建信双利策略主题分级股票型证券投资基金 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:招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。

基金托管人招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	建信双利分级股票		
场内简称	建信双利		
基金主代码	165310		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年5月6日		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	104,111,468.34份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011年6月8日		
下属分级基金的基金简称	建信双利	建信稳健	建信进取
下属分级基金的场内简称	建信双利	建信稳健	建信进取
下属分级基金的交易代码	165310	150036	150037
报告期末下属分级基金份额总额	99,994,846.34份	1,646,648.00份	2,469,974.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过自上而下的方式,通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析,深入挖掘上述趋势将以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题,在前述主题筛选和主题配置的基础上,本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具,采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。
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%×商业银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。 从本基金所分离的两类基金份额来看,建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额;建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。	建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额。	建信进取份额将表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴剧明	张燕
	联系电话	010-66228888	0755-83199084
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95555
传真		010-66228001	0755-83195201

2.4 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	-20,307,212.92	197,163,541.40	104,839,735.99
本期利润	-19,874,246.39	93,652,292.50	91,986,098.92
加权平均基金份额本期利润	-0.1393	0.4062	0.1688
本期基金份额净值增长率	-7.99%	22.06%	23.80%
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	0.4236	0.5476	0.2917
期末基金资产净值	136,706,703.42	245,197,870.69	453,182,351.64
期末基金份额净值	1.313	1.454	1.217

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、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(已实现部分相抵未实现部分);

3、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。

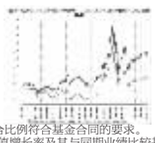
3.2 基金净值表现

3.2.1 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

3.1.1 期间数据和指标	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	1.08%	0.66%	1.67%	0.67%	-0.59%	-0.01%
过去六个月	4.54%	0.70%	4.72%	0.72%	-0.18%	-0.02%
过去一年	-7.99%	1.44%	-10.63%	1.33%	2.64%	0.11%
过去三年	39.02%	1.81%	40.46%	1.70%	-1.44%	0.11%
过去五年	74.62%	1.63%	39.91%	1.54%	34.71%	0.09%
自基金合同生效起至今	47.55%	1.56%	6.59%	1.51%	40.96%	0.05%

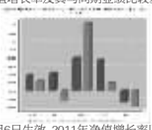
本基金投资业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。其中:沪深300指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准,商业银行活期存款利率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数,它是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。指数样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值。成份股为市场中市场代表性好,流动性高,交易活跃的主流投资股票,能够反映市场主流投资的收益情况。

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



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



本基金基金合同于2011年5月6日生效,2011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

根据本基金基金合同的相关规定,本基金不进行收益分配,也不单独对建信稳健份额与建信进取份额进行收益分配。

§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[2006]150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,并在上海投立了子公司——建信资本管理有限责任公司。目成立以来,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、建信积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、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信创新中国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、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信中证500指数增强型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信嘉新宝货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信睿力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定睿利债券型证券投资基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信可转债债券型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、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、建信恒丰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、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿智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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁拱昀	金融工程及指数投资部总经理,本基金的基金经理	2015年3月25日	-	14	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,历任金融工程研究员、规划发展部产品设计师、机构理财高级经理。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9日至2016年7月20日任深证基本面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日至2016年10月26日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,信守规章,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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 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行办法》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》等风险控制制度。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 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《建信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226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89对平均溢价率超过10%的投资组合中,有80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。

4.3.3 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20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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期初,多种因素共同造成了市场的大幅下跌,之后,随着内外部环境逐渐转暖,市场出现反弹并变得比较活跃,虽然期间历经较大波动,但市场已经从年初的恐慌中恢复。临近报告期末,债券市场出现较大波动,并使股票市场亦发生明显波动。

在报告期内,本基金坚持比较均衡的配置策略,通过个股选择,努力兼顾组合收益率和波动率,力争取得相对于业绩比较基准的超额收益,并基本实现了预定目标。

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-7.99%,波动率1.44%,业绩比较基准收益率-10.63%,波动率1.33%。

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2017年,管理人认为,面对来自房地产价格、汇率、经济增长等多方面的压力,延续多年的货币政策是否会出现实质性调整,是影响全年市场趋势的重要因素。国际国内政治经济形势的发展变化,会在一定程度上加剧市场的波动。监管当局对股票IPO、再融资、金融衍生品等方面的市场改革的施行或调整,也会对市场的发展变化产生相应影响。

本基金属于主动投资的股票型基金,将会通过吸收投研团队的研究成果,优化组合配置,力争给持有人带来超额收益。

4.6 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、方法和流程的变更。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基金经理、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权验;根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校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《中证债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。

4.7 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,本基金不进行收益分配,也不单独对建信稳健份额与建信进取份额进行收益分配。

§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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,并格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全履职尽地履行了应尽职的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了后附的建信双利策略主题分级股票型证券投资基金(以下简称“建信双利分级股票基金”)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(2016)第21889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:建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

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		11,689,240.80	19,984,247.04
结算备付金		627,939.84	1,144,324.60
存出保证金		47,747.72	71,857.66
交易性金融资产		127,249,150.00	227,104,004.34
其中:股票投资		127,249,150.00	227,104,004.34
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		2,809.52	5,060.25
应收股利		-	-
应收申购款		3,534.69	48,739.16
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		139,620,422.57	248,358,233.05
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		3,400.33	-
应付赎回款		72,431.27	82,214.41
应付管理人报酬		179,918.58	313,684.85
应付托管费		29,986.42	52,280.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,170,682.83	2,356,280.10
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		457,299.72	356,902.19
负债合计		2,913,719.15	3,160,362.36
所有者权益:			
实收基金		92,601,653.02	152,838,085.30
未分配利润		44,105,050.40	92,359,785.39
所有者权益合计		136,706,703.42	245,197,870.69
负债和所有者权益总计		139,620,422.57	248,358,233.05

