

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:2015年10月27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2015年10月23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。

本报告中财务数据未经审计。

报告期为2015年7月29日至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金名称 建信大安全战略精选股票型证券投资基金

基金代码 000147

交易代码 000147

契约开放式

基金合同生效日 2015年7月29日

报告期末基金份额总额 242,023,069.76份

投资目标 本基金主要投资于同时关注相关的优质证券，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值和稳定回报。

投资策略 本基金结合宏观经济、政策形势等因素对各个行业及上市公司的影响以及核心股票资产的市盈率、合理估值等基金资产配置比例。本基金主要投资于国内A股全市场公开上市的优质股票，努力实现超额收益。选择投资标的，注重认可度的价值，注重研究具有竞争力且优势，未来成长空间大的上市公司的基本面。本基金债券投资将通过主动管理，分散投资风险。

业绩比较基准 95%×沪深300指数收益率+15%×中债总财富(总值)指数收益率。

风险收益特征 本基金为股票型基金，具有较高风险，预期平均收益较高，其风险预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

基金管理人 建信基金管理有限责任公司

基金托管人 中信证券股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2015年7月29日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -3,193.782,176.63

2.本期利润 -10,344,031.69

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0405

4.期末基金资产净值 233,572,211.66

5.期末基金份额净值 0.9615

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(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。  
2.所列各项基金绩效指标不包括任何已认或购入认购或交易基金的各项费用，以费用后实际收益水平要低于所列示的数值。

## 3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期基金份额净值增长率为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 -3.85% 1.07% -13.36% 2.56% 9.65% -1.52%

净值增长率标准差差额 ② - 0.04% ③ - 0.05% ④ - 0.05%

业绩比较基准 ⑤ - 10.36% ⑥ - 10.36% ⑦ - 10.36% ⑧ - 10.36%

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(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。  
2.所列各项基金绩效指标不包括任何已认或购入认购或交易基金的各项费用，以费用后实际收益水平要低于所列示的数值。

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

建信大安全战略精选股票型证券投资基金 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2015年7月29日至2015年9月30日

建信大安全战略精选股票型证券投资基金 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

2015年7月29日至2015年9