

建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资
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：上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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	建信兴晟优选一年持有混合
基金主代码	015521
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 9 月 27 日
报告期末基金份额总额	213,531,642.85 份
投资目标	本基金将积极发挥选股优势，在严格控制风险的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>（1）行业配置策略 （2）个股选择策略 （3）港股投资策略</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。</p> <p>（四）股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合</p>

	<p>约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。</p> <p>（五）国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与国债期货的投资。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。本基金构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，严控风险，最大限度保证基金资产安全。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。</p> <p>（六）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>（七）股票期权投资策略</p> <p>基金管理人在进行股票期权投资前将建立股票期权投资决策小组，负责股票期权投资管理的相关事项。本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。</p> <p>（八）存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据投资目标，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>（九）融资策略</p> <p>为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%</p>
风险收益特征	<p>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</p>

	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	上海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信兴晟优选一年持有混合 A	建信兴晟优选一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	015521	015522
报告期末下属分级基金的份额总额	176,676,032.78 份	36,855,610.07 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）	
	建信兴晟优选一年持有混合 A	建信兴晟优选一年持有混合 C
1. 本期已实现收益	-27,885,964.78	-5,881,144.17
2. 本期利润	-14,945,123.63	-3,124,061.11
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0780	-0.0776
4. 期末基金资产净值	135,974,547.71	28,220,912.04
5. 期末基金份额净值	0.7696	0.7657

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

建信兴晟优选一年持有混合 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	-9.08%	0.86%	-4.50%	0.57%	-4.58%	0.29%
过去六个月	-15.22%	0.96%	-7.32%	0.61%	-7.90%	0.35%
过去一年	-27.78%	0.95%	-7.39%	0.60%	-20.39%	0.35%
自基金合同	-23.04%	1.07%	-5.99%	0.69%	-17.05%	0.38%

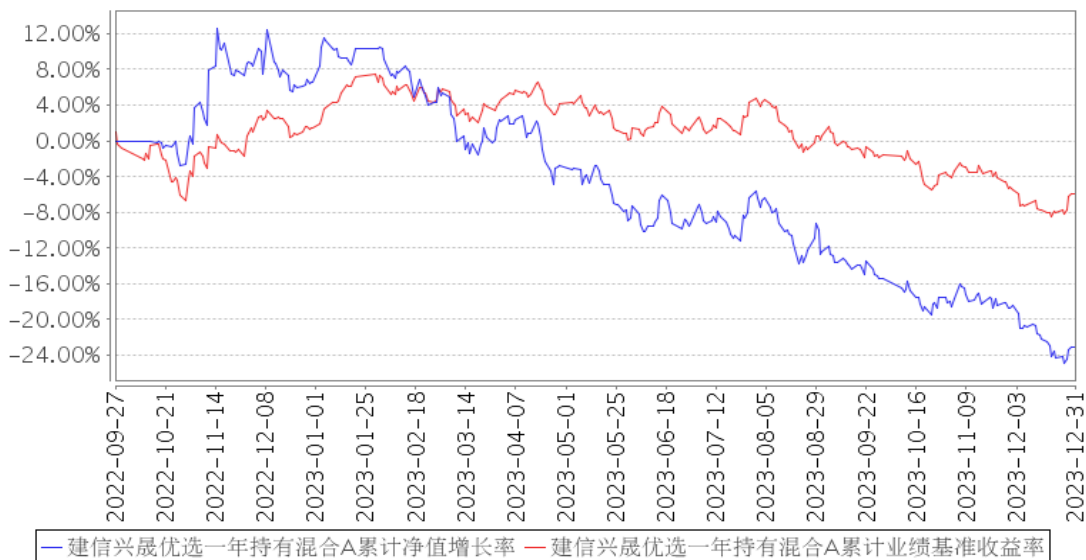
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

