

建信开元耀享 9 个月持有期混合型发起式  
证券投资基金  
2023 年第 4 季度报告

2023 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	建信开元耀享 9 个月持有期混合发起	
基金主代码	018455	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 8 月 8 日	
报告期末基金份额总额	59,258,585.17 份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，力求实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合，形成对大类资产的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定债券类资产、权益类资产、现金类资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，以规避市场风险，提高基金收益率。	
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率（经汇率调整）*5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将通过港股通投资于香港市场股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信开元耀享 9 个月持有期混合发起 A	建信开元耀享 9 个月持有期混合发起 C

下属分级基金的交易代码	018455	018456
报告期末下属分级基金的份额总额	45,573,577.41 份	13,685,007.76 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）	
	建信开元耀享 9 个月持有期混合发起 A	建信开元耀享 9 个月持有期混合发起 C
1. 本期已实现收益	96,229.06	15,206.18
2. 本期利润	-41,320.76	-26,164.45
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0009	-0.0019
4. 期末基金资产净值	45,471,683.37	13,632,729.40
5. 期末基金份额净值	0.9978	0.9962

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

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

#### 3.2 基金净值表现

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

建信开元耀享 9 个月持有期混合发起 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.09%	0.10%	-0.27%	0.14%	0.18%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-0.22%	0.08%	-1.71%	0.13%	1.49%	-0.05%

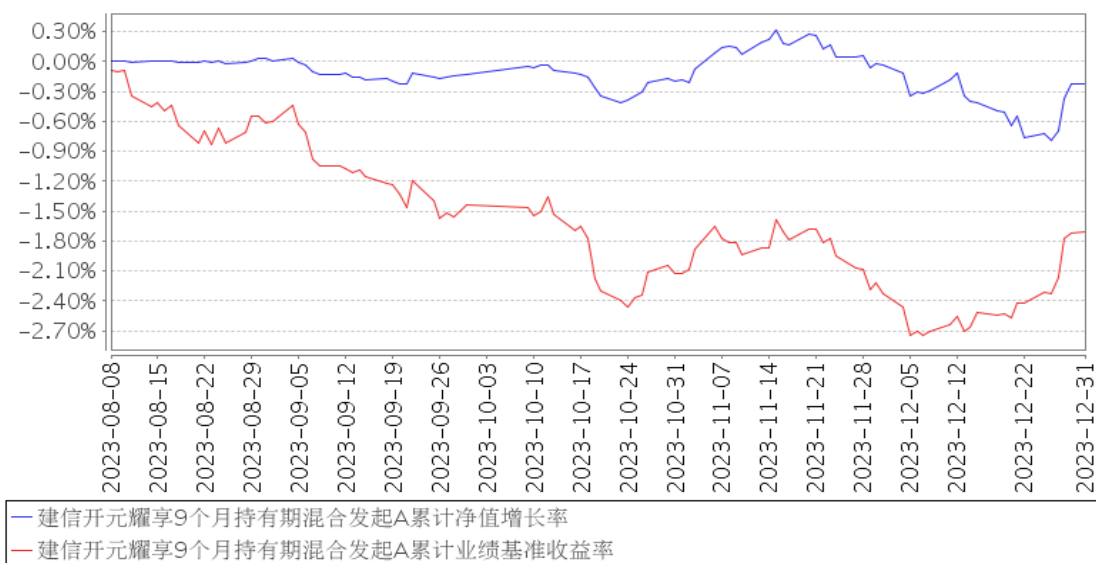
建信开元耀享 9 个月持有期混合发起 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

