

建信转债增强债券型证券投资基金

2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 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 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信转债增强债券
基金主代码	530020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 29 日
报告期末基金份额总额	37,890,943.86 份
投资目标	通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置，并充分利用可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，实施对大类资产的配置，在控制风险并保持良好流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的超额收益。
投资策略	本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置，根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市估值水平和债市收益率情况及风险分析，进行灵活的大类资产配置进而在固定收益类资产、权益类资产以及货币类资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。
业绩比较基准	$60\% \times \text{中证可转换债券指数收益率} + 30\% \times \text{中国债券总指数收益率} + 10\% \times \text{沪深 300 指数收益率}$
风险收益特征	本基金为债券型基金，债券型基金的风险高于货币市场基金，低于混合型和股票型基金，属于中低风险收益的品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司

基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信转债增强债券 A	建信转债增强债券 C
下属分级基金的交易代码	530020	531020
报告期末下属分级基金的份额总额	17,237,729.50 份	20,653,214.36 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）	
	建信转债增强债券 A	建信转债增强债券 C
1. 本期已实现收益	96,986.69	54,834.51
2. 本期利润	2,218,605.42	2,322,755.82
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1268	0.1133
4. 期末基金资产净值	53,045,628.82	61,104,463.30
5. 期末基金份额净值	3.077	2.959

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信转债增强债券 A

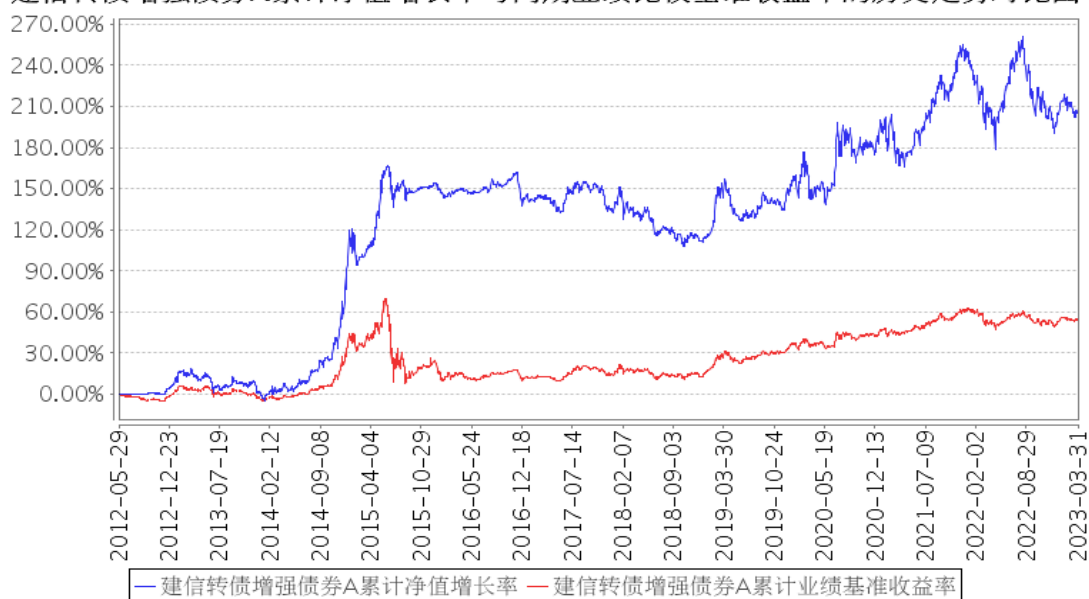
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.20%	0.68%	2.79%	0.30%	1.41%	0.38%
过去六个月	-0.23%	0.89%	1.56%	0.38%	-1.79%	0.51%
过去一年	0.52%	1.05%	1.75%	0.40%	-1.23%	0.65%
过去三年	26.63%	1.10%	14.14%	0.46%	12.49%	0.64%
过去五年	32.17%	1.01%	32.43%	0.49%	-0.26%	0.52%
自基金合同生效起至今	207.70%	0.96%	54.89%	0.80%	152.81%	0.16%

