

建信双债增强债券型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告

2024 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2025 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 1 月 17 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 2024 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | | | |
|-----------------|---|----------------|-----------------|
| 基金简称 | 建信双债增强债券 | | |
| 基金主代码 | 000207 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2013 年 7 月 25 日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 110,572,450.27 份 | | |
| 投资目标 | 在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，通过主动的组合管理为投资人创造较高的当期收入和总回报。 | | |
| 投资策略 | 本基金主要通过采取债券类属配置策略、信用债投资策略、可转债投资策略等投资策略以实现投资目标。 | | |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数。 | | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、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 | 建信双债增强债券 A | 建信双债增强债券 C | 建信双债增强债券 F |
| 下属分级基金的交易代码 | 000207 | 000208 | 021960 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 7,466,871.58 份 | 6,409,365.96 份 | 96,696,212.73 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（2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日） | | |
|-----------------|---------------------------------------|--------------|----------------|
| | 建信双债增强债券 A | 建信双债增强债券 C | 建信双债增强债券 F |
| 1. 本期已实现收益 | 49,420.82 | 88,350.39 | 145,504.85 |
| 2. 本期利润 | 48,680.21 | 147,364.73 | 77,299.58 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0051 | 0.0049 | 0.0008 |
| 4. 期末基金资产净值 | 8,880,486.68 | 7,585,655.81 | 120,077,299.58 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.189 | 1.184 | 1.242 |

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

建信双债增强债券 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 | 0.40% | 0.06% | 2.23% | 0.09% | -1.83% | -0.03% |
| 过去六个月 | 0.65% | 0.05% | 2.50% | 0.10% | -1.85% | -0.05% |
| 过去一年 | 1.97% | 0.04% | 4.98% | 0.09% | -3.01% | -0.05% |
| 过去三年 | 5.10% | 0.06% | 7.69% | 0.06% | -2.59% | 0.00% |
| 过去五年 | 18.69% | 0.37% | 9.88% | 0.07% | 8.81% | 0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | 46.48% | 0.32% | 18.37% | 0.08% | 28.11% | 0.24% |

建信双债增强债券 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 | 0.59% | 0.07% | 2.23% | 0.09% | -1.64% | -0.02% |
| 过去六个月 | 0.75% | 0.05% | 2.50% | 0.10% | -1.75% | -0.05% |

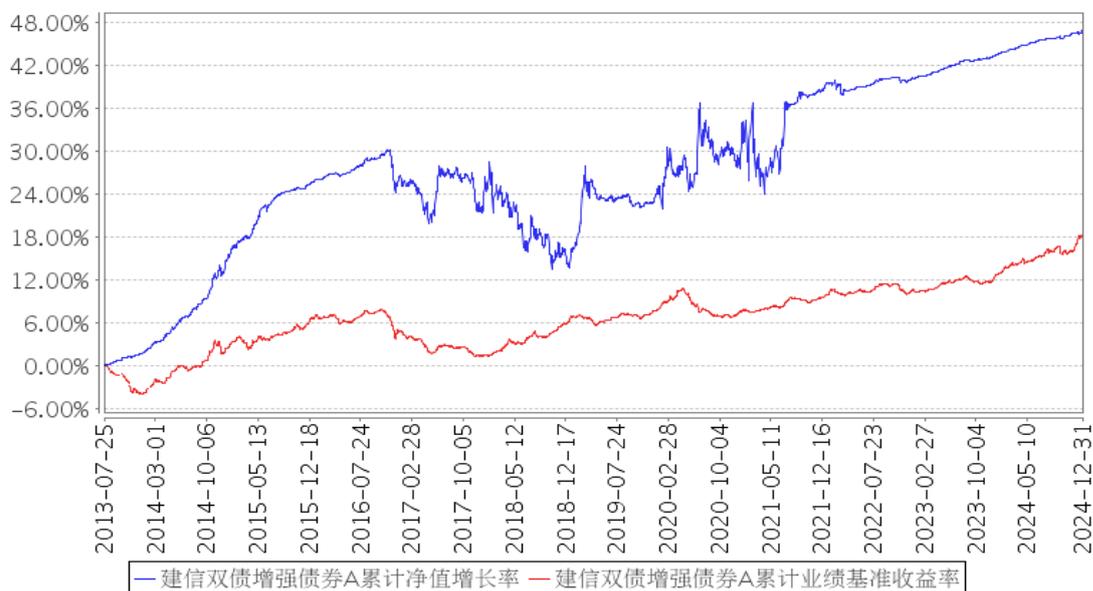
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去一年 | 1.85% | 0.04% | 4.98% | 0.09% | -3.13% | -0.05% |
| 过去三年 | 4.21% | 0.06% | 7.69% | 0.06% | -3.48% | 0.00% |
| 过去五年 | 16.70% | 0.37% | 9.88% | 0.07% | 6.82% | 0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | 40.60% | 0.32% | 18.37% | 0.08% | 22.23% | 0.24% |

