建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）

【2015】第四季度报告

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:2016年1月21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2016年1月19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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信优势动力混合(LOF)
场内简称	建信优势
基金主代码	165313
交易代码	165313
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年3月19日
报告期末基金份额总额	430,030,673.60份
投资目标	采取定量和定性相结合的方法,寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力,但是价值被低估的优势上市公司,通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险,在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产来获取超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人对经济环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析,作出投资决策。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。
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

§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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	90,170,166.31
2.本期利润	109,308,513.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.2472
4.期末基金资产净值	647,516,384.81
5.期末基金份额净值	1.506

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。

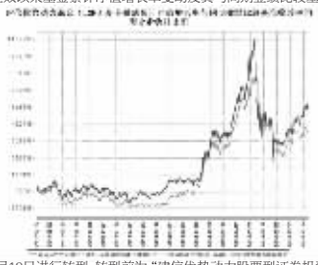
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	19.52%	1.39%	13.17%	1.25%	6.35%	0.14%

3.2.2 目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:本基金于2013年3月19日进行转型,转型前为"建信优势动力股票型证券投资基金"。本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§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		
姜锋	本基金的基金经理	2013年3月19日	-	8	硕士。2007年7月加入本公司,从事行业研究,任研究员。2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理,该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力混合型证券投资基金(LOF),姜锋继续担任该基金基金经理;2014年3月21日起任建信健康民生混合型证券投资基金基金经理;2015年4月22日起任建信环保产业股票基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年4季度市场大幅反弹,各主要指数在经历了3季度的股灾后均出现不同程度的反弹。经济方面,国内经济继续下行,美国经济一枝独秀;政策方面,美国7年来首次加息,国内继续推行宽松的货币政策,人民币汇率波动幅度加大;上市公司方面,2015年3季报业绩平淡,年度业绩展望继续平淡。

本基金4季度基于对政策、经济基本面和企业盈利的判断,结合市场的估值水平,对行业进行了均衡配置,积极参与了TMT板块的反弹。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率19.52%,波动率1.39%,业绩比较基准收益率13.17%,波动率1.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,美国经济保持波动回升态势,2016年美联储加息次数将对全球经济和资本流动产生重要影响;欧洲经济步履蹒跚;国内经济在供给侧改革的引导下有望缓慢企稳,但人民币汇率的波动和需求的疲弱仍将限制经济复苏的步伐。2016年资本市场将迎来一系列新的制度,金融品类的多样化需要研究和评估。

本基金2016年1季度在控制系统性风险的前提下将采取相对均衡的配置策略,积极寻找受益于政策放松的低估值蓝筹行业和公司;本基金将继续在医药、环保、TMT和消费四大行业中自下而上寻找业绩增速与估值相匹配的优质成长股投资。

§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	481,233,646.41	73.47
	其中:股票	481,233,646.41	73.47
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	129,724,344.08	19.80
8	其他资产	44,067,601.06	6.73
9	合计	655,025,591.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	50,340,843.42	7.77
B	采矿业	-	-
C	制造业	261,008,034.43	40.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,927,693.00	2.46
E	建筑业	26,993,467.20	4.17
F	批发和零售业	30,750,942.00	4.75
G	交通运输、仓储和邮政业	18,360,547.97	2.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,453,395.00	2.54
J	金融业	-	-
K	房地产业	18,794,769.00	2.90
L	租赁和商务服务业	25,935,314.04	4.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	16,668,640.35	2.57
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	481,233,646.41	74.32

注:以上行业分类以2015年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.3 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	000920	南方汇通	1,324,189	31,820,261.67	4.91
2	600351	亚宝药业	1,892,680	29,563,661.60	4.57
3	002308	威创股份	1,134,800	27,972,820.00	4.32
4	000705	浙江震元	1,464,800	27,479,648.00	4.24
5	002234	民和股份	1,526,469	27,445,912.62	4.24
6	601888	中国国旅	437,284	25,935,314.04	4.01
7	002630	华西能源	1,660,020	24,518,495.40	3.79
8	002236	大华股份	623,519	23,007,851.10	3.55
9	002458	益生股份	605,686	22,894,930.80	3.54
10	603001	奥康国际	668,352	22,469,994.24	3.47

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无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	655,156.34
2	应收证券清算款	43,354,732.39
3	应收股利	-
4	应收利息	56,810.84
5	应收申购款	901.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,067,601.06

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	453,200,628.47
报告期期间基金总申购份额	1,592,315.83
减:报告期期间基金总赎回份额	24,762,270.70
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	430,030,673.60

