建信现金添利货币市场基金

【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: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	建信现金添利货币
基金主代码	000693
交易代码	000693
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月17日
报告期末基金份额总额	165,966,372,764.40份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取个券选择策略、利率策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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	883,776,905.44
2. 本期利润	883,776,905.44
3. 期末基金资产净值	165,966,372,764.40

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上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。

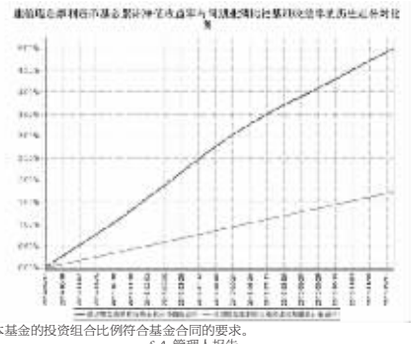
2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

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

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	0.7843%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.4440%	0.0008%

3.2.2 自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		
于猜猜	本基金的基金经理	2014年9月17日	-	7	于猜猜女士,硕士。2008年6月加入国泰人寿保险公司,任固定收益研究专员;2009年9月加入金元惠理基金管理公司(原金元比联基金管理公司),任债券研究员;2011年6月加入我公司,历任债券研究员、基金经理助理,2013年8月5日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财债券基金的基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪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。
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9月17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日起任建信嘉薪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	2015年8月25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9月17日起任建信嘉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25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,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《建信现金添利货币市场基金基金合同》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》、《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,一旦出现不同基金间时买卖同一证券时,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年第四季度,全球经济呈现分化调整。一方面,发达国家经济总体复苏态势不稳,虽然美国经济增长势头明显,但欧元区和日本经济仍未摆脱经济困境;另一方面,新兴经济体呈现明显的分化格局,在金砖国家中,中国、印度经济仍保持在6%-7%经济增速,但俄罗斯、巴西两国经济陷入衰退。

国内方面,11月份PMI为49.6%,比10月下降0.2个百分点,12月只有48.2%,较11月又下滑0.4个百分点,表明第四季度中国经济仍在加速筑底。从基本面来看,实体经济延续疲弱态势,货币政策未来仍有放松空间,大环境仍然利好债券,债市牛市基础尚在。另外,美国12月份开启了加息模式,国内资本外流压力增大,但是央行通过降准及时对冲了外汇占款减量。较低的利率中枢加上宽松的货币政策刺激了收益率曲线快速地平坦化下行,10年期国开下行超过50BP,短端信用债也下行了30BP。

综上所述,本基金在第四季度维持了一贯稳健的投资风格,维持了中性的久期和杠杆比例,并且有效的根据申赎合理安排资金和配置债券,在收益高位配置了大量优质资产,收官业绩表现良好,规模实现持续增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值收益率为0.7843%,波动率为0.0008%;业绩比较基准收益率为0.3403%,波动率为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,全球经济大概率会在深化调整中保持低增长态势。中国目前仍处在动力转换的关键期,所以2016年在保持总需求稳定增长的同时,宏观调控的重点要转向结构性改革,更加重视发挥供给政策的作用,降低企业生产运营成本,提高企业生产效率和核心竞争力,促进增长新动力加快成长,为“十三五”开局奠定良好基础。

2016年的债牛基础仍未动摇,国内经济去杠杆会导致经济增速下行,投资回报收益中枢的下沉会为收益曲线的下移腾挪出空间。但是随着国内刚兑预期的逐渐打破,债市信用风险的爆发导致各评级债券的收益率出现一定分化,因此未来会谨慎配置高等级债券,不断加强信用债的筛选。另外美联储启动加息周期,中美利差会进一步拉大,资金向海外寻求投资机会可能成为常态,即资金流出将成为我国未来一段时间国内货币环境的一大特征,因此流动性问题仍需要注意。

2016年,该基金未来仍将保持稳健的投资风格,以存款和存单为主信用债投资为辅,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	61,493,045,017.96	35.95
	其中:债券	61,493,045,017.96	35.95
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	19,086,511,672.02	11.16
	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	89,607,364,327.73	52.39
4	其他资产	859,677,061.41	0.50
5	合计	171,046,598,079.12	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	12.72	
	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	4,988,596,480.00	3.01
	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

