建信收益增强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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	建信收益增强债券
基金主代码	530009
交易代码	530009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月2日
报告期末基金份额总额	1,350,626,024.61份
投资目标	在保持资产流动性的基础上,发挥投研团队在固定收益、股票及金融衍生产品方面的综合研究实力,在有效控制风险的前提下追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建信用类债券投资组合,运用基本面研究择机介入上市公司股票及参与新股申购,以实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	30%×中债企业债总指数+70%×中债国债总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,但高于货币市场基金以及不涉及股票二级市场投资的债券型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
下属分级基金的交易代码	530009	531009
报告期末下属分级基金的份额总额	983,618,815.22份	367,007,209.39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)	
	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
1. 本期已实现收益	11,997,306.80	3,327,065.25
2. 本期利润	45,515,351.68	13,371,750.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0555	0.0461
4. 期末基金资产净值	1,524,368,582.85	554,134,065.28
5. 期末基金份额净值	1.550	1.510

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

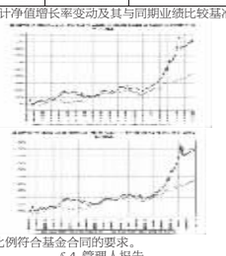
建信收益增强债券A

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	3.75%	0.20%	3.02%	0.12%	0.73%	0.08%

建信收益增强债券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④	①-③	②-④
过去三个月	3.64%	0.20%	3.02%	0.12%	0.62%	0.08%

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		
李菁	固定收益投资部总经理、本基金的基金经理	2009年6月2日	-	10	硕士。2002年7月进入中国建设银行,从事基金托管业务,任主任科员,2005年9月进入建信基金管理有限责任公司,历任债券研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、投资管理部副总监、固定收益投资部总监,2007年11月3日至2012年2月17日任建信货币市场基金基金经理,2009年6月2日起任建信收益增强基金基金经理,2011年6月16日起任建信信用增强债券基金基金经理。

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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信收益增强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

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

在报告期内,本基金配置较为均衡,适当控制了组合波动率,并通过个股选择,取得了相对于业绩比较基准明显的超额收益。

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29.47%,波动率1.86%,业绩比较基准收益率15.65%,波动率1.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年4季度,投资者情绪逐渐从之前大幅下跌的恐慌当中恢复,风险偏好明显提升,市场振荡向上,中小市值股票表现出更高的弹性。

展望2016年1季度,预计在经历此前半年的下跌-反弹过程后,投资者会重新审视股票、外汇、债券等不同市场之间的内在联系,而注册制等新制度的推出,也可能会使投资者重新调整自身的风险偏好和行为模式。

本基金属于高仓位、主动投资的股票型基金,将会通过吸收投研团队的研究成果,优化组合配置,力争给持有人带来超额收益。

§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	权益投资	251,477,127.36	12.06
	其中:股票	251,477,127.36	12.06
2	固定收益投资	1,758,608,142.03	84.33
	其中:债券	1,758,608,142.03	84.33
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	33,146,891.93	1.59
7	其他资产	42,224,905.80	2.02
8	合计	2,085,457,067.12	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	38,409,423.94	1.85
B	采矿业	-	-
C	制造业	150,228,812.14	7.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,270,630.64	1.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,012,115.64	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,068,514.00	0.58
J	金融业	-	-
K	房地产业	10,487,631.00	0.50
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	251,477,127.36	12.10

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	002308	威创股份	959,098	23,641,765.70	1.14
2	002234	民和股份	1,129,753	20,312,958.94	0.98
3	000705	浙江震元	1,013,439	19,012,115.64	0.91
4	000651	格力电器	664,451	14,850,479.85	0.71
5	000333	美的集团	443,000	14,539,260.00	0.70
6	600498	烽火通信	497,887	14,194,758.37	0.68
7	600485	信威集团	513,312	13,731,096.00	0.66
8	600715	*ST松辽	327,600	13,582,296.00	0.65
9	600900	长江电力	967,364	13,117,455.84	0.63
10	002635	安洁科技	467,411	12,994,025.80	0.63

