建信潜力新蓝筹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: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	建信潜力新蓝筹股票
基金主代码	000756
交易代码	000756
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月10日
报告期末基金份额总额	97,756,055.84份
投资目标	本基金主要投资于股票市场,通过股票精选和组合投资,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,综合分析证券市场的走势,主动判断市场时机,通过稳健的资产配置,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,以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	85%×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、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于混合型基金、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	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	10,863,083.27
2.本期利润	26,554,825.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.2721
4.期末基金资产净值	138,209,660.79
5.期末基金份额净值	1.414

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	24.47%	2.18%	14.50%	1.42%	9.97%	0.76%

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		
许杰	本基金的基金经理	2014年9月10日	-	13	硕士,特许金融分析师(CFA)。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员,2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司,历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职,2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理,2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理,2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011年10月加入我公司,2012年3月21日起任建信恒稳价值混合型证券投资基金基金经理,2012年8月14日起任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理;2014年9月10日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金经理;2015年2月3日起任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年5月26日起任建信新经济灵活配置混合型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《建信潜力新蓝筹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

由于认识到去杠杆接近尾声,本基金四季度初提高了股票的配置比例。主要投资方向是代表经济转型方向的创新和新消费行业,集中投资了未来成长空间大、进入壁垒高、目前处于快速增长阶段的行业中的龙头企业。

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24.47%,波动率2.18%,业绩比较基准收益率14.5%,波动率1.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A股市场2016年可能呈震荡行情,全年看可能仍有一定的上涨空间。

经济方面,全年可能仍处于L型底部徘徊阶段;流动性可能仍比较充裕,整体仍有利于股票市场:货币政策宽松基调未变,但边际力度减弱。人民币贬值构成最大的风险点,但对整体社会流动性的影响有限。中国经济的基本面决定了人民币不会失控大幅贬值。同时,在大宗商品价格低迷及国内工业品价格连续多年通缩的背景下,人民币适度贬值不会导致通胀,通胀水平仍将保持在较低的水平上,央行仍然有能力通过降息降准、公开市场操作等手段维持社会流动性充裕;股市政策方面,在注册制、战略新兴板、深港通等有望推出的背景下,2016年股票供给会大幅增加。

因此,2016年股票选择的重要性进一步提高,讲故事搞概念的股票可能遭到摒弃,而真正成长空间大、竞争力强的企业以及基本面改善的企业可能成为投资者关注的焦点。

本基金2016年将集中投资于三类企业:创新和新型服务类等成长类行业中竞争力突出,有望持续高增长,未来能够成为大市值的公司;行业或公司基本面发生变化,有估值提升空间的股票;产能过剩行业整合过程中产生的机会。

§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	122,750,129.01	87.02
	其中:股票	122,750,129.01	87.02
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	17,776,426.86	12.60
8	其他资产	534,119.58	0.38
9	合计	141,060,675.45	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	2,772,817.25	2.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	67,412,038.68	48.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,407,017.79	3.91
F	批发和零售业	3,562,362.00	2.58
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	30,181,753.74	21.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,244,571.03	3.07
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	6,991,919.52	5.06
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	2,177,649.00	1.58
S	综合	-	-
	合计	122,750,129.01	88.81

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	002594	比亚迪	89,198	5,744,351.20	4.16
2	300166	东方国信	177,365	5,681,000.95	4.11
3	600485	信威集团	207,743	5,557,125.25	4.02
4	002051	中工国际	213,463	5,407,017.79	3.91
5	300017	网宿科技	89,295	5,356,807.05	3.88
6	600718	东软集团	162,902	5,058,107.10	3.66
7	002573	清新环境	214,508	4,813,559.52	3.48
8	002426	胜利精密	173,357	4,510,749.14	3.26
9	300043	互动娱乐	256,767	4,413,824.73	3.19
10	600730	中国高科	243,521	4,244,571.03	3.07

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,中国高科集团股份有限公司(600730)于2015年7月23日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《调查通知书》(编号:京调查通字15046号)。因该公司涉嫌未披露关联方交易等信息披露违法违规事项,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对该公司立案调查。上述信息该公司已于2015年7月24日在中国证券报、上海证券报、证券时报及上海证券交易所网站上进行了披露。