建信双债增强债券 F

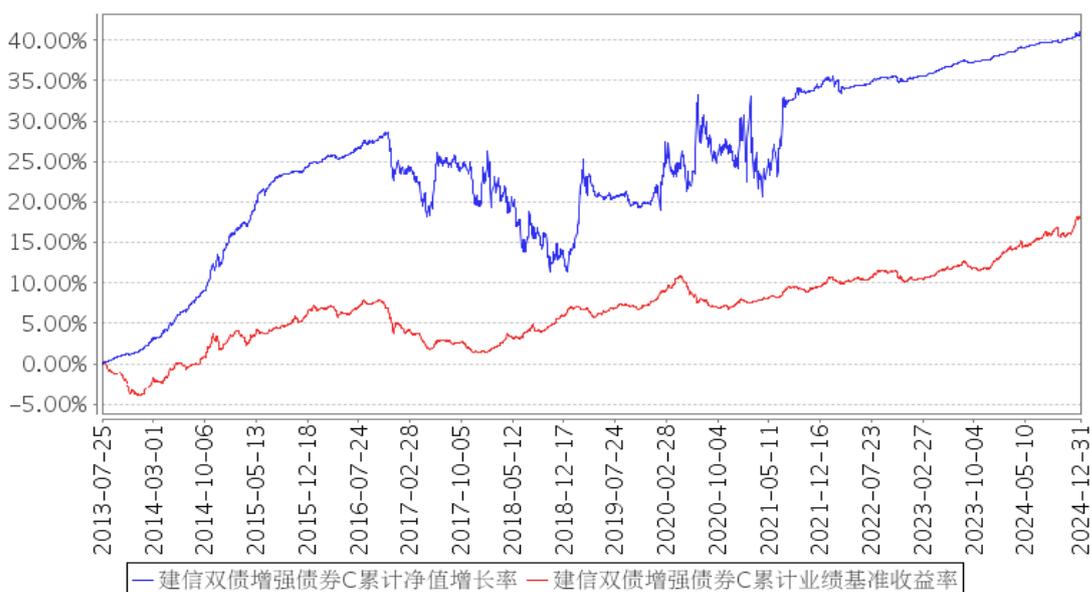
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.08% | 0.09% | 1.97% | 0.11% | -1.89% | -0.02% |

