建信全球机遇混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

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
送出日期:2017年3月29日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2017年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信全球机遇混合（QDII）
基金主代码	539001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月14日
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
报告期末基金份额总额	22,717,377.09份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过全球化的资产配置和组合管理，在分散和控制投资风险的同时追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的资产配置与“自下而上”的证券选择相结合、定量研究与定性研究相结合、组合构建与风险控制相结合的投资策略进行投资组合的构建。
业绩比较基准	标准普尔全球BMI市场指数总收益率（S&P Global BMI）×70%＋标准普尔BMI中国（除A、B股）指数总收益率（S&P BMI China ex-A-B-Shares）×30%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴晓明	郭明
	联系电话	010-66228888	（010）66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	（010）66105798

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Principal Global Investors, LLC.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	信安环球投资有限公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	140 Broadway New York
办公地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	140 Broadway New York
邮政编码		IA 50392-0490	NY10005

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	636,503.99	8,053,987.83	33,969,065.81
本期利润	1,985,594.78	1,563,520.16	7,555,073.61
加权平均基金份额本期利润	0.0841	0.0441	0.0637
本期基金份额净值增长率	8.18%	-1.30%	6.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.1513	0.0639	0.0775
期末基金资产净值	26,154,540.46	25,741,472.02	68,302,019.16
期末基金份额净值	1.151	1.064	1.078

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、汇兑损益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上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、期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣抵未实现部分）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

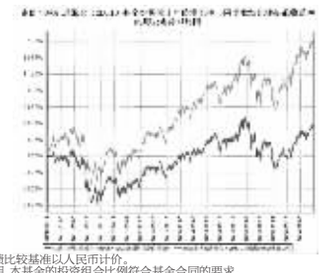
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.14%	0.49%	3.38%	0.52%	-0.24%	-0.03%
过去六个月	12.40%	0.53%	12.07%	0.56%	0.33%	-0.03%
过去一年	8.18%	0.78%	14.36%	0.81%	-6.18%	-0.03%
过去三年	13.18%	0.84%	26.10%	0.81%	-12.92%	0.03%
过去五年	44.42%	0.79%	72.64%	0.78%	-28.22%	0.01%
自基金合同生效起至今	15.10%	0.85%	57.57%	0.89%	-42.47%	-0.04%

1、本基金的业绩比较基准为:标准普尔全球BMI市场指数总收益率（S&P Global BMI）×70%＋标准普尔BMI中国（除A、B股）指数总收益率（S&P BMI China ex-A-B-Shares）×30%。标准普尔全球市场指数（S&P Global BMI）是市场中首只采用自由流通市值进行加权的全市场指数。该指数覆盖全球47个市场的12,000多家上市公司，其中包括26个发达市场和21个发展中市场;涵盖全球上市股票约7%的市值，在国际上被广泛采用为有关投资产品的业绩基准。

标准普尔BMI中国（除A、B股）指数（S&P BMI China ex-A-B-Shares）是由标准普尔指数公司于2007年11月15日推出的标准普尔DOW JONES系列指数之一，旨在为中国境内合格机构投资者（QDII）在海外资本市场进行投资提供广泛的市场比较基准和投资方案。该指数反映在香港证券市场、美国证券市场、新加坡证券市场、日本证券市场上市的以外币计价的中国公司股票价格走势。

2、同期业绩比较基准以人民币计价。

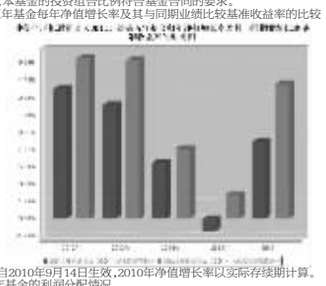
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



1、同期业绩比较基准以人民币计价。

2、本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本基金合同自2010年9月14日生效，2010年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