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	60,376,000.00	2.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	600,171,464.80	28.88
	其中:政策性金融债	570,129,464.80	27.43
4	企业债券	495,164,631.30	23.82
5	企业短期融资券	150,465,000.00	7.24
6	中期票据	435,490,000.00	20.95
7	可转债	16,941,045.93	0.82
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,758,608,142.03	84.61

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	150218	15国开18	1,500,000	157,530,000.00	7.58
2	112253	15荣盛01	780,000	80,964,000.00	3.90
3	150205	15国开05	700,000	73,017,000.00	3.51
4	1580081	15宜兴城建债	500,000	54,200,000.00	2.61
5	150210	15国开10	500,000	54,180,000.00	2.61

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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持有国债期货。

5.9.3 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。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 本期股指期货投资政策

本基金报告期内未投资于股指期货。

5.10.2 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持有股指期货。

5.10.3 本期股指期货投资评价

本基金报告期内未投资于股指期货。

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。

5.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	473,064.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,476,667.35
5	应收申购款	4,275,173.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,224,905.80

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	110030	格力转债	6,445,045.80	0.31

5.10.5 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

项目	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
报告期期初基金份额总额	676,117,237.32	173,733,355.99
报告期期间基金总申购份额	528,783,783.94	280,733,353.35
减:报告期期间基金总赎回份额	221,282,206.04	87,459,499.95
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	983,618,815.22	367,007,209.39

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收益增强债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信收益增强债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信收益增强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

建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

【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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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	建信双利分级股票		
场内简称	建信双利		
基金主代码	165310		
交易代码	165310		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年5月6日		
报告期末基金份额总额	168,665,378.61份		
投资目标	本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	本基金将通过自上而下的方式,通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析,深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题,在前述主题筛选和主题配置的基础上,本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具,采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。		
风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。 从本基金所分离的两类基金份额来看,建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额;建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	建信双利	建信稳健	建信进取
下属分级基金的场内简称	建信双利	建信稳健	建信进取
下属分级基金的交易代码	165310	150036	150037
报告期末下属分级基金的份额总额	163,723,836.61份	1,976,616.00份	2,964,926.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。	建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额。	建信进取份额将表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。

§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	9,728,884.00
2.本期利润	57,254,305.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.3331
4.期末基金资产净值	245,197,870.69
5.期末基金份额净值	1.454

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。

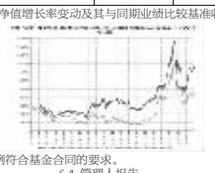
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	29.47%	1.86%	15.65%	1.59%	13.82%	0.27%

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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理、本基金的基金经理	2015年3月25日	-	12	特许金融分析师(CFA),2003年1月获清华大学经济学博士学位。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司,历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理;2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2011年9月8日起任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金基金经理;2015年3月25日起任建信双利分级股票基金的基金经理;2015年7月31日起任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金基金经理;2015年8月6日起任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金基金经理。

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《建信双利策略主题分级股票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

在报告期内,本基金配置较为均衡,适当控制了组合波动率,并通过个股选择,取得了相对于业绩比较基准明显的超额收益。

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29.47%,波动率1.86%,业绩比较基准收益率15.65%,波动率1.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年4季度,投资者情绪逐渐从之前大幅下跌的恐慌当中恢复,风险偏好明显提升,市场振荡向上,中小市值股票表现出更高的弹性。

展望2016年1季度,预计在经历此前半年的下跌-反弹过程后,投资者会重新审视股票、外汇、债券等不同市场之间的内在联系,而注册制等新制度的推出,也可能会使投资者重新调整自身的风险偏好和行为模式。

