

# 建信鑫享短债债券型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 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：恒丰银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 25 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。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	建信鑫享短债债券			
基金主代码	014856			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2022 年 5 月 19 日			
报告期末基金份额总额	279,048,442.48 份			
投资目标	本基金在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资短期债券，力争使基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资收益。			
投资策略	本基金的投资策略包括买入持有策略、久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属和板块轮换策略、骑乘策略、价值驱动的个券选择策略、信用债券投资策略、国债期货投资策略、回购投资策略以及资产支持证券投资策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。			
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（1 年以下）指数收益率。			
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险及预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。			
基金管理人	建信基金管理有限责任公司			
基金托管人	恒丰银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	建信鑫享短债债券 A	建信鑫享短债债券 C	建信鑫享短债债券 D	建信鑫享短债债券 F
下属分级基金的交易代码	014856	014857	016497	014858
报告期末下属分级基金的份额总额	116,413,136.27 份	152,573,788.01 份	52,518.20 份	10,009,000.00 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）		报告期（2022 年 8 月 18 日-2022 年 9 月 30 日）	报告期（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）
	建信鑫享短债债券 A	建信鑫享短债债券 C	建信鑫享短债债券 D	建信鑫享短债债券 F
1. 本期已实现收益	1,230,138.04	1,309,885.88	37.19	104,829.84
2. 本期利润	1,306,470.95	1,306,143.58	13.91	111,236.62
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0112	0.0097	0.0013	0.0111
4. 期末基金资产净值	118,197,644.95	154,857,161.73	53,313.91	10,162,020.19
5. 期末基金份额净值	1.0153	1.0150	1.0152	1.0153

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

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

3、本基金于 2022 年 8 月 18 日起新增 D 类份额。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信鑫享短债债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.11%	0.02%	0.54%	0.01%	0.57%	0.01%
自基金合同	1.53%	0.02%	0.79%	0.01%	0.74%	0.01%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

建信鑫享短债债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.09%	0.02%	0.54%	0.01%	0.55%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.50%	0.02%	0.79%	0.01%	0.71%	0.01%

建信鑫享短债债券 D

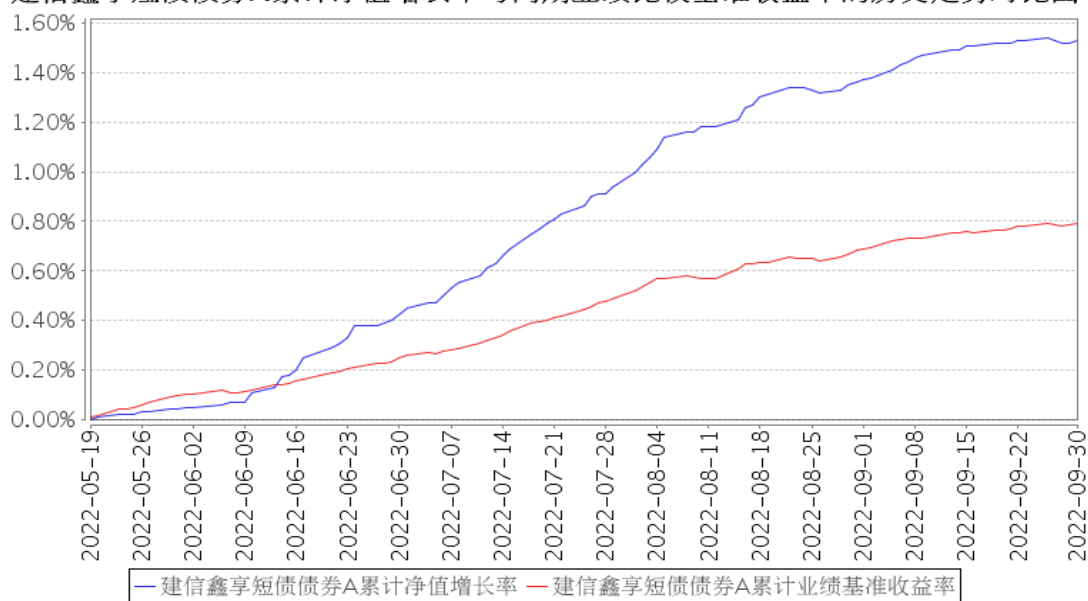
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.22%	0.01%	0.16%	0.01%	0.06%	0.00%

