

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 年中期报告

2020 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 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。本中期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 2020 年 8 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。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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）	6
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)	8
2.5 其他相关资料(转型前)	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)	9
3.2 基金净值表现（转型后）	10
3.2 基金净值表现（转型前）	11
3.3 其他指标	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	18
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	19
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
4.8 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	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
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	20
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	20
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	20
6.1 资产负债表	20
6.2 利润表	22
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
6.4 报表附注	23
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	49

6.1 资产负债表.....	49
6.2 利润表.....	50
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	51
6.4 报表附注.....	53
§7 投资组合报告（转型后）	76
7.1 期末基金资产组合情况.....	76
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	77
7.3 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.....	78
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	81
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	83
7.6 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.....	83
7.7 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.....	83
7.8 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.....	83
7.9 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.....	83
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	83
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	84
7.12 投资组合报告附注.....	84
§7 投资组合报告（转型前）	85
7.1 期末基金资产组合情况.....	85
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	85
7.3 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.....	86
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	89
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	91
7.6 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.....	92
7.7 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.....	92
7.8 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.....	92
7.9 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.....	92
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	92
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	92
7.12 投资组合报告附注.....	92
§8 基金份额持有人信息（转型后）	93
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	93
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	94
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	94
8.4 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.....	94
§8 基金份额持有人信息（转型前）	95
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	95
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	95
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	96
8.4 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.....	96
§9 开放式基金份额变动（转型后）	97

§9 开放式基金份额变动（转型前）	97
§10 重大事件揭示	98
10.1 基金份额持有人大会决议.....	98
10.2 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.....	98
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	98
10.4 基金投资策略的改变.....	98
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	98
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	98
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	98
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	99
10.8 其他重大事件（转型后）.....	101
10.8 其他重大事件（转型前）.....	101
§11 影响投资者决策的其他重要信息	102
11.1 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	102
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	103
§12 备查文件目录	103
12.1 备查文件目录.....	103
12.2 存放地点.....	103
12.3 查阅方式.....	103

§ 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	
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	134,963,802.97 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 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	133,213,937.36 份	1,749,865.61 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	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		
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	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，采用自下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	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。 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。		
	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	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。	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。

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	xinxipilu@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	李建红

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金中期报告备置地点	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
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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2020 年 5 月 7 日(基金合同生效日)-2020 年 6 月 30 日)	
	建信沪深 300 指数增强 A	建信沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	4,324,809.14	35,521.47

本期利润	10,106,351.88	111,311.87
加权平均基金份额本期利润	0.0882	0.0821
本期加权平均净值利润率	8.62%	8.01%
本期基金份额净值增长率	8.13%	6.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	76,303,864.01	141,448.64
期末可供分配基金份额利润	0.5728	0.0808
期末基金资产净值	144,050,663.82	1,891,314.25
期末基金份额净值	1.0813	1.0808
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	8.13%	6.99%

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	报告期(2020 年 1 月 1 日-2020 年 5 月 6 日)
本期已实现收益	4,592,551.65
本期利润	2,000,424.55
加权平均基金份额本期利润	0.0270
本期加权平均净值利润率	1.67%

本期基金份额净值增长率	-0.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 5 月 6 日)
期末可供分配利润	55,743,301.10
期末可供分配基金份额利润	0.4914
期末基金资产净值	113,428,669.32
期末基金份额净值	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 5 月 6 日)
基金份额累计净值增长率	96.61%

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 A

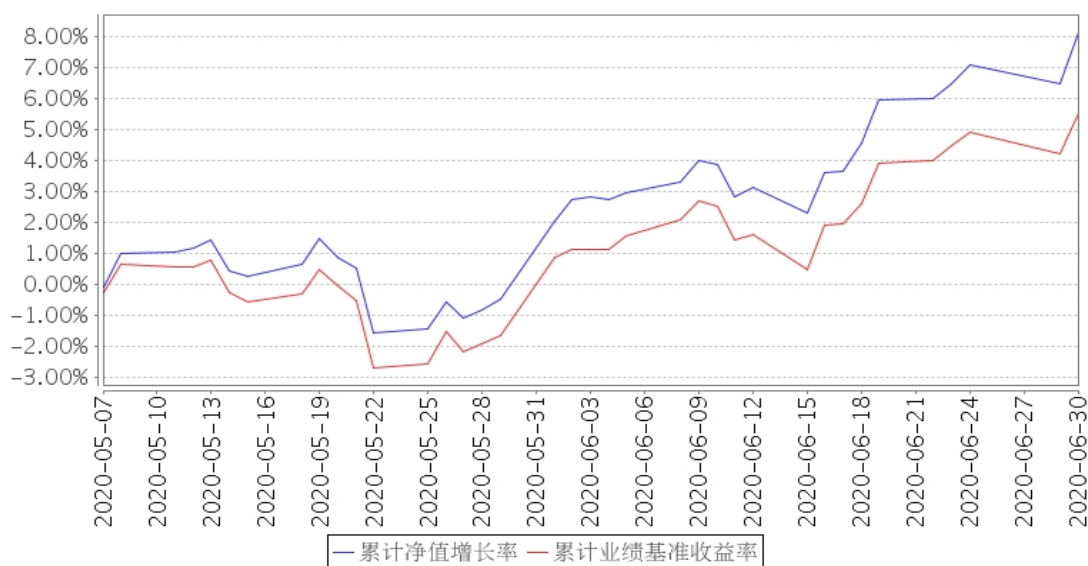
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.63%	0.83%	7.29%	0.85%	1.34%	-0.02%
自基金合同生效起至今	8.13%	0.82%	5.50%	0.84%	2.63%	-0.02%