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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	3,591,235.63
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,591,235.63
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.84

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)设立的文件;

2、《建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;

3、《建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》;

4、《建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)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。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 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
2016年1月21日

建信月盈安心理财债券型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月21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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信月盈安心理财	
基金主代码	630028	
交易代码	630028	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月20日	
报告期末基金份额总额	2,771,534,669.67份	
投资目标	严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报,并力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金通过积极主动的组合管理,充分运用各种短期投资工具,力争为持有人创造低风险基础上的投资收益。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过150天。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)	
风险收益特征	本基金属于债券基金,长期风险收益水平低于股票基金、混合基金,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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
下属分级基金的交易代码	630028	631028
报告期末下属分级基金的份额总额	749,239,955.04份	2,022,294,704.63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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)	
	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
1. 本期已实现收益	5,901,763.67	13,232,056.18
2. 本期利润	5,901,763.67	13,232,056.18
3. 期末基金资产净值	749,239,955.04	2,022,294,704.63

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加入本期公允价值变动收益,由于该基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

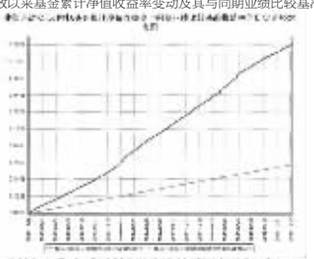
建信月盈安心理财A

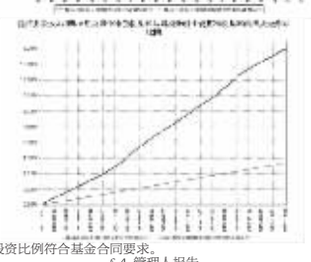
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8413%	0.0051%	0.3403%	0.0000%	0.5010%	0.0051%

建信月盈安心理财B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9151%	0.0051%	0.3403%	0.0000%	0.5748%	0.0051%

3.2.2 目基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

§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		
陈建良	固定收益投资部总经理助理,本基金的基金经理	2014年1月21日	-	8	2005年6月加入中国建设银行厦门分行,任客户经理;2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部,任债券交易员;2013年9月加入我公司,历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总监助理。2013年12月10日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信月盈安心理财基金基金经理;2014年6月17日起任建信鑫新宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币基金的基金经理。
高珊	本基金的基金经理	2012年12月20日	-	9	硕士。2006年7月至2007年6月期间在中信建投证券公司工作,任交易员。2007年6月加入建信基金管理公司,历任初级交易员、交易员。2009年7月起任建信货币市场基金的基金经理助理。2012年8月28日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年1月29日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年5月17日起任建信鑫盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年12月20日起任建信货币市场基金基金经理;2015年8月28日起任建信现金添利货币市场基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《建信月盈安心理财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》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年也是极其波动的一年,上半年希腊濒临违约和退欧扰动全球,6月份中国A股的强劲涨势戛然而止,而进入8月后美联储加息预期升温和人民币汇率波动又引发了全球性的巨震。反观中国经济在全年延续弱势,房地产投资持续下滑,出口数据连续9个月负增长,对美日欧的出口恶化。整体看,在供给侧改革叠加需求方托底的宏观经济政策取向背景下,2015年底的中国经济仅能算勉强录得平稳收官。

中国银行间债券市场四季度收益率曲线平坦化下行,10年期国债下行超过40bp,10年期国开债下行超过50bp,信用利差维持低位。临近年底,出于时护流动性的考虑,央行货币政策操作偏宽松,分别下调存款准备金0.5个百分点,下调存贷款基准利率各25bp,进一步降低了社会融资成本,减轻了企业财务压力。此外,银行间机构在经历过钱荒之后普遍加强了流动性风险管理,对年底资金需求已经提前补齐余缺,故年底货币市场波动不是很大,顺利实现了平稳跨年。