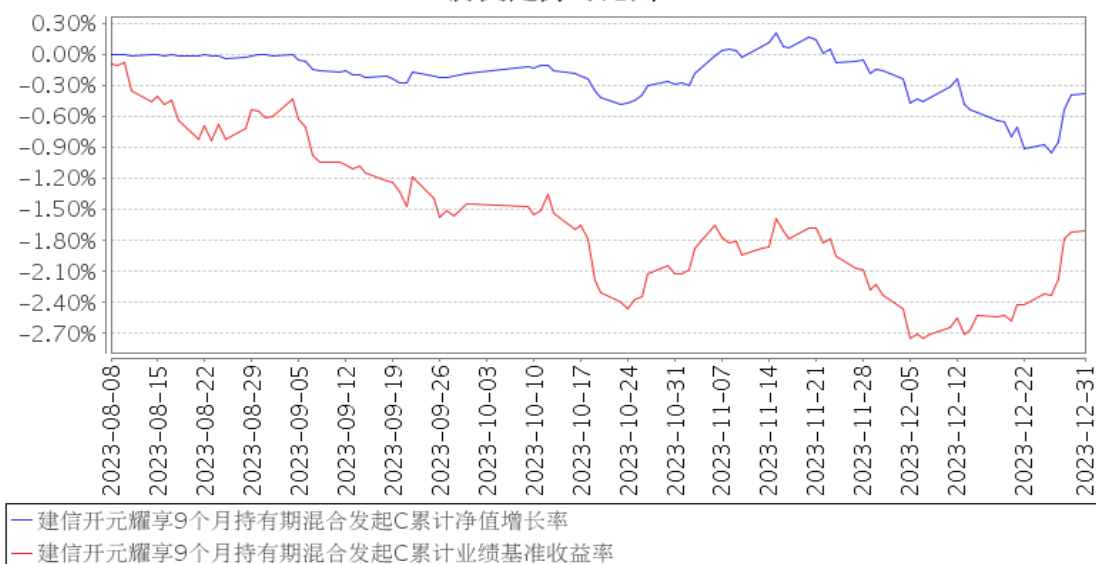
过去三个月	-0.19%	0.10%	-0.27%	0.14%	0.08%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-0.38%	0.08%	-1.71%	0.13%	1.33%	-0.05%

### 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

建信开元耀享9个月持有期混合发起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



建信开元耀享9个月持有期混合发起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：本基金基金合同于2023年8月8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		
王琦	本基金的基金经理	2023年8月8日	-	13	王琦先生，硕士。曾任中国银行股份有限公司投资经理。2016年1月加入建信基金管理有限责任公司专户投资部，历任投资经理助理、投资经理等职务。2023年8月8日起任建信开元耀享9个月持有期混合型发起式证券投资基金的基金经理；2023年11月21日起任建信开元惠享6个月持有期债券型发起式证券投资基金的基金经理。
赵荣杰	本基金的基金经理	2023年8月8日	-	13	赵荣杰先生，多元资产投资部高级投资经理，硕士。曾任北京国信迅捷信息资源开发技术有限公司分析师，国都证券股份有限公司证券投资业务总部投资经理。2016年10月加入建信基金，历任专户投资部投资经理、高级投资经理等职务。2023年8月8日起任建信开元耀享9个月持有期混合型发起式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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
赵荣杰	公募基金	1	59,104,412.77	2023年8月8日
	私募资产管理计划	1	708,952,748.10	2017年2月22日
	其他组合	-	-	-
	合计	2	768,057,160.87	-

### 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《建信开元耀享9个月持有期混合型发起式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

四季度宏观经济相对平稳，但仍面临有效需求不足的挑战。基建和制造业仍是支撑投资的主力，消费复苏动能有限，物价走势偏弱。为促进经济发展，政策持续发力。货币政策相对宽松，央行通过公开市场操作、存款利率下调等方式维持流动性合理充裕，引导实体融资成本下行。财政政策继续维持积极，增发国债后赤字率提高至3.8%左右，同时进一步助力地方政府化债。地产政策持续优化，一线城市陆续出台信贷放松政策提振需求。后续随着政策落地见效，经济有望维持温和复苏。

股票市场方面，四季度随着预期走弱，风险偏好逐步降低。上证指数在12月底创下年内低位，全年下跌3.7%，创业板指下跌19.4%。分行业看，计算机、传媒、通信、电子等TMT板块相对较好，美容护理、商贸零售、房地产、电力设备等表现较差。

