建信改革红利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	建信改革红利股票
基金主代码	000592
交易代码	000592
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月14日
报告期末基金份额总额	130,324,388.59份
投资目标	我国全面深化改革将对经济和资本市场产生深远影响,改革红利的释放有望带来超额投资收益。本基金主要投资受益于全面深化改革的行业股票,包括受益于国企制度改革、户籍和土地制度改革以及资源要素价格改革等的相关行业上市公司,追求超越业绩比较基准的长期回报。
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,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。本基金主要投资受益于改革红利的相关行业,本基金将综合考虑国家经济政策、经济周期、各行业的相对估值水平和行业竞争格局等因素,进行股票资产在各行业间的配置。本基金坚持“自下而上”的个股选择策略,致力于选择具有竞争力比较优势、未来成长空间大、持续经营能力强的上市公司。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标。
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	中国农业银行股份有限公司

§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	25,206,065.43
2.本期利润	73,773,475.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.6062
4.期末基金资产净值	284,814,420.22
5.期末基金份额净值	2.185

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。

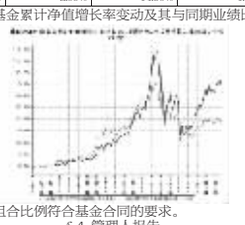
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	39.97%	2.09%	14.50%	1.42%	25.47%	0.67%

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		
陶灿	本基金的基金经理	2014年5月14日	-	8	硕士。2007年7月加入本公司,从事行业研究,历任研究员、基金经理助理。2011年7月11日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理;2014年5月14日起任建信改革红利股票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,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《建信改革红利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

四季度以来,市场整体呈现大幅上涨格局,风格上,中小创表现更加优异,市场从三季度大幅调整后出现显著反弹,表现抢眼的个股录得两倍涨幅。

从基本面看,四季度的宏观经济层面数据在弱势状态下呈现企稳格局,流动性方面,期间依然实施了降准降息操作,同时人民币在四季度还获得了IMF认可,纳入SDR体系,汇率在四季度也呈现较为稳定的走势,再加上前期投资者普遍仓位不高,这些都为四季度的上涨奠定了基础。

在四季度,本基金采取相对进取的策略,在仓位和结构上都积极应对市场的变化,取得了相对较好的结果。先求同、再存异;重对策、轻预测,是基金经理个人的操作思路,这种风格和思路将继续贯穿未来的投资。

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39.97%,波动率2.09%,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

展望16年一季度,供给侧改革成为热点,进一步优化经济结构,转变经济增长方式成为政府工作焦点。从实体经济看,传统产能的出清、去库存、去杠杆、降成本,难度不小,需要考验政府、企业定力和智慧、决心,毕竟这种做“减法”的改革,对利益相关方冲击较大,而补短板这种做“加法”的供给侧改革压力明显较小,补短板主要是加强战略新兴产业、现代服务业的发展,这在政府高层的讲话中也有体现。总体上,整个经济还处于改革转型阶段,企业效益依然维持弱势。而在货币政策、汇率、资本项目上,政府可能选择的独立货币政策、贬值趋势的汇率、加强的资本管制可能遭遇挑战,这种挑战来自于管理能力、复杂的外部环境上。从总体上而言,我们对一季度市场保持谨慎偏乐观的看法,在年初调整之后,收益也将出现。

§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	263,100,209.35	90.85
	其中:股票	263,100,209.35	90.85
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	21,058,855.66	7.27
8	其他资产	5,442,478.36	1.88
9	合计	289,601,543.37	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	39,537,715.26	13.88
B	采矿业	-	-
C	制造业	150,972,565.25	53.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,379,079.95	0.48
F	批发和零售业	7,464,992.00	2.62
G	交通运输、仓储和邮政业	13,433,015.00	4.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,331,815.53	6.44
J	金融业	6,315,908.70	2.22
K	房地产业	14,448,791.66	5.07
L	租赁和商务服务业	7,271,406.00	2.55
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	3,944,920.00	1.39
S	综合	-	-
	合计	263,100,209.35	92.38

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	600271	航天信息	275,413	19,681,012.98	6.91
2	002137	麦达数字	573,342	13,186,866.00	4.63
3	002086	东方海洋	428,163	12,673,624.80	4.45
4	600730	中国高科	528,862	9,218,064.66	3.24
5	600651	飞乐音响	572,096	8,438,416.00	2.96
6	002308	威创股份	339,200	8,361,280.00	2.94
7	600718	东软集团	266,404	8,271,844.20	2.90
8	002477	雏鹰农牧	483,041	8,168,223.31	2.87
9	002458	益生股份	215,003	8,127,113.40	2.85
10	002321	华英农业	613,500	8,104,335.00	2.85

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

本基金报告期内未投资于股指期货。

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	446,186.48
2	应收证券清算款	3,268,377.95
3	应收股利	-
4	应收利息	6,273.08
5	应收申购款	1,721,640.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,442,478.36

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	600271	航天信息	19,681,012.98	6.91	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	117,135,496.44
报告期期间基金总申购份额	82,807,117.39
减:报告期期间基金总赎回份额	69,618,225.24
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	130,324,388.59

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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	2,811,586.05
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	2,811,586.05
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.16

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改革红利股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信改革红利股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信改革红利股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信改革红利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

建信大安全战略精选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:中信证券股份有限公司
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。

基金托管人中信证券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	建信大安全战略精选股票
基金主代码	001473
交易代码	001473
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月29日
报告期末基金份额总额	121,932,684.91份
投资目标	本基金主要投资于同大安全主题相关的优质证券,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值和稳定回报。
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,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。本基金主要投资于同大安全主题相关的行业的优质证券,坚持“自下而上”的个股选择策略,选择投资标的,多维度认可标的价值,重点研究具有竞争力比较优势、未来成长空间大、持续经营能力强的上市公司。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标。
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	中信证券股份有限公司