建信沪深 300 指数增强 C

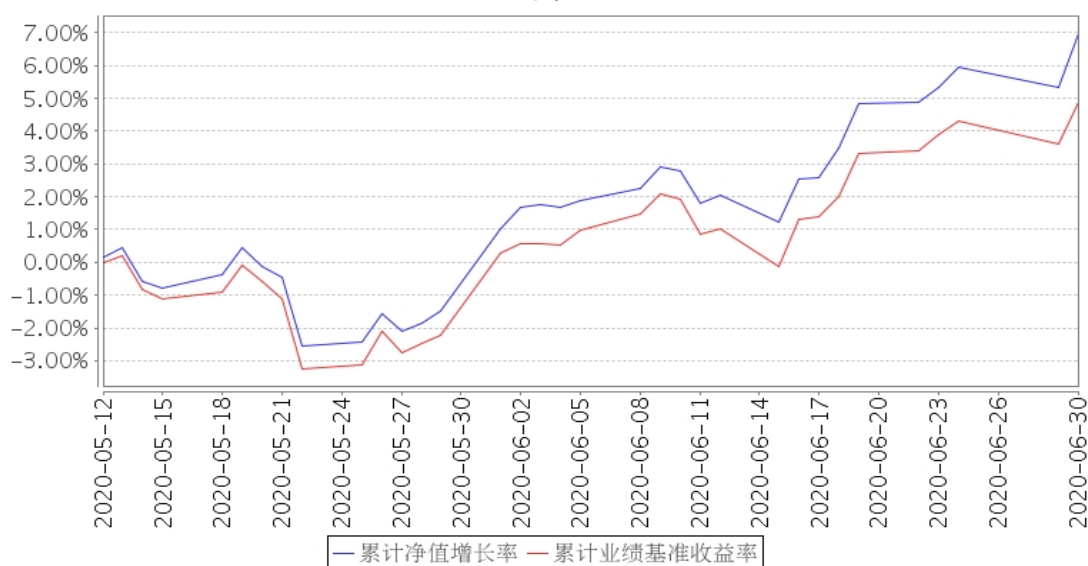
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.59%	0.83%	7.29%	0.85%	1.30%	-0.02%
自基金合同生效起至今	6.99%	0.84%	4.89%	0.86%	2.10%	-0.02%

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 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	7.33%	0.93%	6.44%	0.89%	0.89%	0.04%

过去六个月	-0.44%	1.61%	-3.66%	1.65%	3.22%	-0.04%
过去一年	10.61%	1.19%	2.84%	1.21%	7.77%	-0.02%
过去三年	18.91%	1.17%	7.31%	1.21%	11.60%	-0.04%
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



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 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、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、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、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、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信短债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、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、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

信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、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、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选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、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债债券型证券投资基金、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、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利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、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远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、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 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、建信瑞福添利混合型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信中证政策性金融债 8-10 年指数证券投资基金（LOF）、建信建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）、建信鑫稳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及其联接基金、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、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、建信战略精选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、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、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、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣瑞一年定期

开放债券型证券投资基金、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、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金，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、建信中证 800 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、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金共计 126 只证券投资基金，管理的基金净资产规模共计为 4939.77 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	—	17 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	17 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。

4.1.3 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(转型后)

无。

4.1.3 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(转型前)

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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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，严禁直接或间接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。

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。

4.3.2 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 2 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，保持了 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。报告期中期，部分交易日曾比较密集地发生了大额申购和赎回，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

