

建信双息红利债券型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 20 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 18 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 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | | |
|-----------------|--|-----------------|----------------|
| 基金简称 | 建信双息红利债券 | | |
| 基金主代码 | 530017 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2011 年 12 月 13 日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 398,738,128.75 份 | | |
| 投资目标 | 通过主动管理债券组合，力争在追求基金资产稳定增长基础上为投资者取得高于投资业绩比较基准的回报。 | | |
| 投资策略 | 本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。 同时在固定收益资产所提供的稳健收益基础上，适当进行股票投资，本基金的股票投资作为债券投资的辅助和补充，以本金安全为最重要因素。 | | |
| 业绩比较基准 | 90%×中国债券总指数收益率+10%×中证红利指数收益率。 | | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 | | |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 | | |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 建信双息红利债券 A | 建信双息红利债券 C | 建信双息红利债券 H |
| 下属分级基金的交易代码 | 530017 | 531017 | 960029 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 324,420,504.23 份 | 73,225,826.32 份 | 1,091,798.20 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（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日） | | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|--------------|
| | 建信双息红利债券 A | 建信双息红利债券 C | 建信双息红利债券 H |
| 1. 本期已实现收益 | -6,534,212.63 | -443,160.58 | -11,757.99 |
| 2. 本期利润 | 29,878,973.66 | 3,642,973.80 | 93,620.84 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0922 | 0.1280 | 0.1066 |
| 4. 期末基金资产净值 | 370,949,613.41 | 81,752,349.25 | 1,248,434.32 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.143 | 1.116 | 1.143 |

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

建信双息红利债券 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 | 9.17% | 1.09% | 0.51% | 0.16% | 8.66% | 0.93% |
| 过去六个月 | -3.25% | 1.14% | 1.30% | 0.17% | -4.55% | 0.97% |
| 过去一年 | 9.69% | 0.87% | 4.70% | 0.15% | 4.99% | 0.72% |
| 过去三年 | 15.73% | 0.60% | 14.50% | 0.14% | 1.23% | 0.46% |
| 过去五年 | 18.58% | 0.49% | 25.46% | 0.13% | -6.88% | 0.36% |
| 自基金合同生效起至今 | 109.89% | 0.40% | 61.64% | 0.17% | 48.25% | 0.23% |

建信双息红利债券 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 |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 9.04% | 1.09% | 0.51% | 0.16% | 8.53% | 0.93% |

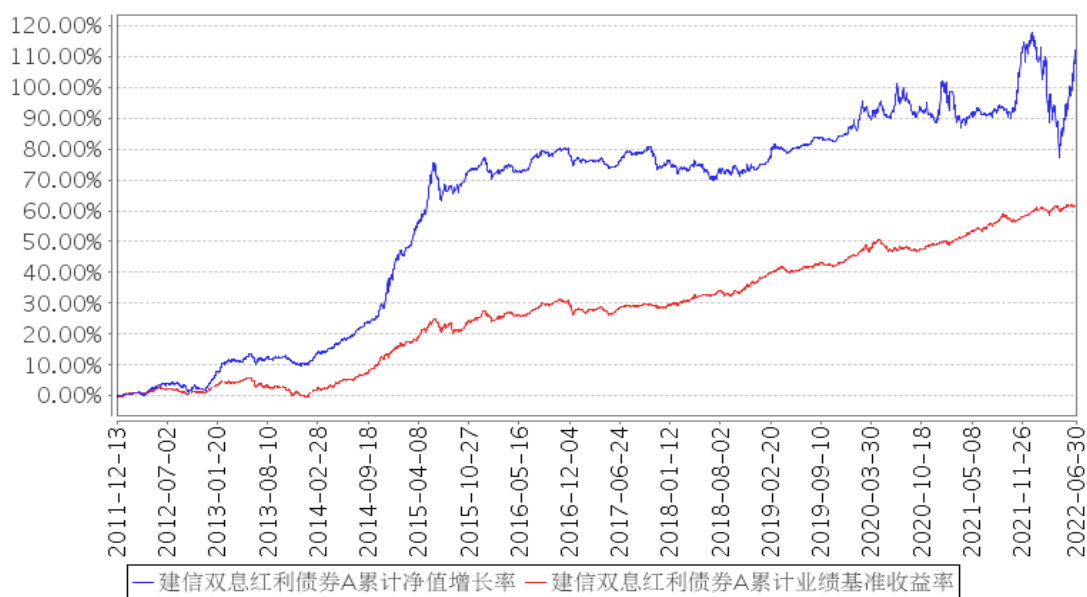
| | | | | | | |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月 | -3.46% | 1.14% | 1.30% | 0.17% | -4.76% | 0.97% |
| 过去一年 | 9.23% | 0.87% | 4.70% | 0.15% | 4.53% | 0.72% |
| 过去三年 | 14.57% | 0.60% | 14.50% | 0.14% | 0.07% | 0.46% |
| 过去五年 | 16.44% | 0.49% | 25.46% | 0.13% | -9.02% | 0.36% |
| 自基金合同 生效起至今 | 66.43% | 0.44% | 51.45% | 0.17% | 14.98% | 0.27% |

