

建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金

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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	建信鑫利灵活配置混合	
基金主代码	001858	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 11 月 4 日	
报告期末基金份额总额	96,942,443.63 份	
投资目标	本基金自上而下积极、动态地配置大类资产，同时通过合理的证券选择，在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整大类资产配置比例，同时将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，运用自上而下和自下而上相结合的个股、个券投资策略，在大类资产配置和证券选择两个层面上实现投资组合的双重优化。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为： $65\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+35\% \times$ 中债总财富（总值）指数收益率。	
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与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信鑫利灵活配置混合 A	建信鑫利灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001858	019073
报告期末下属分级基金的份额总额	96,907,455.92 份	34,987.71 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）	
	建信鑫利灵活配置混合 A	建信鑫利灵活配置混合 C
1. 本期已实现收益	765,840.95	349.30
2. 本期利润	-1,679,585.14	-798.82
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0172	-0.0132
4. 期末基金资产净值	198,503,014.63	71,117.55
5. 期末基金份额净值	2.0484	2.0326

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

建信鑫利灵活配置混合 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	-0.89%	1.24%	-0.76%	0.48%	-0.13%	0.76%
过去六个月	-1.09%	1.34%	2.03%	0.58%	-3.12%	0.76%
过去一年	-8.02%	1.10%	-4.42%	0.56%	-3.60%	0.54%
过去三年	-21.48%	1.42%	-18.55%	0.68%	-2.93%	0.74%
过去五年	125.47%	1.49%	3.51%	0.74%	121.96%	0.75%
自基金合同生效起至今	97.53%	1.36%	5.38%	0.78%	92.15%	0.58%