本报告期本基金转型后 A 净值增长率 8.13%，波动率 0.82%，业绩比较基准收益率 5.50%，波动率 0.84%；本报告期本基金转型后 C 净值增长率 6.99%，波动率 0.84%，业绩比较基准收益率 4.89%，波动率 0.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年，Covid-19 疫情对全球的经济和社会生活造成了很大冲击。经过艰苦努力，中国有效地控制了疫情在国内的传播，同时，适时推出多项宏观经济政策，尽力缓解实体经济受到的压力。预计下半年，疫情对投资者情绪造成的影响将会明显缓和，它对实体经济的实质影响会成为市场

关注的重点。一些涉及国际经贸关系和政治关系的事件，亦可能成为中短期的扰动因素。A 股市场预计会在一个较宽的区间内运行，波动性比遭受事件冲击的上半年有所下降。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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本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。

4.8 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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 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 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	11,650,346.25
结算备付金		475,404.83
存出保证金		60,213.12
交易性金融资产	6.4.7.2	137,062,249.43
其中：股票投资		137,062,249.43
基金投资		—
债券投资		—

资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	1,378.21
应收股利		-
应收申购款		167,700.95
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		149,417,292.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		517,943.12
应付管理人报酬		103,979.57
应付托管费		20,795.93
应付销售服务费		538.74
应付交易费用	6.4.7.7	2,470,093.81
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	361,963.55
负债合计		3,475,314.72
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	69,496,665.42
未分配利润	6.4.7.10	76,445,312.65
所有者权益合计		145,941,978.07
负债和所有者权益总计		149,417,292.79

注: 本基金合同生效日为 2020 年 05 月 07 日, 本报告期自基金合同生效日 2020 年 05 月 07 日起至 2020 年 06 月 30 日止。报告截止日 2020 年 06 月 30 日, 基金份额总额 134,963,802.97 份, 其中建信沪深 300 指数增强 A 基金份额总额 133,213,937.36 份, 基金份额净值 1.0813 元; 建信沪深 300 指数增强 C 基金份额总额 1,749,865.61 份, 基金份额净值 1.0808 元。

6.2 利润表

会计主体: 建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

第 21 页 共 104 页

本报告期：2020 年 5 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 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 6 月 30 日
一、收入		10,800,459.21
1. 利息收入		8,518.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,518.73
债券利息收入		-
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）		4,921,460.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,779,392.53
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,142,067.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,857,333.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	13,146.93
减：二、费用		582,795.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	176,540.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	35,308.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	790.30
4. 交易费用	6.4.7.19	309,612.39
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	6.4.7.20	60,544.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,217,663.75
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,217,663.75

6.3 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 6 月 30 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 6 月 30 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）	-	10,217,663.75	10,217,663.75
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）	11,811,297.20	10,484,347.80	22,295,645.00
其中：1. 基金申购款	17,930,574.31	16,546,179.93	34,476,754.24
2. 基金赎回款	-6,119,277.11	-6,061,832.13	-12,181,109.24
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）	69,496,665.42	76,445,312.65	145,941,978.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 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》，基金管理人在份额转换基准日（2020 年 5 月 6 日）将建信双利基金

份额、建信稳健份额和建信进取份额转换成建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）的 A 类基金份额。自份额转换基准日（2020 年 5 月 6 日）次日起，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。转型后，基金的托管人、登记机构、基金代码不变。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。

本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取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；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，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 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别。

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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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。本基金的标的指数为：沪深 300 指数。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%。

6.4.2 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。

6.4.3 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 6 月 30 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 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 5 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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、资产支持证券投资和衍生工具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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生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。

6.4.4.6 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) 交易双方准备按净额结算时,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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	11,650,346.25

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	11,650,346.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	125,173,995.41	137,062,249.43	11,888,254.02
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	125,173,995.41	137,062,249.43	11,888,254.02

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
----	------------------------

应收活期存款利息	1,137.21
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	213.90
应收债券利息	—
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	27.10
合计	1,378.21

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,470,093.81
银行间市场应付交易费用	—
合计	2,470,093.81

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,024.11
应付证券出借违约金	—
应付指数使用费	30,219.78
预提费用	330,719.66
合计	361,963.55

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

建信沪深 300 指数增强 A

项目	本期 2020 年 5 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 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 6 月 30 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 6 月 30 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 6 月 30 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 6 月 30 日基金拆分和集中申购 完成后	-	-
本期申购	31,647,397.29	16,094,874.15
本期赎回（以“-”号填列）	-11,863,823.22	-6,033,442.56
本期末	133,213,937.36	67,746,799.81

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 6 月 30 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 6 月 30 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 6 月 30 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 6 月 30 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 6 月 30 日基金拆分和集中申购 完成后	-	-
本期申购	1,835,700.16	1,835,700.16
本期赎回(以“-”号填列)	-85,834.55	-85,834.55
本期末	1,749,865.61	1,749,865.61

