建信创新中国混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

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	建信创新中国混合
基金主代码	000308
交易代码	000308
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月24日
报告期末基金份额总额	27,772,826.50份
投资目标	在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值，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	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测，在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金属于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。
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	9,874,263.19
2.本期利润	12,758,063.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.5065
4.期末基金资产净值	61,645,531.17
5.期末基金份额净值	2.220

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	30.90%	1.97%	13.17%	1.25%	17.73%	0.72%

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		
邵卓	本基金的基金经理	2015年5月22日	－	8	硕士，2006年4月至2006年12月任明基（西门子）移动通信研发中心软件工程师；2007年2月至2010年7月任IBM中国软件实验室软件工程师；2010年7月加入广发证券公司，任计算机行业研究员，2011年9月加入我公司，历任研究员、研究主管、基金经理，2015年3月24日起任建信信息产业股票基金经理；2015年5月22日起任建信创新中国混合基金基金经理。

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《建信创新中国混合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

四季度宏观经济继续延续弱势，从数据来看，工业生产方面，11月工业增加值同比增长6.2%，较10月有一定回升；投资方面，前11月固定资产投资累计同比增长10.2%，与前10月持平，其中制造业累计同比增速8.4%，比前值的8.3%回升0.1%，基建投资累计增速18%，比上月的17.4%回升0.6%；而房地产投资继续下滑，不过地产销售增速再度出现改善，11月100城市土地出让收入也出现改善，由于销售和融资的好转，房地产企业到位资金也连续4个月改善；消费方面，11月名义消费当月同比11.17%也略有回升；进出口方面，进口数据有一定改善，11月增速下滑8.7%降幅有所收窄，而出口数据则连续九个月负增长，对美日欧的出口恶化。

货币政策方面，央行货币政策操作仍然偏向宽松，四季度央行进行“双降”操作，下调法定存款准备金率0.5个百分点，下调存贷款基准利率各25基点，“双降”操作将有助于进一步降低社会融资成本，减轻企业财务压力。

2015年四季度A股市场稳步上涨，创业板涨幅明显超过主板，计算机通信电子等行业涨幅居前，房地产行业也有较好表现。截至2015年12月31日，券商两融余额11743亿元，伴随股市走高比四季度初的9224亿元有所增长。

建信创新中国基金在2015年四季度大部分时间保持中等仓位，采取较为稳健的组合策略，在具体的配置上，聚焦行业与个股，淡化宏观经济的影响，尽力为投资者寻求穿越经济周期的成长性行业和价值低估个股，谋求超额收益。

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30.9%，波动率1.97%，业绩比较基准收益率13.17%，波动率1.25%。

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，经济仍面临一定的下行压力，PPI仍严重通缩，目前企业库存增速维持低位，但是去产能并未大规模展开，随着企业经营的进一步恶化以及供给侧结构改革的推进，2016年企业去产能很可能加速，并伴随着信用风险的释放；物价方面，经济下行态势下明年全年CPI压力不大。货币政策方面16年预计依旧在维持偏松局面。

2016年的A股市场投资面临较大的挑战，海外美元加息、国内人民币汇率、供给侧改革等方面都可能带来系统性风险的冲击；同时“资产荒”局面下只要股市下跌到一定程度，股票权益市场对全社会资本的配置性需求来说，就仍然具有吸引力。因此2016年将是机会和挑战并存的一年，但挑战将比过去3年更大。

§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	51,943,625.76	81.96
	其中：股票	51,943,625.76	81.96
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	9,658,919.62	15.24
8	其他资产	1,774,006.96	2.80
9	合计	63,376,552.34	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	3,445,468.00	5.59
B	采矿业	－	－
C	制造业	27,058,520.48	43.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	339,108.00	0.55
E	建筑业	2,450,160.00	3.97
F	批发和零售业	6,773,678.00	10.99
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	10,118,887.68	16.41
J	金融业	－	－
K	房地产业	1,427,937.00	2.32
L	租赁和商务服务业	－	－
M	科学研究和技术服务业	329,866.60	0.54
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	51,943,625.76	84.26

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	600485	信威集团	103,400	2,765,950.00	4.49
2	000998	隆平高科	109,800	2,607,750.00	4.23
3	600477	杭萧钢构	199,200	2,450,160.00	3.97
4	600718	东软集团	78,600	2,440,530.00	3.96
5	000593	大通燃气	138,900	1,990,437.00	3.23
6	300113	顺网科技	18,800	1,905,756.00	3.09
7	600855	航天长峰	46,500	1,845,120.00	2.99
8	600372	中航电子	73,300	1,805,379.00	2.93
9	300400	劲拓股份	37,100	1,800,463.00	2.92
10	002308	威创股份	70,200	1,730,430.00	2.81