建信鑫享短债债券 F

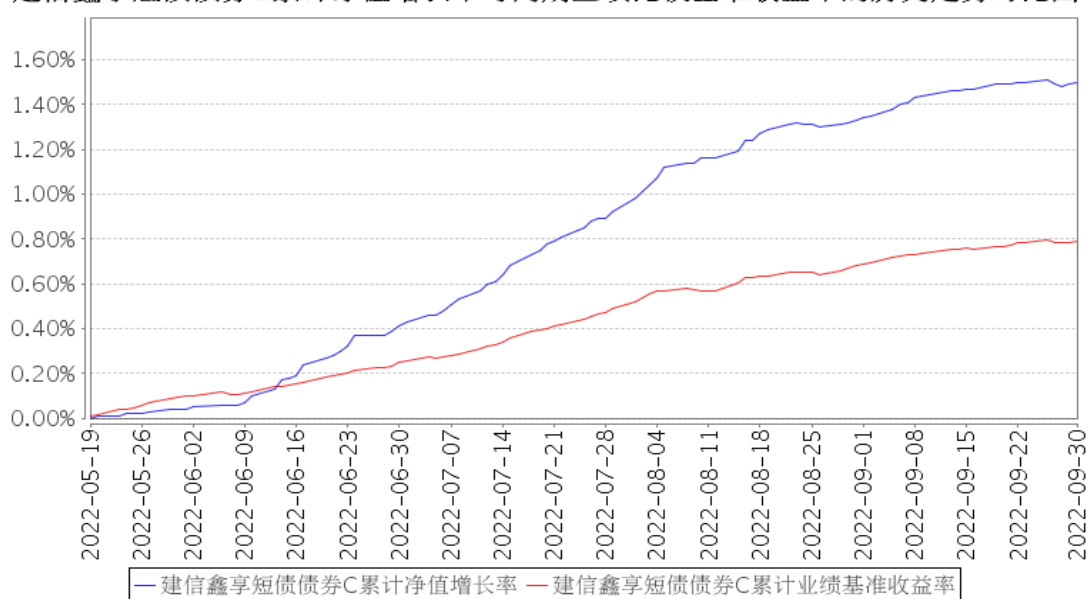
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.11%	0.02%	0.54%	0.01%	0.57%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.53%	0.02%	0.79%	0.01%	0.74%	0.01%

### 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

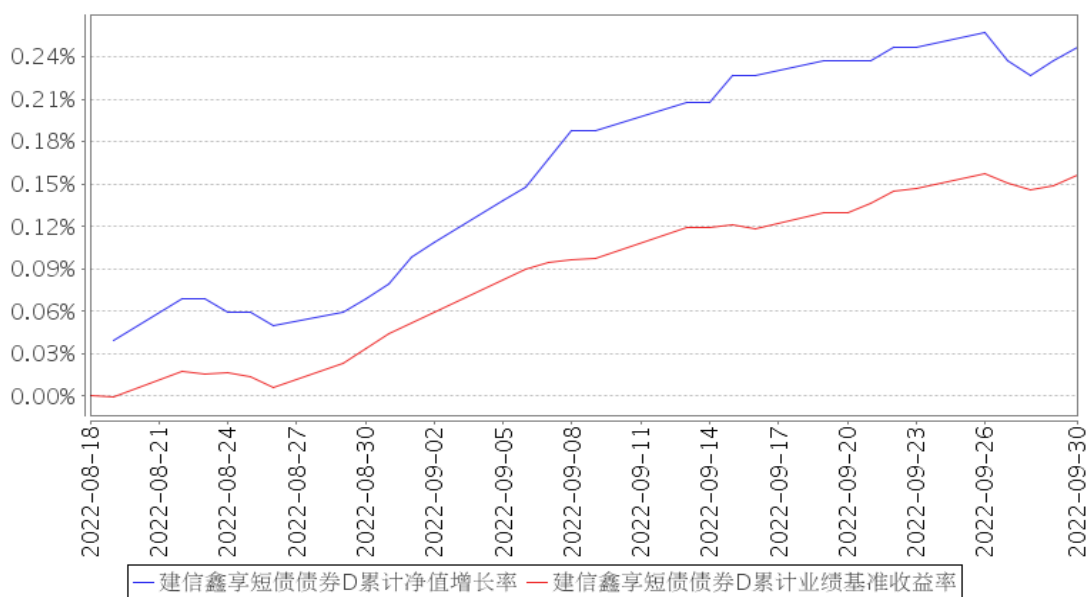
建信鑫享短债债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