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

建信沪深 300 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	82,151,688.95	-26,408,387.85	55,743,301.10
本期利润	4,324,809.14	5,781,542.74	10,106,351.88
本期基金份额 交易产生的变动数	15,156,544.37	-4,702,333.34	10,454,211.03
其中：基金申 购款	23,981,140.15	-7,468,778.98	16,512,361.17
基金赎 回款	-8,824,595.78	2,766,445.64	-6,058,150.14
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	101,633,042.46	-25,329,178.45	76,303,864.01
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	35,521.47	75,790.40	111,311.87
本期基金份额 交易产生的变动数	438,698.01	-408,561.24	30,136.77
其中：基金申 购款	461,593.29	-427,774.53	33,818.76
基金赎 回款	-22,895.28	19,213.29	-3,681.99
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	474,219.48	-332,770.84	141,448.64

6.4.7.11 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,542.08
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	1,239.15
其他	1,737.50
合计	8,518.73

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 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6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,779,392.53
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	3,779,392.53

6.4.7.12.2 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 6 月 30 日
卖出股票成交总额	95,449,759.21
减：卖出股票成本总额	91,670,366.68
买卖股票差价收入	3,779,392.53

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 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 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,142,067.88
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	1,142,067.88

6.4.7.17 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 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,857,333.14
股票投资	5,857,333.14
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	5,857,333.14
----	--------------

6.4.7.18 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 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,141.63
基金转换费收入	5.30
合计	13,146.93

6.4.7.19 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 6 月 30 日
交易所市场交易费用	309,612.39
银行间市场交易费用	—
合计	309,612.39

6.4.7.20 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 6 月 30 日
审计费用	7,513.55
信息披露费	18,032.85
证券出借违约金	—
银行划款手续费	2,058.56
指数使用费	30,219.78
银行间账户维护费	2,719.80
合计	60,544.54

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	176,540.19
其中：支付销售机构的客户维护费	55,751.11

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。

6.4.10.2.2 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 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	35,308.04

注：支付基金托管人招商银行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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 6 月 30 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	建信沪深 300 指数增强	合计
	A	C	

中国建设银行	-	662.92	662.92
建信基金	-	0.06	0.06
-	-	-	-
合计	-	662.98	662.98

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	11,650,346.25	5,542.08

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新发未上市	36.18	36.18	1,367	49,458.06	49,458.06	-
688080	映翰通	2020 年 2 月 3 日	2020 年 8 月 12 日	新发未上市	27.63	86.78	1,786	49,347.18	154,989.08	-
688222	成都先导	2020 年 4 月 3 日	2020 年 10 月 16 日	新发未上市	20.52	43.70	6,468	132,723.36	282,651.60	-
688277	天智航	2020 年 6 月 24 日	2020 年 07 月 07 日	新发未上市	12.04	12.04	5,544	66,749.76	66,749.76	-
688377	迪威	2020	2020	新发未上市	16.42	16.42	3,167	52,002.14	52,002.14	-

	尔	年 6 月 29 日	年 07 月 08 日	上市						
688516	奥特维	2020 年 5 月 14 日	2020 年 11 月 23 日	新发未 上市	23.28	43.10	2,310	53,776.80	99,561.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,650,346.25	0.00			11,650,346.25
结算备付金	475,404.83				475,404.83
存出保证金	60,213.12				60,213.12
交易性金融资产				137,062,249.43	137,062,249.43
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				0.00	0.00
应收利息				1,378.21	1,378.21
应收股利				0.00	0.00
应收申购款	9.94			167,691.01	167,700.95
其他资产				0.00	0.00
资产总计	12,185,974.14			137,231,318.65	149,417,292.79
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				517,943.12	517,943.12
应付管理人报酬				103,979.57	103,979.57
应付托管费				20,795.93	20,795.93
应付销售服务费				538.74	538.74
应付交易费用				2,470,093.81	2,470,093.81
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				361,963.55	361,963.55
负债总计		-		3,475,314.72	3,475,314.72
利率敏感度缺口	12,185,974.14	0.00	0.00	133,756,003.93	145,941,978.07

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 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	137,062,249.43	93.92
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
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	137,062,249.43	93.92

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金转型后不满一年，尚无足够经验数据。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 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。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 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 136,356,837.79 元，属于第二层次的余额为人民币 168,209.96 元，属于第三层次的余额为人民币 537,201.68 元。

6.4.14.1.2.2 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。

6.4.14.1.2.3 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。

6.4.14.2 承诺事项

无。

6.4.14.3 其他事项

无。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 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	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		35,634.57	—
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-	-
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	6.4.7.3	-	-
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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	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	6.4.7.9	57,685,368.22	58,431,551.29
未分配利润	6.4.7.10	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 05 月 06 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。