建信双息红利债券 H

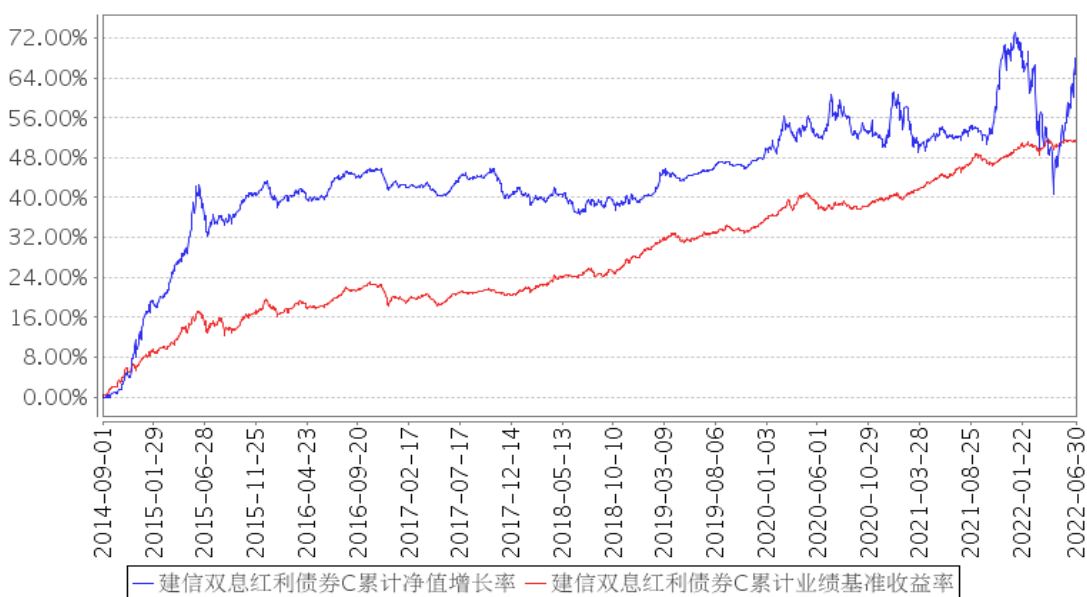
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准 差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 9.17% | 1.09% | 0.51% | 0.16% | 8.66% | 0.93% |
| 过去六个月 | -3.25% | 1.14% | 1.30% | 0.17% | -4.55% | 0.97% |
| 过去一年 | 9.59% | 0.87% | 4.70% | 0.15% | 4.89% | 0.72% |
| 过去三年 | 15.75% | 0.60% | 14.50% | 0.14% | 1.25% | 0.46% |
| 过去五年 | 18.61% | 0.49% | 25.46% | 0.13% | -6.85% | 0.36% |
| 自基金合同 生效起至今 | 20.78% | 0.45% | 27.59% | 0.13% | -6.81% | 0.32% |

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

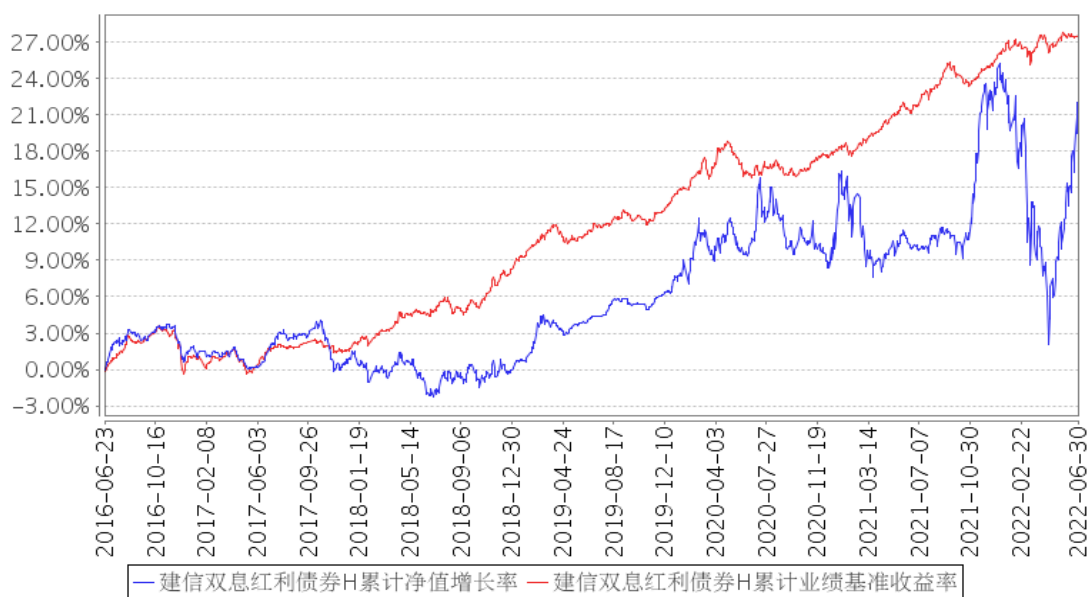
建信双息红利债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信双息红利债券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



