

建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资  
基金（LOF）  
2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 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 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	建信丰裕多策略混合（LOF）
场内简称	建信丰裕 LOF
基金主代码	165317
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2018 年 2 月 27 日
报告期末基金份额总额	20,640,412.78 份
投资目标	本基金主要在对公司股票投资价值的长期跟踪和深入分析的基础上，利用多策略挖掘和把握国内经济结构调整和升级的大背景下的投资机会，力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、类别资产配置策略 本基金将按照风险收益配比原则，实行动态的资产配置。2、股票投资策略 基金管理人通过“自上而下”和“自下而上”相结合的投资思路和定性分析与定量分析相佐证的分析方法，审慎制定投资方案。本基金主要采用多策略，包括 （1）股东增持与回购策略 本基金通过定性和定量方法对股权变动可能带来的影响进行模拟分析，挑选具有绝对或相对估值吸引力的公司股票，再通过分析和评估股权变化，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。（2）超预期业绩预告策略 本基金将通过筛选与分析业绩变化情况，自下而上评估，结合公司基本面情况，择优选取成长性好，安全边际高的公司进行投资。（3）资产重组，包括重组、注入与并购策略 本基金在市场上收集公开的信息，对影响中的公司进行分析与估值，挑选具有吸引力的公司股票。（4）定增策略 基金管理人立足于上市公司的定增行为对上市公司估值重构、盈利提升的影响、上市公司市值管理需要、市场情绪特征、宏观经济环境等多方面的因素综合判断，把握定增事

	件的二级市场联动效应，审慎制定参与二级市场投资交易的投资方案。（5）高分红及高转送策略 本基金将通过筛选、分析和评估高分红，高转送股票；结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。（6）股权激励策略 本基金将对采用股权激励的公司进行调研，综合分析公司基本面、预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。（7）其他 其他包括但不限于公司发布对预期业绩及行业造成极大影响的重要产品或重大合同公告；有影响上下游公司的重大事项发生；公司遭遇重大危机；管理层发生重大变更等。此类事件会对公司的运营造成深远的影响，继而影响其市场估值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率（全价）×50%。
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低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。
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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-3,489,278.74
2. 本期利润	-1,124,439.89
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0536
4. 期末基金资产净值	29,849,034.06
5. 期末基金份额净值	1.4461

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

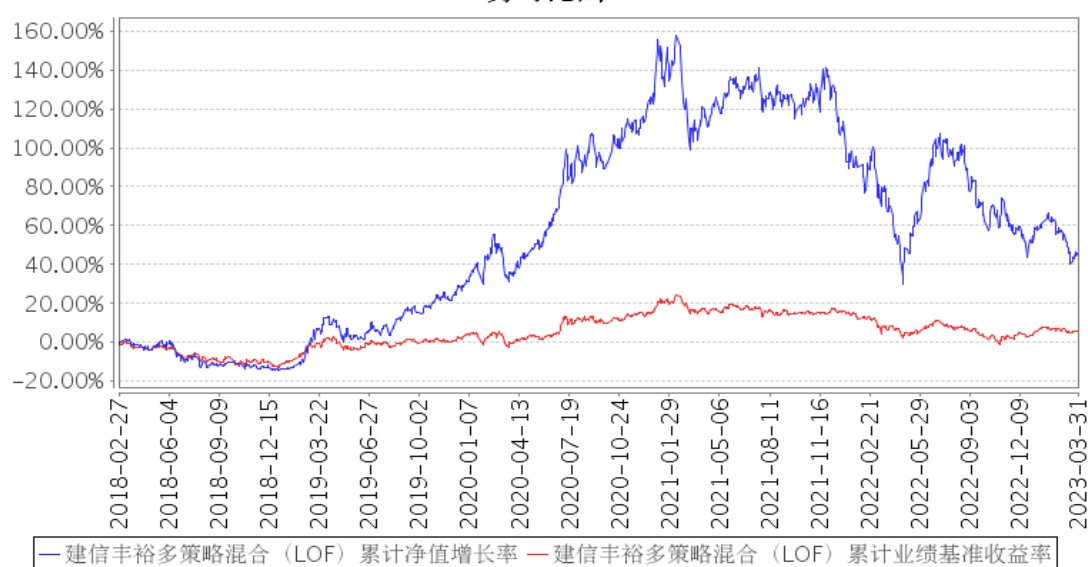
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.93%	1.27%	2.49%	0.43%	-6.42%	0.84%
过去六个月	-10.11%	1.51%	3.21%	0.54%	-13.32%	0.97%

