

建信鑫和 30 天持有期债券型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告

2024 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

报告送出日期：2024 年 7 月 18 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信鑫和 30 天持有债券	
基金主代码	016799	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 月 29 日	
报告期末基金份额总额	1,714,547,270.04 份	
投资目标	本基金在严格控制风险的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资收益，追求稳定的当期收益和基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。	
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信鑫和 30 天持有债券 A	建信鑫和 30 天持有债券 C
下属分级基金的交易代码	016799	016800
报告期末下属分级基金的份额总额	447,775,809.94 份	1,266,771,460.10 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
	建信鑫和 30 天持有债券 A	建信鑫和 30 天持有债券 C
1. 本期已实现收益	4,387,585.91	12,410,478.68
2. 本期利润	5,860,289.49	16,465,702.57
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0124	0.0119
4. 期末基金资产净值	482,660,240.23	1,363,252,598.53
5. 期末基金份额净值	1.0779	1.0762

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

建信鑫和 30 天持有债券 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	1.18%	0.05%	1.06%	0.07%	0.12%	-0.02%
过去六个月	2.49%	0.05%	2.42%	0.07%	0.07%	-0.02%
过去一年	4.23%	0.04%	3.27%	0.06%	0.96%	-0.02%
自基金合同生效起至今	7.79%	0.03%	4.67%	0.05%	3.12%	-0.02%

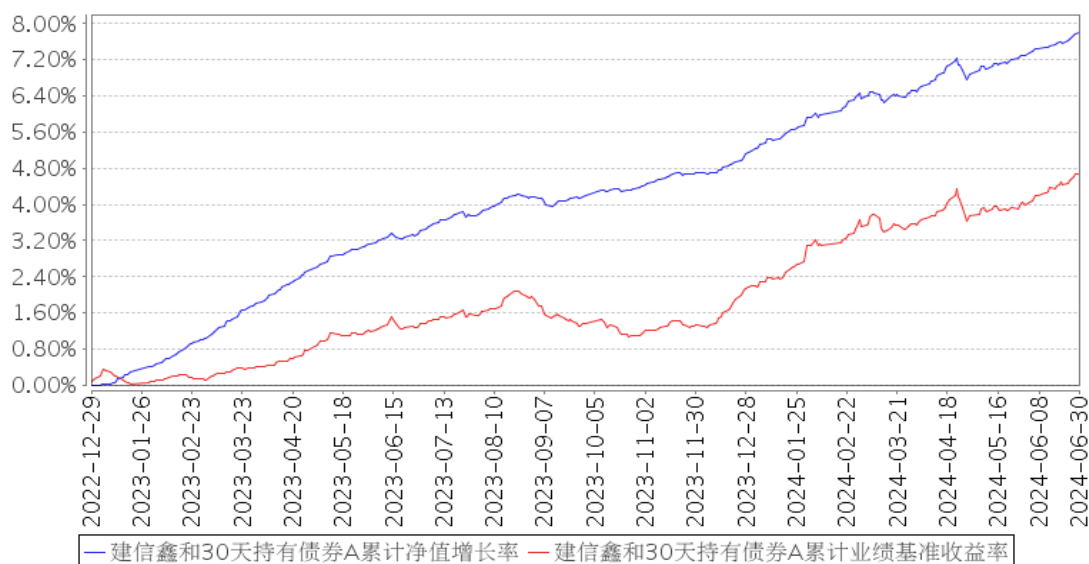
建信鑫和 30 天持有债券 C

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	1.17%	0.05%	1.06%	0.07%	0.11%	-0.02%
过去六个月	2.44%	0.05%	2.42%	0.07%	0.02%	-0.02%
过去一年	4.12%	0.04%	3.27%	0.06%	0.85%	-0.02%
自基金合同生效起至今	7.62%	0.03%	4.67%	0.05%	2.95%	-0.02%

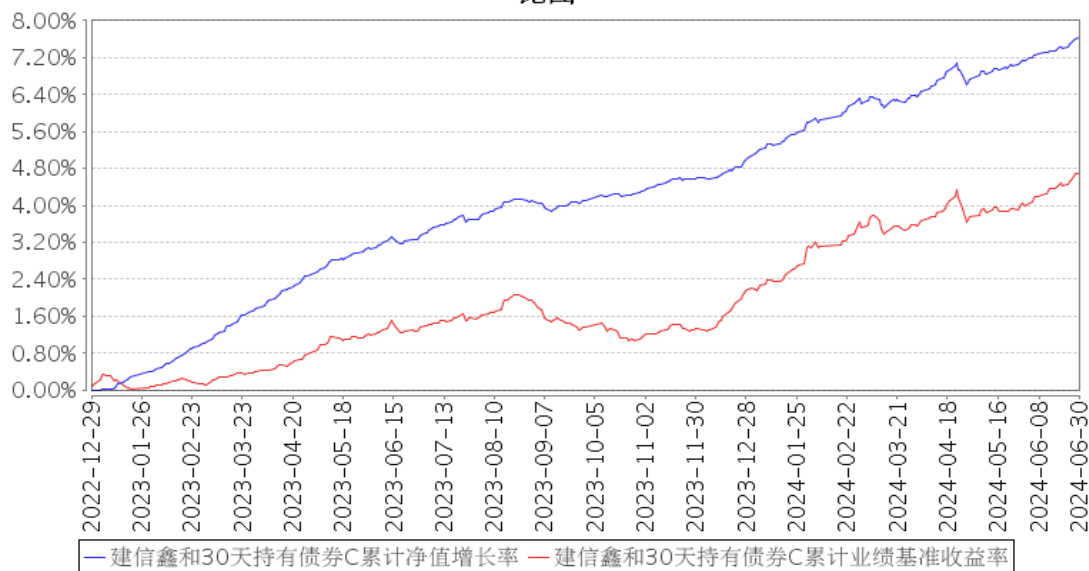
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

