 300 指数增强型证券投资基金  
(LOF)  
2021 年第 4 季度报告

2021 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

报告送出日期：2022 年 1 月 21 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	建信沪深 300 指数增强 (LOF)
场内简称	沪深 300 增强
基金主代码	165310
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 7 日
报告期末基金份额总额	247,726,044.86 份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以沪深 300 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	建信沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的场内简称	沪深 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	208,950,914.69 份	38,775,130.17 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2021 年 10 月 1 日-2021 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
1. 本期已实现收益	-275,840.92	-285,784.87
2. 本期利润	2,484,660.19	115,378.76
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0121	0.0021
4. 期末基金资产净值	295,549,880.14	54,490,043.88
5. 期末基金份额净值	1.4144	1.4053

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信沪深 300 指数增强 (LOF) A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.86%	0.74%	1.46%	0.75%	-0.60%	-0.01%
过去六个月	-2.90%	0.96%	-5.13%	0.97%	2.23%	-0.01%
过去一年	1.41%	1.08%	-4.85%	1.11%	6.26%	-0.03%
自基金合同生效起至今	41.44%	1.13%	24.30%	1.15%	17.14%	-0.02%

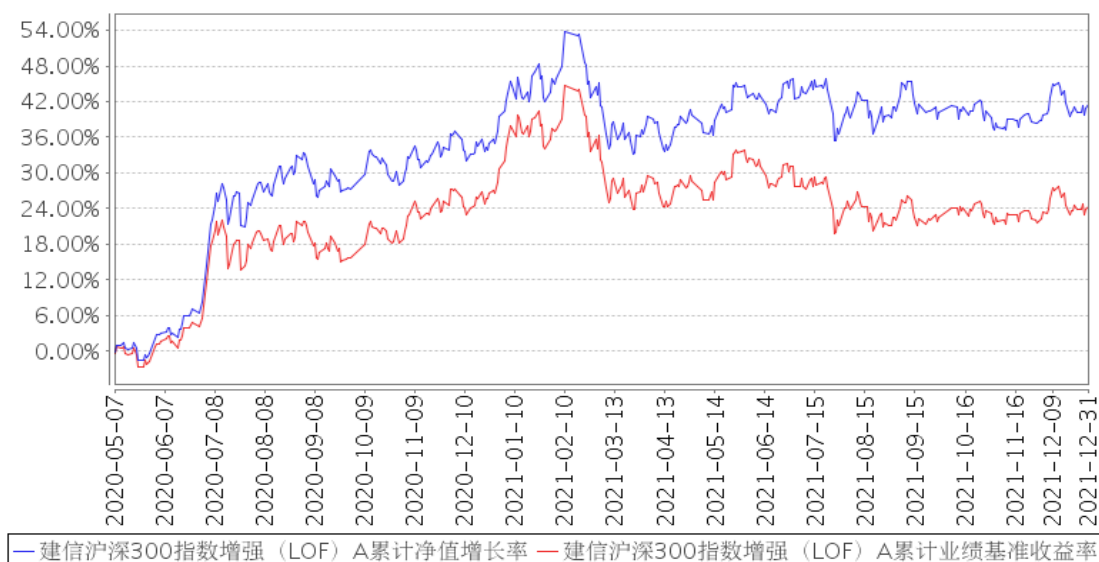
建信沪深 300 指数增强 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

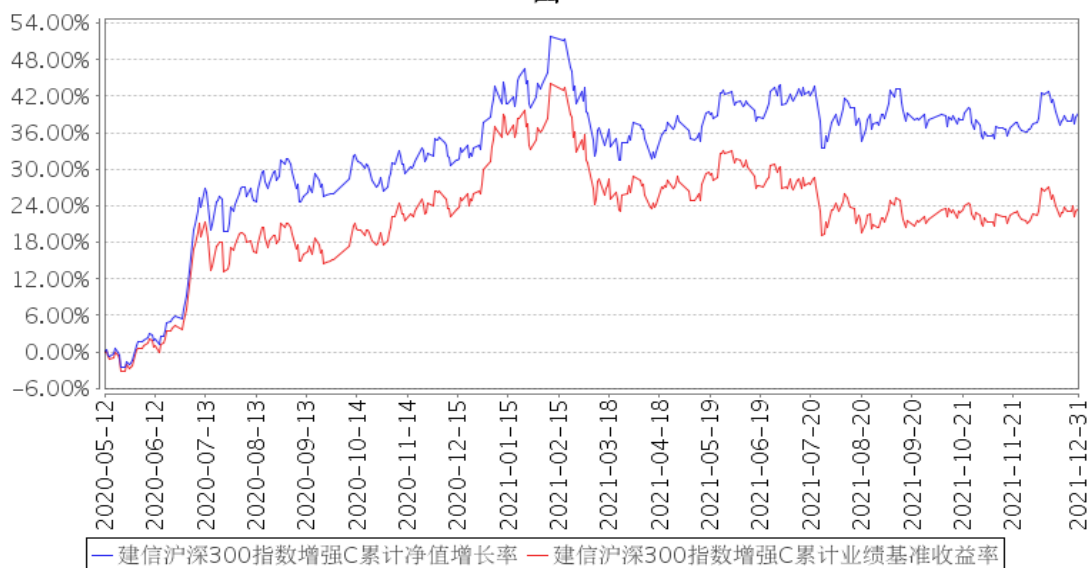
		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	0.76%	0.74%	1.46%	0.75%	-0.70%	-0.01%
过去六个月	-3.10%	0.96%	-5.13%	0.97%	2.03%	-0.01%
过去一年	0.99%	1.08%	-4.85%	1.11%	5.84%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	39.11%	1.13%	23.59%	1.15%	15.52%	-0.02%

