

建信安心回报定期开放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:中泰证券股份有限公司
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。

基金托管人和中国工商银行股份有限公司根据基金合同约定，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。

本报告中财务数据未经审计。

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	建信安心回报债券
基金主代码	000016
交易代码	000016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月14日
报告期末基金份额总额	192,029,791.42份
报告期末基金资产净值	70,414,212.09份

注:本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§ 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)	建信安心回报债券 A	建信安心回报债券 C
1.本期已实现收益	967,479.54	70,414,212.09	-
2.本期利润	1,000,310.05	1,343,007.00	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0203	0.0191	-
4.期末基金资产净值	99,129,009.46	81,072,842.20	-
5.期末基金份额净值	1.178	1.104	-

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将低于所列数字。

3.2 基金的净值表现

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

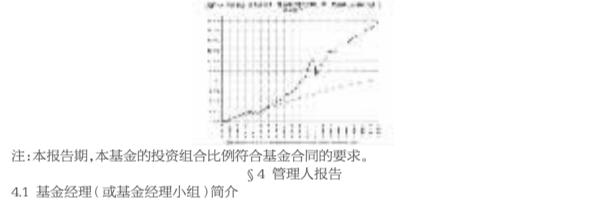
建信安心回报债券 C

阶段	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	1.75%	0.00%	0.40%	0.01%	1.35%	0.00%

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将低于所列数字。

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间	证券从业年限	说明
朱建华	本基金的基金经理	2013年6月14日	-	7

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》及其他有关法律法规的规定和《建信安心回报定期开放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

为了避免出现不正当关联交易、利益输送等违法犯规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金公司内部控制制度指引意见》、《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控制制度,制定了《公平交易管理制度》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理制度》及风险管理制度。公司使用的交易系统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,系统会自动启动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面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

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

在本基金报告期内,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》及其他有关法律法规的规定和《建信创新中国混合型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.3 公平交易制度的执行情况

为了避免出现不正当关联交易、利益输送等违法犯规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金公司内部控制制度指引意见》、《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控制制度,制定了《公平交易管理制度》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理制度》及风险管理制度。公司使用的交易系统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,系统会自动启动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面的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.5 管理人对宏观经济的展望

在本基金报告期内,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》及其他有关法律法规的规定和《建信创新中国混合型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.6 管理人对行业及市场的展望

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.7 管理人对估值方法的说明

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.8 管理人对流动性风险的专项说明

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.9 管理人对本基金定期报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.10 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.11 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.12 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.13 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.14 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.15 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.16 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.17 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.18 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.19 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.20 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.21 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.22 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.23 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.24 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.25 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.26 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.27 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.28 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.29 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.30 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.31 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.32 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.33 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.34 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.35 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.36 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。

4.4.37 管理人对基金年度报告的结论性意见

本基金报告期内未发现存在不公平交易、利益输送等违法犯规行为。