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

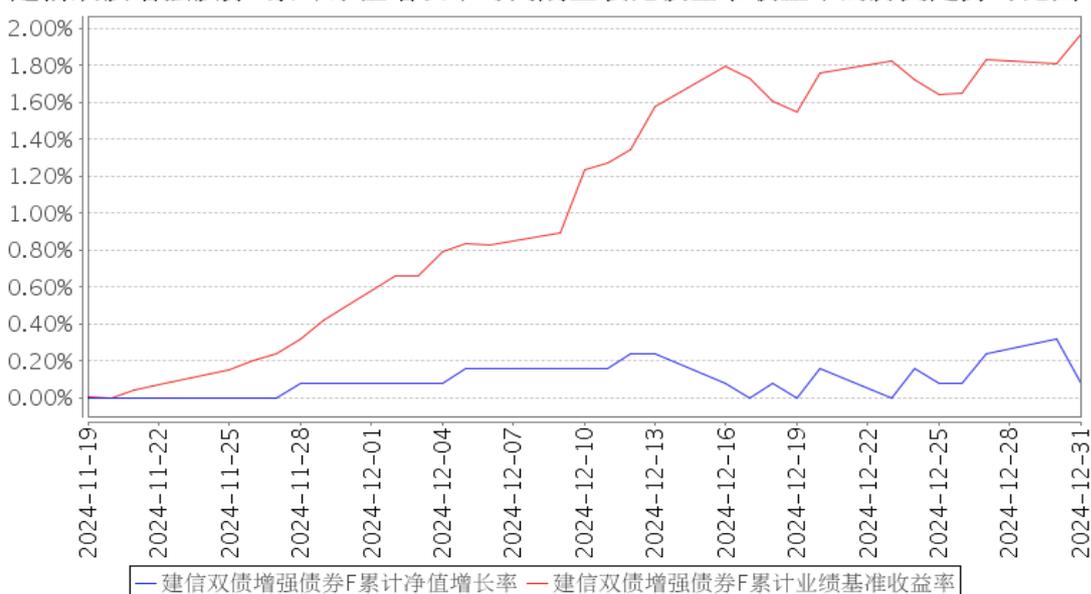
建信双债增强债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信双债增强债券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



建信双债增强债券F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 | | |
| 彭紫云 | 本基金的基金经理 | 2019年7月17日 | - | 11 | 彭紫云先生，硕士。2013年7月加入建信基金，历任研究部助理研究员、固定收 |

| | | | | | |
|-----|----------|-----------------|---|----|--|
| | | | | | <p>益投资债券研究员、基金经理助理和基金经理。2019 年 7 月 17 日起任建信纯债债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 7 月 17 日至 2021 年 11 月 10 日任建信双息红利债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 1 月 3 日至 2021 年 11 月 18 日任建信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 1 月 3 日至 2021 年 12 月 14 日任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 10 日至 2021 年 3 月 9 日任建信瑞福添利混合型证券投资基金；2020 年 4 月 10 日至 2021 年 9 月 29 日任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 12 月 18 日至 2021 年 11 月 28 日任建信稳定丰利债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 12 月 18 日至 2022 年 1 月 6 日任建信稳定增利债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 8 月 10 日起任建信鑫悦 90 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金的基金经理；2022 年 5 月 9 日起任建信鑫恒 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理；2022 年 7 月 27 日起任建信鑫福 60 天持有期中短债债券型证券投资基金的基金经理；2022 年 12 月 29 日起任建信鑫和 30 天持有期债券型证券投资基金的基金经理；2023 年 3 月 27 日至 2024 年 3 月 29 日任建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2023 年 8 月 23 日起任建信鑫弘 180 天持有期债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 2 月 26 日起任建信宁远 90 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 张溢麟 | 本基金的基金经理 | 2024 年 6 月 27 日 | - | 8 | <p>张溢麟先生，硕士。2016 年 5 月毕业于美国芝加哥大学统计专业，同年 9 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理兼研究员、投资经理等职务。2023 年 1 月 4 日起任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2024 年 6 月 27 日起任建信双债增强债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 薛玲 | 数量投资 | 2024 年 6 月 27 | - | 11 | <p>薛玲女士，数量投资部副总经理，博士。</p> |