建信双息红利债券H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 | | |
| 尹润泉 | 本基金的基金经理 | 2021年10月15日 | - | 9年 | 尹润泉先生，硕士。2011年12月毕业于加州大学洛杉矶分校金融工程专业。2013年1月至2018年9月在华安财保资产管理有限责任公司担任投资经理，从事专户投资工作；2018年10月至2021年7月在中国人寿养老保险股份有限公司担任高级投资经理，从事年金投资工作。2021年8月加入建信基金固定收益投资部担任拟任基金经理。2021年10月15日起任建信双息红利债券型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金的基金经理；2022年1月20日起任建信汇益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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《建信双息红利债券型证券投资基金基金合同》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

五月以来随着各地疫情得以有效控制，宏观经济也在持续修复，无论是企业生产、物流供应链还是居民消费，在数据上环比都有所改善。并且在稳增长政策逐步落地的背景下，宏观经济逐步改善的趋势在三季度应该会得以延续。但是经济复苏的节奏和斜率我们认为相较于 2020 年将有所放缓，因此后续我们需要观察经济恢复的动能，其中房地产和居民消费修复的程度值得重点关注，虽然政策仍在发力阶段，但在疫情以及内外部复杂环境之下企业和居民部门是否仍有意愿增加支出具有不确定性。海外方面，主要经济体增速下滑，滞涨的趋势愈发明显，各国央行难以在通胀和经济衰退之间获得很好的平衡，我们预计美债利率短期维持高位震荡。三季度美联储继续维持较高强度的货币政策正常化操作，包括 6 月开始的缩表和连续加息，因此三季度美股市场可能继续面临紧缩加码、通胀高位、增长下滑等“不友好”环境组合。对于 A 股而言，后续走势主要还是取决于国内经济基本面恢复情况，而中国经济相对优势逐渐回归，并且国内通胀相对可

控，反映到资产端就是人民币汇率以及 A 股近期表现较为坚挺，虽然美元流动性将逐步收紧，但人民币资产性价比优势较为明显，因此资本短期再度大幅外流概率不大。

在市场表现上，受益于经济改善以及充裕的流动性，权益市场自五月以来出现一轮强劲的反弹。从公司基本面来看，企业盈利下行进入尾声，考虑疫情影响绝对增速底部将在二季度出现。未来 2-3 个季度将是盈利圆弧底，真正见底仍需要等待原材料价格回落和库存出清。三季度宽松的流动性有望延续，这继续有利于权益市场。虽然三季度美联储加息提速和 CPI 通胀回升下，市场或对货币政策预期产生波动，但这些因素短期并不会实质性制约国内货币政策，国内的政策制定整体上还是“以我为主”，后续需要关注资金利率跟随经济修复回到合理中枢水平，中观流动性则需要观察基金发行回暖和中长期增量资金流入。股市底部反弹以来估值显著修复，但股债性价比仍处于合理区间，估值分位处于历史中枢水平，目前市场不存在高估风险。结构上关注大宗商品价格回落下，需求和成本端同时改善的中下游行业，例如汽车、家电、电力设备、高端装备等。另外困境反转型板块也值得跟踪，例如线下出行、餐饮消费和地产后周期等。

可转债方面，市场也在持续上涨，一是由于权益市场的反弹，二是由于转债标的里面中小盘品种多、市场好转时反弹幅度往往更大。分板块看，汽车产业链、光伏、锂电、风电等板块表现较好，主要受益于高景气、复工复产以及大宗商品价格的下行。由于转债溢价率仍处于高位，因此在组合构建上采取均衡配置的思路，兼顾弹性品种和稳健品种，规避高价、高溢价率且有赎回风险的标的，以自下而上择券为主，同时逐步兑现上涨幅度过大的个券。