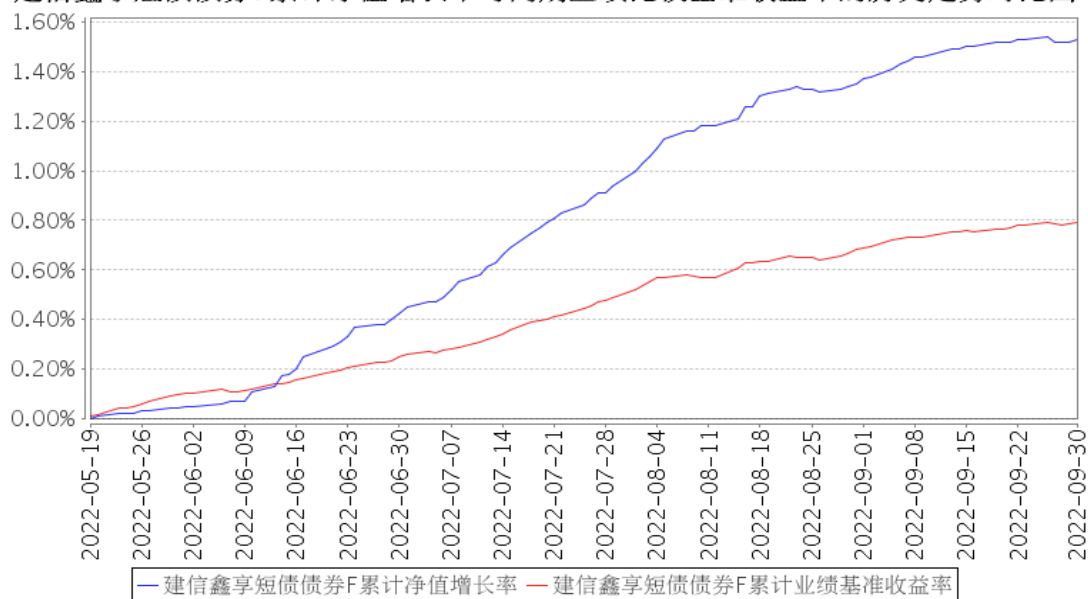
建信鑫享短债债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信鑫享短债债券D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



建信鑫享短债债券F累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2022 年 5 月 19 日生效，截至报告期末仍处于建仓期。

### 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		

吴沛文	本基金的基金经理	2022 年 5 月 19 日	-	11 年	吴沛文先生，硕士。2011 年 7 月至 2014 年 11 月在中债资信评估有限责任公司担任评级分析师；2014 年 12 月至 2015 年 9 月在阳光资产管理股份有限公司担任信用研究员；2015 年 10 月加入建信基金固定收益投资部，历任研究员、基金经理助理、基金经理。2019 年 7 月 17 日起任建信货币市场基金的基金经理；2020 年 5 月 20 日起任建信短债债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 6 月 29 日起任建信现金添利货币市场基金的基金经理；2022 年 1 月 20 日起任建信睿怡纯债债券型证券投资基金的基金经理；2022 年 5 月 19 日起任建信鑫享短债债券型证券投资基金的基金经理。
-----	----------	-----------------	---	------	--

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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信鑫享短债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量

超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面，三季度经济总体呈底部回升态势，生产需求稳中有升。从制造业采购经理指数（PMI）上看，PMI 指数在 22 年 7-9 月分别录得 49.0%、49.4% 和 50.1%，随着稳经济政策持续发挥效能，制造业景气度有所回暖，重返扩张区间。从需求端上看，固定资产投资增速继续下滑，1-8 月累计增速同比增长 5.8%，相比上半年回落 0.3 个百分点。从分项上看，制造业累计投资增速仍然保持较快增长，基础设施累计投资增速回升幅度加大，而房地产累计投资增速继续走低。三季度市场销售恢复加快，社会消费品零售总额累计增速由负转正，其中汽车消费改善明显；进出口方面，1-8 月货物进出口总额美元计价同比增长 9.5%，其中出口同比增长 13.5%，进口同比增长 4.6%，总体维持较高增速，相比上半年略有回落。从生产端上看，三季度工业生产有所回升，1-8 月全国规模以上工业增加值同比增长 3.6%，增速相比上半年有小幅提高。总体看，22 年三季度经济表现延续恢复发展态势，显示出较强韧性。

通胀方面，22 年三季度居民消费价格基本平稳，工业生产者价格涨幅继续回落。从消费者价格指数 CPI 上看，1-8 月份 CPI 同比增速相比上半年提升 0.2 个百分点，收于 1.9%，其中食品项中猪肉价格涨幅较大，油价下行影响下相关非食品项价格回落，居民物价运行总体平稳。从工业品价格指数上看，1-8 月全国工业生产者出厂价格同比增长 6.6%，相比上半年继续回落，受国际原油、有色金属等大宗商品价格波动传导等影响工业品价格走势整体下行。

货币政策和资金面层面，三季度货币政策维持稳健偏宽松基调，资金面整体较为宽松。人民银行在 8 月下调 7 天逆回购、1 年期中期借贷便利操作利率各 10BP，此外 8 月贷款市场报价利率 LPR 也出现非对称调降，其中 1 年期 LPR 下调 5BP 至 3.65%，5 年期 LPR 下调 15BP 至 4.30%。整体三季度月资金利率中枢仍明显低于政策利率，国庆节前受跨季等季节性因素影响有一定上行。从人民币汇率上看，三季度人民币汇率波动加大，9 月末人民币兑美元中间价收于 7.0998，较二季度末贬值 5.79%。