| | | | | |
|----------------|---|--|--|--|
| 部副总经理，本基金的基金经理 | 日 | | | <p>2009 年 5 月至 2010 年 1 月任中国电力科学研究院农电与配电研究所工程师、2010 年 1 月至 2013 年 4 月任路孚特（中国）科技有限公司高级软件工程师、2013 年 4 月至 2015 年 9 月任中国中金财富证券有限公司研究员、投资经理，2015 年 9 月加入我公司，历任金融工程及指数投资部基金经理助理、基金经理、部门总经理助理、部门副总经理等职务。2016 年 7 月 4 日起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；2017 年 5 月 27 日至 2018 年 4 月 25 日任建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 9 月 13 日至 2023 年 8 月 29 日任建信量化事件驱动股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 9 月 28 日起任深证基本面 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；2017 年 12 月 20 日起任建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 22 日起任建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 3 月 5 日至 2021 年 5 月 31 日任建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 10 月 25 日起任建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2018 年 12 月 13 日至 2021 年 8 月 9 日任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的基金经理；2020 年 12 月 15 日至 2021 年 12 月 14 日任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 9 月 21 日起任建信恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理；2023 年 1 月 5 日至 2024 年 1 月 29 日任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2024 年 1 月 29 日起任建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理；2024 年 6 月 27 日起任建信双债增强债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 7 月 16 日起任建信红利精选股票型发起式证券投资基金的基金经理。</p> |
|----------------|---|--|--|--|

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，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 3 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面，PMI 指数在 24 年 10-12 月分别录得 50.1%，50.3% 和 50.1%，维持在荣枯线之上，反映经济动能环比持续改善。

通胀方面，24 年四季度居民消费价格（CPI）单月同比连续下滑，工业生产者出厂价格（PPI）单月同比降幅维持高位。

资金面和货币政策层面，24 年四季度资金环境维持宽松。央行通过多种方式如买入国债、买断式回购等提供流动性。

债券市场方面，四季度收益率总体先回调高位震荡然后下行。

本季度在操作上除了继续持有商金债，利用量化策略适度建仓了可转债。持有转债以来，转

债市场以震荡为主。基金的转债部分力争在中证转债指数的基础上，获取较为持续、稳定的超额收益。

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 0.40%，波动率 0.06%，业绩比较基准收益率 2.23%，波动率 0.09%。本报告期本基金 C 净值增长率 0.59%，波动率 0.07%，业绩比较基准收益率 2.23%，波动率 0.09%。本报告期本基金 F 净值增长率 0.08%，波动率 0.09%，业绩比较基准收益率 1.97%，波动率 0.11%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，自 2024 年 10 月 1 日至 2024 年 11 月 18 日，本基金基金资产净值存在连续 20 个工作日低于 5000 万元的情形。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》（2014 年 8 月 8 日生效）第四十一条的要求，现将该情况在本次报告中予以披露。

§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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 129,267,152.05 | 93.53 |
| | 其中：债券 | 129,267,152.05 | 93.53 |
| | 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 | -762.39 | -0.00 |
| | 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 | 1,446,749.38 | 1.05 |
| 8 | 其他资产 | 7,502,313.20 | 5.43 |
| 9 | 合计 | 138,215,452.24 | 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

无。

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

无。

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 | 73,234,654.89 | 53.63 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,148,460.27 | 7.43 |
| 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） | 56,032,497.16 | 41.04 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 129,267,152.05 | 94.67 |

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 | 2228009 | 22 光大银行小微债 | 100,000 | 10,251,967.21 | 7.51 |
| 2 | 2228033 | 22 广发银行 01 | 100,000 | 10,206,824.66 | 7.48 |
| 3 | 2228044 | 22 中国银行小微债 02 | 100,000 | 10,201,931.51 | 7.47 |
| 4 | 220207 | 22 国开 07 | 100,000 | 10,148,460.27 | 7.43 |
| 5 | 2220079 | 22 江苏银行 | 100,000 | 10,141,002.74 | 7.43 |

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 | 266.90 |
| 2 | 应收证券清算款 | 7,488,759.31 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 4,286.99 |
| 6 | 其他应收款 | 9,000.00 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 7,502,313.20 |