§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	19,170,158.43
2.本期利润	36,934,548.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.2114
4.期末基金资产净值	139,115,514.38
5.期末基金份额净值	1.1409

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。

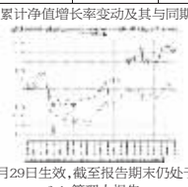
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	18.66%	1.85%	14.50%	1.42%	4.16%	0.43%

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:本基金基金合同于2015年7月29日生效,截至报告期末仍处于建仓期。

§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		
王东杰	本基金的基金经理	2015年7月29日	-	7	博士,2008年7月至2012年5月在高华证券有限责任公司工作,历任分析员、经理;2012年5月加入我公司,历任初级研究员、研究员、研究主管、基金经理,2015年5月13日起任建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年7月29日起任建信大安全战略精选股票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,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《建信大安全战略精选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

A股在经历了3季度的股灾后,4季度出现了明显的超跌反弹。上证综指上涨15.93%,创业板上涨30.32%。板块方面,所有行业全部上涨,表现较好的是股灾期间下跌较多的计算机、通信等板块,以及阶段性景气度较好的VR,IP等概念板块。

本基金在4季度初显著提升了股票配置比例,整个4季度均保持了较高的股票仓位,并集中配置了业绩确定性高,估值相对合理的个股。业绩与基准同步,取得了可观的正收益。

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18.66%,波动率1.85%,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

展望2016年,我们认为市场上涨阻力较大:1)国内经济依旧疲弱,改革进入深水区,不确定性加大;2)经过2012年以来的结构性牛市和全市场牛市,市场整体估值存在一定程度的泡沫;3)美联储加息,人民币贬值,市场交易结构变化等都会对市场产生影响。

操作方面,本基金会在1季度保持中等偏低的股票仓位,重点布局业绩确定性高、估值相对合理的个股,并关注以下几类机会:1)供给侧改革带来的周期行业机会;2)教育、VR等长期空间较大的行业;3)注册制来临前壳资源集中变现的机会。

§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	120,652,569.11	85.68
	其中:股票	120,652,569.11	85.68
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	16,806,843.90	11.94
8	其他资产	3,353,263.55	2.38
9	合计	140,812,676.56	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	12,059,141.00	8.67
B	采矿业	-	-
C	制造业	68,213,355.20	49.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,147,904.00	1.54
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,320,052.00	3.82
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	7,148,674.91	5.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	13,793,485.86	9.92
L	租赁和商务服务业	3,557,744.15	2.56
M	科学研究和技术服务业	2,213,813.11	1.59
N	水利、环境和公共设施管理业	6,198,398.88	4.46
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	120,652,569.11	86.73

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	600867	通化东宝	245,225	6,662,763.25	4.79
2	600730	中国高科	283,800	4,946,634.00	3.56
3	300203	聚光科技	141,200	4,841,748.00	3.48
4	300070	碧水源	90,044	4,661,577.88	3.35
5	002035	华帝股份	254,300	4,521,454.00	3.25
6	002089	新海宜	158,400	3,565,584.00	2.56
7	002400	省广股份	141,461	3,557,744.15	2.56
8	000488	晨鸣纸业	367,100	3,274,532.00	2.35
9	600382	广东明珠	200,300	3,176,758.00	2.28
10	002036	汉麻产业	99,300	3,058,440.00	2.20

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,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	402,620.83
2	应收证券清算款	2,897,841.28
3	应收股利	-
4	应收利息	4,142.88
5	应收申购款	48,658.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,353,263.55

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	242,923,059.75
报告期期间基金总申购份额	14,340,041.88
减:报告期期间基金总赎回份额	135,330,416.72
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	121,932,684.91

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大安全战略精选股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信大安全战略精选股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信大安全战略精选股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信大安全战略精选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

建信纯债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:中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人中国光大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	建信纯债债券	
基金主代码	530021	
交易代码	530021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月15日	
报告期末基金份额总额	1,541,693,998.79份	
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资人创造稳定的当期回报,并力争实现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债券投资组合。通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析,比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用特征的券种及债券与现金之间进行动态调整。	
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其风险和预期收益水平低于股票型基金、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	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信纯债债券A	建信纯债债券C
下属分级基金的交易代码	530021	531021
报告期末下属分级基金的份额总额	927,235,501.43份	614,458,497.36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)	
	建信纯债债券A	建信纯债债券C
1. 本期已实现收益	16,303,276.80	19,209,828.77
2. 本期利润	18,067,100.14	19,742,771.99
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0303	0.0264
4. 期末基金资产净值	1,099,336,457.00	719,443,234.41
5. 期末基金份额净值	1.186	1.171

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

建信纯债债券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	2.60%	0.07%	1.81%	0.08%	0.79%	-0.01%

建信纯债债券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	2.45%	0.08%	1.81%	0.08%	0.64%	0.00%

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,本基金投资比例符合基金合同要求。

§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		
黎颖芳	本基金的基金经理	2012年11月15日	-	15	硕士,2000年7月毕业于湖南大学金融保险学院,同年进入大成基金管理公司,在金融工程部、规划发展部任职。2005年11月加入本公司研究部,历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2009年2月19日至2011年5月11日任建信稳定增利债券型证券投资基金基金经理;2011年01月18日至2014年1月22日任建信保本混合型证券投资基金基金经理;2012年11月15日起任建信纯债债券型证券投资基金基金经理;2014年12月2日起任建信稳定得利债券基金基金经理;2015年12月8日起任建信稳定丰利债券基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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《建信纯债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