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 9.17%，波动率 1.09%，业绩比较基准收益率 0.51%，波动率 0.16%。本报告期本基金 C 净值增长率 9.04%，波动率 1.09%，业绩比较基准收益率 0.51%，波动率 0.16%。本报告期本基金 H 净值增长率 9.17%，波动率 1.09%，业绩比较基准收益率 0.51%，波动率 0.16%。

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 | 84,119,214.73 | 17.43 |
| | 其中：股票 | 84,119,214.73 | 17.43 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 389,188,376.43 | 80.63 |
| | 其中：债券 | 389,188,376.43 | 80.63 |
| | 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 | 3,000,000.00 | 0.62 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 5,598,771.54 | 1.16 |
| 8 | 其他资产 | 748,878.29 | 0.16 |
| 9 | 合计 | 482,655,240.99 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 3,777,717.00 | 0.83 |
| C | 制造业 | 64,605,431.73 | 14.23 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 2,687,605.00 | 0.59 |
| F | 批发和零售业 | 2,562,615.00 | 0.56 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,466,464.00 | 0.54 |
| J | 金融业 | 6,668,388.00 | 1.47 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,350,994.00 | 0.30 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 84,119,214.73 | 18.53 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 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 | 600522 | 中天科技 | 464,300 | 10,725,330.00 | 2.36 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 92,400 | 3,899,280.00 | 0.86 |
| 3 | 601899 | 紫金矿业 | 404,900 | 3,777,717.00 | 0.83 |
| 4 | 300358 | 楚天科技 | 178,500 | 3,175,515.00 | 0.70 |
| 5 | 300421 | 力星股份 | 258,200 | 3,108,728.00 | 0.68 |
| 6 | 603666 | 亿嘉和 | 44,400 | 3,045,840.00 | 0.67 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 109,020 | 2,769,108.00 | 0.61 |
| 8 | 601669 | 中国电建 | 341,500 | 2,687,605.00 | 0.59 |
| 9 | 600690 | 海尔智家 | 97,400 | 2,674,604.00 | 0.59 |
| 10 | 600976 | 健民集团 | 50,100 | 2,562,615.00 | 0.56 |

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 | 33,917,173.20 | 7.47 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 10,696,487.67 | 2.36 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,696,487.67 | 2.36 |
| 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） | 344,574,715.56 | 75.91 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 389,188,376.43 | 85.73 |

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 | 110081 | 闻泰转债 | 135,350 | 16,672,965.52 | 3.67 |
| 2 | 128042 | 凯中转债 | 133,912 | 16,545,451.30 | 3.64 |
| 3 | 019664 | 21 国债 16 | 134,230 | 13,643,972.00 | 3.01 |
| 4 | 128140 | 润建转债 | 80,124 | 12,900,036.44 | 2.84 |
| 5 | 110074 | 精达转债 | 71,810 | 12,654,757.58 | 2.79 |

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国债期货交易情况说明**5.9.1 本期国债期货投资政策**

