

# 建信睿怡纯债债券型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2023 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 20 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	建信睿怡纯债债券	
基金主代码	002377	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 9 月 19 日	
报告期末基金份额总额	130,188,669.06 份	
投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，深入挖掘价值被低估的标的券种。	
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，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	建信睿怡纯债债券 A	建信睿怡纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	002377	012413
报告期末下属分级基金的份额总额	11,565,748.38 份	118,622,920.68 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	建信睿怡纯债债券 A	建信睿怡纯债债券 C
1. 本期已实现收益	78,297.00	1,895,503.61
2. 本期利润	35,306.51	1,615,687.63
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0029	0.0050
4. 期末基金资产净值	12,720,205.98	130,926,941.20
5. 期末基金份额净值	1.0998	1.1037

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

建信睿怡纯债债券 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	0.28%	0.06%	0.01%	0.05%	0.27%	0.01%
过去六个月	1.47%	0.05%	0.95%	0.04%	0.52%	0.01%
过去一年	2.73%	0.05%	0.62%	0.05%	2.11%	0.00%
过去三年	9.70%	0.14%	4.54%	0.05%	5.16%	0.09%
过去五年	16.45%	0.11%	7.27%	0.06%	9.18%	0.05%
自基金合同生效起至今	16.57%	0.11%	7.43%	0.06%	9.14%	0.05%

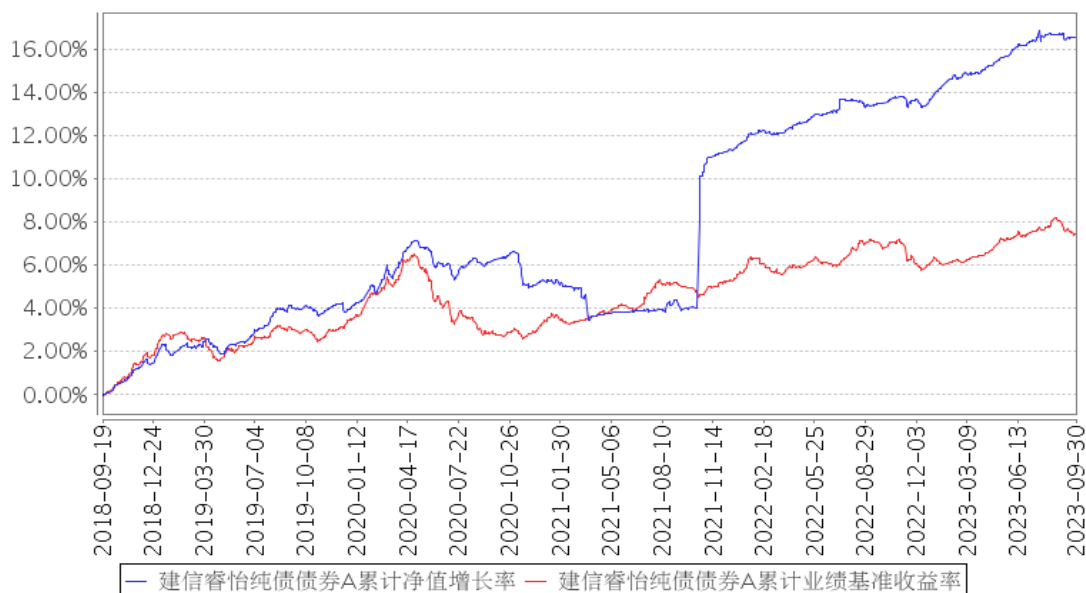
建信睿怡纯债债券 C

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	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	--------------	-----	-----

