

建信兴润一年持有期混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 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：中信证券股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 24 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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 22 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信兴润一年持有混合
基金主代码	013021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 24 日
报告期末基金份额总额	2,760,365,199.18 份
投资目标	本基金坚持以合理的价格买入优质公司并长期持有持续获得超额回报的有效方法，重点布局竞争优势明显、管理层优秀、估值相对合理的优质公司，力求赢得长期稳定的回报。
投资策略	本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+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×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，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。本基金可投资港股通标的股票，一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信证券股份有限公司

§ 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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-42,149,928.52
2. 本期利润	124,939,422.56
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0446
4. 期末基金资产净值	1,826,941,627.54
5. 期末基金份额净值	0.6618

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。

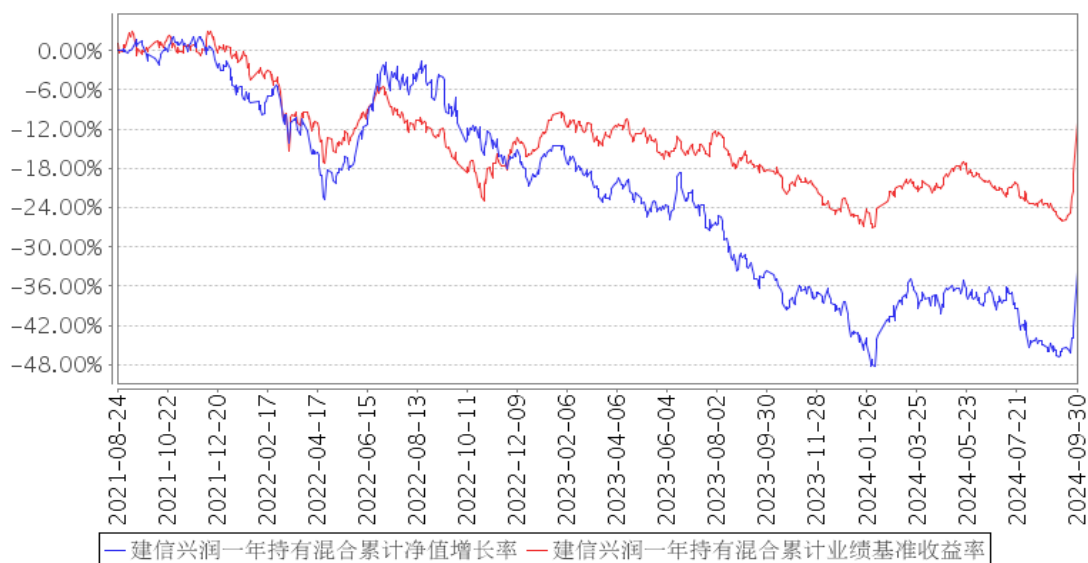
3.2 基金净值表现

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	7.54%	1.95%	13.07%	1.19%	-5.53%	0.76%
过去六个月	7.00%	1.67%	12.53%	0.95%	-5.53%	0.72%
过去一年	-0.12%	1.56%	8.96%	0.85%	-9.08%	0.71%
过去三年	-33.37%	1.28%	-11.14%	0.87%	-22.23%	0.41%
自基金合同 生效起至今	-33.82%	1.26%	-10.96%	0.87%	-22.86%	0.39%

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

建信兴润一年持有混合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		
陶灿	权益投资部执行总经理，本基金的基金经理	2021年8月24日	-	17	陶灿先生，权益投资部执行总经理，硕士。2007年7月加入本公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、权益投资部总经理助理兼研究部首席策略官等职务。2011年7月11日至2016年4月22日任建信优化配置混合型证券投资基金的基金经理；2014年5月14日起任建信改革红利股票型证券投资基金的基金经理；2016年2月23日至2021年9月29日任建信现代服务业股票型证券投资基金的基金经理；2017年2月9日至2019年1月21日任建信回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017年3月22日至2024年2月22日任建信恒久价值混合型证券投资基金的基金经理；2017年10月27日起任建信安心保本二号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于2017年11月4日起

					转型为建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金，陶灿于 2017 年 11 月 4 日起至 2023 年 6 月 28 日担任该基金的基金经理；2020 年 1 月 21 日起任建信高股息股票型证券投资基金的基金经理；2020 年 6 月 17 日起任建信新能源行业股票型证券投资基金的基金经理；2021 年 3 月 26 日至 2023 年 11 月 10 日任建信智能生活混合型证券投资基金的基金经理；2021 年 8 月 24 日起任建信兴润一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 1 月 19 日起任建信沃信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

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《建信兴润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，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 年三季度，国内 A 股市场在 9 月底的政策催化下迎来较大幅度上涨，其中沪深 300 指数上涨 16.1%，上证指数上涨 12.4%，创业板指数上涨 29.2%，科创 50 指数上涨 22.5%。从行业上看，三季度以非银金融、房地产、TMT 为代表的行业涨幅居前，而石化、煤炭、公用事业则涨幅靠后。整体上高贝塔行业体现较大弹性，在政策超预期的催化下，A 股市场季度层面迎来久违的大幅上涨。

本基金在三季度增持了非银金融、新能源等行业的配置，保持了对 TMT 行业的配置，同时减持了有色金属、煤炭、白酒等行业的配置比例。

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 7.54%，波动率 1.95%，业绩比较基准收益率 13.07%，波动率 1.19%。

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	1,727,291,232.23	93.72
	其中：股票	1,727,291,232.23	93.72
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	115,446,027.98	6.26
8	其他资产	327,376.59	0.02
9	合计	1,843,064,636.80	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 100,930,555.21 元，占期末基金资产净值比例为 5.52%。

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	313.10	0.00
B	采矿业	76,278,484.74	4.18
C	制造业	1,388,493,235.60	76.00
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	10,179.48	0.00
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	47,105,620.20	2.58
J	金融业	62,861,752.50	3.44
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	167,446.90	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	45,635,910.00	2.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,804,280.00	0.32
Q	卫生和社会工作	3,454.50	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,626,360,677.02	89.02

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	-	-
Consumer Discretionary 非日常消费品	27,931,727.83	1.53
Energy 能源	9,316,789.28	0.51
Financials 金融	-	-
Health Care 医疗保健	44,073,994.29	2.41
Industrials 工业	4,343,706.00	0.24
Real Estate 房地产	-	-
Information Technology 信息技术	-	-
Telecommunication Services 通讯服务	15,264,337.81	0.84
Utilities 公用事业	-	-

合计	100,930,555.21	5.52
----	----------------	------

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	300308	中际旭创	1,147,760	177,742,113.60	9.73
2	603606	东方电缆	1,834,400	101,203,848.00	5.54
3	300502	新易盛	752,413	97,791,117.61	5.35
4	300274	阳光电源	955,820	95,180,555.60	5.21
5	688169	石头科技	241,450	67,103,784.00	3.67
6	000960	锡业股份	4,049,725	66,010,517.50	3.61
7	002475	立讯精密	1,403,800	61,009,148.00	3.34
8	000400	许继电气	1,662,474	56,839,986.06	3.11
9	600487	亨通光电	3,190,340	53,948,649.40	2.95
10	603179	新泉股份	1,073,800	52,680,628.00	2.88

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	258,880.19
4	应收利息	-
5	应收申购款	68,496.40
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	327,376.59

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	2,826,292,300.65
报告期期间基金总申购份额	12,227,235.77
减：报告期期间基金总赎回份额	78,154,337.24
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	2,760,365,199.18

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	9,999,450.00
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	9,999,450.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.36

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润一年持有期混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信兴润一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信兴润一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信兴润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 10 月 24 日