

建信周盈安心理财债券型证券投资基金

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 | 建信周盈安心理财债券 | |
| 基金主代码 | 530030 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 12 月 31 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 54,001,244.09 份 | |
| 投资目标 | 在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报，并力争实现基金资产的长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金通过积极主动的组合管理，充分运用各种短期投资工具，力争为持有人创造低风险基础上的投资收益。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 127 天。 | |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款利率（税前） | |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券基金，长期风险收益水平低于股票基金、混合基金，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 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 建信周盈安心理财债券 A | 建信周盈安心理财债券 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 530030 | 531030 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 51,122,875.08 份 | 2,878,369.01 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） | |
|-----------------|---------------------------------------|--------------|
| | 建信周盈安心理财债券 A | 建信周盈安心理财债券 B |
| 1. 本期已实现收益 | 231,823.11 | 15,194.71 |
| 2. 本期利润 | 194,695.29 | 13,132.53 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0038 | 0.0046 |
| 4. 期末基金资产净值 | 53,224,321.25 | 3,023,263.49 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0411 | 1.0503 |

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

建信周盈安心理财债券 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 | 0.37% | 0.01% | 0.35% | 0.00% | 0.02% | 0.01% |
| 过去六个月 | 0.52% | 0.01% | 0.69% | 0.00% | -0.17% | 0.01% |
| 过去一年 | 1.25% | 0.01% | 1.38% | 0.00% | -0.13% | 0.01% |
| 过去三年 | 4.06% | 0.01% | 4.19% | 0.00% | -0.13% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.11% | 0.01% | 4.20% | 0.00% | -0.09% | 0.01% |

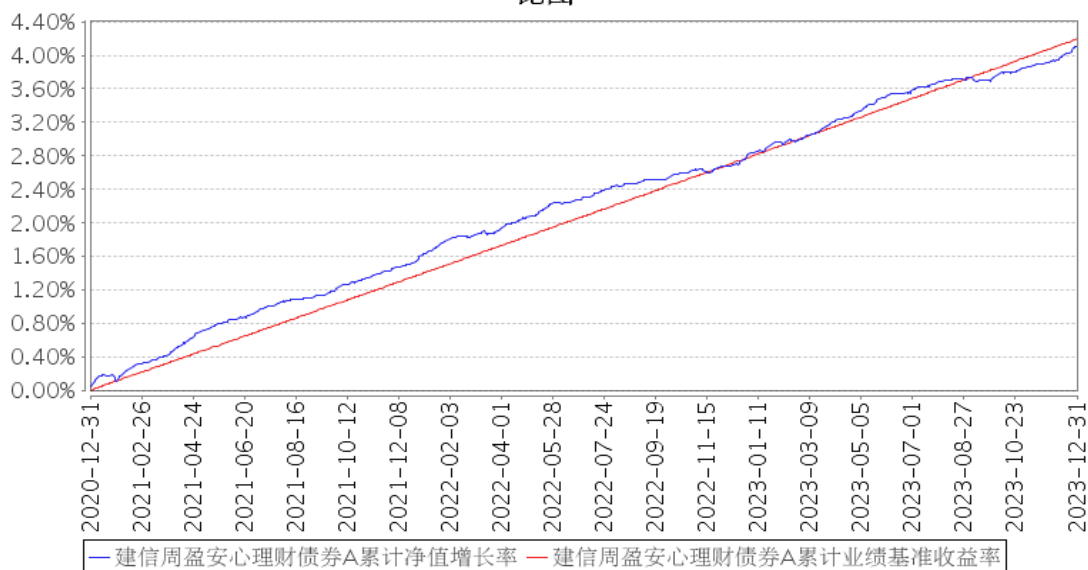
建信周盈安心理财债券 B

| 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 | 0.43% | 0.01% | 0.35% | 0.00% | 0.08% | 0.01% |
| 过去六个月 | 0.66% | 0.01% | 0.69% | 0.00% | -0.03% | 0.01% |
| 过去一年 | 1.55% | 0.01% | 1.38% | 0.00% | 0.17% | 0.01% |

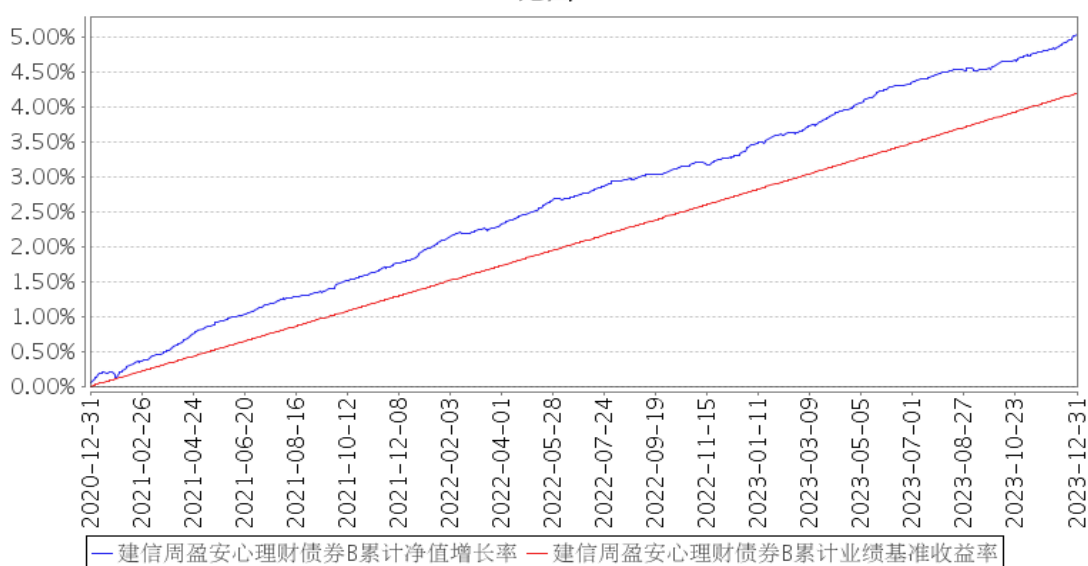
| | | | | | | |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去三年 | 4.98% | 0.01% | 4.19% | 0.00% | 0.79% | 0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | 5.03% | 0.01% | 4.20% | 0.00% | 0.83% | 0.01% |