本基金本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	99
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

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120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	24.68	3.01
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	9.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.47	-
3	60天(含)-90天	22.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	33.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	12.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	102.54	3.01

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	11,548,841,642.66	6.96
	其中:政策性金融债	10,898,900,559.02	6.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	16,499,882,255.25	9.94
6	中期票据	-	-
7	同业存单	33,444,321,120.05	20.15
8	其他	-	-
9	合计	61,493,045,017.96	37.06
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	787,183,616.78	0.47

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	150413	15农发13	39,100,000	3,908,582,516.54	2.36
2	111593037	15广州银行CD036	20,000,000	1,986,931,278.63	1.20
3	111593318	15盛京银行CD100	20,000,000	1,985,325,990.84	1.20
4	111591876	15重庆银行CD016	18,000,000	1,785,095,615.36	1.08
5	150311	15进出11	16,800,000	1,678,922,657.58	1.01
6	111509258	15浦发CD258	16,000,000	1,583,615,595.28	0.95
7	111508218	15中信CD218	15,000,000	1,488,471,099.87	0.90
8	111507078	15招行CD078	15,000,000	1,488,220,147.05	0.90
9	111507114	15招行CD114	15,000,000	1,472,171,187.62	0.89
10	111593074	15西安银行CD036	12,000,000	1,181,526,169.67	0.71

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1045%
报告期内偏离度的最低值	0.0556%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0781%

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损益。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	859,677,061.41
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	859,677,061.41

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	102,337,631,750.71
报告期期间基金总申购份额	165,676,858,122.12
减:报告期期间基金总赎回份额	102,048,117,108.43
报告期末基金份额总额	165,966,372,764.40

注:上述总申购份额含红利再投份额。

§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交易明细

本基金本报告期末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现金添利货币市场基金设立的文件;

2、《建信现金添利货币市场基金基金合同》;

3、《建信现金添利货币市场基金招募说明书》;

4、《建信现金添利货币市场基金托管协议》;

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

建信消费升级混合型证券投资基金

【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	建信消费升级混合
基金主代码	000056
交易代码	000056
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月14日
报告期末基金份额总额	32,011,695,480份
投资目标	本基金通过深入挖掘消费升级过程中形成的投资机会,重点投资于直接受惠消费升级主题行业群组中的优势上市公司,同时兼顾消费升级间接拉动行业群组中的投资机会,通过积极主动的投资管理,在有效控制投资风险的前提下,实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势、消费升级对各个行业及上市公司的影响以及核心股票资产的估值水平,合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例。本基金采取的行业分类标准为广泛使用的中银万国行业分类标准,本基金在行业资产配置方面采取“核心-卫星”的策略。本基金坚持“自下而上”的个股选择策略,致力于选择核心行业及卫星行业中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。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标,同时根据需要进行积极操作,以提高基金收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为: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	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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

§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	4,519,746.71
2.本期利润	11,031,183.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.3275
4.期末基金资产净值	54,841,030.42
5.期末基金份额净值	1.713

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	22.80%	1.75%	13.17%	1.25%	9.63%	0.50%

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		
邱宇航	本基金的基金经理	2013年6月14日	-	8	硕士。2007年7月加入本公司,从事行业研究、历任研究员、基金经理助理,基金经理。2011年7月11日至2014年3月27日任建信恒久价值混合型证券投资基金基金经理;2013年6月14日起任建信消费升级混合型证券投资基金基金经理;2015年5月20日起任建信优化配置混合基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《建信消费升级混合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,一旦出现不同基金间时买卖同一证券时,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,A股在经历了前期下跌后,市场出现了企稳并恢复上涨的局面;一方面随着汇金、证金入场,限制上市公司高管减持等措施的推出,市场供求格局好转,另一方面融资杠杆逐步降低释放了市场压力。

本基金4季度跟随市场布局新的投资方向,但也慎重应对市场再次泡沫化所可能产生的风险。

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22.8%,波动率1.75%,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1季度,人民币汇率问题带来资本流出预期;供给侧改革任务比较艰巨;市场对于注册制的反应也值得关注;但注册制后市场估值体系调整会带来新的机会,市场的内部结构调整会孕育新的方向。