自基金合同生效以来，本基金未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、量化衍生品及海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北两个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至2016年12月31日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深300指数证券投资基金（LOF）、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信职极配置混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、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、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信瑞盛添利混合型证券投资基金、建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金共82只开放式基金，管理的公募基金资产规模共计为3770.62亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
赵英楷	量化衍生品及海外投资部总经理、本基金的基金经理	2011年4月20日	-	17	美国哥伦比亚大学商学院MBA，曾任美国美林证券公司研究员、高盛证券公司研究员、美林证券公司投资组合策略分析师、美国阿罗亚投资公司基金经理;2010年3月加入建信基金管理有限责任公司，历任海外投资部执行总监、总监，量化衍生品及海外投资部总监。2011年4月20日起任建信全球机遇混合基金基金经理，2011年6月21日起任建信新兴市场混合基金基金经理，2012年6月26日起任建信全球资源混合型证券投资基金基金经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职位	证券从业年限	说明
Christopher Ibach	投资组合经理	19	Christopher Ibach负责监督支持所有股票策略的全球研究&发展，包括全球量化研究、股票选择模型发展、投资组合构建和风险管理。他作为共同基金经理，专精于主动核心、机会型的和专业全球组合。Chris也监督公司的系统策略团队，负责被动增强和被动股票组合。他在2000年作为股票研究分析师加入公司，专精于分析国际科技公司并在2002年成为基金经理。在此之前，Chris在Motorola，Inc取得了6年的相关行业经验。Chris从University of Iowa获得了金融学MBA学位和电子工程学士学位。Chris获得了使用特许金融分析师称号的权利并且是CFA Institute的成员。
Mustafa Sagun	首席投资官	22	Mustafa Sagun是信安环球股票的首席投资官。他负责监督所有国际、国内和全球股票策略的投资组合管理和研究。Mustafa在2000年加入公司。他从2002年开始就担任全球股票组合的主管基金经理，而在2006年开始担任首席投资官。他之前也担任公司资产配置策略团队的成员。Mustafa的职业生涯开始于1991年，曾担任过投资管理，研究和风险管理的职位。在加入信安之前，他是PNC金融服务集团的副总裁和分析师和Salomon Brothers的股票衍生品专家。Mustafa从University of South Florida取得金融学Ph.D.学位和国际经济学MA学位。他从土耳其的Bogazici University取得电子和工程的学士学位。Mustafa获得了使用特许金融分析师称号的权利。他是CFA Institute和CFA Society of Iowa的成员。
王曦	投资组合经理	13	王曦在信安担任香港和中国投资组合的基金经理，他也是我们的高级投资分析师和大中华区研究团队负责人。王曦的金融职业生涯开始于中国银行总行，担任财务总监执行助理超过3年时间，也为该行IPO准备工作提供支持。王曦在2003年加入信安，担任香港和中国股票市场的基金经理以及亚洲和新兴市场策略的助理基金经理。作为全球研发团队的资深成员，王曦也负责我们全球研究平台（GRP）的模型搭建，特别是亚洲和大中华选股模型。他也曾在建设银行和信安的中国合资公司成立之初时任高级顾问。王曦在2008年离开信安，曾在中国平安资产管理公司（香港）担任股票投资总监，也曾任贝莱德亚洲的基金经理。王曦持有爱荷华大学Tippie管理学院的MBA学位，中国人民大学经济学和国际金融学士学位。他执有特许金融分析师（CFA）资格。

4.3 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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

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。

4.4.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下（日内、3日内、5日内）管理的不同投资组合（包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等）同向交易的交易价差从T检验（置信度为95%）、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下：

当时间窗为1日时，配了19338对投资组合，有4101对投资组合未通过T检验，其中1329对投资组合的正溢价率占优频率小于55%，其它2772对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中，其中1807对平均溢价率低于2%，其它965对平均溢价率超过2%的投资组合中，其中920对贡献率均未超过5%，另外45对溢价金额占组合净资产比例很小，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为3日时，配了20730对投资组合，有4694对投资组合未通过T检验，但其中822对投资组合的溢价率占优频率均小于55%，其它3872对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中，其中3601对平均溢价率低于5%，其它271对平均溢价率超过5%的投资组合中，有235对贡献率未超过5%，另外36对溢价金额占组合净资产比例很小，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为5日时，配了21350对投资组合，有5960对投资组合未通过T检验，但其中1162对投资组合的溢价率占优频率均小于55%，其它4798对正溢价率占优频率大于55%的投资组合，其中4709对平均溢价率低于10%，其它289对平均溢价率超过10%的投资组合中，有90对贡献率均未超过5%，另外9对溢价金额占组合净资产比例很小，同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.4.3 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2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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年全球股票市场既充满了悬念与黑天鹅，也带来了惊喜，在上半年经历较大幅度的震荡后，理性和良好的经济基本面在下半年回归主导。