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 | 110059 | 浦发转债 | 4,577,994.25 | 3.35 |
| 2 | 113052 | 兴业转债 | 3,825,833.26 | 2.80 |
| 3 | 113042 | 上银转债 | 2,268,996.26 | 1.66 |
| 4 | 110079 | 杭银转债 | 1,858,912.96 | 1.36 |
| 5 | 113050 | 南银转债 | 1,572,104.93 | 1.15 |
| 6 | 110075 | 南航转债 | 891,308.71 | 0.65 |
| 7 | 127032 | 苏行转债 | 876,614.23 | 0.64 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 8 | 110085 | 通 22 转债 | 873,573.99 | 0.64 |
| 9 | 127049 | 希望转 2 | 815,862.90 | 0.60 |
| 10 | 128129 | 青农转债 | 777,111.92 | 0.57 |
| 11 | 113024 | 核建转债 | 757,515.08 | 0.55 |
| 12 | 127045 | 牧原转债 | 731,009.23 | 0.54 |
| 13 | 113061 | 拓普转债 | 715,662.80 | 0.52 |
| 14 | 128081 | 海亮转债 | 712,138.36 | 0.52 |
| 15 | 113045 | 环旭转债 | 707,376.39 | 0.52 |
| 16 | 110087 | 天业转债 | 663,601.46 | 0.49 |
| 17 | 127024 | 盈峰转债 | 650,032.93 | 0.48 |
| 18 | 113682 | 益丰转债 | 645,292.63 | 0.47 |
| 19 | 113655 | 欧 22 转债 | 638,494.48 | 0.47 |
| 20 | 127022 | 恒逸转债 | 626,733.22 | 0.46 |
| 21 | 113056 | 重银转债 | 625,201.07 | 0.46 |
| 22 | 113046 | 金田转债 | 589,913.42 | 0.43 |
| 23 | 127089 | 晶澳转债 | 588,798.82 | 0.43 |
| 24 | 110081 | 闻泰转债 | 580,564.44 | 0.43 |
| 25 | 113633 | 科沃转债 | 577,674.59 | 0.42 |
| 26 | 127018 | 本钢转债 | 576,571.92 | 0.42 |
| 27 | 111001 | 山玻转债 | 549,684.16 | 0.40 |
| 28 | 123236 | 家联转债 | 548,644.60 | 0.40 |
| 29 | 123107 | 温氏转债 | 538,667.88 | 0.39 |
| 30 | 128066 | 亚泰转债 | 535,775.86 | 0.39 |
| 31 | 113053 | 隆 22 转债 | 519,904.63 | 0.38 |
| 32 | 128138 | 侨银转债 | 514,523.27 | 0.38 |
| 33 | 128125 | 华阳转债 | 456,757.81 | 0.33 |
| 34 | 123191 | 智尚转债 | 428,411.22 | 0.31 |
| 35 | 110062 | 烽火转债 | 424,987.58 | 0.31 |
| 36 | 127025 | 冀东转债 | 410,269.85 | 0.30 |
| 37 | 113532 | 海环转债 | 395,748.84 | 0.29 |
| 38 | 113054 | 绿动转债 | 394,371.62 | 0.29 |
| 39 | 110082 | 宏发转债 | 381,993.47 | 0.28 |
| 40 | 113666 | 爱玛转债 | 379,325.75 | 0.28 |
| 41 | 110076 | 华海转债 | 373,285.15 | 0.27 |
| 42 | 128134 | 鸿路转债 | 362,014.61 | 0.27 |
| 43 | 127066 | 科利转债 | 361,593.42 | 0.26 |
| 44 | 127016 | 鲁泰转债 | 359,946.78 | 0.26 |
| 45 | 113605 | 大参转债 | 359,600.34 | 0.26 |
| 46 | 127073 | 天赐转债 | 357,713.10 | 0.26 |
| 47 | 113659 | 莱克转债 | 348,429.45 | 0.26 |
| 48 | 127101 | 豪鹏转债 | 346,628.59 | 0.25 |
| 49 | 127043 | 川恒转债 | 345,947.81 | 0.25 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 50 | 111003 | 聚合转债 | 340,706.34 | 0.25 |
| 51 | 123179 | 立高转债 | 339,211.34 | 0.25 |
| 52 | 111010 | 立昂转债 | 337,875.62 | 0.25 |
| 53 | 127020 | 中金转债 | 337,406.90 | 0.25 |
| 54 | 113670 | 金 23 转债 | 334,151.51 | 0.24 |
| 55 | 113663 | 新化转债 | 332,863.75 | 0.24 |
| 56 | 128074 | 游族转债 | 331,436.23 | 0.24 |
| 57 | 128136 | 立讯转债 | 330,922.37 | 0.24 |
| 58 | 128133 | 奇正转债 | 328,882.86 | 0.24 |