报告截止日2016年12月31日,基金份额总额104,111,468.34份,其中建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健收益类份额的份额净值1.050元,基金份额总额1,646,648.00份;建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额的份额净值1.488元,基金份额总额2,469,974.00份;建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额的份额净值1.313元,基金份额总额99,994,846.34份。

7.2 利润表

会计主体:建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

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		-12,917,941.95	104,812,301.20
1.利息收入		122,780.82	196,757.25
其中:存款利息收入		122,780.82	196,757.25
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)		-13,487,778.81	208,023,133.06
其中:股票投资收益		-16,675,328.79	204,563,998.87
基金投资收益		-	-
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		-	-
股利收益		3,187,549.98	3,459,134.19
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		432,966.53	-103,511,248.90
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		14,089.51	103,659.79
减:二、费用		6,956,304.44	11,160,008.70
1. 管理人报酬		2,694,286.13	4,776,652.40
2. 托管费		449,047.64	796,108.83
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		3,368,756.28	5,134,357.12
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		444,214.39	452,890.35
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-19,874,246.39	93,652,292.50
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-19,874,246.39	93,652,292.50

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

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)	152,838,085.30	92,359,785.39	245,197,870.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-19,874,246.39	-19,874,246.39
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)	-60,236,432.28	-28,380,488.60	-88,616,920.88
其中:1.基金申购款	7,653,440.45	2,884,779.75	10,538,220.20
2.基金赎回款	-67,889,872.73	-31,265,268.35	-99,155,141.08
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)	92,601,653.02	44,105,050.40	136,706,703.42

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)	344,590,635.27	108,591,716.37	453,182,351.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	93,652,292.50	93,652,292.50
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)	-191,752,549.97	-109,884,223.48	-301,636,773.45
其中:1.基金申购款	23,531,774.03	12,675,093.77	36,206,867.80
2.基金赎回款	-215,284,324.00	-122,559,317.25	-337,843,641.25
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)	152,838,085.30	92,359,785.39	245,197,870.69

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 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信双利策略主题分级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[2011]355号《关于核准建信双利策略主题分级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(以下简称“建信基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双利策略主题分级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人民币2,973,543,800.59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(2011)第161号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》于2011年5月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,974,508,248.97份基金份额,其中认购资金利息折合9964,448.38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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额(以下简称“建信双利基金份额”)、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“建信稳健份额”)及建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额(简称“建信进取份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售建信双利基金份额。投资人场外认购所得的建信双利基金份额,不进行百动分离或分拆。投资人场内认购所得的建信双利基金份额,将按4:6的基金份额配比日动分离为建信稳健份额和建信进取份额。建信稳健份额和建信进取份额的数量保持4:6的比例不变。基金合同生效后,建信双利基金份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回,但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下,建信稳健份额和建信进取份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内建信双利基金份额与建信稳健份额和建信进取份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换,包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每10份场内建信双利基金份额按照4:6的份额配比转换成4份建信稳健份额与6份建信进取份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每4份建信稳健份额与6份建信进取份额按照4:6的基金份额配比转换成10份场内建信双利基金份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算:建信双利基金份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数,其中基金份额总数为建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额数量的总和。本基金每4份建信稳健份额与每6份建信进取份额构成一对份额组合,该份额组合的基金份额参考净值之和等于10份建信双利基金份额的基金份额净值之和。建信稳健份额的约定年收益率逐日计算,计算出建信稳健份额的基金份额参考净值后,根据建信双利基金份额的基金份额净值与建信稳健份额、建信进取份额之间的基金份额参考净值关系,可以计算出建信进取份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日,本基金将进行基金的定期份额折算:定期份额折算后建信稳健份额的基金份额参考净值调整为1.000元,基金份额折算基准日折算前建信稳健份额的基金份额参考净值超出1.000元的部分将折算为场内建信双利基金份额分配给建信稳健份额持有人。建信双利基金份额持有人持有的每10份建信双利基金份额将按4份建信稳健份额获得新增建信双利基金份额的分配。持有场外建信双利基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外建信双利基金份额的分配;持有场内建信双利基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内建信双利基金份额的分配。经过上述份额折算后,建信双利基金份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后,建信稳健份额和建信进取份额的份额配比保持4:6的比例。建信进取份额不参与定期份额折算,每次定期份额折算不改变建信进取份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上定期份额折算外,当建信双利基金份额的基金份额净值大于或等于2.000元时,或当建信进取份额的基金份额参考净值小于或等于0.200元时,本基金将以该日后的次一交易日为本基金不定期折算基准日,进行不定期份额折算:份额折算启本基金将确保建信稳健份额和建信进取份额的比例为4:6,份额折算后建信稳健份额的基金份额参考净值、建信进取份额的基金份额参考净值和建信双利基金份额的基金份额参考净值和建信双利基金份额的基金份额净值均调整为1.000元。当建信双利基金份额的基金份额净值大于或等于2.000元时,基金份额折算基准日折算前建信双利基金份额的基金份额净值及建信稳健份额、建信进取份额的基金份额参考净值超出1.000元的部分均将折算为建信双利基金份额分别分配给建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额的持有人。当建信进取份额的基金份额参考净值小于或等于0.200元时,建信双利基金份额、建信稳健份额和建信进取份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2011]168号核准,本基金建信稳健份额37,344,064.00份基金份额与建信进取份额56,016,098.00份基金份额于2011年6月8日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的建信双利基金份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为建信稳健份额和建信进取份额即可上市流通;对于托管在场外的建信双利基金份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为建信稳健份额和建信进取份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票投资比例范围为基金资产的90%-95%,权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%;固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的5%-10%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基