建信转债增强债券 C

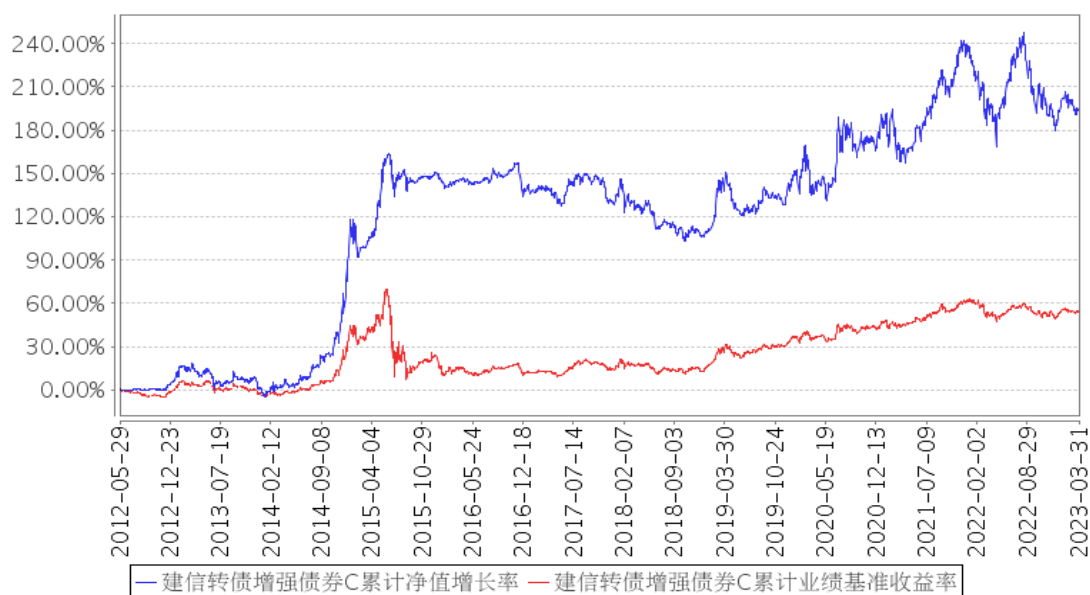
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.15%	0.68%	2.79%	0.30%	1.36%	0.38%
过去六个月	-0.37%	0.89%	1.56%	0.38%	-1.93%	0.51%
过去一年	0.20%	1.05%	1.75%	0.40%	-1.55%	0.65%
过去三年	25.33%	1.10%	14.14%	0.46%	11.19%	0.64%
过去五年	29.84%	1.01%	32.43%	0.49%	-2.59%	0.52%
自基金合同生效起至今	195.90%	0.96%	54.89%	0.80%	141.01%	0.16%

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

建信转债增强债券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



建信转债增强债券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



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		
牛兴华	本基金的基金经理	2021年1月25日	-	12	牛兴华先生，硕士，2008年毕业于英国卡迪夫大学国际经济、银行与金融学专业，同年进入神州数码中国有限公司，任投资专员；2010年9月，加入中诚信国际信用评级有限责任公司，担任高级分析师；2013年4月加入本公司，历任债券研究员、基金经理。2014年12月2日至2017年6月30日任建信稳定得利债券型证券投资基金的基金经理；2015年4月17日至2020年8月6日任建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015年5月13日至2019年1月21日任建信回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015年5月14日至2022年12月27日任建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；

					<p>2015 年 6 月 16 日至 2018 年 1 月 23 日任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2015 年 11 月 25 日任建信鑫裕回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 10 月 29 日至 2017 年 7 月 12 日任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 2 月 22 日至 2018 年 1 月 23 日任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理；2016 年 10 月 25 日至 2017 年 12 月 6 日任建信瑞盛添利混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 12 月 2 日至 2018 年 4 月 2 日任建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 12 月 23 日至 2017 年 12 月 29 日任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 3 月 1 日起任建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 4 月 20 日起任建信安心保本混合型证券投资基金的基金经理，该基金在 2019 年 10 月 11 日转型为建信灵活配置混合型证券投资基金，牛兴华继续担任该基金的基金经理；2019 年 3 月 26 日起任建信润利增强债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 8 月 6 日至 2020 年 12 月 15 日任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 8 月 6 日至 2021 年 3 月 9 日任建信稳定添利债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 10 日起任建信兴利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2021 年 1 月 25 日起任建信转债增强债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 30 日起任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理。</p>
吕怡	本基金的基金经理	2022 年 9 月 13 日	-	6	<p>吕怡女士，硕士。2016 年 6 月毕业于复旦大学金融学专业。2016 年 7 月至 2019 年 12 月在国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部任债券研究员。2019 年 12 月加入建信基金，历任固定收益投资部转债研究员、基金经理助理兼研究员。2022 年 9 月 13 日起任建信转债增强债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理。</p>
李峰	本基金的	2019 年 8 月 6	2023 年 2 月	15	<p>李峰先生，硕士。曾任华夏基金管理公司</p>

	基金经理	日	20 日	基金会计业务经理、风控高级经理，2012 年 9 月至 2015 年 6 月任建信基金管理公司交易员、交易主管，2015 年 7 月至 2016 年 6 月任银华基金管理公司询价研究主管。2016 年 6 月至今任建信基金管理公司基金经理助理、基金经理。2017 年 5 月 15 日起任建信信用增强债券型证券投资基金和建信稳定鑫利债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 2 日至 2020 年 3 月 17 日任建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2018 年 3 月 14 日起任建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 3 月 8 日起任建信中短债纯债债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 8 月 6 日至 2023 年 2 月 20 日任建信转债增强债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月 23 日至 2022 年 1 月 20 日任建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月 31 日起任建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2020 年 12 月 16 日起任建信利率债策略纯债债券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《建信转债增强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