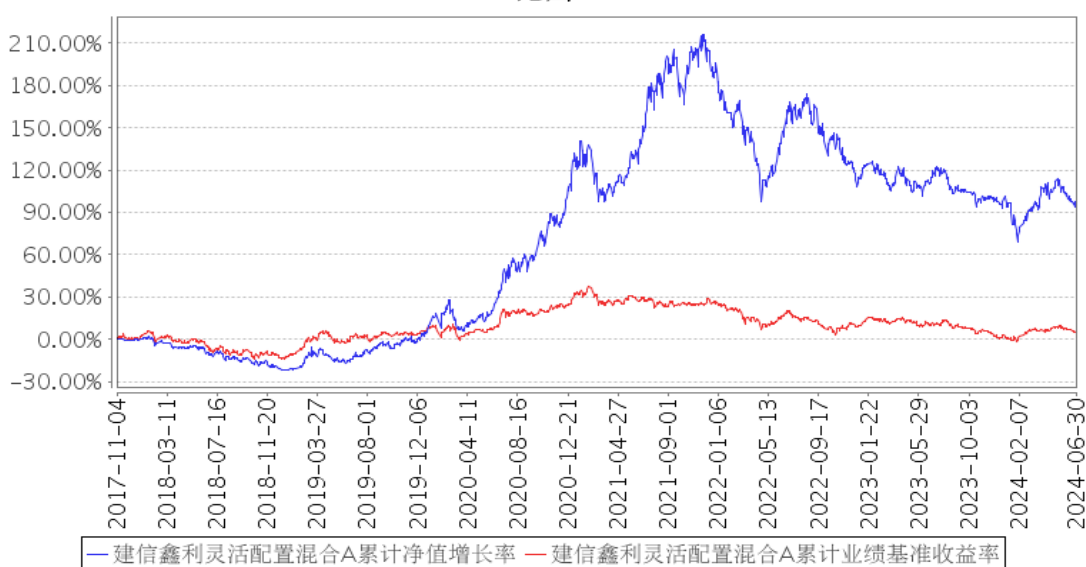
建信鑫利灵活配置混合 C

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

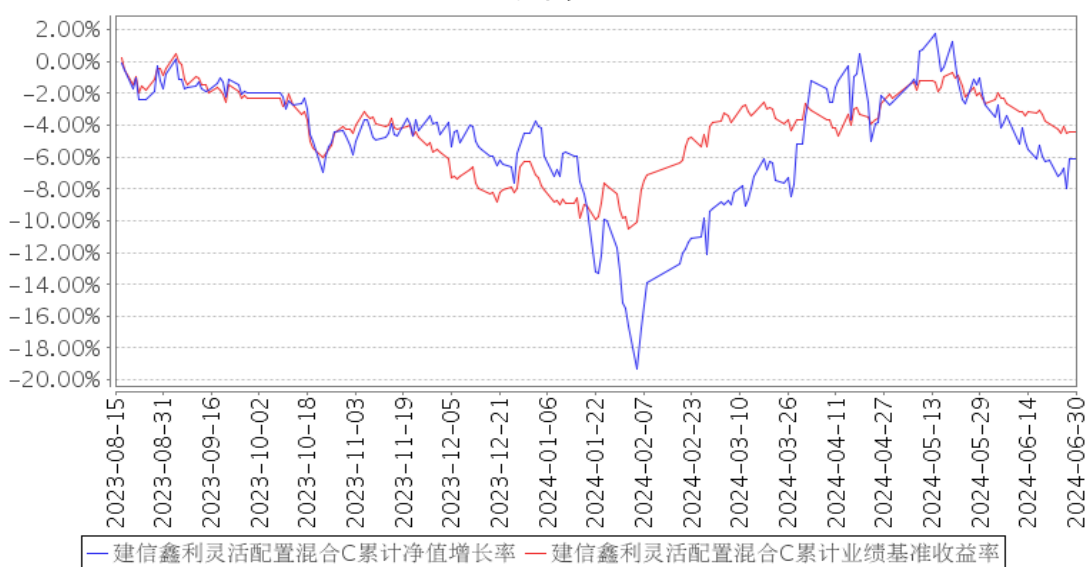
				④		
过去三个月	-0.98%	1.23%	-0.76%	0.48%	-0.22%	0.75%
过去六个月	-1.74%	1.34%	2.03%	0.58%	-3.77%	0.76%
自基金合同 生效起至今	-5.10%	1.11%	-4.39%	0.55%	-0.71%	0.56%

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率变动的比较

建信鑫利灵活配置混合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



建信鑫利灵活配置混合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		
张湘龙	本基金的基金经理	2023 年 5 月 19 日	-	8	张湘龙先生，硕士。2015 年 7 月毕业于北京大学经济专业，同年 7 月加入建信基金，历任研究部助理研究员、初级研究员、行业研究员、高级行业研究员兼基金经理助理、基金经理等职务。2021 年 2 月 1 日至 2023 年 5 月 19 日任建信新能源行业股票型证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 10 日起任建信智能汽车股票型证券投资基金的基金经理；2023 年 5 月 19 日起任建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2023 年 11 月 10 日起任建信智能生活混合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《建信鑫利灵活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 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

2024 年二季度，国内 A 股市场经历了先扬后抑，反映了宏观层面相对较弱的预期，等待后续库存周期底部回升及相关政策效果；海外，美国经济数据仍具韧性，关注后续降息节奏；从二季度各板块表现来看，红利占优的结构继续强化。

本产品重点关注供需格局较好且进入复苏期的成熟赛道，目前主要配置方向集中于供给约束较强的上游环节，包括有色及化工相关的资源品、海工船舶、油气及相关服务设备等。

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-0.89%，波动率 1.24%，业绩比较基准收益率-0.76%，波动率 0.48%。本报告期本基金 C 净值增长率-0.98%，波动率 1.23%，业绩比较基准收益率-0.76%，波动率 0.48%。

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	165,306,060.84	81.69
	其中：股票	165,306,060.84	81.69
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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	36,937,171.22	18.25
8	其他资产	119,055.03	0.06
9	合计	202,362,287.09	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	33,773,580.00	17.01
C	制造业	119,008,779.84	59.93
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	1,877,500.00	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	4,123,635.00	2.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	6,312,650.00	3.18
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	209,916.00	0.11
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	165,306,060.84	83.25

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

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	000338	潍柴动力	744,000	12,082,560.00	6.08
2	601899	紫金矿业	647,600	11,378,332.00	5.73
3	600150	中国船舶	279,100	11,362,161.00	5.72
4	603727	博迈科	843,300	11,097,828.00	5.59

5	600096	云天化	528,500	10,263,470.00	5.17
6	002353	杰瑞股份	280,747	9,848,604.76	4.96
7	000039	中集集团	1,052,000	9,741,520.00	4.91
8	601989	中国重工	1,354,600	6,678,178.00	3.36
9	600031	三一重工	390,500	6,443,250.00	3.24
10	601077	渝农商行	1,257,500	6,312,650.00	3.18

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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，中国船舶重工股份有限公司（601989）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》（证监立案字 0142023015 号），因公司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，中国证监会决定对公司立案。2023 年 12 月 29 日，中国船舶重工股份有限公司收到中国证监会北京监管局下发的《行政处罚决定书》（2023）15 号，因中国船舶重工股份有限公司 2018 年、2019 年、2020 年年度报告存在错报，上述行为违反了 2005 年《证券法》第六十三条及《证券法》第七十八条第二款的规定，构成 2005 年《证券法》第一百九十三条第一款、《证券法》第一百九十七条第二款所述的违法行为，故对中国船舶重工股份有限公司给予警告，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	108,822.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,232.82
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	119,055.03

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

项目	建信鑫利灵活配置混合 A	建信鑫利灵活配置混合 C
报告期期初基金份额总额	98,636,424.54	22,655.40
报告期期间基金总申购份额	1,234,221.48	89,218.56
减：报告期期间基金总赎回份额	2,963,190.10	76,886.25
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	96,907,455.92	34,987.71

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	1,748,024.34
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	1,748,024.34
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.80

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利灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信鑫利灵活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

2024 年 7 月 18 日