美联储于15年12月开始了金融危机来的首次加息，随后美联储副主席对16年加息次数的指引（4次）大大超出了市场预期，全球市场1月经历了大幅下跌。但美国经济在今年上半年的增长明显减速，首次加息后金融市场发生动荡，就业数据出现较大波动，导致美联储在四月和六月两个关键时点没有进行加息。同时在欧洲，围绕债长疲软和英国退欧的不确定性下，欧央行继续推行宽松政策扩大资产购买和负利率政策。在六月下旬英国公投确认退欧后，英资和欧洲银行股遭到大幅抛售，市场高度关注欧盟整合和全球化进程的民意支持度是否面临解体。市场开始相信发达国家央行将不得不继续延续宽松的货币政策来维持经济的增长。石油价格在2季度继续反弹在六月中达到50美元的高点，为新兴市场特别是巴西和俄罗斯等原材料出口国带来较大利好，受低油价重挫的经济得到一定恢复，股市大幅反弹，推动了新兴市场的总体表现。中国在供给侧改革和房地产市场复苏的推动下，投资和企业利润都有所向上提升，不确定性逐渐缓和，市场表现相对平稳。

上半年在美联储暂缓加息美元汇率平稳后，美国宏观经济先扬后抑，在6、7两月非农就业数据强劲后，8月新增就业又低于预期，导致美联储再一次暂缓9月加息的计划。中国经济平稳增长，企业盈利反弹，证伪了对硬着陆的担忧，对周期性行业盈利复苏预期和大宗商品价格提供了强劲支撑。石油价格和大宗商品价格稳定盘整，中国经济继续保持较好增长的环境下，新兴市场特别是巴西和俄罗斯等原材料出口国经济继续得到修复，受低油价重挫的经济得到一定恢复，股市也随全球市场盘整。

在中美全球两大经济体的良性共振带领下，第四季度全球宏观基本面总体表现优异。在多重利好因素的支持下，全球股票市场业绩提升，石油价格在欧佩克达成新一轮限产协议的鼓舞下向上突破了50美元/桶大关。在中国经济成功企稳，供给侧改革去落后产能的推动下，大宗商品系列全面复苏，需求旺盛。

美国宏观经济继续表现出良好态势，在10、11两月非农就业数据符合预期，制造业复苏有力。美国总统大选在11月下旬终于揭晓，特朗普“意外”当选美国下一届总统，市场迅速扭转原先对特朗普的负面观点，转向关注特朗普新政对振兴美国制造业和基础设施的良好预期，美欧股市持续超预期大涨，市场进一步调高了对美国未来经济增长的预期。美联储终于如市场预期水到渠成在12月中旬进行了08年金融危机后的第二次加息，受坏财政和美联储加息的推动，美国长期国债收益率大幅反弹，资金大规模从债市流入股市。新兴市场方面，虽然经济基本面有所好转，但美元指数上涨、美联储加息等因素造成资金回流成熟市场，主要新兴市场国家货币出现一定程度贬值，股票市场也略有回调。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本年度本基金净值增长率8.18%，波动率0.78%，业绩比较基准收益率14.36%，波动率0.81%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年，我们认为美中两大经济体的宏观经济态势将继续驱动全球资本市场的起伏。美联储今年的加息步调将主导全球利率和流动性预期，并在全球资本市场传导。特朝普新政府的财经团队还没有完成组建，新政府的财政、税收政策如何兑现竞选承诺，尤为市场关注，并将主导市场对美国企业盈利的预期。在中国方面，我们预期供给侧改革，过剩行业产能等结构化改革与转型会继续为中国经济注入活力，并对全球市场提供良好支撑。从目前市场情况分析，投资人对风险资产的偏好逐渐增强，对全球股票市场形成较好支持。另一方面，全球经济可能继续维持弱势增长，企业盈利增长较低，对市场有一定影响，尤其是美国脱欧后，欧洲经济和政治结构的未来发展状况尤其值得投资人关注。我们预计未来全球市场将维持震荡行情，结构性机会值得关注。我们将继续遵循一贯的价值投资理念，挑选具有核心竞争力、估值合理的投资标的，力争为投资人带来良好的超额收益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策;对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督;对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的改变等。估值委员会由公司分管估值业务的副总裁、督察长、投资总经理、研究总经理、风险管理总经理、运营总经理及监察稽核总经理组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的专业人员组成，数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题;提议基金估值调整的相关方案并进行论证;根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和检验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）。