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

建信周盈安心理财债券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



建信周盈安心理财债券B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 | | |
| 先轺宇 | 固定收益投资部总经理助理，本基金的基金经理 | 2018年3月26日 | - | 11 | 先轺宇先生，固定收益投资部总经理助理，硕士。曾任中国建设银行金融市场部业务经理。2016年7月加入我公司，历任固定收益投资部基金经理助理、基金经理、总经理助理兼基金经理。2017年7月7日起任建信现金增利货币市场基金和建信现金添益交易型货币市场基金的基金经理；2018年3月26日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金的基金经理；2019年1月25日起任建信天添益货币市场基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金的基金经理；2020年12月18日起任建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2022年10月18日起任建信中证同业存单AAA指数7天持有期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《建信周盈安心理财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，四季度经济延续复苏态势，但动能有所放缓。从制造业采购经理指数（PMI）上看，PMI 指数在 23 年 10-12 月分别录得 49.5%，49.4% 和 49.0%，连续 3 月绝对值回到荣枯线之下。从需求端上看，固定资产投资增速继续回落，具体分项上看，制造业累计投资增速小幅回升，基础设施累计投资增速继续下滑，房地产累计投资增速跌幅持续走扩。消费增速继续回升，1-11 月社会消费品零售总额同比增长 7.2%（高于前三季度 0.4 个百分点）；进出口方面，1-11 月货物进出口总额美元计价同比下降 5.6%，其中出口同比下降 5.2%，进口同比下降 6.0%，总体降幅相比前三季度收窄。从生产端上看，四季度生产供给稳步回升，1-11 月全国规模以上工业增加值同比增长 4.3%，高于 23 年前三季度增速 0.3 个百分点。总体看，23 年四季度经济呈现稳中有升态势，但复苏动能有所放缓。

通胀方面，23 年四季度通胀有所回落，其中居民消费价格（CPI）单月同比重新回落至负区间，工业生产者出厂价格（PPI）单月同比降幅有所扩大。从消费者价格指数上看，1-11 月份居民消费价格 CPI 同比低于 23 年前三季度，收于 0.3%，分月看 10、11 月份全国居民消费价格同比分别下降 0.2% 和下降 0.5%，受食品、能源价格波动下行等因素影响较大。从工业品价格指数上看，1-11 月全国工业生产者出厂价格相比 23 年前三季度持平，收于 -3.1%，其中 10、11 月当月 PPI 同比分别为 -2.6% 和 -3.0%，主要受到国际油价回落影响以及部分工业品市场需求偏弱所致。

资金面和货币政策层面，23 年四季度货币政策整体中性偏宽松，主要通过超额续作中期借贷便利（MLF）的形式补充中长期流动性。资金利率中枢来看，7 天质押回购利率（R007）10 月下旬到 11 月有一定走高，年末有所回落保持稳定。从人民币汇率上看，四季度人民币汇率总体偏升值，12 月末人民币兑美元即期汇率收于 7.0920，较 23 年三季度末升值 2.85%。

债券市场方面，四季度债券收益率前高后低，收益率震荡下行。整体看，四季度末 1 年期国开债和 1 年期国债全季度分别下行 6BP 和 9BP 至 2.20% 和 2.08%，1 年期 AAA 中短期票据收益率下行 3BP 到 2.52%，1 年期 AAA 商业银行同业存单到期收益率下行 4BP 到 2.40%。

报告期内，本基金对同业存单和信用债投资继续保持审慎，仓位结构上继续以利率债和短期逆回购为主。考虑到四季度短期资金利率波动加大，本基金始终将杠杆水平控制在较低水平，并适当参与波段交易进行收益增厚。

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 0.37%，波动率 0.01%，业绩比较基准收益率 0.35%，波动率 0.00%。本报告期本基金 B 净值增长率 0.43%，波动率 0.01%，业绩比较基准收益率 0.35%，波动率 0.00%。

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 | 51,206,107.37 | 74.19 |
| | 其中：债券 | 51,206,107.37 | 74.19 |
| | 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 | 17,003,226.98 | 24.63 |
| | 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 | 793,915.14 | 1.15 |
| 8 | 其他资产 | 17,439.90 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 69,020,689.39 | 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 | 51,206,107.37 | 91.04 |
| | 其中：政策性金融债 | 51,206,107.37 | 91.04 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 51,206,107.37 | 91.04 |

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 | 230401 | 23 农发 01 | 200,000 | 20,416,728.77 | 36.30 |
| 2 | 190404 | 19 农发 04 | 100,000 | 10,295,811.48 | 18.30 |
| 3 | 210202 | 21 国开 02 | 100,000 | 10,294,284.93 | 18.30 |
| 4 | 092218001 | 22 农发清发 01 | 100,000 | 10,199,282.19 | 18.13 |

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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 17,439.90 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 17,439.90 |

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 | 建信周盈安心理财债券 A | 建信周盈安心理财债券 B |
|---------------------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 52,510,135.92 | 2,878,369.01 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,255,392.84 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,642,653.68 | - |
| 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 | 51,122,875.08 | 2,878,369.01 |

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周盈安心理财债券型证券投资基金设立的文件；

- 2、《建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信周盈安心理财债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信周盈安心理财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 1 月 19 日