| 59 | 123071 | 天能转债 | 328,148.11 | 0.24 |
| 60 | 128142 | 新乳转债 | 327,866.65 | 0.24 |
| 61 | 127026 | 超声转债 | 325,373.12 | 0.24 |
| 62 | 128105 | 长集转债 | 325,302.77 | 0.24 |
| 63 | 127092 | 运机转债 | 320,398.96 | 0.23 |
| 64 | 127088 | 赫达转债 | 318,666.47 | 0.23 |
| 65 | 123147 | 中辰转债 | 317,742.47 | 0.23 |
| 66 | 113542 | 好客转债 | 317,609.99 | 0.23 |
| 67 | 113616 | 韦尔转债 | 314,268.61 | 0.23 |
| 68 | 127072 | 博实转债 | 311,307.29 | 0.23 |
| 69 | 123226 | 中富转债 | 310,218.02 | 0.23 |
| 70 | 123133 | 佩蒂转债 | 306,757.19 | 0.22 |
| 71 | 110086 | 精工转债 | 305,210.14 | 0.22 |
| 72 | 111007 | 永和转债 | 292,511.34 | 0.21 |
| 73 | 113058 | 友发转债 | 289,649.10 | 0.21 |
| 74 | 123158 | 宙邦转债 | 286,614.25 | 0.21 |
| 75 | 127103 | 东南转债 | 277,664.45 | 0.20 |
| 76 | 118030 | 睿创转债 | 276,894.21 | 0.20 |
| 77 | 110077 | 洪城转债 | 271,499.32 | 0.20 |
| 78 | 127015 | 希望转债 | 269,007.47 | 0.20 |
| 79 | 113631 | 皖天转债 | 268,332.82 | 0.20 |
| 80 | 113648 | 巨星转债 | 265,200.34 | 0.19 |
| 81 | 113068 | 金铜转债 | 262,332.58 | 0.19 |
| 82 | 123117 | 健帆转债 | 261,420.84 | 0.19 |
| 83 | 113675 | 新 23 转债 | 259,042.77 | 0.19 |
| 84 | 113647 | 禾丰转债 | 257,155.44 | 0.19 |
| 85 | 123159 | 崧盛转债 | 256,588.95 | 0.19 |
| 86 | 123146 | 中环转 2 | 249,955.26 | 0.18 |
| 87 | 123161 | 强联转债 | 244,649.42 | 0.18 |
| 88 | 123132 | 回盛转债 | 244,028.42 | 0.18 |
| 89 | 128131 | 崇达转 2 | 243,195.29 | 0.18 |
| 90 | 127105 | 龙星转债 | 243,151.46 | 0.18 |
| 91 | 127068 | 顺博转债 | 240,722.96 | 0.18 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|------------|------|
| 92 | 123113 | 仙乐转债 | 237,457.36 | 0.17 |
| 93 | 113625 | 江山转债 | 235,961.37 | 0.17 |
| 94 | 118005 | 天奈转债 | 234,944.63 | 0.17 |
| 95 | 123235 | 亿田转债 | 234,664.11 | 0.17 |
| 96 | 127034 | 绿茵转债 | 234,121.29 | 0.17 |
| 97 | 118034 | 晶能转债 | 233,253.21 | 0.17 |
| 98 | 127035 | 濮耐转债 | 229,547.84 | 0.17 |
| 99 | 123085 | 万顺转 2 | 220,785.70 | 0.16 |
| 100 | 123063 | 大禹转债 | 219,744.49 | 0.16 |
| 101 | 113676 | 荣 23 转债 | 219,526.62 | 0.16 |
| 102 | 123121 | 帝尔转债 | 214,901.75 | 0.16 |
| 103 | 118024 | 冠宇转债 | 214,132.34 | 0.16 |
| 104 | 113598 | 法兰转债 | 213,934.52 | 0.16 |
| 105 | 113681 | 镇洋转债 | 207,352.00 | 0.15 |
| 106 | 118022 | 锂科转债 | 195,319.48 | 0.14 |
| 107 | 113674 | 华设转债 | 194,639.56 | 0.14 |
| 108 | 127030 | 盛虹转债 | 194,268.58 | 0.14 |
| 109 | 110073 | 国投转债 | 173,293.97 | 0.13 |
| 110 | 118031 | 天 23 转债 | 153,904.32 | 0.11 |
| 111 | 123176 | 精测转 2 | 140,247.14 | 0.10 |
| 112 | 127056 | 中特转债 | 140,076.96 | 0.10 |
| 113 | 113577 | 春秋转债 | 132,025.62 | 0.10 |
| 114 | 113059 | 福莱转债 | 109,295.34 | 0.08 |
| 115 | 113641 | 华友转债 | 102,545.09 | 0.08 |
| 116 | 113062 | 常银转债 | 75,399.42 | 0.06 |
| 117 | 113065 | 齐鲁转债 | 74,191.40 | 0.05 |
| 118 | 113652 | 伟 22 转债 | 45,566.32 | 0.03 |