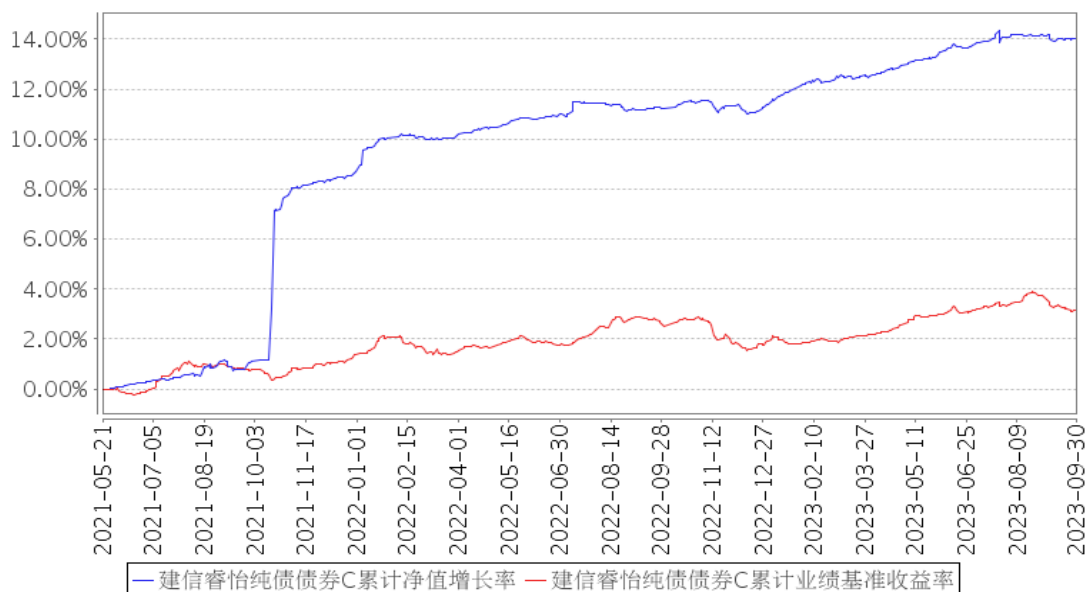
				④		
过去三个月	0.23%	0.06%	0.01%	0.05%	0.22%	0.01%
过去六个月	1.36%	0.05%	0.95%	0.04%	0.41%	0.01%
过去一年	2.51%	0.05%	0.62%	0.05%	1.89%	0.00%
自基金合同生效起至今	14.03%	0.15%	3.15%	0.05%	10.88%	0.10%

### 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

建信睿怡纯债债券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



建信睿怡纯债债券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		
闫晗	本基金的基金经理	2018年9月19日	-	10	闫晗先生，硕士。2012年10月至今历任建信基金管理公司交易员、交易主管、基金经理助理、基金经理。2017年11月3日起任建信目标收益一年期债券型证券投资基金的基金经理，该基金在2018年9月19日转型为建信睿怡纯债债券型证券投资基金，闫晗继续担任该基金的基金经理；2018年4月20日起任建信安心回报定期开放债券型基金的基金经理；2018年4月20日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，该基金自2019年4月25日转型为建信安心回报6个月定期开放债券型证券投资基金，闫晗继续担任该基金的基金经理；2019年3月25日起任建信中债1-3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理；2019年4月30日起任建信中债3-5年国开行债券指数证券投资基金的基金经理；2019年9月17日至2022年1月17日任建信中债5-10年国开行债券指数证券投资基金的基金经理；2020年3月17日起任建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2020年5月7日起任建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2020年6月15日至2023年6月16日任建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金的基金经理；2020年9月28日至2023年5月23日任建信中债1-3年农发行债券指数证券投资基金的基金经理；2021年1月27日起任建信利率债债券型证券投资基金的基金经理；2021

					年 11 月 10 日起任建信彭博巴克莱政策性银行债券 1-5 年指数证券投资基金的基金经理, 该基金在 2022 年 3 月 22 日起更名为建信彭博政策性银行债券 1-5 年指数证券投资基金, 闫晗继续担任该基金的基金经理。
吴沛文	本基金的基金经理	2022 年 1 月 20 日	-	12	吴沛文先生, 硕士。曾任中债资信评估有限责任公司评级分析师、阳光资产管理股份有限公司信用研究员。2015 年 10 月加入建信基金固定收益投资部, 历任研究员、基金经理助理、基金经理。2019 年 7 月 17 日起任建信货币市场基金的基金经理; 2020 年 5 月 20 日起任建信短债债券型证券投资基金的基金经理; 2021 年 6 月 29 日起任建信现金添利货币市场基金的基金经理; 2022 年 1 月 20 日起任建信睿怡纯债债券型证券投资基金的基金经理; 2022 年 5 月 19 日起任建信鑫享短债债券型证券投资基金的基金经理; 2022 年 12 月 29 日起任建信鑫和 30 天持有期债券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《建信睿怡纯债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，2023 年三季度经济运行整体延续恢复向好态势，9 月制造业采购经理指数（PMI）重回荣枯线之上，非制造业商务活动指数持续处于扩张区间。从需求端看，1-8 月固定资产投资保持平稳增长，随着稳增长政策逐步发力，基建投资和制造业投资韧性延续，其中高技术产业投资保持较快增长；房地产方面，保交楼背景下的房屋竣工是地产投资的主要支撑，但是新开工和施工面积仍表现低迷。总体来说，2023 年三季度随着稳增长政策的不断落地生效，带动经济逐步企稳回升。