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	194,142.13
2	应收证券清算款	290,579.69
3	应收股利	-
4	应收利息	6,740.63
5	应收申购款	42,657.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	534,119.58

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	300043	互动娱乐	4,413,824.73	3.19	筹划发行股份购买资产

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	95,419,664.27
报告期期间基金总申购份额	27,866,358.75
减:报告期期间基金总赎回份额	25,529,967.18
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	97,756,055.84

注:上述总申购份额含转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§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潜力新蓝筹股票型证券投资基金设立的文件;
2、《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金合同》;
3、《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信潜力新蓝筹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

建信全球机遇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:中国工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。

基金托管人中国工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	建信全球机遇混合(QDII)
基金主代码	539001
交易代码	539001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月14日
报告期末基金份额总额	24,195,128.55份
投资目标	本基金通过全球化的资产配置和组合管理,在分散和控制投资风险的同时追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金采取"自上而下"的资产配置与"自下而上"的证券选择相结合、定量研究与定性研究相结合、组合构建与风险控制相结合的投资策略进行投资组合的构建。
业绩比较基准	标准普尔全球BMI市场指数总收益率(S&P Global BMI)×70%+标准普尔BMI中国(除A、B股)指数总收益率(S&P BMI China ex-A-B-Shares)×30%
风险收益特征	本基金为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	中国工商银行股份有限公司

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Principal Global Investors, LLC.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	信安环球投资有限公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	140 Broadway New York
办公地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	140 Broadway New York
邮政编码		IA 50392-0490	NY10005

§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	-285,742.39
2.本期利润	1,860,465.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.0748
4.期末基金资产净值	25,741,472.02
5.期末基金份额净值	1.064

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、汇兑损益、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。

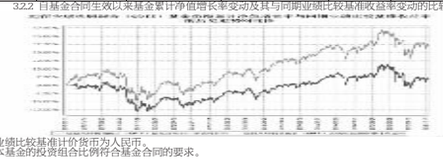
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	7.37%	0.90%	8.72%	1.02%	-1.35%	-0.12%

