

建信中证互联网金融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:中国银行股份有限公司
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、监事及董事会秘书不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对某内容的真实性、准确性、完整性、及时性、完整性承担连带责任。

基金托管人中国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 建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金

场内简称 网络金融

基金主代码 1605316

交易代码 1605315

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2015年10月31日

报告期末基金份额总额 90,044,188.61份

报告期末基金份额净值 0.9036,份额净值变动比例 0.9036%

投资目标 本基金通过投资于互联网金融行业股票,追求超越标的指数的回报,力争将已均衡配置偏股型股票投资组合在0.3%以内,以期获得长期稳定的资本增值。

投资策略 本基金将采用指数化投资方法投资于股票,按照成分股在指数中的权重比例构建指数化投资组合,并根据指数成份股的构成及变化情况进行定期调整。

业绩比较基准 中证互联网金融指数收益率×0.9%+商业银行存款利率(税后)×1%

本基金为股票型基金,其预期的收益与风险高于货币市场基金、债券型基金与货币市场基金。

风险收益特征 本基金为股票型基金,其预期的收益与风险高于货币市场基金、债券型基金与货币市场基金。

基金管理人 建信基金管理有限责任公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

基金类别 网络金融

基金状态 交易型开放式基金

基金募集期 2015年10月31日

报告期基金净值总额 77,036,778.94

报告期末基金净值总额 92,030

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。

§ 3.2 报告期末未持有极低投资比例的股票投资组合

§ 3.3 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) 占基金资产净值的比例(%)

1 3000104 乐视网 63,300 3,134,040.00 3.73

2 600271 东方财富 35,324 2,567,120.94 3.06

3 002023 亿邦通 59,400 2,951,724.00 3.04

4 601666 中国银河 157,000 2,522,990.00 3.00

5 601166 兴业银行 146,700 2,504,160.00 2.98

6 600109 中国国电 153,700 2,477,640.00 2.96

7 000446 金证股份 60,100 2,464,410.00 2.93

8 601318 中国平安 68,200 2,456,200.00 2.92

9 600177 飞利浦 148,200 2,412,650.00 2.87

10 000001 平安银行 195,100 2,339,240.00 2.79

注:本基金持有的股票按公允价值计算的基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细。

本基金本报告期末未持有极低投资比例的股票投资组合。

§ 3.4 报告期末按公允价值品种的股票投资组合

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 3000104 乐视网 63,300 3,134,040.00 3.73

2 600271 东方财富 35,324 2,567,120.94 3.06

3 002023 亿邦通 59,400 2,951,724.00 3.04

4 601666 中国银河 157,000 2,522,990.00 3.00

5 601166 兴业银行 146,700 2,504,160.00 2.98

6 600109 中国国电 153,700 2,477,640.00 2.96

7 000446 金证股份 60,100 2,464,410.00 2.93

8 601318 中国平安 68,200 2,456,200.00 2.92

9 600177 飞利浦 148,200 2,412,650.00 2.87

10 000001 平安银行 195,100 2,339,240.00 2.79

注:本基金持有的股票按公允价值计算的基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细。

本基金本报告期末未持有极低投资比例的股票投资组合。

§ 3.5 报告期末按公允价值品种的股票投资组合

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 3000104 乐视网 63,300 3,134,040.00 3.73

2 600271 东方财富 35,324 2,567,120.94 3.06

3 002023 亿邦通 59,400 2,951,724.00 3.04

4 601666 中国银河 157,000 2,522,990.00 3.00

5 601166 兴业银行 146,700 2,504,160.00 2.98

6 600109 中国国电 153,700 2,477,640.00 2.96

7 000446 金证股份 60,100 2,464,410.00 2.93

8 601318 中国平安 68,200 2,456,200.00 2.92

9 600177 飞利浦 148,200 2,412,650.00 2.87

10 000001 平安银行 195,100 2,339,240.00 2.79

注:本基金持有的股票按公允价值计算的基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细。

本基金本报告期末未持有极低投资比例的股票投资组合。

§ 3.6 报告期末按公允价值品种的股票投资组合

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 3000104 乐视网 63,300 3,134,040.00 3.73

2 600271 东方财富 35,324 2,567,120.94 3.06

3 002023 亿邦通 59,400 2,951,724.00 3.04

4 601666 中国银河 157,000 2,522,990.00 3.00

5 601166 兴业银行 146,700 2,504,160.00 2.98

6 600109 中国国电 153,700 2,477,640.00 2.96

7 000446 金证股份 60,100 2,464,410.00 2.93

8 601318 中国平安 68,200 2,456,200.00 2.92

9 600177 飞利浦 148,200 2,412,650.00 2.87

10 000001 平安银行 195,100 2,339,240.00 2.79

注:本基金持有的股票按公允价值计算的基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细。

本基金本报告期末未持有极低投资比例的股票投资组合。

§ 3.7 报告期末按公允价值品种的股票投资组合

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 3000104 乐视网 63,300 3,134,040.00 3.73

2 600271 东方财富 35,324 2,567,120.94 3.06

3 002023 亿邦通 59,400 2,951,724.00 3.04

4 601666 中国银河 157,000 2,522,990.00 3.00

5 601166 兴业银行 146,700 2,504,160.00 2.98

6 600109 中国国电 153,700 2,477,640.00 2.96

7 000446 金证股份 60,100 2,464,410.00 2.93

8 601318 中国平安 68,200 2,456,200.00 2.92

9 600177 飞利浦 148,200 2,412,650.00 2.87

10 000001 平安银行 195,100 2,339,240.00 2.79

注:本基金持有的股票按公允价值计算的基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细。

本基金本报告期末未持有极低投资比例的股票投资组合。

§ 3.8 报告期末按公允价值品种的股票投资组合

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 3000104 乐视网 63,300 3,134,040.00 3.73

2 600271 东方财富 35,324 2,567,120.94 3.06

3 002023 亿邦通 59,400 2,951,724.00 3.04

4 601666 中国银河 157,000 2,522,990.00 3.00

5 601166 兴业银行 146,700 2,504,160.00 2.98

6 600109 中国国电 153,700 2,477,640.00 2.96

7 000446 金证股份 60,100 2,464,410.00 2.93

8 601318 中国平安 68,200 2,456,200.00 2.92

9 600177 飞利浦 148,200 2,412,650.00 2.87

10 000001 平安银行 195,100 2,339,240.00 2.79

注:本基金持有的股票按公允价值计算的基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细。

本基金本报告期末未持有极低投资比例的股票投资组合。

§ 3.9 报告期末按公允价值品种的股票投资组合

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 3000104 乐视网 63,300 3,134,040.00 3.73

2 600271 东方财富 35,324 2,567,120.94 3.06

3 002023 亿邦通 59,400 2,951,724.00 3.04

4 601666 中国银河 157,000 2,522,990.00 3.00

5 601166 兴业银行 146,700 2,504,160.00 2.98

6 600109 中国国电 153,700 2,477,640.00 2.96

7 000446 金证股份 60,100 2,464,410.00 2.93

8 601318 中国平安 68,200 2,456,200.00 2.92

9 600177 飞利浦 148,200 2,412,650.00 2.87

10 000001 平安银行 195,100 2,339,240.00 2.79

注:本基金持有的股票按公允价值计算的基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细。

本基金本报告期末未持有极低投资比例的股票投资组合。

§ 3.10 报告期末按公允价值品种的股票投资组合

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 3000104 乐视网 63,300 3,134,040.00 3.73