货币政策方面，三季度央行货币政策整体稳健，货币政策传导效率不断增强，期间央行下调 7 天公开市场操作利率和 1 年期中期借贷便利（MLF）利率，并于 9 月降低金融机构存款准备金率释放长期资金，推动降低社会融资成本，提振实体经济融资需求，三季度银行间市场流动性整体保持合理充裕。

债券市场方面，三季度前期在经济基本面走弱叠加降息推动下，债券市场收益率下行，进入 8 月下旬后，随着呵护房地产的政策陆续出台叠加跨季时点回购利率价格的不断上升，债券市场收益率有所上行。整体看三季度国债期限利差有所走平，中短端国债收益率上行明显。

基金操作方面，基金经理在报告期以维持净值稳定和控制信用风险为主要目标，通过增加中短期、高票息债券维持组合静态收益和杠杆水平，同时保持了少量可转债以增厚组合收益。另外考虑到三季度债券市场收益率波动较大，基金经理及时的运用国债期货工具对风险进行了对冲，有效的规避了利率风险，降低了业绩波动。

#### 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 0.28%，波动率 0.06%，业绩比较基准收益率 0.01%，波动率 0.05%。本报告期本基金 C 净值增长率 0.23%，波动率 0.06%，业绩比较基准收益率 0.01%，波动率 0.05%。

#### 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	160,490,226.26	92.04
	其中：债券	160,490,226.26	92.04
	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	10,003,270.45	5.74
	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	3,134,548.43	1.80
8	其他资产	745,096.76	0.43
9	合计	174,373,141.90	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	9,138,617.26	6.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	41,836,270.75	29.12
	其中：政策性金融债	41,836,270.75	29.12



4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	92,103,707.43	64.12
6	中期票据	16,320,142.62	11.36
7	可转债（可交换债）	1,091,488.20	0.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	160,490,226.26	111.73

#### 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	170415	17 农发 15	200,000	21,411,174.86	14.91
2	220332	22 进出 32	200,000	20,425,095.89	14.22
3	042380281	23 镇江交通 CP003	125,000	12,639,446.72	8.80
4	012380857	23 西安高新 SCP001	100,000	10,244,626.23	7.13
5	012380834	23 涪陵交通 SCP001	100,000	10,226,857.92	7.12

#### 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

报告期内，组合通过参与国债期货主力合约的投资，进行套期保值的操作。当判断市场收益率将出现上行趋势时，建立一定比例的国债期货空头仓位，部分对冲组合的久期敞口。当判断收益率存在下行趋势时，通过建立国债期货多头仓位，拉长组合久期。三季度在债券市场收益率波动过程中，控制了净值回撤，平滑了组合收益曲线。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
T2312	T2312	-20	-20,356,000.00	-52,250.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-52,250.00
国债期货投资本期收益(元)					-743,969.96
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-52,250.00

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金以套期保值为目的,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。本基金通过构建量化分析体系,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,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。本报告期内,本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

## 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	428,797.29
2	应收证券清算款	316,299.47
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	745,096.76

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113066	平煤转债	1,091,488.20	0.76

### 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	建信睿怡纯债债券 A	建信睿怡纯债债券 C
报告期期初基金份额总额	11,720,880.68	417,229,325.09
报告期期间基金总申购份额	4,331,268.20	735,374,263.74
减：报告期期间基金总赎回份额	4,486,400.50	1,033,980,668.15
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	11,565,748.38	118,622,920.68

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	4,662,811.30
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	4,662,811.30
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	3.58

### 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睿怡纯债债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信睿怡纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信睿怡纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信睿怡纯债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

2023 年 10 月 24 日