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.本基金业绩比较基准计价货币为人民币。

2.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		
赵英楷	量化衍生品及海外投资部总经理,本基金的基金经理	2011年4月20日	-	17	美国哥伦比亚大学商学院MBA。曾任美国美林证券公司研究员、高盛证券公司研究员、美林证券公司投资组合策略分析师、美国阿罗亚投资公司基金经理;2010年3月加入建信基金管理有限责任公司,历任海外投资部执行总监、总监,量化衍生品及海外投资部总监。2011年4月20日起任建信全球机遇混合基金基金经理,2011年6月21日起任建信新兴市场混合基金基金经理,2012年6月26日起任建信全球资源混合型证券投资基金基金经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Christopher Ibach	投资组合经理	19	Christopher Ibach负责监督支持所有股票策略的全球研究&发展,包括全球量化研究、股票选择模型发展、投资组合构建和风险管理。他作为共同基金经理,专精于主动核心、机会型的和专业全球组合。Chris也监督公司的系统策略团队,负责被动增强和被动股票组合。他在2000年作为股票研究分析师加入公司,专精于分析国际科技公司并在2002年成为基金经理。在此之前,Chris在Motorola, Inc取得了6年的相关行业经验。Chris从University of Iowa获得了金融学MBA学位和电子工程学士学位。Chris获得了使用特许金融分析师称号的权利并且是CFA Institute的成员。
Mustafa Sagun	首席投资官	22	Mustafa Sagun是信安环球股票的首席投资官。他负责监督所有国际、国内和全球股票策略的投资组合管理和研究。Mustafa在2000年加入公司。他从2002年开始就担任全球股票组合的主管基金经理,而在2006年开始担任首席投资官。他之前也担任公司资产配置策略团队的成员。Mustafa的职业生涯开始于1991年,曾担任过投资管理、研究和风险管理的职位。在加入信安之前,他是PNC金融服务集团的副总裁和分析师和Salomon Brothers的股票衍生品专家。Mustafa从University of South Florida取得金融学Ph.D.学位和国际经济学MA学位。他从土耳其的Bogazici University取得电子和工程的学士学位。Mustafa获得了使用特许金融分析师称号的权利。他是CFA Institute和CFA Society of Iowa的成员。
王曦	投资组合经理	13	王曦在信安担任香港和中国投资组合的基金经理,他也是我们的高级投资分析师和大中华区研究团队负责人。王曦的金融职业生涯开始于中国银行总行,担任财务总监执行助理超过3年时间,也为该行IPO准备工作提供支持。王曦在2003年加入信安,担任香港和中国股票市场的基金经理以及亚洲和新兴市场策略的助理基金经理。作为全球研发团队的资深成员,王曦也负责我们全球研究平台(GRP)的模型搭建,特别是亚洲和大中华选股模型。他也曾在建设银行和信安的中国合资公司成立之初时任高级顾问。王曦在2008年离开信安,曾在中国平安资产管理公司(香港)担任股票投资总监,也曾任贝莱德亚洲的基金经理。王曦持有爱荷华大学Tippie管理学院的MBA学位,中国人民大学经济学和国际金融学士学位。他执有特许金融分析师(CFA)资格。
李晓西	投资组合经理	14	李晓西是信安环球股票定量研究部总经理,负责所有股票策略的量化研究。他的研究职责包括为公司专属的全球研究平台(GRP)股票选择模型,投资组合构建和风险管理进行全球股票量化研究并实施模型开发。他也担任全球核心、全球全部国家、全球机遇、全球价值&收入和其它专门的全球基金的基金经理。晓西在2006年加入公司。此前,晓西是Hantang Securities Co., Ltd., Beijing的高级经理。他的经历还包括Yinjian Industrial Co., Ltd., Beijing的投资组合经理。他从北京大学获得MBA学位,从北京工商大学获得会计学硕士学位并从对外经济贸易大学会计学专业毕业。晓西是金融风险管理师持证人和Global Association of Risk Professionals成员。他获得了使用特许金融分析师称号的权利并且是CFA Institute的成员。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《建信全球机遇混合型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在经历第三季度全球股票市场较大幅度的下跌后,全球各主要市场在四季度初都普遍经历一波中级别反弹,但进入11月后,全球市场在多重宏观和地缘政治因素的综合作用下,进入新的分化阶段。其中,美国、日本市场在反弹后基本回到二季度的市场高点,直到年底都维持高位盘整;欧洲的反弹较为弱势,但也基本维持了盘整的格局;新兴市场和大宗商品则再度经受了新一轮的抛压。

第四季度美国经济增长继续平稳向上,三季度GDP环比增长达到2%,消费、房屋销售等数据比较稳定,虽然制造业PMI在四季度继续下行,但劳动力市场仍然表现良好,重要的非农就业指标继续维持在20万人以上,从而使联储在经过近两年的酝酿和与市场的沟通后,于12月16日做出了自08年金融危机发行最化宽松的非常规货币政策后的首次加息决定。由于前期沟通比较充分,正如我们前期预计的,市场对加息预期已经充分消化,美、欧、日本等发达国家股市和外汇市场对美联储的加息决定反应平稳,市场基本上波澜不惊,美元指数也没有大幅上涨。地缘政治方面,俄罗斯从10月初开始军事介入叙利亚反恐,意图主导中东局势的意图明显;以沙特为首的欧佩克继续拒绝削减产能,美国在12月宣布终止实施四十多年的禁令,恢复石油出口等背景下,原油市场的供给继续过剩,油价在季度中反弹到50美元/桶后,再度经历持续走跌,走续跌破了40和35美元/桶的重要心理价位。原油为首的全球大宗商品持续走低,再加上海外市场对中国经济放缓和人民币贬值的持续担忧,对全球新兴市场和海外中资中概股市场形成利空。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率7.37%,波动率0.90%,业绩比较基准收益率8.72%,波动率1.02%。