6.2 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 6 月 30 日
一、收入		3,914,931.27	25,091,962.67
1. 利息收入		53,908.33	38,296.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	33,734.99	38,296.85
债券利息收入		14.41	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,158.93	-
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	13,182,249.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,312,427.68	12,099,695.61
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	15,498.63	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-5,349.03	1,082,553.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,592,127.10	11,863,216.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	130,572.76	8,199.98
减：二、费用		1,914,506.72	2,508,598.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	626,101.54	829,810.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	104,350.26	138,301.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	950,672.21	1,325,471.74
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	-
7. 其他费用	6.4.7.20	233,382.66	215,014.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,000,424.55	22,583,364.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,000,424.55	22,583,364.54

6.3 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 6 月 30 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）	-	22,583,364.54	22,583,364.54
三、本期基金份额交易产生的基	-4,574,579.86	-3,503,595.40	-8,078,175.26

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	2, 171, 724. 08	1, 539, 917. 53	3, 711, 641. 61
2. 基金赎 回款	-6, 746, 303. 94	-5, 043, 512. 93	-11, 789, 816. 87
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)	64, 601, 962. 20	50, 260, 873. 13	114, 862, 835. 33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 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%。

6.4.2 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。

根据《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 5 月 7 日转型为建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF），存续期不定，因此本基金本期财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

6.4.3 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。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 5 月 6 日
活期存款	7,749,069.76

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

6.4.7.2 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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 5 月 6 日
----	-----------------------

应收活期存款利息	11,750.68
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
应收债券利息	—
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
合计	15,396.23

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 5 月 6 日
交易所市场应付交易费用	2,276,645.14
银行间市场应付交易费用	—
合计	2,276,645.14

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 5 月 6 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,621.47
应付证券出借违约金	—
预提费用	429,028.17
合计	430,649.64

6.4.7.9 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。

6.4.7.10 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

6.4.7.11 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
活期存款利息收入	26,493.38
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
其他	1,904.40
合计	33,734.99

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 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
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,312,427.68
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

6.4.7.12.2 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
卖出股票成交总额	314,595,461.94
减：卖出股票成本总额	308,283,034.26
买卖股票差价收入	6,312,427.68

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 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
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
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

6.4.7.13.2 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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	92,522.25
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	76,997.97
减：应收利息总额	25.65
买卖债券差价收入	15,498.63

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日
股票投资产生的股利收益	-5,349.03
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

6.4.7.17 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
1. 交易性金融资产	-2,592,127.10
股票投资	-2,592,127.10
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

6.4.7.18 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
基金赎回费收入	130,551.87
基金转换费收入	20.89
合计	130,572.76

6.4.7.19 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
交易所市场交易费用	950,672.21
银行间市场交易费用	-
合计	950,672.21

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 6 日
审计费用	17,349.47
信息披露费	141,639.49
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,113.50
银行间账户维护费	6,280.20
持有人大会费用	45,000.00
上市费	20,000.00
合计	233,382.66

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

截至财务报表批准日, 本基金无其他需要说明的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期, 存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	626,101.54	829,810.62
其中：支付销售机构的客户维护费	214,312.02	321,306.49

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。

6.4.10.2.2 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 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	104,350.26	138,301.75

注：支付基金托管人招商银行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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 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 6 月 30 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	9,682,045.28	32,066.60

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2020 年 5 月 6 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 5 月 6 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	0.00	-
合计	0.00	-

6.4.13.2.4 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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 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	0.00	0.00	0.00	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			
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	0.00	0.00	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
应付税费				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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（上年末：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 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

6.4.13.4.3.2 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

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

6.4.14.1.1 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。

6.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 5 月 6 日（基金合同失效前日），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 6 月 30 日，属于第一层次的余额为人民币 107,000,783.71 元，属于第二层次的余额为人民币 56,976.54 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元）。

6.4.14.1.2.2 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。

6.4.14.1.2.3 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。

6.4.14.2 承诺事项

无。

6.4.14.3 其他事项

无。

§ 7 投资组合报告（转型后）

7.1 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	137,062,249.43	91.73
	其中：股票	137,062,249.43	91.73
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	12,125,751.08	8.12
8	其他各项资产	229,292.28	0.15
9	合计	149,417,292.79	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	3,561,388.00	2.44
B	采矿业	1,988,160.00	1.36
C	制造业	52,702,564.47	36.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	634,206.00	0.43
E	建筑业	3,505,802.00	2.40
F	批发和零售业	1,944,093.00	1.33
G	交通运输、仓储和邮政业	1,077,590.00	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,189,802.00	1.50
J	金融业	40,102,920.36	27.48
K	房地产业	6,430,910.72	4.41
L	租赁和商务服务业	-	-
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	616,140.00	0.42
S	综合	-	-
	合计	114,753,576.55	78.63

