

建信红利精选股票型发起式证券投资基金 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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展银行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 16 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 建信红利精选股票发起 |
| 基金主代码 | 020759 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2024 年 7 月 16 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 47,506,114.82 份 |
| 投资目标 | 本基金通过把握宏观经济和市场的变化趋势，精选具有明确竞争优势、行业地位稳固、长期盈利稳定、分红收益率高且估值合理的企业，在严格控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济环境、国家经济政策、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的分析，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极、主动地确定权益类资产、固定收益类资产和现金等各类资产的配置比例并进行实时动态调整。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金采取积极的股票投资策略，综合采用定量分析和定性分析相结合的研究方法，自下而上精选持续分红能力强且估值相对合理的优质上市公司，追求稳健的股息收入和长期的资本增值。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证红利指数收益率×85%+中证港股通高股息投资指数收益率×5%+中债综合全价（总值）指数收益率×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于 |

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| | 混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金的基金资产如投资于港股，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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 建信红利精选股票发起 A | 建信红利精选股票发起 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 020759 | 020760 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 37,452,076.10 份 | 10,054,038.72 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 7 月 16 日-2024 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|--------------------------------------|---------------|
| | 建信红利精选股票发起 A | 建信红利精选股票发起 C |
| 1. 本期已实现收益 | -28,240.71 | -24,069.69 |
| 2. 本期利润 | 2,827,622.50 | 801,771.59 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0831 | 0.0389 |
| 4. 期末基金资产净值 | 40,446,137.24 | 10,848,204.54 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0799 | 1.0790 |

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

建信红利精选股票发起 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 |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 7.99% | 0.71% | 6.67% | 1.24% | 1.32% | -0.53% |

建信红利精选股票发起 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

| | | 准差② | 收益率③ | 收益率标准差 ④ | | |
|----------------|-------|-------|-------|-------------|-------|--------|
| 自基金合同 生效起至今 | 7.90% | 0.71% | 6.67% | 1.24% | 1.23% | -0.53% |

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

注：本基金基金合同于 2024 年 7 月 16 日生效，截至报告期末仍处于建仓期。

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 | | |
| 薛玲 | 数量投资部副总经理，本基金的基金经理 | 2024 年 7 月 16 日 | - | 11 | 薛玲女士，数量投资部副总经理，博士。2009 年 5 月至 2010 年 1 月任中国电力科学研究院农电与配电研究所工程师，2010 年 1 月至 2013 年 4 月任路孚特（中国）科技有限公司高级软件工程师，2013 年 4 月至 2015 年 9 月任中国中金财富证券有限公司研究员、投资经理，2015 年 9 月加入我公司，历任金融工程及指数投资部基金经理助理、基金经理、部门总经理助理、部门副总经理等职务。2016 年 7 月 4 日起任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2017 年 5 月 27 日至 2018 年 4 月 25 日任建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 9 月 13 日至 2023 年 8 月 29 日任建信量化事件驱动股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 9 月 28 日起任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金（ETF）及其联接基金的基金经理；2017 年 12 月 20 日起任建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 22 日起任建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2018 年 3 月 5 日 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | 至 2021 年 5 月 31 日任建信智享添鑫定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 10 月 25 日起任建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；2018 年 12 月 13 日至 2021 年 8 月 9 日任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 12 月 15 日至 2021 年 12 月 14 日任建信瑞丰添利混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 9 月 21 日起任建信恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理；2023 年 1 月 5 日至 2024 年 1 月 29 日任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2024 年 1 月 29 日起任建信沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理；2024 年 6 月 27 日起任建信双债增强债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 7 月 16 日起任建信红利精选股票型发起式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《建信红利精选股票型发起式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

股票市场方面，9 月末伴随着利好政策的密集发布，市场参与主体的信心以及宏观经济预期得到显著改善，短期内市场整体呈现快速上涨的走势，代表性宽基指数今年以来收益迅速回正。本基金在建仓初期保持了相对较低的权益仓位，9 月下旬以来权益仓位逐步提升。

报告期内，本基金在股票组合的配置上以量化分析研究为基础，结合宏观经济走势和对市场风格的判断，通过多因子的方式建立选股模型，在精选红利持仓时，不以静态高股息率为唯一目标，关注预期股息水平、关注企业质量。本基金将继续坚持选取符合红利特征、具备长期投资价值的投资组合，在多变的市场环境下不断优化收益获取能力。

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 7.99%，波动率 0.71%，业绩比较基准收益率 6.67%，波动率 1.24%。本报告期本基金 C 净值增长率 7.90%，波动率 0.71%，业绩比较基准收益率 6.67%，波动率 1.24%。

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 | 41,632,376.10 | 75.59 |
| | 其中：股票 | 41,632,376.10 | 75.59 |
| 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 | 5,004,894.56 | 9.09 |
| | 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 | 7,695,763.05 | 13.97 |
| 8 | 其他资产 | 742,091.84 | 1.35 |
| 9 | 合计 | 55,075,125.55 | 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 6,989,751.72 元，占期末基金资产净值比例为 13.63%。