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

建信沪深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。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	-	19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。
--	--	--	--	--

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内, 基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益, 严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人, 保护投资人利益, 避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为, 公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资

基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，本基金根据量化模型进行指数增强管理。投资组合行业配置与基准指数相近，持股适度分散。管理人持续跟踪组合的超额收益表现，并根据需要对组合风格和持仓结构进行适当调整，以适应市场风格和热点出现的变化。报告期前期，基金超额收益有所回撤，后期管理人努力进行了修复。在报告期内，基金积极参与了一级市场申购，并适时在二级市场兑现，总体上增厚了投资回报。报告期内部分交易日基金遇到的较大比例申赎，对收益产生了一定影响，放大了跟踪误差。管理人将继续保持对量化模型的跟踪和改进，以期在未来继续使基金平稳获得超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 0.86%，波动率 0.74%，本报告期本基金 C 净值增长率 0.76%，波动率 0.74%；业绩比较基准收益率 1.46%，波动率 0.75%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	325,944,136.19	91.90
	其中：股票	325,944,136.19	91.90
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	344,995.46	0.10
	其中：债券	344,995.46	0.10
	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	28,115,589.25	7.93
8	其他资产	272,361.70	0.08
9	合计	354,677,082.60	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,526,096.00	0.44
B	采矿业	8,053,344.00	2.30
C	制造业	176,047,526.59	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,726,317.00	1.92
E	建筑业	1,599,528.00	0.46
F	批发和零售业	2,535,404.42	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	6,938,531.70	1.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,810,536.70	1.09
J	金融业	74,442,206.60	21.27
K	房地产业	4,040,867.00	1.15
L	租赁和商务服务业	1,426,165.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	10,698,719.00	3.06
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	179,100.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	298,024,342.01	85.14

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	553,204.00	0.16
C	制造业	21,228,505.60	6.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	925,443.11	0.26



G	交通运输、仓储和邮政业	269,581.00	0.08
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,778,329.38	0.51
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,895,718.00	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	719,722.59	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.01
R	文化、体育和娱乐业	521,806.92	0.15
S	综合	-	-
	合计	27,919,794.18	7.98

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	10,993	22,535,650.00	6.44
2	300750	宁德时代	23,800	13,994,400.00	4.00
3	000858	五粮液	37,373	8,321,472.18	2.38
4	000166	申万宏源	1,518,100	7,772,672.00	2.22
5	601818	光大银行	2,306,300	7,656,916.00	2.19
6	601009	南京银行	852,000	7,633,920.00	2.18
7	000333	美的集团	102,700	7,580,287.00	2.17
8	002736	国信证券	649,800	7,459,704.00	2.13
9	601318	中国平安	141,900	7,153,179.00	2.04
10	601211	国泰君安	362,200	6,479,758.00	1.85

#### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000988	华工科技	122,300	3,407,278.00	0.97
2	603610	麒盛科技	89,600	2,317,056.00	0.66
3	603127	昭衍新药	15,140	1,747,610.20	0.50

4	600884	杉杉股份	52,900	1,733,533.00	0.50
5	300768	迪普科技	39,600	1,633,500.00	0.47

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
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)	344,995.46	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	344,995.46	0.10

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	113052	兴业转债	3,450	344,995.46	0.10

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

无。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中, 南京银行股份有限公司(601009)于2021年3月11日发布公告, 公司于该日披露其2020年收到的各类处罚, 其中因违规办理票据及信用证业务、员工行为管理不审慎等被中国银保监会派出机构根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项等的规定罚款195万元; 因为未按规定对客户身份开展持续识别、未按规定对高风险客户采取强化识别措施等被中国人民银行派出机构罚款676万元; 因存在办理经常项目资金收付, 未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查的行为等被国家外汇管理局地方分支机构依据《中华人民共和国外汇管理条例》第47条第1项规定罚款55万元。合计接受处罚约926万元。

#### 5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	72,595.59
2	应收证券清算款	72,145.51
3	应收股利	-
4	应收利息	3,559.96
5	应收申购款	124,060.64

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	272,361.70

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

##### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信沪深 300 指数增强 (LOF) A	建信沪深 300 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	169,324,881.59	79,914,001.84
报告期期间基金总申购份额	47,944,200.74	25,312,259.42
减:报告期期间基金总赎回份额	8,318,167.64	66,451,131.09
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	208,950,914.69	38,775,130.17

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

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 设立的文件；
- 2、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 4、《建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

### 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2022 年 1 月 21 日