

建信高端装备股票型证券投资基金 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：光大证券股份有限公司

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。

基金托管人光大证券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	建信高端装备股票
基金主代码	011506
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 4 月 27 日
报告期末基金份额总额	923,649,174.61 份
投资目标	本基金重点投资于高端装备主题相关的上市公司，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
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。 本基金在对高端装备相关行业研究的基础上，从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局多个角度综合评估各个行业的投资价值。 本基金坚持“自下而上”的个股选择策略，通过广泛选择投资标的，多维度认可标的价值，重点研究具有竞争力比较优势、未来成长空间大、持续经营能力强的上市公司，同时结合定量分析和多种价值评估方法进行多角度投资价值分析。
业绩比较基准	中证高端装备制造指数收益率×75%+中证全债指数收益率×15%+中证港股通综合指数收益率×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	光大证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信高端装备股票 A	建信高端装备股票 C
下属分级基金的交易代码	011506	011507
报告期末下属分级基金的份额总额	614,807,522.38 份	308,841,652.23 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）	
	建信高端装备股票 A	建信高端装备股票 C
1. 本期已实现收益	-10,958,414.10	-5,751,987.53
2. 本期利润	-13,770,634.77	-6,512,921.09
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0223	-0.0232
4. 期末基金资产净值	656,135,312.95	326,110,288.53
5. 期末基金份额净值	1.0672	1.0559

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

建信高端装备股票 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	-2.02%	1.10%	-5.41%	0.92%	3.39%	0.18%
过去六个月	-9.29%	1.20%	-13.87%	0.91%	4.58%	0.29%
过去一年	-6.99%	1.14%	-10.83%	0.89%	3.84%	0.25%
自基金合同	6.72%	1.56%	-20.66%	1.16%	27.38%	0.40%

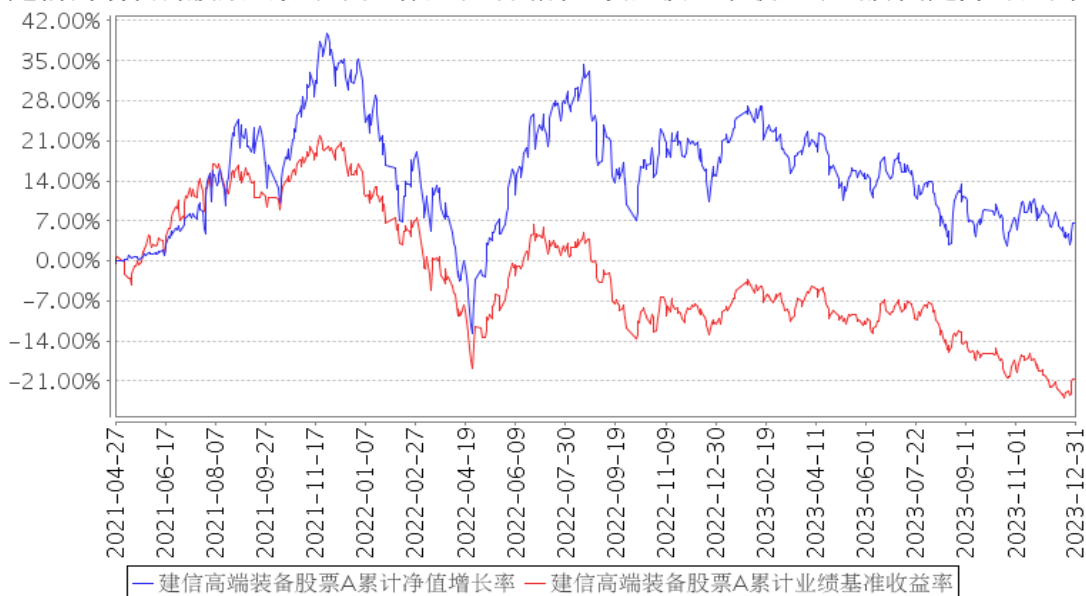
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

