建信环保产业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: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	建信环保产业股票
基金主代码	001166
交易代码	001166
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月22日
报告期末基金份额总额	5,277,466,195.64份
投资目标	本基金为股票型基金,在有效控制风险前提下,精选优质的为环境保护提供助力的上市公司,力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率×80%+中债综合指数收益率(全价)×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。
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

§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	-65,605,778.62
2.本期利润	638,669,711.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.1170
4.期末基金资产净值	4,645,747,679.24
5.期末基金份额净值	0.880

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。

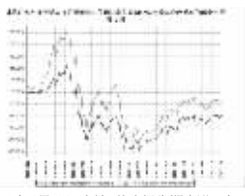
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	14.88%	1.49%	18.71%	1.60%	-3.83%	-0.11%

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、本基金基金合同于2015年4月22日生效,截止报告期未满一年。

2、本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§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	说明
		任职日期	离任日期		
姜锋	本基金的基金经理	2015年4月22日	-	8	硕士。2007年7月加入本公司,从事行业研究,任研究员。2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理,该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力混合型证券投资基金(LOF),姜锋继续担任该基金基金经理;2014年3月21日起任建信健康民生混合型证券投资基金基金经理;2015年4月22日起任建信环保产业股票基金基金经理。

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《建信环保产业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

2015年4季度市场大幅反弹,各主要指数在经历了3季度的股灾后均出现不同程度的反弹。经济方面,国内经济继续下行,美国经济一枝独秀;政策方面,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季度基于对政策、经济基本面和企业盈利的判断,结合市场的估值水平,重点配置了环保相关行业和公司,积极参与了新兴板块的反弹。

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14.88%,波动率1.49%,业绩比较基准收益率18.71%,波动率1.6%。

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,美国经济保持波动回升态势,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;欧洲经济步履蹒跚;国内经济在供给侧政策的引导下有望缓慢企稳,但人民币汇率的波动和需求的疲弱仍将限制经济复苏的步伐。注册制背景下,资本市场面临大扩容,交易品类的丰富需要动态研究和评估。

本基金2016年1季度在控制系统性风险的前提下积极寻找受益于政策放松的低估值蓝筹行业和公司;本基金将主要围绕环保及环保相关行业进行配置,同时积极参与其他板块的投资机会。

§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	3,810,620,733.92	81.70
	其中:股票	3,810,620,733.92	81.70
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	760,200,605.81	16.30
8	其他资产	93,611,264.30	2.01
9	合计	4,664,432,604.03	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	112,725,105.28	2.43
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,872,236,857.15	40.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	790,052,934.78	17.01
E	建筑业	218,029,214.66	4.69
F	批发和零售业	44,036,739.80	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	66,218,575.98	1.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	127,639,672.66	2.75
J	金融业	-	-
K	房地产业	70,223,944.07	1.51
L	租赁和商务服务业	138,656,815.92	2.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	370,800,873.62	7.98
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	3,810,620,733.92	82.02

注:以上行业分类以2015年12月31日的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	002236	大华股份	5,884,794	217,148,898.60	4.67
2	002665	首航节能	5,347,263	163,091,521.50	3.51
3	600886	国投电力	17,065,300	142,495,255.00	3.07
4	601888	中国国旅	2,337,832	138,656,815.92	2.98
5	002630	华西能源	8,932,638	131,935,063.26	2.84
6	300070	碧水源	2,500,000	129,425,000.00	2.79
7	300285	国瓷材料	2,573,454	117,092,157.00	2.52
8	600900	长江电力	8,116,650	110,061,774.00	2.37
9	002450	康得新	2,862,441	109,059,002.10	2.35
10	600674	川投能源	10,034,400	107,970,144.00	2.32

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

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。

5.11.2

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	3,940,112.59
2	应收证券清算款	89,527,266.24
3	应收股利	-
4	应收利息	61,318.80
5	应收申购款	82,566.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	93,611,264.30

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中未存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	5,641,799,483.44
报告期期间基金总申购份额	55,326,517.94
减:报告期期间基金总赎回份额	419,659,805.74
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	5,277,466,195.64

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环保产业股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信环保产业股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信环保产业股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信环保产业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

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

【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	建信沪深300指数(LOF)
场内简称	建信300
基金主代码	165309
交易代码	165309
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2009年11月5日
报告期末基金份额总额	457,322,875.93份
投资目标	本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
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%×商业银行税后活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
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

§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	11,384,041.42
2.本期利润	79,396,522.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.1683
4.期末基金资产净值	502,977,003.02
5.期末基金份额净值	1.0998

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。

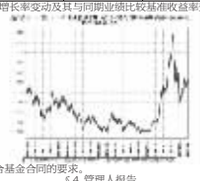
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	17.50%	1.64%	15.65%	1.59%	1.85%	0.05%

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	2009年11月5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《建信沪深300指数型证券投资基金(LOF)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

四季度A股企稳后市场持续恢复,秋季反弹出现后至高点,上证综指修复20%,创业板指修复40%;9月底至年底二者分别反弹16%、30%。从全年来看,2015年成长风格领涨,新兴与转型是市场热点:涨幅靠前的行业包括TMT和转型为主的纺织服装,轻工制造;跌幅靠前的主要是金融、有色、钢铁、煤炭等传统行业。从行风分析来看,15年沪深300指数小幅上涨5.6%,其中盈利的正面贡献覆盖了估值的负面贡献。

