

## 建信回报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、监事及高级管理人员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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人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。

基金销售机构承诺以诚实信用、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未来的表现。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。

本基金合同自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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 4,219,911.61

2.本期利润 6,814,766.03

3.加权平均基金份额本期利润 0.0063

4.期末基金份额净值 2,581,837,406.44

5.期末总资产净值 1.061

注:1.本公司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，本期期间为本期前三项收入加上期间公允价值变动损益。

2.所述本期利润不包括持有人认购或申购基金时产生的费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.1 本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的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩基准收益率(%) 业绩基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 1.15% 0.08% 1.54% 0.02% -0.39% 0.00%

3.2.2 本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

注:1.本基金合同于2015年5月13日生效，截至报告期末未满一年。

2.本基金建仓期为6个月，建仓期结束后各项资产配置比例符合合同相关规定。

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

牛兴华 本基金的基金经理 2015年5月13日 - 4

博士，2008年7月至2012年1月在海通证券资产管理有限公司工作，历任研究员、经理；2012年5月加入广发基金管理有限公司，历任研究员、经理；2015年5月13日起任本基金基金经理。牛兴华先生具有13年证券从业经验，其中7年基金管理经验。

王东杰 本基金的基金经理 2015年5月13日 - 7

硕士，2008年7月至2012年1月在海通证券资产管理有限公司工作，历任研究员、经理；2012年5月加入广发基金管理有限公司，历任研究员、经理；2015年5月13日起任本基金基金经理。王东杰先生具有7年证券从业经验，其中5年基金管理经验。

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，严守了基金法、《证券法》、《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定和《建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

4.3 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，根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售行为规范导则》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《公开募集证券投资基金公平交易管理办法》、《利益冲突防范办法》等风险管理规定，公司使用的交易系统中设置了公平交易机制。

4.4 银证转账交易的说明

本基金通过银证转账交易进行资金划拨，具体操作流程参见《银证转账协议书》。

4.5 报告期内本基金参与的所有投资组合的交易公开披露情况、公平交易原则的执行情况及公平交易制度的执行情况

本基金报告期内所有投资组合的交易公开披露情况、公平交易原则的执行情况及公平交易制度的执行情况参见“4.1 公平交易制度的执行情况”。

4.6 报告期内基金的停牌股票

本基金报告期内没有处于停牌状态的股票。

4.7 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报期内，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

利益，严守了基金法、《证券法》、《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定和《建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

4.8 公开披露基金净值信息的说明

为了向投资人提供公开、公平、公正的信息披露服务，本基金通过指定网站、报刊、电视、广播、电台、互联网等媒介披露基金净值信息。

4.9 报告期内基金投资组合类别的前五名

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 47,913,577.06 1.04

2 基金投资 47,913,577.06 1.04

3 固定收益投资 236,773,108.33 9.08

4 货币市场基金 236,773,108.33 9.08

5 金融衍生品投资 - -

5.1 投资组合报告

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 3,962,900.33

2.本期利润 3,962,900.33

3.加权平均基金份额净值 2,581,837.4063

4.期末基金份额净值 2,581,837.4063

5.期末总资产净值 1.061

注:1.本基金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，本期期间为本期前三项收入加上期间公允价值变动损益。

2.本期利润不包括持有人认购或申购基金时产生的费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.1 本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的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩基准收益率(%) 业绩基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0234% 0.0006% 0.0240% 0.0000% 0.0431% 0.0067%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变化的比较

注:1.本基金合同于2015年5月13日生效，截至报告期末未满一年。

2.本基金建仓期为6个月，建仓期结束后各项资产配置比例符合合同相关规定。

3.4 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

牛兴华 本基金的基金经理 2014年6月17日 -

博士，2008年6月加入广发基金管理有限公司，担任定量研究员、专户理财研究员、基金经理助理、基金经理，现任本基金基金经理。牛兴华先生具有13年证券从业经验，其中7年基金管理经验。

王东杰 本基金的基金经理 2014年6月17日 -

硕士，2008年7月至2012年1月在海通证券资产管理有限公司工作，历任研究员、经理；2012年5月加入广发基金管理有限公司，历任研究员、经理；2015年5月13日起任本基金基金经理。王东杰先生具有7年证券从业经验，其中5年基金管理经验。

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

利益，严守了基金法、《证券法》、《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定和《建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

4.3 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，根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售行为规范导则》、《证券投资基金销售适用性管理办法》、《公开募集证券投资基金公平交易管理办法》、《利益冲突防范办法》等风险管理规定，公司使用的交易系统中设置了公平交易机制。

4.4 银证转账交易的说明

本基金通过银证转账交易进行资金划拨，具体操作流程参见《银证转账协议书》。

4.5 报告期内本基金参与的所有投资组合的交易公开披露情况、公平交易原则的执行情况及公平交易制度的执行情况

本基金报告期内所有投资组合的交易公开披露情况、公平交易原则的执行情况及公平交易制度的执行情况参见“4.1 公平交易制度的执行情况”。

4.6 报告期内基金的停牌股票

本基金报告期内没有处于停牌状态的股票。

4.7 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报期内，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

利益，严守了基金法、《证券法》、《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定和《建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

4.8 公开披露基金净值信息的说明

为了向投资人提供公开、公平、公正的信息披露服务，本基金通过指定网站、报刊、电视、广播、电台、互联网等媒介披露基金净值信息。

4.9 报告期内基金投资组合类别的前五名

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 47,913,577.06 1.04

2 基金投资 47,913,577.06 1.04

3 固定收益投资 236,773,108.33 9.08

4 货币市场基金 236,773,108.33 9.08

5 金融衍生品投资 - -

5.1 投资组合报告

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 3,962,900.33

2.本期利润 3,962,900.33

3.加权平均基金份额净值 2,581,837.4063

4.期末基金份额净值 2,581,837.4063

5.期末总资产净值 1.061

注:1.本基金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，本期期间为本期前三项收入加上期间公允价值变动损益。

2.本期利润不包括持有人认购或申购基金时产生的费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.1 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变化的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩基准收益率(%) 业绩基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0234% 0.0006% 0.0240% 0.0000% 0.0431% 0.0067%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变化的比较

注:1.本基金合同于2015年5月13日生效，截至报告期末未满一年。

2.本基金建仓期为6个月，建仓期结束后各项资产配置比例符合合同相关规定。

3.4 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

牛兴华 本基金的基金经理 2014年6月17日 -

博士，2008年6月加入广发基金管理有限公司，担任定量研究员、专户理财研究员、基金经理助理、基金经理，现任本基金基金经理。牛兴华先生具有13年证券从业经验，其中7年基金管理经验。

王东杰 本基金的基金经理 2014年6月17日 -

硕士，2008年7月至2012年1月在海通证券资产管理有限公司工作，历任研究员、经理；2012年5月加入广发基金管理有限公司，历任研究员、经理；2015年5月13日起任本基金基金经理。王东杰先生具有7年证券从业经验，其中5年基金管理经验。

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

利益，严守了基金法、《证券法》、《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定和《建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

4.3 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，根据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作