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 | 537,932.00 | 1.05 |
| B | 采矿业 | 5,497,764.00 | 10.72 |
| C | 制造业 | 14,128,985.72 | 27.54 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 155,930.00 | 0.30 |
| E | 建筑业 | 171,804.00 | 0.33 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 851,894.00 | 1.66 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 819,883.00 | 1.60 |
| J | 金融业 | 8,798,401.00 | 17.15 |
| K | 房地产业 | 225,012.00 | 0.44 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,007,175.66 | 1.96 |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,447,843.00 | 4.77 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 34,642,624.38 | 67.54 |

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 | 117,196.62 | 0.23 |
| Consumer Staples 日常生活消费品 | - | - |
| Consumer Discretionary 非日常消费品 | - | - |
| Energy 能源 | 2,412,035.73 | 4.70 |
| Financials 金融 | 1,929,830.60 | 3.76 |

| | | |
|------------------------------------|--------------|-------|
| Health Care 医疗保健 | - | - |
| Industrials 工业 | 796,560.13 | 1.55 |
| Real Estate 房地产 | - | - |
| Information Technology 信息技术 | - | - |
| Telecommunication Services 通讯服务 | 1,322,263.11 | 2.58 |
| Utilities 公用事业 | 411,865.53 | 0.80 |
| 合计 | 6,989,751.72 | 13.63 |

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 | 601088 | 中国神华 | 28,900 | 1,260,040.00 | 2.46 |
| 1 | 01088 | 中国神华 | 16,000 | 505,723.83 | 0.99 |
| 2 | 601225 | 陕西煤业 | 45,300 | 1,249,374.00 | 2.44 |
| 3 | 000651 | 格力电器 | 24,800 | 1,188,912.00 | 2.32 |
| 4 | 000830 | 鲁西化工 | 94,400 | 1,180,944.00 | 2.30 |
| 5 | 600153 | 建发股份 | 98,646 | 1,007,175.66 | 1.96 |
| 6 | 00386 | 中国石油化工股份 | 116,000 | 506,300.97 | 0.99 |
| 6 | 600028 | 中国石化 | 70,800 | 492,768.00 | 0.96 |
| 7 | 600295 | 鄂尔多斯 | 96,536 | 991,424.72 | 1.93 |
| 8 | 601077 | 渝农商行 | 182,100 | 990,624.00 | 1.93 |
| 9 | 600016 | 民生银行 | 243,900 | 980,478.00 | 1.91 |
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 37,400 | 977,636.00 | 1.91 |

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，鲁西化工集团股份有限公司（000830）于 2024 年 7 月 5 日发布公告称鲁西化工集团股份有限公司（以下简称“公司”）及全资子公司聊城鲁西双氧水新材料科技有限公司（以下简称“双氧水公司”）于近日收到聊城市应急管理局下发的《行政处罚决定书》（（鲁聊）应急罚〔2024〕SG1 号、SG2 号）。依据 2024 年 4 月 19 日，山东省人民政府发布的关于《聊城鲁西双氧水新材料科技有限公司“5·1”重大爆炸着火事故调查报告》的批复（鲁政字〔2024〕52 号）认定，双氧水公司“5·1”重大爆炸着火事故是一起因对高浓度双氧水安全风险辨识不清，管控不力，违章操作，现场人员聚集造成的重大生产安全责任事故。依据《中华人民共和国安全生产法》《山东省安全生产条例》等相关条款规定，分别给予公司及双氧水公司 208 万元、200 万元的行政处罚。

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 | 37,610.56 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 7,111.75 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 697,369.53 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 742,091.84 |

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 | 建信红利精选股票发起 A | 建信红利精选股票发起 C |
|------------------------------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日(2024年7月16日)基金份额总额 | 37,415,954.95 | 28,504,053.55 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 8,436,402.46 | 196,639.49 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 8,400,281.31 | 18,646,654.32 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 37,452,076.10 | 10,054,038.72 |

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

| | |
|-------------------------------------|---------------|
| 基金合同生效日(2024 年 7 月 16 日)管理人持有的本基金份额 | 10,002,833.62 |
| 基金合同生效日起至报告期末买入/申购总份额 | - |
| 基金合同生效日起至报告期末卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,002,833.62 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 21.06 |

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,002,833.62 | 21.06 | 10,002,833.62 | 21.06 | 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | 13,148.65 | 0.03 | - | - | 3 年 |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,015,982.27 | 21.09 | 10,002,833.62 | 21.06 | 3 年 |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

单位：份

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|-------|----------------|-------------------------|------|------|------------|------|---------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比(%) |
| | | | | | | | |

| | | | | | |
|--|---|---------------------------------------|----------------|----------------|-------|
| 机构 | 1 | 2024 年 08 月 20 日 -2024 年 09 月 30 日 | -10,002,833.62 | -10,002,833.62 | 21.06 |
| 产品特有风险 | | | | | |
| 本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。 | | | | | |

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信红利精选股票型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信红利精选股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信红利精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信红利精选股票型发起式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。

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

10.3 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