7.2.2 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	443,744.00	0.30
C	制造业	11,632,957.63	7.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,424,445.00	0.98
E	建筑业	536,216.00	0.37
F	批发和零售业	691,416.00	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	3,519,615.00	2.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	776,166.00	0.53
J	金融业	931,500.65	0.64
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	672,426.60	0.46
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	1,580,310.00	1.08
R	文化、体育和娱乐业	99,876.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	22,308,672.88	15.29

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 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

7.3.1 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	600519	贵州茅台	6,300	9,216,144.00	6.31
2	000333	美的集团	116,269	6,951,723.51	4.76
3	000858	五粮液	39,173	6,703,283.76	4.59

4	601166	兴业银行	379,092	5,982,071.76	4.10
5	000002	万 科 A	221,400	5,787,396.00	3.97
6	300059	东方财富	275,200	5,559,040.00	3.81
7	601318	中国平安	74,434	5,314,587.60	3.64
8	000001	平安银行	411,800	5,271,040.00	3.61
9	002475	立讯精密	93,032	4,777,193.20	3.27
10	601336	新华保险	96,900	4,290,732.00	2.94
11	600276	恒瑞医药	41,248	3,807,190.40	2.61
12	601169	北京银行	707,400	3,466,260.00	2.38
13	600030	中信证券	137,000	3,303,070.00	2.26
14	600346	恒力石化	173,300	2,426,200.00	1.66
15	002714	牧原股份	26,720	2,191,040.00	1.50
16	002142	宁波银行	81,000	2,127,870.00	1.46
17	600919	江苏银行	343,100	1,945,377.00	1.33
18	601668	中国建筑	386,200	1,842,174.00	1.26
19	002024	苏宁易购	191,300	1,677,701.00	1.15
20	601390	中国中铁	331,400	1,663,628.00	1.14
21	000063	中兴通讯	36,200	1,452,706.00	1.00
22	300498	温氏股份	62,860	1,370,348.00	0.94
23	300433	蓝思科技	46,700	1,309,468.00	0.90
24	000725	京东方 A	267,700	1,250,159.00	0.86
25	002594	比亚迪	17,400	1,249,320.00	0.86
26	601601	中国太保	44,100	1,201,725.00	0.82
27	600016	民生银行	208,900	1,184,463.00	0.81
28	000876	新 希 望	38,600	1,150,280.00	0.79
29	002624	完美世界	18,800	1,083,632.00	0.74
30	601899	紫金矿业	245,000	1,078,000.00	0.74
31	002352	顺丰控股	19,700	1,077,590.00	0.74
32	002555	三七互娱	21,700	1,015,560.00	0.70
33	002001	新 和 成	34,600	1,006,860.00	0.69
34	603288	海天味业	7,840	975,296.00	0.67
35	000157	中联重科	150,200	965,786.00	0.66
36	603993	洛阳钼业	248,000	910,160.00	0.62
37	300136	信维通信	15,460	819,689.20	0.56
38	002241	歌尔股份	27,700	813,272.00	0.56
39	000651	格力电器	12,100	684,497.00	0.47
40	002463	沪电股份	26,400	659,472.00	0.45
41	300124	汇川技术	16,700	634,433.00	0.43
42	300413	芒果超媒	9,450	616,140.00	0.42
43	600011	华能国际	144,900	611,478.00	0.42
44	600585	海螺水泥	11,200	592,592.00	0.41
45	600848	上海临港	27,376	587,762.72	0.40

46	601012	隆基股份	14,000	570,220.00	0.39
47	603986	兆易创新	2,240	528,438.40	0.36
48	600867	通化东宝	29,700	517,671.00	0.35
49	002415	海康威视	15,900	482,565.00	0.33
50	000538	云南白药	4,400	412,764.00	0.28
51	002157	正邦科技	21,500	375,820.00	0.26
52	600309	万华化学	7,500	374,925.00	0.26
53	600436	片仔癀	2,000	340,500.00	0.23
54	600745	闻泰科技	2,500	314,875.00	0.22
55	002371	北方华创	1,800	307,638.00	0.21
56	601933	永辉超市	28,400	266,392.00	0.18
57	600438	通威股份	14,800	257,224.00	0.18
58	601162	天风证券	41,700	252,702.00	0.17
59	002252	上海莱士	28,700	242,802.00	0.17
60	000895	双汇发展	5,200	239,668.00	0.16
61	601881	中国银河	14,700	168,609.00	0.12
62	600183	生益科技	5,000	146,350.00	0.10
63	300014	亿纬锂能	2,100	100,485.00	0.07
64	002410	广联达	1,300	90,610.00	0.06
65	000069	华侨城 A	9,200	55,752.00	0.04
66	002938	鹏鼎控股	900	45,054.00	0.03
67	601628	中国人寿	1,300	35,373.00	0.02
68	600900	长江电力	1,200	22,728.00	0.02

