

# 建信优化配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	建信优化配置混合
基金主代码	530005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 3 月 1 日
报告期末基金份额总额	1,123,697,454.27 份
投资目标	通过合理的资产配置和积极的证券选择, 在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。
投资策略	基金管理人对宏观经济、行业及上市公司、债券、货币市场工具等进行定性与定量相结合的研究, 运用自上而下和自下而上相结合的投资策略, 在大类资产配置这一宏观层面与个股个券选择这一微观层面优化投资组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准: 60%×富时中国 A600 指数+40%×中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金, 一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金, 低于股票型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

## § 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（2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日）
--------	---------------------------------------

1. 本期已实现收益	104,685,524.41
2. 本期利润	217,536,338.62
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1879
4. 期末基金资产净值	2,060,612,621.87
5. 期末基金份额净值	1.8338

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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	11.45%	1.08%	7.78%	0.59%	3.67%	0.49%
过去六个月	24.09%	1.37%	13.29%	0.79%	10.80%	0.58%
过去一年	45.83%	1.36%	16.24%	0.84%	29.59%	0.52%
过去三年	55.78%	1.18%	22.72%	0.79%	33.06%	0.39%
过去五年	49.39%	1.14%	22.95%	0.75%	26.44%	0.39%
自基金合同生效起至今	229.49%	1.49%	100.82%	1.03%	128.67%	0.46%

#### 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

建信优化配置混合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		
邱宇航	权益投资部首席策略官，本基金的基金经理	2015年5月20日	-	13年	邱宇航先生，权益投资部资深基金经理兼研究部首席策略官，硕士。2007年7月加入本公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、权益投资部总经理助理、权益投资部资深基金经理兼研究部首席策略官。2011年7月11日至2014年3月27日任建信恒久价值股票型证券投资基金的基金经理；2013年6月14日起任建信消费升级混合型证券投资基金的基金经理；2015年5月20日起任建信优化配置混合型证券投资基金的基金经理；2018年5月3日起任建信安心保本六号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于2018年5月9日起转型为建信汇利灵活配置混合型证券投资基金，邱宇航继续担任该基金的基金经理。

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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信优化配置混合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

2020 年 4 季度，市场整体流动性充裕，经济基本面不断回升。A 股市场总体表现活跃，但行业间估值出现比较大的分化。新能源汽车产业链，包括上游的能源金属行业表现尤为突出；光伏产业链也获得资金青睐。消费品中白酒行业和国防军工行业估值进一步提升。另一方面，部分传统行业如金融地产受相关政策影响股价受到压制；TMT 行业因缺乏明显亮点相对吸引力下降表现也比较平淡。

本基金 4 季度顺应市场变化，加大了对新能源汽车和上游能源金属行业方面的投资，同时布局了全球周期性复苏的部分行业机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 11.45%，波动率 1.08%，业绩比较基准收益率 7.78%，波动率 0.59%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,741,497,278.92	82.69
	其中：股票	1,741,497,278.92	82.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,486,219.44	0.07
	其中：债券	1,486,219.44	0.07
	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	362,440,026.67	17.21
8	其他资产	573,187.14	0.03
9	合计	2,105,996,712.17	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	71,336,549.00	3.46
C	制造业	1,268,407,034.45	61.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,037,340.66	1.75
J	金融业	185,062,941.21	8.98
K	房地产业	66,795,947.14	3.24
L	租赁和商务服务业	87,155,596.50	4.23
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	742,507.80	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	25,907,391.36	1.26
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,741,497,278.92	84.51

### 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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	692,407	202,078,982.95	9.81
2	600519	贵州茅台	88,050	175,923,900.00	8.54
3	002475	立讯精密	2,302,806	129,233,472.72	6.27
4	601601	中国太保	3,294,000	126,489,600.00	6.14
5	000661	长春高新	227,456	102,107,272.96	4.96
6	002241	歌尔股份	2,517,669	93,959,407.08	4.56
7	601888	中国中免	308,570	87,155,596.50	4.23
8	300122	智飞生物	554,600	82,030,886.00	3.98
9	000651	格力电器	1,133,243	70,193,071.42	3.41
10	603799	华友钴业	826,877	65,571,346.10	3.18

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	1,486,219.44	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,486,219.44	0.07

#### 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	128136	立讯转债	9,872	1,255,520.96	0.06
2	123090	三诺转债	2,307	230,698.48	0.01

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

无。

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

无。

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

无。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细



无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1

本基金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。

#### 5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	485,899.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	48,699.07
5	应收申购款	38,589.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	573,187.14

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,187,739,396.11
报告期期间基金总申购份额	7,496,082.50
减：报告期期间基金总赎回份额	71,538,024.34
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	1,123,697,454.27

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	1,674,285.54
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,674,285.54
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.15

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信优化配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信优化配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信优化配置混合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

2021 年 1 月 21 日