

信息披露 Disclosure

建信健康民生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:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2016年1月21日

§ 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。

基金托管人光大银行股份有限公司根据基金合同规定,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。

本报告书经基金托管人复核无误。

本基金报告自2016年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信健康民生混合
基金主代码	000047
交易代码	000047
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月21日
报告期末基金份额总额	63,426,268,609份
投资目标	本基金的主要投资策略有利于提升居民健康水平和促进国民生产的行业公司,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资将综合健康和民生这两个主题,本基金将精选有利于提升居民健康水平和促进国民生产的行业公司进行投资。
业绩比较基准	8%×沪深300指数收益率+30%×中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其风险与预期收益水平高于货币市场基金,低于股票基金,中等风险。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§ 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.本期实现收入	14,262,470.04
2.本期利润	27,966,142.66
3.期末平均基金份额本期利润	0.0324
4.期末基金资产净值	118,046,400.06
5.期末基金份额净值	2.2110

注:1.本期已实现收益指基金本期收入,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。

3.2.1 本基金净值份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3 报告期内基金净值增长率走势图

3.2.4 管理人对报告期内本基金运作遵守信情况的说明

本基金报告期内,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取利益,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《建信健康民生混合型证券投资基金合同》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》、《证券投资基金托管人内部控制指导意见》、《证券投资基金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,制定了公平交易管理制度。公司使用的交易系统设置了公平交易模块,定期对公平交易制度的执行情况进行评价。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内,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 报告期内基金管理人的投资策略和业绩表现

4.4.1 报告期内本基金投资策略和分析

2015年4季度市场大幅震荡,本基金在经历了3季度的股灾后均出现不同程度的反弹。

经济方面,全球经济持续复苏,美国经济复苏动能强,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季度基于对政治、经济基本面和行业盈利的判断,结合市场的估值水平,对行业进行了均衡配置,积极参加了医药IT板块的反弹。

4.4.2 报告期内本基金的业绩表现

本基金报告期内整体表现优秀,12月份大盘蓝筹表现更佳。4季度市场情绪有所好转,随着市场的反弹,本基金在医药、白酒、家电、金融等行业上获得较好收益。

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,美国经济持续波动回升趋势,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;欧洲经济逐步触底;国内经济在政策引导的情况下有望缓慢企稳,但人民币贬值的波动力和市场的弱预期仍会限制经济复苏的步伐,注册制、战略新兴板等一系列制度的推出将对资本市场产生深远的影响,需要密切关注。

本基金2016年1季度在市场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扶持的低估值行业和公司;本基金将继续在医药、环保、IT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。

5 投资组合报告

5.1 投资组合报告

5.2 报告期末基金资产组合情况

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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十名股票投资明细

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债券投资明细

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贵金属投资明细

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

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其他证券投资

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.13 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

5.14 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债券投资明细

5.15 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贵金属投资明细

5.16 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

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他证券投资

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.20 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.21 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

5.22 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.23 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债券投资明细

5.24 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贵金属投资明细

5.25 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

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他证券投资

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.28 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.29 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.30 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

5.31 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债券投资明细

5.32 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贵金属投资明细

5.33 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

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他证券投资

5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.36 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.37 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.38 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

5.39 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债券投资明细

5.40 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贵金属投资明细

5.41 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

5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他证券投资

5.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.44 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.45 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.46 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

5.47 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债券投资明细

5.48 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贵金属投资明细

5.49 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

5.50 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他证券投资

5.51 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.52 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.53 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.54 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

5.55 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债券投资明细

5.56 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贵金属投资明细

5.57 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

5.58 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他证券投资

5.59 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.60 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.61 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.62 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

5.63 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债券投资明细

5.64 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贵金属投资明细

5.65 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

5.66 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他证券投资

5.67 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.68 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.69 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.70 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

5.71 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债券投资明细

5.72 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贵金属投资明细

5.73 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

5.74 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他证券投资

5.75 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他资产

5.76 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.77 报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

5.78 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

</div