本基金在1季度将注意市场风险释放,更加重视个股的增长质量,布局重点仍放在各细分领域的龙头个股。

§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	41,263,463.17	74.49
	其中:股票	41,263,463.17	74.49
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	13,916,301.10	25.12
8	其他资产	211,280.36	0.38
9	合计	55,391,044.63	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	2,697,371.20	4.92
B	采矿业	265,430.00	0.48
C	制造业	20,315,638.28	37.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,595,627.76	4.73
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,635,516.00	2.98
G	交通运输、仓储和邮政业	2,550,802.00	4.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,128,771.27	13.00
J	金融业	1,295,990.00	2.36
K	房地产业	1,258,016.48	2.29
L	租赁和商务服务业	771,968.00	1.41
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	748,332.18	1.36
S	综合	-	-
	合计	41,263,463.17	75.24

注:以上行业分类以2015年12月31日的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	600271	航天信息	41,535	2,968,091.10	5.41
2	600718	东软集团	61,300	1,903,365.00	3.47
3	600570	恒生电子	24,591	1,499,313.27	2.73
4	601998	中信银行	179,500	1,295,990.00	2.36
5	300017	网宿科技	20,400	1,223,796.00	2.23
6	300330	华虹计通	55,700	1,198,664.00	2.19
7	002308	威创股份	48,300	1,190,595.00	2.17
8	002127	麦达数字	45,500	1,046,500.00	1.91
9	002037	久联发展	36,900	1,024,344.00	1.87
10	601006	大秦铁路	114,600	987,852.00	1.80

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

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,恒生电子股份有限公司(600570)于2015年8月19日发布公告:恒生电子近日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(沪证专调查字2015356号)。因控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司涉嫌违反证券、期货法律法规,中国证券监督管理委员会决定对恒生网络进行立案调查。2015年9月2日恒生电子从证监会官网了解到案件调查审理完毕,2015年9月7日恒生网络收到证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2015]68号),因向不具有经营证券业务资质的客户销售系统、提供相关服务,并获取非法收益,严重扰乱证券市场秩序,恒生网络被处没收违法所得132,852,384.06元,并处以398,557,152.18元罚款。

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	66,611.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,454.11
5	应收申购款	142,214.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	211,280.36

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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600271	航天信息	2,968,091.10	5.41	重大资产重组

注:本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	34,841,444.50
报告期期间基金总申购份额	5,596,815.77
减:报告期期间基金总赎回份额	8,426,564.79
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	32,011,695.48

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

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

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消费升级混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信消费升级混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信消费升级混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信消费升级混合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

建信新经济灵活配置混合型证券投资基金

【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	建信新经济灵活配置混合
基金主代码	001276
交易代码	001276
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月26日
报告期末基金份额总额	881,445,340.24份
投资目标	本基金的股票资产主要投资于同新经济相关的上市公司股票,并且通过股票与债券等资产的合理配置,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,力争创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、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估值水平,合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例。本基金在对新经济相关产业研究的基础上,根据各产业中子行业在不同时期受益于新经济的程度,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,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。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:65%×沪深300指数收益率+35%×中债总财富(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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

§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	44,426,356.16
2.本期利润	137,630,030.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.1509
4.期末基金资产净值	798,906,416.13
5.期末基金份额净值	0.906

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	19.21%	1.92%	11.83%	1.08%	7.38%	0.84%

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:1、本基金基金合同于2015年5月26日生效,截至报告期末未满一年。

2、本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§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		
彭云峰	本基金的基金经理	2015年5月26日	-	10	硕士,曾任中经网数据有限公司财经分析师、国都证券有限责任公司债券研究员兼宏观研究员,2006年5月起就职于鹏华基金管理公司,历任债券研究员、社保组合投资经理、债券基金经理等职,2010年5月31日至2011年6月14日任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理。彭云峰于2011年6月加入本公司,2011年11月30日至2013年5月31日任建信保本混合型证券投资基金基金经理;2012年2月17日至2014年1月21日任建信货币市场基金基金经理;2012年5月29日起任建信转债增强债券型证券投资基金基金经理;2013年11月5日起