建信兴晟优选一年持有混合 C

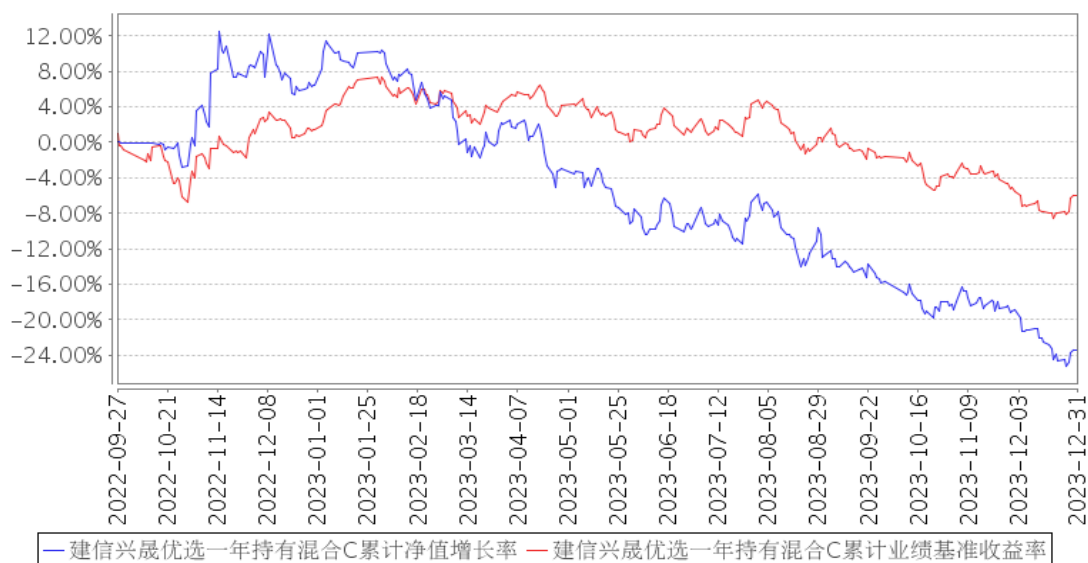
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.17%	0.86%	-4.50%	0.57%	-4.67%	0.29%
过去六个月	-15.40%	0.96%	-7.32%	0.61%	-8.08%	0.35%
过去一年	-28.07%	0.95%	-7.39%	0.60%	-20.68%	0.35%
自基金合同生效起至今	-23.43%	1.07%	-5.99%	0.69%	-17.44%	0.38%

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

建信兴晟优选一年持有混合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



建信兴晟优选一年持有混合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：本基金基金合同于 2022 年 9 月 27 日生效，截至报告期末建仓结束未满一年。本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

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		
孙晟	本基金的基金经理	2022年9月27日	-	12	孙晟先生，硕士。曾任华夏基金管理公司研究员。2013年6月加入建信基金，历任研究员、研究主管、基金经理等职务。2016年3月30日至2018年9月12日任建信健康民生混合型证券投资基金的基金经理；2017年3月8日起任建信中国制造2025股票型证券投资基金的基金经理；2020年7月17日起任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2021年4月27日起任建信高端装备股票型证券投资基金的基金经理；2021年10月20日起任建信内生动力混合型证券投资基金的基金经理；2022年9月27日起任建信兴晟优选一年持有期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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
孙晟	公募基金	5	1,607,391,090.05	2016年3月30日
	私募资产管理计划	1	36,289,361.88	2021年12月14日
	其他组合	-	-	-
	合计	6	1,643,680,451.93	-

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《建信兴晟优选一年持有期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

四季度权益市场延续下跌态势，从风格来看，红利指数和微盘股指数表现较好，大盘股表现较差，从行业来看，煤炭、电子、农业上涨，地产、建材、新能源跌幅较大。本基金配置结构不佳，导致跑输市场。

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-9.08%，波动率 0.86%，业绩比较基准收益率-4.50%，波动率

0.57%。本报告期本基金 C 净值增长率-9.17%，波动率 0.86%，业绩比较基准收益率-4.50%，波动率 0.57%。

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	119,013,893.95	72.14
	其中：股票	119,013,893.95	72.14
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	45,966,527.68	27.86
8	其他资产	-	-
9	合计	164,980,421.63	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 24,333,968.96 元，占期末基金资产净值比例为 14.82%。

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	3,986,224.00	2.43
B	采矿业	-	-
C	制造业	63,835,175.65	38.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,388,176.00	2.06
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	2,583,280.00	1.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	9,210,036.00	5.61
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,677,033.34	7.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	94,679,924.99	57.66

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	-	-
Consumer Staples 日常生活消费品	6,546,116.42	3.99
Consumer Discretionary 非日常消费品	-	-
Energy 能源	-	-
Financials 金融	-	-
Health Care 医疗保健	5,000,376.96	3.05
Industrials 工业	-	-
Real Estate 房地产	-	-
Information Technology 信息技术	12,787,475.58	7.79
Telecommunication Services 通讯服务	-	-
Utilities 公用事业	-	-
合计	24,333,968.96	14.82

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	002044	美年健康	1,942,934	11,677,033.34	7.11
2	600266	城建发展	1,902,900	9,210,036.00	5.61
3	002756	永兴材料	138,800	7,246,748.00	4.41
4	00992	联想集团	718,000	7,105,272.28	4.33
5	09985	卫龙	1,017,400	6,546,116.42	3.99
6	000625	长安汽车	358,400	6,031,872.00	3.67

7	300308	中际旭创	52,500	5,927,775.00	3.61
8	300502	新易盛	119,900	5,913,468.00	3.60
9	02382	舜宇光学科技	88,500	5,682,203.30	3.46
10	002738	中矿资源	133,800	4,992,078.00	3.04

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

无。

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	建信兴晟优选一年持有混合 A	建信兴晟优选一年持有混合 C
报告期期初基金份额总额	229,606,402.52	47,780,271.13

报告期期间基金总申购份额	223,312.75	47,700.67
减:报告期期间基金总赎回份额	53,153,682.49	10,972,361.73
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	176,676,032.78	36,855,610.07

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兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金设立的文件;
- 2、《建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》;
- 4、《建信兴晟优选一年持有期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 1 月 19 日