4.6 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,我们预期美联储在2016年还会继续加息3-4次,让美国货币政策逐步回到危机前的水平。我们预期美联储加息节奏将极为审慎,以不影响经济的正常增长尤其就业增长为前提。在这个宏观大背景下,美元将维持较强的态势。美国企业盈利在国内温和增长、美元升值和新兴市场经济增速下降的影响下,同比增长将维持在个位数;美国股市目前估值处于历史平均水平,估值较合理,使全球资本的较好避风港。欧洲经济可能会继续弱复苏,由于欧洲估值较低,市场存在一定投资机会,但近期的难民问题和11月的巴黎恐怖袭击增加了不确定因素。强势美元和大宗商品的弱势下、新兴市场未来仍不太明朗。在超跌下可能会出现一定的反弹机会,但其经济基本面较弱,在没有明晰可实施的内部结构化改革的情况下,反弹的力度可能有限。中国政府继续推出保增长政策,预期央行将继续维持宽松的货币政策,并采取有力措施稳定市场预期。我们将继续遵循一贯的价值投资理念,挑选具有核心竞争力、估值合理的投资标的,力争为投资人带来良好的超额收益。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,自2015年10月1日至2015年12月31日,本基金基金资产净值低于五千万元超过连续20个工作日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》(2014年8月8日生效)第四十一条的要求,现将该情况在本次报告中予以披露。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,485,592.67	89.29
	其中:普通股	21,664,563.14	82.37
	优先股	-	0.00
	存托凭证	1,821,029.53	6.92
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中:远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	2,806,447.48	10.67
8	其他资产	9,141.17	0.03
9	合计	26,301,181.32	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	9,214,848.90	35.80
美国	8,822,837.95	34.27
日本	1,378,077.79	5.35
英国	1,311,654.91	5.10
加拿大	912,789.76	3.55
法国	695,297.38	2.70
瑞士	508,392.00	1.97
德国	343,600.81	1.33
澳大利亚	165,815.28	0.64
瑞典	132,277.89	0.51
合计	23,485,592.67	91.24

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	858,534.62	3.34
公用事业	504,628.41	1.96
信息技术	4,770,028.99	18.53
材料	889,738.38	3.46
电信服务	1,546,139.33	6.01
必需消费品	1,028,513.79	4.00
工业	1,731,365.19	6.73
保健	2,163,613.36	8.41
非必需消费品	3,654,572.17	14.20
金融	6,338,458.43	24.62
合计	23,485,592.67	91.24

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	KYG875721634	香港证券交易所	中国香港	10,400	1,328,719.08	5.16
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	US01609W1027	纽约证券交易所	美国	1,252	660,724.06	2.57
3	CHINA MOBILE LTD	中国移动	HK0941009539	香港证券交易所	中国香港	7,500	549,793.13	2.14
4	KDDI CORP	KDDI株式会社	JP3496400007	东京交易所	日本	2,800	475,780.90	1.85
5	MICROSOFT CORP	微软	US5949181045	纳斯达克证券交易所	美国	1,307	470,866.26	1.83
6	WELLS FARGO & CO	富国银行	US9497461015	纽约证券交易所	美国	1,239	437,357.21	1.70
7	BAIDU INC - SPON ADR	百度	US0567521085	纳斯达克证券交易所	美国	351	430,870.10	1.67
8	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	CNE100000125	香港证券交易所	中国香港	136,000	394,225.76	1.53
9	CHINA MERCHANTS BANK-H	招商银行	CNE1000002M1	香港证券交易所	中国香港	24,329	372,997.00	1.45
10	NOVARTIS AG-REG	诺华	CH0012005267	瑞士证券交易所	瑞士	656	369,676.84	1.44

注:所有证券代码采用ISIN码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券

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 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	7,542.23
4	应收利息	288.93
5	应收申购款	116,405.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	124,236.17

5.10.4 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。

5.10.5 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不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	29,802,601.90
报告期期间基金总申购份额	1,860,910.35
减:报告期期间基金总赎回份额	4,135,091.70
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	27,528,420.55

§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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2015年12月30日	2,911,208.15	2,023,024.74	0.30%
合计			2,911,208.15	2,023,024.74	

§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全球机遇混合型证券投资基金设立的文件;
2、《建信全球机遇混合型证券投资基金基金合同》;
3、《建信全球机遇混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信全球机遇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

建信全球资源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