债券市场方面，年末资金面的相对稳定和部分机构提前配置的行为带动收益率继续下行，其中长端利率债受到保险资金的需求影响，收益率明显走低，30年期国债利率更是创下历史新低。信用债方面，城投品种受益于地方政府化债表现较好，机构仍偏好短端品种。

回顾四季度的基金管理工作，本基金平稳运作，债券组合在建仓初期仍以票息策略为主，优选高评级的优质信用债作为底仓配置，同时在权益市场低位增配转债提升组合弹性；股票组合在市场调整中逐步提升仓位，配置结构相对均衡，关注盈利稳定且注重股东回报的红利资产、受益产业趋势且具备核心竞争力的科技板块、以及商业模式和现金流优异的价值标的。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率-0.09%，波动率 0.10%，业绩比较基准收益率-0.27%，波动率 0.14%。本报告期本基金 C 净值增长率-0.19%，波动率 0.10%，业绩比较基准收益率-0.27%，波动率 0.14%。

#### 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	6,286,235.01	10.47
	其中：股票	6,286,235.01	10.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	52,679,467.36	87.72
	其中：债券	52,679,467.36	87.72
	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	1,045,576.87	1.74
8	其他资产	45,093.41	0.08
9	合计	60,056,372.65	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,169,168.79 元，占期末基金资产净值比例为 1.98%。

### 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	238,379.00	0.40
C	制造业	2,584,478.72	4.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	172,074.00	0.29
F	批发和零售业	58,743.00	0.10

G	交通运输、仓储和邮政业	59,220.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	917,688.50	1.55
J	金融业	415,521.00	0.70
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	382,992.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	118,437.00	0.20
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	112,315.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	57,218.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	5,117,066.22	8.66

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
Materials 材料	353,235.49	0.60
Consumer Staples 日常生活消费品	94,971.86	0.16
Consumer Discretionary 非日常消费品	111,329.13	0.19
Energy 能源	188,493.76	0.32
Financials 金融	-	-
Health Care 医疗保健	-	-
Industrials 工业	-	-
Real Estate 房地产	-	-
Information Technology 信息技术	-	-
Telecommunication Services 通讯服务	421,138.55	0.71
Utilities 公用事业	-	-
合计	1,169,168.79	1.98

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002027	分众传媒	60,600	382,992.00	0.65
2	01378	中国宏桥	61,000	353,235.49	0.60
3	600519	贵州茅台	200	345,200.00	0.58
4	00941	中国移动	4,000	234,892.22	0.40



5	002415	海康威视	6,700	232,624.00	0.39
6	300285	国瓷材料	8,300	191,896.00	0.32
7	688083	中望软件	1,925	191,614.50	0.32
8	00883	中国海洋石油	16,000	188,493.76	0.32
9	00700	腾讯控股	700	186,246.33	0.32
10	300122	智飞生物	3,000	183,330.00	0.31

#### 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	3,058,287.12	5.17
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	33,436,427.00	56.57
6	中期票据	12,201,791.21	20.64
7	可转债（可交换债）	3,982,962.03	6.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	52,679,467.36	89.13

#### 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	102103191	21 陕煤化 MTN010	50,000	5,042,313.11	8.53
2	102101963	21 首开 MTN004	40,000	4,049,352.13	6.85
3	101900037	19 南电 MTN002	30,000	3,110,125.97	5.26
4	019694	23 国债 01	30,000	3,058,287.12	5.17
5	012383492	23 泰达投资 SCP014	30,000	3,057,062.30	5.17

#### 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

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，北京首都开发股份有限公司于 2023 年 7 月 12 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《立案告知书》（编号：证监立案字 0142023014 号），因涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会决定对其立案。公司于 2023 年 11 月 30 日收到中国证监会北京监管局下发的《行政处罚决定书》（编号：〔2023〕6 号），因首开股份在 2021 年存货减值测试中，高估下属子公司存货可变现净值，少计提存货跌价准备 4.05 亿元，少计资产减值损失 4.05 亿元。上述事项导致首开股份 2021 年年度报告存在错报，并导致首开股份 2022 年 5 月至 2023 年 5 月期间发行的公司债券和债务融资工具的募集说明书等发行文件，以及在银行间债券市场披露的 2021 年年度报告存在错报。首开股份的上述行为违反了