债券市场方面，受流动性宽松环境延续及货币政策降息操作等影响，7-8 月债券市场整体下行较多，9 月由于资金利率波动以及地产政策放松等影响有一定反弹。整体看三季度末 1 年期国开债和 1 年期国债分别下行 13BP 和 10BP 至 1.89% 和 1.85%，1 年期 AAA 中短期票据利率下行 26BP 至 2.16%。

报告期内，本基金完成建仓并开放申赎，运作初期整体秉承稳健投资的思路，以票息策略为主并在杠杆使用上保有了足够弹性，组合久期在合意区间动态调整，回撤控制良好。同时，本基金紧随债券市场和信用环境变化，为组合精选中高等级信用债和优质 ABS 以积累收益，努力为持



有人提供优良的投资回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 1.11%，波动率 0.02%，业绩比较基准收益率 0.54%，波动率 0.01%；本报告期本基金 C 净值增长率 1.09%，波动率 0.02%，业绩比较基准收益率 0.54%，波动率 0.01%；本报告期本基金 D 净值增长率 0.22%，波动率 0.01%，业绩比较基准收益率 0.16%，波动率 0.01%；本报告期本基金 F 净值增长率 1.11%，波动率 0.02%，业绩比较基准收益率 0.54%，波动率 0.01%。

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	350,866,546.43	99.57
	其中：债券	325,842,799.86	92.47
	资产支持证券	25,023,746.57	7.10
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	333,486.66	0.09
8	其他资产	1,171,285.03	0.33
9	合计	352,371,318.12	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

##### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

无。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	25,680,276.71	9.07
	其中：政策性金融债	25,680,276.71	9.07
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	204,158,964.18	72.07
6	中期票据	96,003,558.97	33.89
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	325,842,799.86	115.03

## 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	101901757	19 盘江投资 MTN003	200,000	21,050,109.59	7.43
2	102001521	20 镇国投 MTN002	200,000	20,680,728.77	7.30
3	012281650	22 津城建 SCP031	200,000	20,438,200.55	7.22
4	012280749	22 象屿 SCP003	200,000	20,337,178.08	7.18
5	042280203	22 华阳新材 CP002	200,000	20,319,780.82	7.17

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180582	济租 03A1	150,000	15,018,801.37	5.30
2	180129	国惠 01A2	60,000	6,004,647.12	2.12
3	180817	晋建 2A1	40,000	4,000,298.08	1.41

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

无。

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

无。

## 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.10 投资组合报告附注

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，江苏沙钢集团有限公司（以下简称“公司”、“沙钢集团”）于 2022 年 7 月 12 日发布公告，公司于 2022 年 7 月 11 日收到了中国证监会《行政处罚决定书》（〔2022〕33 号）。沙钢集团因隐瞒其与锦麟丰泰的一致行动关系，导致沙钢股份 2019 年及 2020 年年度报告存在虚假记载，2020 年 6 月 29 日持股比例减少百分之一时也未告知上市公司及时公告，违反了《证券法》第六十三条第三款、第七十八条第一款、第二款的规定，构成《证券法》第一百九十七条第二款所述发行人的控股股东、实际控制人隐瞒相关事项导致信息披露义务人披露的信息有虚假记载的行为。依据《证券法》第一百九十五条、第一百九十七条第一款、第一百九十七条第二款的规定，中国证监会对沙钢集团给予警告、责令改正的处罚，并处以 250 万元罚款。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-

2	应收证券清算款		-
3	应收股利		-
4	应收利息		-
5	应收申购款		1,171,285.03
6	其他应收款		-
7	其他		-
8	合计		1,171,285.03

#### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信鑫享短债 债券 A	建信鑫享短债 债券 C	建信鑫 享短债 债券 D	建信鑫享短 债债券 F
报告期期初基金份额总额	117,555,531.95	107,825,834.70	-	10,009,000.00
报告期期间基金总申购份额	4,116,644.92	191,957,761.07	52,518.20	-
减：报告期期间基金总赎回份额	5,259,040.60	147,209,807.76	-	-
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	116,413,136.27	152,573,788.01	52,518.20	10,009,000.00

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、本基金于 2022 年 8 月 18 日起新增 D 类份额。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%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	2022 年 07 月 01 日 - 2022 年 09 月 04 日, 2022 年 09 月 29 日 - 2022 年 09 月 30 日	60,064,800.00	-	-	60,064,800.00	21.52
	2	2022 年 08 月 22 日 - 2022 年 08 月 23 日	40,089,000.00	-	-	40,089,000.00	14.37
产品特有风险							
<p>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。</p>							

### 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鑫享短债债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信鑫享短债债券型证券投资基金基金合同》；

- 3、《建信鑫享短债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信鑫享短债债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

## 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

## 9.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

2022 年 10 月 25 日