7.3.2 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	600017	日照港	1,413,500	3,519,615.00	2.41
2	000516	国际医学	390,200	1,580,310.00	1.08
3	300435	中泰股份	145,500	1,424,445.00	0.98
4	300119	瑞普生物	56,500	1,262,775.00	0.87
5	603611	诺力股份	54,800	1,176,008.00	0.81
6	603360	百傲化学	55,083	1,070,262.69	0.73
7	002223	鱼跃医疗	26,500	964,600.00	0.66
8	600908	无锡银行	189,715	931,500.65	0.64
9	002110	三钢闽光	117,400	781,884.00	0.54
10	000785	居然之家	87,300	691,416.00	0.47
11	002600	领益智造	57,100	606,973.00	0.42
12	002384	东山精密	19,000	569,050.00	0.39
13	000090	天健集团	77,600	536,216.00	0.37
14	300383	光环新网	18,600	484,902.00	0.33
15	000975	银泰黄金	28,300	443,744.00	0.30

16	300558	贝达药业	2,800	391,944.00	0.27
17	300316	晶盛机电	15,800	390,892.00	0.27
18	300676	华大基因	2,500	389,775.00	0.27
19	002124	天邦股份	24,800	318,680.00	0.22
20	002301	齐心集团	19,400	318,548.00	0.22
21	002626	金达威	11,900	308,924.00	0.21
22	002030	达安基因	10,560	288,076.80	0.20
23	688222	成都先导	6,468	282,651.60	0.19
24	300308	中际旭创	4,230	266,490.00	0.18
25	002531	天顺风能	42,700	255,346.00	0.17
26	002399	海普瑞	10,000	250,400.00	0.17
27	300760	迈瑞医疗	800	244,560.00	0.17
28	002353	杰瑞股份	6,900	213,900.00	0.15
29	002459	晶澳科技	11,200	210,336.00	0.14
30	600633	浙数文化	21,200	207,336.00	0.14
31	002734	利民股份	13,230	198,053.10	0.14
32	300750	宁德时代	900	156,924.00	0.11
33	688080	映翰通	1,786	154,989.08	0.11
34	300397	天和防务	4,500	109,845.00	0.08
35	002049	紫光国微	1,500	109,125.00	0.07
36	300394	天孚通信	1,800	107,190.00	0.07
37	603238	诺邦股份	2,400	101,280.00	0.07
38	300336	新文化	20,300	99,876.00	0.07
39	688516	奥特维	2,310	99,561.00	0.07
40	300207	欣旺达	5,200	98,280.00	0.07
41	300604	长川科技	2,700	83,133.00	0.06
42	300737	科顺股份	3,800	74,974.00	0.05
43	300373	扬杰科技	2,000	67,040.00	0.05
44	688277	天智航	5,544	66,749.76	0.05
45	002351	漫步者	2,800	59,136.00	0.04
46	688377	迪威尔	3,167	52,002.14	0.04
47	688027	国盾量子	1,367	49,458.06	0.03
48	300684	中石科技	1,400	48,580.00	0.03
49	002583	海能达	6,200	47,058.00	0.03
50	603258	电魂网络	800	44,448.00	0.03
51	600521	华海药业	1,200	40,716.00	0.03
52	300352	北信源	5,600	39,480.00	0.03
53	300763	锦浪科技	200	12,818.00	0.01
54	300679	电连技术	200	6,396.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000002	万 科 A	5,734,947.00	3.93
2	000001	平安银行	4,791,541.00	3.28
3	600519	贵州茅台	4,386,788.97	3.01
4	600017	日照港	4,164,882.00	2.85
5	601336	新华保险	3,981,828.00	2.73
6	600016	民生银行	3,890,943.00	2.67
7	600030	中信证券	3,140,234.00	2.15
8	600919	江苏银行	2,492,158.00	1.71
9	000333	美的集团	2,290,854.00	1.57
10	600346	恒力石化	2,154,388.71	1.48
11	601988	中国银行	2,143,478.00	1.47
12	601166	兴业银行	1,979,719.00	1.36
13	300059	东方财富	1,968,825.00	1.35
14	600848	上海临港	1,780,214.28	1.22
15	000858	五 粮 液	1,592,987.00	1.09
16	000516	国际医学	1,574,725.00	1.08
17	300435	中泰股份	1,520,682.00	1.04
18	601668	中国建筑	1,505,625.00	1.03
19	002001	新 和 成	1,258,869.00	0.86
20	601601	中国太保	1,246,300.00	0.85