2023 年一季度经济企稳回升，随着线下消费场景的恢复，居民出行消费活动明显增加，采购经理人指数重新回荣枯线以上，经济增长回到正常轨道。需求侧来看，前两个月固定资产投资增速平稳，基建及制造业投资韧性延续，其中一季度基建投资增速维持在 12.18% 的较高水平。在地产政策呵护下，二手房成交活跃并带动地产企业拿地意愿增加，一季度地产投资累计同比增速 -5.1%，跌幅较上年四季度有所收窄。社会消费品零售总额稳步修复，其中线下消费改善明显，汽车等耐用品相对较弱。出口方面，受海外需求放缓影响，1-2 月出口延续回落趋势。

价格方面，居民消费价格指数整体表现温和，1-2 月 CPI 同比分别为 2.1% 和 1.0%，其中猪肉价格持续走弱影响较大。工业品方面，受全球原油价格回落及基数效应影响，工业品价格指数(PPI) 1-2 月 PPI 同比分别为 -0.8% 和 -1.4%。

政策方面，一季度央行整体维持稳健的政策基调，积极推动降低社会融资成本，提振实体经济融资需求。央行在 3 月 27 日全面降低金融机构存款准备金率 0.25 个百分点，释放长期资金。整个一季度资金面环境维持宽松，但季末资金价格有所抬升，整体来看利率中枢有所上行。汇率方面，一季度人民币汇率维持震荡，3 月末人民币兑美元中间价收于 6.8717，较 2022 年末升值 1.33%。

在此背景下，受资金利率预期波动的影响，利率债短端的收益率有所上行，长端则维持窄幅震荡。其中 10 年国开收益率较 2022 年四季度末上行 3BP 到 3.02%，1 年期国开收益率则上行 16BP 至 2.39%，曲线呈现平坦化特征。权益方面，受益于经济复苏的预期，一季度上证综指上涨 5.94%，收于 3276.86 点。中证转债指数上涨 3.53%。

回顾一季度的基金管理工作，组合在行业结构上进行了调整，提高了成长风格的配比，并加配了业绩确定性高的个股。转债方面，由于溢价率水平仍然处于比较高的位置，在持仓标的选择方面提高了估值性价比，加配了前期调整的顺周期和医药方向、以及估值合理的 TMT 方向。股票

方面，自下而上优选业绩确定性高的个股，并提高了成长风格的仓位占比，我们认为后续随着经济复苏进程，前期超跌的顺周期板块也具备左侧配置价值。

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 4.20%，波动率 0.68%，业绩比较基准收益率 2.79%，波动率 0.30%。本报告期本基金 C 净值增长率 4.15%，波动率 0.68%，业绩比较基准收益率 2.79%，波动率 0.30%。

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	20,144,987.79	15.21
	其中：股票	20,144,987.79	15.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	108,277,625.88	81.74
	其中：债券	108,277,625.88	81.74
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,740,470.37	2.07
8	其他资产	1,298,300.94	0.98
9	合计	132,461,384.98	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	318,336.00	0.28
B	采矿业	1,405,151.00	1.23
C	制造业	14,502,700.37	12.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	664,162.00	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	359,600.00	0.32
H	住宿和餐饮业	533,296.00	0.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	723,195.42	0.63
J	金融业	737,612.00	0.65
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	214,650.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	341,408.00	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	344,877.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	20,144,987.79	17.65

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	000858	五粮液	2,400	472,800.00	0.41
2	000933	神火股份	26,400	467,808.00	0.41
3	600426	华鲁恒升	13,200	465,300.00	0.41
4	300223	北京君正	4,700	418,347.00	0.37
5	300502	新易盛	8,400	407,400.00	0.36
6	688501	青达环保	16,926	391,836.90	0.34
7	300896	爱美客	700	391,125.00	0.34
8	300286	安科瑞	9,800	386,904.00	0.34
9	000568	泸州老窖	1,500	382,185.00	0.33
10	600572	康恩贝	63,200	376,040.00	0.33

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	6,516,169.64	5.71
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）	101,761,456.24	89.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	108,277,625.88	94.86

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	019638	20 国债 09	64,000	6,516,169.64	5.71
2	110053	苏银转债	38,270	4,683,026.51	4.10
3	132018	G 三峡 EB1	24,000	3,277,709.59	2.87
4	123107	温氏转债	18,730	2,403,931.36	2.11
5	113598	法兰转债	13,490	2,376,193.28	2.08

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	69,302.71
2	应收证券清算款	1,221,754.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,243.89
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,298,300.94