本基金在报告期内提升了股票仓位并一直保持在较高的仓位水平,在报告期内完成了本基金的建仓。个股方面,采取自下而上精选个股的投资策略,重点配置企业盈利增长较快、估值安全边际相对较高的个股,主要分布在互联网+、TMT、医药、消费等前景良好的板块,获得了一定的相对收益。

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25.07%,波动率2%,业绩比较基准收益率15.33%,波动率1.38%。

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16年1季度,预计宏观经济窄幅波动,中观层面资源品仍将处于底部,周期制造分化,消费品则相对稳定。GDP增速结构方面,第一产业稳定,第二产业仍有下行压力,第三产业自14年出现上行趋势。三驾马车中,进出口拉动作用较小,投资和消费基本持平。宏观经济从增量模式转入存量模式:经历三期叠加到新常态,再到波动收敛,结构问题凸显下的供给侧改革模式。

流动性方面整体不悲观,但边际变化需谨慎。M1、M2数据维持较高增长,但对宏观经济的带动并不强势,考虑整体经济的下行可能和结构性改革托底需求,预计未来流动性整体仍将保持宽松态势,且在外汇占款下行的背景下,货币主要来源变成央行通过公开市场的主动投放。总体来看宏观流动性继续宽松但边际作用减弱,关注政策重心的变化。利率水平的下行是趋势,但对估值的支撑可能不及预期。股市的资金供需处于紧平衡。

估值方面:截至2015年底,创业板静态估值约106倍,中小板约67倍,全部A股约25倍。市场的整体估值并不低,但也与目前的宽松流动性环境基本匹配。

整体来看,一季度市场可能出现宽幅震荡的格局。由于本基金已度过建仓期,未来股票仓位将按照基金合同的要求维持在80%以上,因此本基金的运作重点将放在精选个股上。本基金坚持认为经济扎实回归发展前景良好的真成长公司将会走出良好的股价表现,未来将继续重点布局互联网加成长转型、互联网基础设施和相关应用等优质个股,同时兼顾周期股在供给侧改革政策带动下的投资机会,尽力为持有人创造超额回报。

§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	473,386,249.53	93.34
	其中:股票	473,386,249.53	93.34
2	固定收益投资	116,856.00	0.02
	其中:债券	116,856.00	0.02
	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	33,453,240.51	6.60
7	其他资产	222,810.92	0.04
8	合计	507,179,156.96	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	416,979.36	0.08
B	采矿业	16,279,033.35	3.24
C	制造业	151,368,756.57	30.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,123,739.24	4.00
E	建筑业	17,626,144.43	3.50
F	批发和零售业	12,431,020.61	2.47
G	交通运输、仓储和邮政业	17,877,583.66	3.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,791,435.64	5.92
J	金融业	158,408,572.29	31.49
K	房地产业	25,246,065.91	5.02
L	租赁和商务服务业	4,838,127.90	0.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,939,965.61	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	577,914.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	8,417,666.83	1.67
S	综合	2,655,756.17	0.53
	合计	469,998,761.57	93.44

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。

5.2.2 报告期末积极投资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	51,777.00	0.01
B	采掘业	752,555.00	0.15
C	制造业	1,173,882.16	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	206,250.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,203,023.80	0.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	3,387,487.96	0.67

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

5.3.1 报告期末指数投资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	505,932	18,213,552.00	3.62
2	600016	民生银行	1,486,082	14,325,830.48	2.85
3	601166	兴业银行	641,202	10,945,318.14	2.18
4	600036	招商银行	536,383	9,649,530.17	1.92
5	000002	万 科A	367,678	8,982,373.54	1.79
6	600000	浦发银行	435,645	7,959,234.15	1.58
7	601288	农业银行	2,384,999	7,703,546.77	1.53
8	601328	交通银行	1,129,320	7,272,820.80	1.45
9	600030	中信证券	367,590	7,112,866.50	1.41
10	600837	海通证券	377,851	5,977,602.82	1.19

5.3.2 报告期末积极投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000839	中信国安	54,368	1,106,388.80	0.22
2	600259	广晟有色	17,200	681,120.00	0.14
3	002180	艾派克	7,100	327,665.00	0.07
4	002074	国轩高科	7,800	289,380.00	0.06
5	002366	台海核电	3,800	250,610.00	0.05

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	116,856.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	116,856.00	0.02

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	110031	航信转债	900	116,856.00	0.02

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

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体中,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日的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。

海通证券股份有限公司(600837)于2015年1月19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。公司因存在违规为到期融资融券合约展期问题,受到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28,653,000元,并处以85,959,000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	142,030.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,351.27
5	应收申购款	73,429.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	222,810.92

5.11.4 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	110031	航信转债	116,856.00	0.02

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资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	000002	万 科A	8,982,373.54	1.79	重大资产重组

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	486,525,986.04
报告期期间基金总申购份额	17,583,896.55
减:报告期期间基金总赎回份额	46,787,006.66
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	457,322,875.93

注:上述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沪深300指数证券投资基金(LOF)设立的文件;

2、《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金合同》;

3、《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)招募说明书》;

4、《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)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

建信互联网+产业升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:华夏银行股份有限公司
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。

基金托管人华夏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	建信互联网+产业升级股票
基金主代码	001396
交易代码	001396
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月23日
报告期末基金份额总额	2,428,260,292.66份
投资目标	本基金为股票型基金,在有效控制风险前提下,精选优质的互联网公司和应用新一代互联网技术实现产业升级的上市公司,力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+中债综合指数收益率(全价)×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,属于