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 | 建信双债增强债券 A | 建信双债增强债券 C | 建信双债增强债券 F |
|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 9,966,453.95 | 10,539,659.23 | - |
| 报告期期间基金总申购份额 | 359,925.57 | 82,706,722.29 | 96,696,212.73 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,859,507.94 | 86,837,015.56 | - |

| | | | |
|---------------------------|--------------|--------------|---------------|
| 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 | 7,466,871.58 | 6,409,365.96 | 96,696,212.73 |

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 | 5,910,021.24 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 5,910,021.24 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | - |

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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 | 2024-11-21 | - | 112,409.34 | - |
| 2 | 分红 | 2024-11-21 | - | 118,763.48 | - |
| 3 | 赎回 | 2024-12-24 | 2,283,913.26 | 2,715,572.87 | - |
| 4 | 赎回 | 2024-12-24 | 3,626,107.98 | 4,293,311.85 | - |
| 合计 | | | 5,910,021.24 | 7,240,057.54 | |

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|--------------------|------|------|------|------------|---------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20% | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比(%) |
| | | | | | | | |

| | | 的时间区 间 | | | | | |
|--|---|---|--------------|----------------|---------------|----------------|-------|
| 机 构 | 1 | 2024 年 10 月 01 日 -2024 年 11 月 18 日 | 5,910,021.24 | - | 5,910,021.24 | - | - |
| | 2 | 2024 年 11 月 19 日 -2024 年 12 月 31 日 | | -96,696,212.73 | | -96,696,212.73 | 87.45 |
| | 3 | 2024 年 11 月 19 日 -2024 年 12 月 09 日 | | -82,508,250.83 | 82,508,250.83 | | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。 | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信双债增强债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信双债增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信双债增强债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信双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

2025 年 1 月 21 日