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。

7.4.2 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	600048	保利地产	2,934,348.83	2.01
2	601818	光大银行	2,844,626.00	1.95
3	600016	民生银行	2,612,963.00	1.79
4	601881	中国银河	2,447,430.00	1.68
5	600025	华能水电	2,388,081.00	1.64
6	002797	第一创业	2,348,340.00	1.61
7	601857	中国石油	2,256,872.00	1.55
8	600079	人福医药	2,234,486.00	1.53
9	601377	兴业证券	2,200,684.00	1.51
10	000069	华侨城 A	2,162,130.00	1.48
11	601988	中国银行	2,155,279.00	1.48
12	601318	中国平安	2,097,809.00	1.44
13	600958	东方证券	1,959,445.00	1.34
14	600436	片仔癀	1,866,814.00	1.28
15	600031	三一重工	1,767,068.00	1.21
16	600276	恒瑞医药	1,477,531.00	1.01

17	000568	泸州老窖	1,436,688.00	0.98
18	600606	绿地控股	1,433,268.00	0.98
19	000563	陕国投 A	1,424,201.00	0.98
20	002714	牧原股份	1,408,130.40	0.96

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。

7.4.3 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	115,424,624.69
卖出股票收入（成交）总额	95,449,759.21

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1**

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。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.12.3 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	60,213.12
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,378.21
5	应收申购款	167,700.95
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	229,292.28

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 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。

§ 7 投资组合报告（转型前）

7.1 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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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。

7.4.2 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。

7.4.3 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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

7.12.3 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

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 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 基金份额持有人信息（转型后）

8.1 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 A	3,585	37,158.70	45,108,624.22	33.86	88,105,313.14	66.14
建信沪深 300 指数增强 C	194	9,019.93	—	—	1,749,865.61	100.00

合计	3,779	35,714.16	45,108,624.22	33.42	89,855,178.75	66.58
----	-------	-----------	---------------	-------	---------------	-------

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占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）。

8.2 期末上市基金前十名持有人

建信沪深 300 指数增强 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	9.94
2	高其铭	312,477.00	7.47
3	刘新	253,593.00	6.06
4	官文举	194,296.00	4.64
5	柴旭麟	182,803.00	4.37
6	周旺余	142,711.00	3.41
7	颜风云	133,482.00	3.19
8	张中芬	127,209.00	3.04
9	黄崇安	124,820.00	2.98
10	尹德荣	101,936.00	2.44

建信沪深 300 指数增强 C

注：该基金未上市。

8.3 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 A	2,250.44	0.00
	建信沪深 300 指数增强 C	0.00	0.00
	合计	2,250.44	0.00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占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）。

8.4 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	建信沪深 300 指数增强 A	0~10
	建信沪深 300 指数增强 C	—

基金		
	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 A	-
	建信沪深 300 指数增强 C	-
	合计	-

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

8.1 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
建信稳健	145	5,657.46	-	-	820,331.00	100.00
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	17.18	93,937,366.03	82.82

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占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）。

8.2 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

8.3 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	0.0
	建信稳健	0.00	0.0
	建信进取	0.00	0.0
	合计	174.69	0.0

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占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）。

8.4 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

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。

§ 9 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 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	31,647,397.29	1,835,700.16
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	11,863,823.22	85,834.55
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）	—	—
本报告期期末基金份 额总额	133,213,937.36	1,749,865.61

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。

§ 9 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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 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），本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

10.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	
中信证券	1	82,250,097.10	39.12%	74,949.66	38.74%	—
中金财富证券	1	63,917,224.19	30.40%	59,522.66	30.77%	—
招商证券	1	34,786,662.25	16.55%	31,695.51	16.38%	—
国泰君安	1	29,294,459.64	13.93%	27,280.84	14.10%	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
九州证券	1	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

10.7.1 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。

10.7.2 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	—	—	—	—	—	—

10.8 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	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理办法》修改旗下部分证券投资基金基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-06-11
2	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

10.8 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	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转换结果的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-08
2	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的公告	指定报刊和/或公司网站	2020-05-07
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、建信进取份额终止上市的提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2020-04-30
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	建信双利策略主题分级股票型证券投资	指定报刊和/或公司网站	2020-04-28

	资基金之建信稳健份额、建信进取份额的终止上市公告		
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
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第二次提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2020-03-02
14	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一次提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2020-02-29
15	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
16	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
17	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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

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 06 月 30 日	9,679,273.37	35,429,350.85	-	45,108,624.22	33.42
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 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

2020 年 8 月 28 日