本季度,建信月盈安心理财基金维持了一贯稳健的投资风格,维持中短久期、减持了部分低评级品种的信用债,并且有效的根据申赎合理安排资金,在三季度 集中配置了大额存单,并抓住年底收益率的高点配置了逆回购和定期存款等高收益资产,收官业绩表现良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期月盈A净值收益率0.8413%,波动率0.0051%;月盈B净值收益率0.9151%,波动率0.0051%;业绩比较基准收益率0.3403%,波动率0.0000%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年一季度,宏观调控政策将继续维持汇率先行、利率维稳、财政发力的总体组合不变,制造业和房地产业依然面临产业升级以及去库存的压力,经济下行压力依然较大。人民币面临之前累计的贬值压力释放,叠加上美元进入加息周期,资金面易紧难松,虽然央行试图稳定中短期流动性预期,但在经济结构转型的大背景下,真实利率将为负值的概率不大,7天回购利率或将维持在2%-2.5%的水平,与去年大部分时间持平。10年期国债已经下行到2.80%的位置,期限利差基本没有压缩空间,而资金面的约束将使利率债下行空间受限。相对的,高等级信用债在产业结构调整阶段将愈发稀缺,与利率债的利差将持续压缩,同时等级利差加剧分化,在当前的市场情况下具备相对投资价值。

中央经济工作会议将去产能定为2016年经济的首要任务,在"供给侧"改革推动产能出清的过程中,今年信用风险事件发生的频率和规模相比2015年还可能升级,信用风险可能进一步扩大。我们将谨慎甄选标的,关注高评级信用债,规避评级较低、产能过剩行业的品种,将信用风险发生的可能性降到最低。

建信月盈安心理财基金仍将保持稳健的投资风格,以大额存单以及协议存款为主,高等级信用债投资为辅,在保证组合流动性的同时力争保证组合能够跟随市场的发展变化,为投资人获得合理的收益。

§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	固定收益投资	2,147,857,474.74	59.17
	其中:债券	2,147,857,474.74	59.17
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	667,321,240.98	18.38
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	781,949,446.28	21.54
4	其他资产	32,927,114.53	0.91
5	合计	3,630,055,276.53	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	26.11	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	857,198,284.20	30.93
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	93

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过150天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	25.23	30.93
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.99	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	15.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	48.90	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	27.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		129.79	30.93

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	170,125,254.00	6.14
	其中:政策性金融债	170,125,254.00	6.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,270,214,369.84	45.83
6	中期票据	-	-
7	同业存单	707,517,850.90	25.53
8	其他	-	-
9	合计	2,147,857,474.74	77.50
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111693389	15西安银行CD041	1,200,000	118,095,862.96	4.26
2	150202	15国开02	1,000,000	100,098,981.02	3.61
3	011599639	15龙源电力SCP009	1,000,000	100,074,776.83	3.61
4	011599854	15新能源SCP003	1,000,000	99,903,018.28	3.60
5	111681159	15中信CD159	1,000,000	98,995,878.65	3.57
6	011599561	15中煤钛SCP006	900,000	90,115,043.93	3.25
7	011599504	15三花SCP001	800,000	79,985,057.07	2.89
8	150416	15农发16	700,000	70,026,272.98	2.53
9	011599428	15首发SCP001	500,000	50,103,218.39	1.81
10	011586009	15光厚SCP009	500,000	50,064,073.16	1.81

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	23
报告期内偏离度的最高值	0.3367%
报告期内偏离度的最低值	0.1059%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2046%

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提摊益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.8.2本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3基金投资的前十名债券的发行主体本期未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。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

5.8.4 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	应收利息	23,475,004.53
4	应收申购款	9,452,110.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	32,927,114.53

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
报告期期初基金份额总额	736,224,476.51	1,162,651,068.13
报告期期间基金总申购份额	397,109,914.28	929,698,332.14
减:报告期期间基金总赎回份额	384,094,435.75	70,054,695.64
报告期期末基金份额总额	749,239,955.04	2,022,294,704.63

注:上述总申购份额含红利再投资份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金说明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信月盈安心理财债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信月盈安心理财债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信月盈安心理财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。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 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
2016年1月21日

建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:国信证券股份有限公司
报告送出日期:2016年1月21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。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信有色金属分级		
场内简称	有色金属		
基金主代码	165316		
交易代码	165316		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年8月6日		
报告期末基金份额总额	45,910,011.41份		
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。 本基金力争建信有色份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	中证申万有色金属指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	国信证券股份有限公司		
下属分级基金简称	建信有色金属	建信有色金属A	建信有色金属B
下属分级场内简称	有色金属	金属A	金属B
下属分级基金交易代码	165316	150333	150334
下属分级基金报告期末基金份额总额	12,604,255.41份	16,652,878.00份	16,652,878.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	建信有色A份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的特征;	建信有色B份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的特征。

§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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-76,811.92
2.本期利润	-207,848.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0038
4.期末基金资产净值	45,315,032.08
5.期末基金份额净值	0.9870

注:1、本