过去一年	-13.84%	1.88%	-1.31%	0.57%	-12.53%	1.31%
过去三年	7.56%	1.80%	6.77%	0.60%	0.79%	1.20%
过去五年	47.89%	1.60%	8.70%	0.64%	39.19%	0.96%
自基金合同 生效起至今	45.64%	1.58%	6.10%	0.63%	39.54%	0.95%

### 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

建信丰裕多策略混合（LOF）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		
何坤华	本基金的基金经理	2021年10月20日	-	12	何坤华先生，硕士。2010年5月加入建信基金管理公司，历任助理研究员、初级研究员、研究员、研究主管、基金经理等职务。2015年4月17日至2017年6月30日任建信稳健回报灵活配置混合型证

					券投资基金的基金经理；2015 年 6 月 23 日起任建信互联网+产业升级股票型证券投资基金的基金经理；2018 年 1 月 10 日至 2019 年 6 月 13 日担任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 7 月 17 日起任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2021 年 10 月 20 日起任建信丰裕多策略灵活配置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《建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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

2023 年 1 季度，受美联储加息预期变化、欧美银行风险事件扰动等因素影响，全球权益资产

普涨，且呈现海外强于国内的格局，上证指数上涨约 6%处于中游水平。债券市场方面，美债利率冲高回落，国债利率窄幅震荡，中美利差倒挂幅度有所收窄，人民币兑美元小幅升值，整体呈现宽幅震荡走势。

从 A 股内部来看，国内的数字中国政策与国外的 ChatGPT 持续发酵，共振引领 TMT 板块强势反弹，AI 相关板块的成交量占比一度超 40%，计算机、传媒季度涨幅均超 30%。此外，国企改革板块和中国特色估值体系逻辑相关个股表现较好。

具体来看，2023 年 1 季度上证综指上涨 5.94%、深证成指上涨 6.45%、沪深 300 指数上涨 4.63%、中小 100 指数上涨 5.89%、中证 500 指数上涨 8.11%，创业板指上涨 2.25%、万得全 A 上涨 6.47%，总体来看中盘股的表现好于创业板股票。行业方面，TMT 领涨，其中计算机上涨 38.69%、传媒上涨 34.22%、通信上涨 22.88%、电子上涨 16.88%。跌幅较大的板块则主要集中在经济相关板块：其中房地产下跌 6.21%、消费者服务下跌 5.29%、银行下跌 2.25%。此前机构重仓的电力设备与新能源也下跌 0.18%。

本基金在报告期内按照基金合同要求保持在 90%的仓位水平，运作重点将放在精选全年业绩超预期的行业和个股上。行业配置方面本基金将继续重点布局新能源、高端制造、硬科技等中长期前景良好的板块中的优质个股，尽力为持有人创造超额回报。

#### 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-3.93%，波动率 1.27%，业绩比较基准收益率 2.49%，波动率 0.43%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，自 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 03 月 31 日，本基金基金资产净值低于五千万元超过连续 20 个工作日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》（2014 年 8 月 8 日生效）第四十一条的要求，现将该情况在本次报告中予以披露。

## § 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	26,208,299.04	87.32
	其中：股票	26,208,299.04	87.32
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	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,788,292.06	12.62
8	其他资产	16,665.24	0.06
9	合计	30,013,256.34	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	-	-
C	制造业	24,793,955.74	83.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,433.30	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	-	-
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	868,530.00	2.91
N	水利、环境和公共设施管理业	542,380.00	1.82
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	26,208,299.04	87.80

### 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	300316	晶盛机电	29,700	1,939,113.00	6.50
2	300750	宁德时代	4,700	1,908,435.00	6.39
3	603688	石英股份	14,500	1,790,460.00	6.00
4	002475	立讯精密	52,500	1,591,275.00	5.33
5	603799	华友钴业	28,380	1,560,900.00	5.23
6	002531	天顺风能	96,600	1,425,816.00	4.78
7	603218	日月股份	52,500	1,167,600.00	3.91
8	600549	厦门钨业	53,700	1,094,406.00	3.67
9	601890	亚星锚链	115,700	1,091,051.00	3.66
10	300443	金雷股份	22,200	978,576.00	3.28

#### 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	6,309.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,355.74
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	16,665.24

### 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	21,807,834.54
报告期期间基金总申购份额	1,116,368.06
减：报告期期间基金总赎回份额	2,283,789.82
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	20,640,412.78

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丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 2、《建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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住所。

## 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

2023 年 4 月 21 日