建信高端装备股票 C

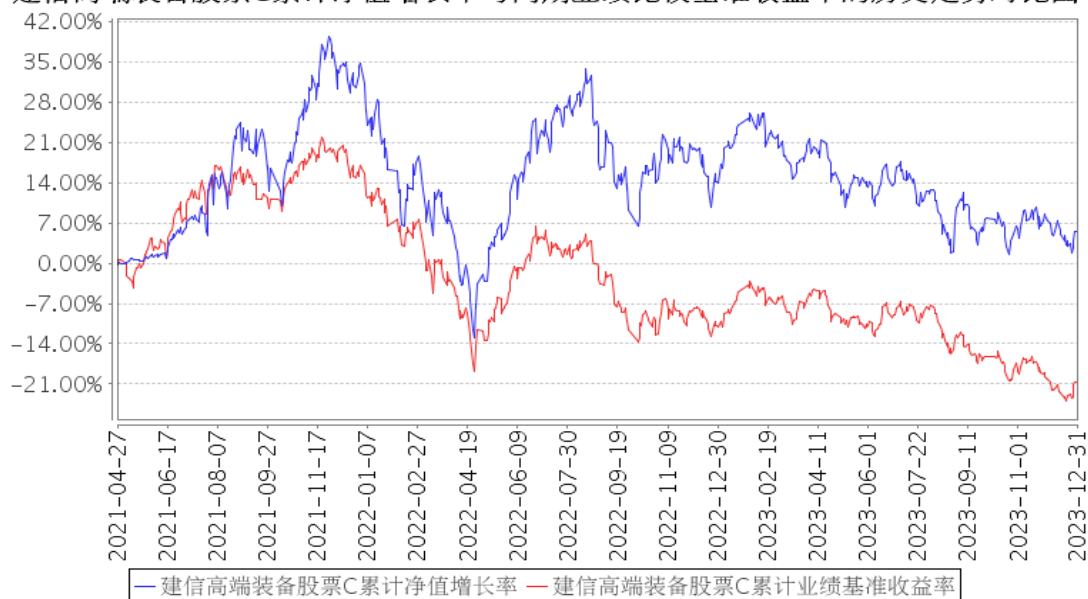
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.12%	1.10%	-5.41%	0.92%	3.29%	0.18%
过去六个月	-9.47%	1.20%	-13.87%	0.91%	4.40%	0.29%
过去一年	-7.36%	1.14%	-10.83%	0.89%	3.47%	0.25%
自基金合同生效起至今	5.59%	1.56%	-20.66%	1.16%	26.25%	0.40%

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

建信高端装备股票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



建信高端装备股票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		
黄子凌	本基金的基金经理	2021年4月27日	-	8	黄子凌先生，硕士。2015年7月毕业于清华大学机械工程专业，同年7月加入建信基金研究部，历任助理研究员、研究员、高级行业研究员、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。
孙晟	本基金的基金经理	2021年4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《建信高端装备股票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

回顾四季度，市场表现整体较为疲弱，新兴科技板块如 MR 等相对较好，新能源、半导体、军工等成长板块仍然较为疲弱。我们认为，当前新能源板块产能去化正在推进过程中，这其中具备显著竞争优势且赚取合理利润率的环节及个股将逐步迎来较好风险收益比的配置时机；对于人工智能板块，我们维持密切关注应用场景实际落地及表现情况，特别是在智能驾驶及机器人等领域的进展变化；在制造业出海领域，部分板块及公司在今年展现出较强的韧性与盈利能力，后续仍有挖掘投资机会的潜力。我们将继续在积极评估个股风险收益比的基础上寻求布局时机，力争创造长期稳健回报。

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-2.02%，波动率 1.10%，业绩比较基准收益率-5.41%，波动率 0.92%。本报告期本基金 C 净值增长率-2.12%，波动率 1.10%，业绩比较基准收益率-5.41%，波动率 0.92%。

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	877,649,570.26	89.11
	其中：股票	877,649,570.26	89.11
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	101,248,741.02	10.28
8	其他资产	6,034,345.20	0.61
9	合计	984,932,656.48	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 24,775,039.83 元，占期末基金资产净值比例为 2.52%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	814,123,956.36	82.88
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	-	-
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	29,495,244.07	3.00
J	金融业	9,255,330.00	0.94
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	852,874,530.43	86.83

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	13,400,601.38	1.36
Energy 能源	-	-
Financials 金融	-	-
Health Care 医疗保健	-	-
Industrials 工业	-	-
Real Estate 房地产	-	-
Information Technology 信息技术	11,374,438.45	1.16
Telecommunication Services 通讯服务	-	-
Utilities 公用事业	-	-

合计	24,775,039.83	2.52
----	---------------	------

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	300750	宁德时代	389,657	63,615,401.82	6.48
2	688981	中芯国际	858,971	45,542,642.42	4.64
2	00981	中芯国际	632,000	11,374,438.45	1.16
3	601799	星宇股份	383,100	50,228,241.00	5.11
4	688072	拓荆科技	169,982	39,316,836.60	4.00
5	600933	爱柯迪	1,613,015	35,389,549.10	3.60
6	688017	绿的谐波	217,710	33,418,485.00	3.40
7	300855	图南股份	1,060,295	32,020,909.00	3.26
8	002050	三花智控	1,078,500	31,707,900.00	3.23
9	002997	瑞鹤模具	898,232	29,929,090.24	3.05
10	688012	中微公司	193,216	29,677,977.60	3.02

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	2,639,895.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,394,449.58
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	6,034,345.20

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	建信高端装备股票 A	建信高端装备股票 C
报告期期初基金份额总额	609,076,036.38	277,051,959.70
报告期期间基金总申购份额	51,256,597.27	79,131,079.75
减：报告期期间基金总赎回份额	45,525,111.27	47,341,387.22
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	614,807,522.38	308,841,652.23

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高端装备股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信高端装备股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信高端装备股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信高端装备股票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