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	110053	苏银转债	4,683,026.51	4.10
2	132018	G 三峡 EB1	3,277,709.59	2.87
3	123107	温氏转债	2,403,931.36	2.11
4	113598	法兰转债	2,376,193.28	2.08
5	127032	苏行转债	2,272,328.91	1.99
6	127027	靖远转债	2,256,171.05	1.98
7	113060	浙 22 转债	2,245,623.58	1.97
8	110088	淮 22 转债	2,239,375.88	1.96
9	127016	鲁泰转债	2,239,150.95	1.96
10	113055	成银转债	2,165,972.23	1.90
11	111000	起帆转债	2,028,417.83	1.78
12	113636	甬金转债	1,805,540.25	1.58
13	128140	润建转债	1,780,497.10	1.56
14	118015	芯海转债	1,776,447.48	1.56
15	123115	捷捷转债	1,755,953.94	1.54
16	110068	龙净转债	1,754,332.78	1.54
17	118012	微芯转债	1,738,515.37	1.52

18	127020	中金转债	1,428,360.41	1.25
19	113625	江山转债	1,373,953.75	1.20
20	113530	大丰转债	1,347,809.04	1.18
21	113648	巨星转债	1,304,409.41	1.14
22	118006	阿拉转债	1,280,613.89	1.12
23	127030	盛虹转债	1,255,676.99	1.10
24	123145	药石转债	1,255,347.29	1.10
25	127022	恒逸转债	1,253,375.32	1.10
26	113654	永 02 转债	1,236,075.84	1.08
27	127058	科伦转债	1,234,358.34	1.08
28	128137	洁美转债	1,229,889.93	1.08
29	113623	凤 21 转债	1,229,807.50	1.08
30	113563	柳药转债	1,227,758.06	1.08
31	110074	精达转债	1,222,403.75	1.07
32	110075	南航转债	1,173,083.94	1.03
33	113632	鹤 21 转债	1,172,393.84	1.03
34	127069	小熊转债	1,169,606.11	1.02
35	118008	海优转债	1,158,621.26	1.01
36	113545	金能转债	1,151,640.58	1.01
37	123156	博汇转债	1,150,694.08	1.01
38	123090	三诺转债	1,145,640.24	1.00
39	118019	金盘转债	1,139,796.33	1.00
40	113047	旗滨转债	1,137,792.82	1.00
41	113057	中银转债	1,118,482.38	0.98
42	110079	杭银转债	1,111,063.79	0.97
43	110048	福能转债	1,100,173.68	0.96
44	127043	川恒转债	1,089,279.58	0.95
45	128091	新天转债	1,059,434.26	0.93
46	110062	烽火转债	862,832.50	0.76
47	127062	垒知转债	658,410.78	0.58
48	113643	风语转债	609,158.98	0.53
49	127037	银轮转债	594,555.92	0.52
50	118003	华兴转债	591,078.81	0.52
51	123124	晶瑞转 2	591,015.19	0.52
52	123142	申昊转债	581,697.53	0.51
53	110090	爱迪转债	580,830.47	0.51
54	123118	惠城转债	577,790.43	0.51
55	113626	伯特转债	572,641.48	0.50
56	113027	华钰转债	569,760.76	0.50
57	128144	利民转债	569,209.54	0.50
58	113644	艾迪转债	560,718.54	0.49
59	110061	川投转债	556,314.16	0.49

60	127038	国微转债	547,057.00	0.48
61	123148	上能转债	545,635.88	0.48
62	123077	汉得转债	512,274.73	0.45
63	123158	宙邦转债	496,394.60	0.43
64	110089	兴发转债	434,137.86	0.38
65	128131	崇达转 2	350,354.64	0.31
66	127046	百润转债	345,964.59	0.30
67	113588	润达转债	345,913.50	0.30
68	128122	兴森转债	343,401.70	0.30
69	123150	九强转债	342,377.05	0.30
70	123078	飞凯转债	341,342.10	0.30
71	123108	乐普转 2	336,839.01	0.30
72	118013	道通转债	335,796.28	0.29
73	128075	远东转债	262,072.37	0.23
74	127050	麒麟转债	241,436.41	0.21
75	118009	华锐转债	238,732.51	0.21
76	123133	佩蒂转债	234,251.20	0.21
77	127060	湘佳转债	233,788.03	0.20
78	111004	明新转债	228,724.06	0.20

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	建信转债增强债券 A	建信转债增强债券 C
报告期期初基金份额总额	17,711,490.80	20,403,226.25
报告期期间基金总申购份额	383,235.61	1,423,072.15
减：报告期期间基金总赎回份额	856,996.91	1,173,084.04
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	17,237,729.50	20,653,214.36

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转债增强债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信转债增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信转债增强债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信转债增强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

2023 年 4 月 21 日