自2015年3月26日起，公司按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值价格，对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)进行估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定，本基金本报告期内未达到进行利润分配的条件，未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，自2016年1月1日至2016年12月31日，本基金基金资产净值低于五千万元超过连续20个工作日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》（2014年8月8日生效）第四十一条的要求，现将该情况在本次报告中予以披露。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对建信全球机遇混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，建信全球机遇混合型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信全球机遇混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，建信全球机遇混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信全球机遇混合型证券投资基金2016年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司审计了后附的建信全球机遇混合型证券投资基金(原建信全球机遇股票型证券投资基金，以下简称“建信全球机遇混合基金”)的财务报表，包括2016年12月31日的资产负债表、2016年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注，并出具了普华永道中天审字(2017)第21922号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信全球机遇混合型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:			
银行存款		3,292,708.08	2,806,447.48
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		23,368,195.00	23,485,592.67
其中:股票投资		23,368,195.00	23,485,592.67
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		148.46	73.11
应收股利		19,246.11	4,771.58
应收申购款		10,876.90	98.43
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	4,198.05
资产总计		26,691,174.55	26,301,181.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		47,361.64	166,462.44
应付管理人报酬		38,163.04	38,248.64
应付托管费		7,420.60	7,437.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		443,688.81	347,560.97
负债合计		536,634.09	559,709.30
所有者权益:			
实收基金		22,717,377.09	24,195,128.55
未分配利润		3,437,163.37	1,546,343.47
所有者权益合计		26,154,540.46	25,741,472.02
负债和所有者权益总计		26,691,174.55	26,301,181.32

注:报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.151元，基金份额总额22,717,377.09份。

7.2 利润表

会计主体:建信全球机遇混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		2,930,300.75	2,885,518.71
1.利息收入		6,649.82	9,717.23
其中:存款利息收入		6,649.82	9,717.23
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,425,510.04	8,652,885.70
其中:股票投资收益		922,192.09	6,593,832.42
基金投资收益		-	1,072,358.26
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	51,598.98
股利收益		503,317.95	935,096.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		1,349,090.79	-6,490,467.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		145,956.56	711,211.53
5.其他收入（损失以“-”号填列）		3,093.54	2,171.92
减:二、费用		944,705.97	1,321,998.55
1. 管理人报酬		445,656.28	701,970.90
2. 托管费		86,655.40	136,494.34
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		56,018.37	131,411.65
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		356,375.92	352,121.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,985,594.78	1,563,520.16
减:所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,985,594.78	1,563,520.16

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:建信全球机遇混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	24,195,128.55	1,546,343.47	25,741,472.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,985,594.78	1,985,594.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,477,751.46	-94,774.88	-1,572,526.34
其中:1.基金申购款	4,377,175.36	311,897.30	4,689,072.66
2.基金赎回款	-5,854,926.82	-406,672.18	-6,261,599.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	22,717,377.09	3,437,163.37	26,154,540.46
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	63,386,551.95	4,915,467.21	68,302,019.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,563,520.16	1,563,520.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-39,191,423.40	-4,932,643.90	-44,124,067.30
其中:1.基金申购款	1,683,703.04	235,033.83	1,918,736.87
2.基金赎回款	-40,875,126.44	-5,167,677.73	-46,042,804.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	24,195,128.55	1,546,343.47	25,741,472.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

孙志晨 赵乐峰 丁颖

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 投资明细

7.4.1 基金基本情况

建信全球机遇混合型证券投资基金（原名为建信全球机遇股票型证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]982号《关于核准建信全球机遇股票型证券投资基金募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《建信全球机遇股票型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集681,859,858.00元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第232号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信全球机遇股票型证券投资基金合同》于2010年9月14日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为681,944,805.65份基金份额，其中认购资金利息折合84,947.65份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)，境外投资顾问为信安环球投资有限公司(Principal Global Investors, LLC)。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，建信全球机遇股票型证券投资基金于2015年8月8日公告后更名为建信全球机遇混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信全球机遇混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括股票和其他权益类证券、现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具。其中，股票及其他权益类证券包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、存托凭证、公募股票基金等。现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具，中长期政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币市场基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券，中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品等。本基金为混合型基金，投资组合中股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例不低于60%;现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具市值占基金资产的比例不高于40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金投资于境外上市的中国公司股票的股票投资组合称为“海外中国组合”，投资于其他上市公司股票的股票投资组合称为“全球(中国除外)组合”。其中，境外上市的中国公司是指在香港、美国、英国、新加坡等地上市的公司，这些公司注册于中国大陆境内，或者虽注册于中国大陆境外，但其主要控股股东或主要业务收入源自中国大陆。海外中国组合占本基金股票投资的目标比例为30%(比例范围0%-60%);全球(中国除外)组合占本基金股票投资的目标比例为70%(比例范围40%-100%)。本基金的业绩比较基准为标准普尔全球BMI市场指数总收益率(S&P Global BMI) X 70%＋标准普尔BMI中国(除A、B股)指数