本基金属于高仓位、主动投资的股票型基金,将会通过吸收投研团队的研究成果,优化组合配置,力争给持有人带来超额收益。

§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	权益投资	227,104,004.34	91.44
	其中:股票	227,104,004.34	91.44
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	21,128,571.64	8.51
7	其他资产	125,657.07	0.05
8	合计	248,358,233.05	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	444,706.00	0.18
B	采矿业	9,958,635.72	4.06
C	制造业	59,103,522.91	24.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,230,516.00	6.62
E	建筑业	14,490,998.88	5.91
F	批发和零售业	12,439,540.00	5.07
G	交通运输、仓储和邮政业	8,257,634.98	3.37
H	住宿和餐饮业	291,076.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,923,303.00	4.45
J	金融业	79,773,358.34	32.53
K	房地产业	12,622,033.00	5.15
L	租赁和商务服务业	687,630.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	972,110.51	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	625,860.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	283,080.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	227,104,004.34	92.62

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	601318	中国平安	392,556	14,132,016.00	5.76
2	601166	兴业银行	603,400	10,300,038.00	4.20
3	601766	中国中车	504,011	6,476,541.35	2.64
4	600999	招商证券	290,100	6,295,170.00	2.57
5	000001	平安银行	499,500	5,989,005.00	2.44
6	601669	中国电建	712,200	5,718,966.00	2.33
7	600016	民生银行	583,661	5,626,492.04	2.29
8	600030	中信证券	277,289	5,365,542.15	2.19
9	601991	大唐发电	981,000	5,042,340.00	2.06
10	601688	华泰证券	251,173	4,953,131.56	2.02

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持有股指期货。

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持有股指期货。

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,招商证券股份有限公司(600999)于2015年1月16日发布公告:2015年1月16日,中国证监会公开通报 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司因存在存在向不符合条件的客户融资融券问题,并且受过处理仍未改正,被采取责令限期改正的行政监管措施。

中信证券股份有限公司(600030)于2015年1月19日发布公告:2015 年 1 月 16 日收市后,中国证监会在例行的新闻发布会上,通报证券公司融资融券业务检查情况,提及本公司等 3 家证券公司由于存在为到期融资融券合约展期的问题,对本公司等 3 家证券公司采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。2015 年 1 月 16 日约 17 时,本公司通过网络报道知悉上述处罚。2015年11月27日中信证券收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书,本次调查的范围是本公司在融资融券业务开展过程中,存在违反《证券公司监督管理条例》第八十四条"未按照规定与客户签订业务合同"规定之嫌。

华泰证券股份有限公司(601668)于2015年9月12日发布公告:2015年9月10日,公司收到中国证监会行政处罚事先告知书。对外部接入的第三方交易终端软件未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解,违反相关规定,对华泰证券责令改正,给予警告,没收违法所得18,235,275.00元,并处以54,705,825.00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	71,857.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,060.25
5	应收申购款	48,739.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	125,657.07

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信双利	建信稳健	建信进取
报告期期初基金份额总额	167,271,975.38	2,761,044.00	4,141,568.00
报告期期间基金总申购份额	6,550,157.46	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	12,059,366.23	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	1,961,070.00	-784,428.00	-1,176,642.00
报告期期末基金份额总额	163,723,836.61	1,976,616.00	2,964,926.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§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双利策略主题分级股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信双利策略主题分级股票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

建信双息红利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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	建信双息红利债券
基金主代码	530017
交易代码	530017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月13日
报告期末基金份额总额	5,510,980,251.53份
投资目标	通过主动管理债券组合,力争在追求基金资产稳定增长基础上为投资者取得高于投资业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。同时在固定收益资产所提供的稳健收益基础上,适当进行股票投资,本基金的股票投资作为债券投资的辅助和补充,以本金安全为最重要因素。
业绩比较基准	90%×中国债券总指数收益率+10%×中证红利指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、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	中信银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	建信双息红利债券A	建信双息红利债券C
下属分级基金的交易代码	530017	531017
报告期末下属分级基金的份额总额	4,296,286,926.34份	1,215,693,325.19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