《证券法》第七十八条第二款、《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第180号）第四条、《银行间债券市场非金融企业债务融资工具管理办法》（中国人民银行令〔2008〕第1号）第七条的规定，构成《证券法》第一百九十七条第二款所述的违法行为，故对其给予警告，并处以150万元的罚款。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	45,093.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	45,093.41

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	174,418.74	0.30
2	132018	G三峡EB1	154,562.60	0.26
3	123099	普利转债	143,007.68	0.24
4	123107	温氏转债	118,984.56	0.20
5	110060	天路转债	117,206.34	0.20
6	123158	宙邦转债	116,546.67	0.20
7	113044	大秦转债	116,331.01	0.20
8	127012	招路转债	115,834.43	0.20
9	113061	拓普转债	113,264.73	0.19
10	110047	山鹰转债	113,062.68	0.19
11	128128	齐翔转2	107,433.49	0.18
12	110048	福能转债	102,883.72	0.17
13	110077	洪城转债	91,427.51	0.15
14	123131	奥飞转债	89,621.53	0.15
15	127037	银轮转债	86,738.83	0.15
16	113634	珀莱转债	84,898.19	0.14
17	123177	测绘转债	83,302.07	0.14
18	110075	南航转债	82,804.67	0.14
19	128081	海亮转债	64,528.43	0.11

20	123176	精测转2	61,181.41	0.10
21	113066	平煤转债	60,920.25	0.10
22	113643	风语转债	60,724.34	0.10
23	127014	北方转债	60,641.24	0.10
24	110091	合力转债	60,285.40	0.10
25	113623	凤21转债	59,469.77	0.10
26	110088	淮22转债	59,459.44	0.10
27	113631	皖天转债	58,816.28	0.10
28	113060	浙22转债	58,799.92	0.10
29	113505	杭电转债	58,504.92	0.10
30	110074	精达转债	58,253.29	0.10
31	113037	紫银转债	58,112.52	0.10
32	113063	赛轮转债	58,022.37	0.10
33	113619	世运转债	58,011.33	0.10
34	110061	川投转债	57,808.39	0.10
35	127017	万青转债	57,723.63	0.10
36	110093	神马转债	57,698.78	0.10
37	128083	新北转债	57,284.51	0.10
38	127071	天箭转债	56,656.99	0.10
39	113670	金23转债	56,212.35	0.10
40	127020	中金转债	55,926.07	0.09
41	110090	爱迪转债	55,309.63	0.09
42	127065	瑞鹤转债	55,108.03	0.09
43	118030	睿创转债	55,051.60	0.09
44	111010	立昂转债	54,357.13	0.09
45	113582	火炬转债	53,644.00	0.09
46	110045	海澜转债	53,512.17	0.09
47	113055	成银转债	52,765.26	0.09
48	110062	烽火转债	52,521.73	0.09
49	127006	敖东转债	52,429.81	0.09
50	113655	欧22转债	49,483.15	0.08
51	110083	苏租转债	29,091.41	0.05
52	128119	龙大转债	28,356.37	0.05
53	123194	百洋转债	27,800.45	0.05

#### 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

项目	建信开元耀享9个月持有期混合发起A	建信开元耀享9个月持有期混合发起C
报告期期初基金份额总额	45,491,635.56	13,684,997.72
报告期期间基金总申购份额	81,941.85	10.04
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	45,573,577.41	13,685,007.76

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	10,000,000.00
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	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	16.88

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	16.88	10,000,000.00	16.88	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人	80,144.26	0.14	-	-	3年

员					
基金管理人股 东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,080,144.26	17.02	10,000,000.00	16.88	3年

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信开元耀享9个月持有期混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信开元耀享9个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信开元耀享9个月持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信开元耀享9个月持有期混合型发起式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。

### 10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 10.3 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

2024年1月19日