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注**5.10.1**

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 73,225.94 |
| 2 | 应收证券清算款 | 262,523.21 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 413,129.14 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 748,878.29 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1 | 110081 | 闻泰转债 | 16,672,965.52 | 3.67 |
| 2 | 128042 | 凯中转债 | 16,545,451.30 | 3.64 |
| 3 | 128140 | 润建转债 | 12,900,036.44 | 2.84 |
| 4 | 110074 | 精达转债 | 12,654,757.58 | 2.79 |
| 5 | 128139 | 祥鑫转债 | 12,103,738.33 | 2.67 |
| 6 | 113598 | 法兰转债 | 11,838,545.91 | 2.61 |
| 7 | 123123 | 江丰转债 | 11,615,772.37 | 2.56 |
| 8 | 132020 | 19 蓝星 EB | 10,313,651.48 | 2.27 |
| 9 | 110047 | 山鹰转债 | 9,802,100.73 | 2.16 |
| 10 | 118000 | 嘉元转债 | 9,564,719.57 | 2.11 |
| 11 | 113622 | 杭叉转债 | 9,537,140.43 | 2.10 |
| 12 | 113046 | 金田转债 | 9,255,087.36 | 2.04 |
| 13 | 128134 | 鸿路转债 | 9,229,193.34 | 2.03 |
| 14 | 110077 | 洪城转债 | 9,144,970.36 | 2.01 |
| 15 | 110053 | 苏银转债 | 8,895,411.04 | 1.96 |
| 16 | 113025 | 明泰转债 | 8,341,064.60 | 1.84 |
| 17 | 113637 | 华翔转债 | 8,245,832.35 | 1.82 |
| 18 | 128097 | 奥佳转债 | 8,227,506.19 | 1.81 |
| 19 | 128109 | 楚江转债 | 8,151,789.70 | 1.80 |
| 20 | 127049 | 希望转 2 | 7,613,955.84 | 1.68 |
| 21 | 123100 | 朗科转债 | 6,617,425.16 | 1.46 |
| 22 | 110068 | 龙净转债 | 5,840,651.27 | 1.29 |
| 23 | 110056 | 亨通转债 | 5,730,220.67 | 1.26 |
| 24 | 128119 | 龙大转债 | 5,572,909.36 | 1.23 |
| 25 | 113047 | 旗滨转债 | 5,508,283.98 | 1.21 |
| 26 | 127022 | 恒逸转债 | 5,376,508.43 | 1.18 |
| 27 | 128144 | 利民转债 | 5,061,591.97 | 1.12 |
| 28 | 128081 | 海亮转债 | 4,748,976.78 | 1.05 |
| 29 | 128017 | 金禾转债 | 4,475,460.03 | 0.99 |
| 30 | 123091 | 长海转债 | 4,282,916.38 | 0.94 |
| 31 | 113616 | 韦尔转债 | 4,148,416.79 | 0.91 |
| 32 | 113582 | 火炬转债 | 3,850,101.07 | 0.85 |
| 33 | 123083 | 朗新转债 | 3,678,910.52 | 0.81 |
| 34 | 113545 | 金能转债 | 3,648,288.70 | 0.80 |
| 35 | 113504 | 艾华转债 | 3,537,549.19 | 0.78 |
| 36 | 123085 | 万顺转 2 | 3,326,505.74 | 0.73 |
| 37 | 113049 | 长汽转债 | 2,652,628.93 | 0.58 |
| 38 | 128121 | 宏川转债 | 2,572,051.38 | 0.57 |
| 39 | 128025 | 特一转债 | 2,311,296.06 | 0.51 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 40 | 111000 | 起帆转债 | 2,219,326.95 | 0.49 |
| 41 | 128075 | 远东转债 | 2,217,763.46 | 0.49 |
| 42 | 127052 | 西子转债 | 1,866,312.43 | 0.41 |
| 43 | 113627 | 太平转债 | 1,841,173.31 | 0.41 |
| 44 | 128137 | 洁美转债 | 1,813,064.24 | 0.40 |
| 45 | 127026 | 超声转债 | 1,666,709.26 | 0.37 |
| 46 | 113579 | 健友转债 | 1,630,001.37 | 0.36 |
| 47 | 110048 | 福能转债 | 1,613,286.79 | 0.36 |
| 48 | 111001 | 山玻转债 | 1,577,396.15 | 0.35 |
| 49 | 128023 | 亚太转债 | 1,572,571.99 | 0.35 |
| 50 | 113043 | 财通转债 | 1,563,782.69 | 0.34 |
| 51 | 123107 | 温氏转债 | 1,301,113.77 | 0.29 |
| 52 | 113599 | 嘉友转债 | 1,217,353.23 | 0.27 |
| 53 | 123099 | 普利转债 | 1,195,280.76 | 0.26 |
| 54 | 123022 | 长信转债 | 1,014,032.53 | 0.22 |
| 55 | 113525 | 台华转债 | 949,895.53 | 0.21 |
| 56 | 127030 | 盛虹转债 | 920,258.72 | 0.20 |
| 57 | 127050 | 麒麟转债 | 721,007.52 | 0.16 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 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 | 建信双息红利债券 A | 建信双息红利债券 C | 建信双息红利债券 H |
|---------------------------|----------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 327,676,768.97 | 24,809,101.82 | 862,798.19 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 20,542,303.95 | 51,035,487.95 | 414,017.04 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 23,798,568.69 | 2,618,763.45 | 185,017.03 |
| 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 | 324,420,504.23 | 73,225,826.32 | 1,091,798.20 |

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

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 26,218,899.80 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 26,218,899.80 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 6.58 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率(%) |
|----|------|------------|---------|------------|---------|
| 1 | 分红 | 2022-04-15 | - | 917,661.49 | - |
| 合计 | | | - | 917,661.49 | |

注：该基金分红业务费用为 0。

§ 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双息红利债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信双息红利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信双息红利债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信双息红利债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；

6、基金托管人业务资格批件和营业执照；

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

9.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2022 年 7 月 20 日