建信鑫和30天持有债券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



建信鑫和30天持有债券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



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
彭紫云	本基金的基金经理	2022 年 12 月 29 日	-	10	彭紫云先生，硕士。2013 年 7 月加入建信基金，历任研究部助理研究员、固定收益投资债券研究员、基金经理助理和基金经理。2019 年 7 月 17 日起任建信纯债债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 7 月 17 日至 2021 年 11 月 10 日任建信双息红利债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 1 月 3 日至 2021 年 11 月 18 日任建信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 1 月 3 日至 2021 年 12 月 14 日任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 10 日至 2021 年 3 月 9 日任建信瑞福添利混合型证券投资基金；2020 年 4 月 10 日至 2021 年 9 月 29 日任建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 12 月 18 日至 2021 年 11 月 28 日任建信稳定丰利债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 12 月 18 日至 2022 年 1 月 6 日任建信稳定增利债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 8 月 10 日起任建信鑫悦 90 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金的基金经理；2022 年 5 月 9 日起任建信鑫恒 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理；2022 年 7 月 27 日起任建信鑫福 60 天持有期中短债债券型证券投资基金的基金经理；2022 年 12 月 29 日起任建信鑫和 30 天持有期债券型证券投资基金的基金经理；2023 年 3 月 27 日至 2024 年 3 月 29 日任建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2023 年 8 月 23 日起任建信鑫弘 180 天持有期债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 2 月 26 日起任建信宁远 90 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。
吴沛文	本基金的基金经理	2022 年 12 月 29 日	-	12	吴沛文先生，硕士。曾任中债资信评估有限责任公司评级分析师、阳光资产管理股份有限公司信用研究员。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；2022 年 12 月 29 日起任建信鑫和 30 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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《建信鑫和 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济方面，PMI 指数在 24 年 4-6 月分别录得 50.4%，49.5%和 49.5%，重新回落至荣枯线之下。从需求端上看，制造业累计投资增速继续回升，基础设施累计投资增速转向下行，房地产累计投资增速跌幅略有收窄。

通胀方面，24 年二季度通胀企稳回升，居民消费价格（CPI）单月同比略回升，工业生产者出厂价格（PPI）单月同比降幅收窄。

资金面和货币政策层面，24 年二季度资金环境维持宽松。受禁止手工补息影响，大量存款向理财等其它资管产品转化，非银机构资金充裕，资金利率维持低位。二季度央行并未调整利率和存款准备金率。资金利率中枢来看，7 天质押回购利率（R007）中枢维持平稳。

债券市场方面，“资产荒”逻辑仍主导市场走势，但央行多次警示利率风险使得行情一波三折。长债收益率走势接近倒 N 型，中短债持续震荡下行。整体看，二季度末 10 年国债收益率下行 8BP 到 2.21%，而 10 年国开债收益率相比于一季度末下行 12BP 到 2.29%。1 年期国债和 1 年期国开债全季度分别下行 18BP 和 15BP 至 1.54%和 1.69%，期限利差略有走扩。

操作上，二季度组合主要以利率债和大行二级资本债为主要持仓，维持相对偏长的久期获得收益率下行带来的资本利得，通过精选信用债获取票息收益，后续仍将保持风格特征，实现净值的稳定增长。

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 1.18%，波动率 0.05%，业绩比较基准收益率 1.06%，波动率 0.07%。本报告期本基金 C 净值增长率 1.17%，波动率 0.05%，业绩比较基准收益率 1.06%，波动率 0.07%。

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	2,275,526,679.00	98.94
	其中：债券	2,262,406,347.77	98.37
	资产支持证券	13,120,331.23	0.57
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	14,733,266.25	0.64
8	其他资产	9,680,937.36	0.42
9	合计	2,299,940,882.61	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	50,914,958.79	2.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,199,014,093.11	64.96
	其中：政策性金融债	603,906,339.82	32.72
4	企业债券	10,257,931.51	0.56
5	企业短期融资券	122,757,634.92	6.65
6	中期票据	682,472,446.70	36.97
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	196,989,282.74	10.67
9	其他	-	-
10	合计	2,262,406,347.77	122.56

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	112417058	24 光大银行 CD058	1,000,000	98,509,306.85	5.34
2	112417061	24 光大银行 CD061	1,000,000	98,479,975.89	5.34
3	240401	24 农发 01	800,000	80,540,721.31	4.36
4	232380036	23 工行二级资本	700,000	74,216,363.93	4.02

		债 02A			
5	232380066	23 中行二级资本 债 03A	600,000	64,415,586.89	3.49

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	143986	川担 1A1	50,000	5,065,298.63	0.27
2	143941	示范区 11A	50,000	5,040,979.45	0.27
3	143294	示范区 3A	30,000	3,014,053.15	0.16

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

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

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	12,256.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,668,680.55
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	9,680,937.36

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	建信鑫和 30 天持有债券 A	建信鑫和 30 天持有债券 C
报告期期初基金份额总额	489,995,888.77	1,348,067,056.39
报告期期间基金总申购份额	133,522,115.97	703,175,428.90
减：报告期期间基金总赎回份额	175,742,194.80	784,471,025.19
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	447,775,809.94	1,266,771,460.10

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

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

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鑫和 30 天持有期债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信鑫和 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信鑫和 30 天持有期债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信鑫和 30 天持有期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

2024 年 7 月 18 日