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	160,364.94
2	应收证券清算款	1,455,733.95
3	应收股利	－
4	应收利息	2,431.87
5	应收申购款	155,476.20
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	1,774,006.96

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	23,356,365.53
报告期期间基金总申购份额	11,817,585.84
减：报告期期间基金总赎回份额	7,401,124.87
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	27,772,826.50

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基持有本金。

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创新中国混合型证券投资基金设立的文件；

2、《建信创新中国混合型证券投资基金基金合同》；

3、《建信创新中国混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信创新中国混合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

建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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。

基金托管人招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	建信安心回报两年定期开放债券
基金主代码	000346
交易代码	000346
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月5日
报告期末基金份额总额	197,830,278.00份
投资目标	在严格控制风险并保持较高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资收益，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。本基金在债券资产所提供的稳定收益的基础上，适当参与一级市场新股申购或增发新股，为基金份额持有人增加收益，实现基金资产的长期稳定增值。 本基金在综合分析宏观经济、货币政策等因素的基础上，采用久期管理、期限管理、类属管理和风险管理相结合的投资策略。在个券选择上，本基金将综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险分析、流动性分析等方法来评估个券的投资价值。
业绩比较基准	两年期银行定期存款收益率(税前)。
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	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信安心回报两年定期开放债券A　建信安心回报两年定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	000346　000347
报告期末下属分级基金的份额总额	35,738,466.78份　162,091,811.22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）	
	建信安心回报两年定期开放债券A	建信安心回报两年定期开放债券C
1. 本期已实现收益	3,827,709.98	3,949,685.29
2. 本期利润	1,125,077.84	1,192,853.16
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0146	0.0098
4. 期末基金资产净值	36,769,152.65	166,655,186.39
5. 期末基金份额净值	1.029	1.028

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

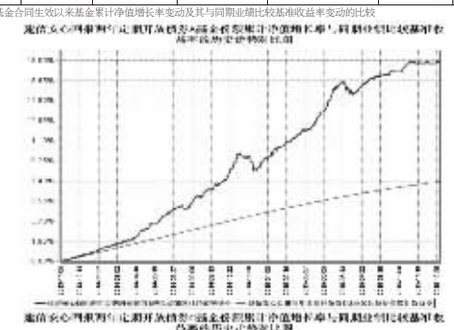
建信安心回报两年定期开放债券A

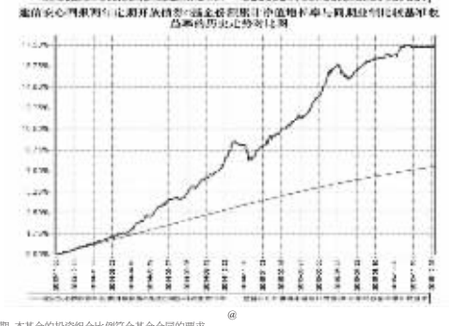
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.87%	0.05%	0.55%	0.01%	0.32%	0.04%

建信安心回报两年定期开放债券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	0.77%	0.05%	0.55%	0.01%	0.22%	0.04%

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		
彭云峰	本基金的基金经理	2013年11月5日	－	10	硕士。曾任中经网数据有限公司财经分析师、国都证券有限责任公司债券研究员兼宏观研究员，2006年5月起就职于鹏华基金管理公司，历任债券研究员、社保组合投资经理、债券基金经理等职，2010年5月31日至2011年6月14日任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理，彭云峰于2011年6月加入本公司，2011年11月30日至2013年5月3日任建信保本混合型证券投资基金基金经理；2012年2月17日至2014年1月21日任建信货币市场基金基金经理；2012年5月30日起任建信转债增强债券型证券投资基金基金经理；2013年7月25日起任建信双债增强债券型证券投资基金基金经理；2013年11月5日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2015年5月26日起任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金。

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《建信安心回报两年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年四季度，中国经济增速相对平稳，10—11月消费增速和工业增加值增速小幅回升，投资增速和出口增速有所回落，通胀水平保持在较低水平。为降低社会融资成本，稳定经济增速，央行于2015年10月24日降低存贷款基准利率和存款准备金率。12月中下旬召开的中央经济工作会议定2016年继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，推进供给侧结构性改革，主要抓好去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板五大任务。

四季度债券市场持续上涨，只在11月上旬出现小幅调整，各期限、各品种收益率都明显下降。四季度债券收益率曲线呈现平坦化下行态势，10年期国债收益率下行超过40bp，10年期国开债收益率下行超过50bp，短期国债收益率下行幅度较小，不到10bp；信用利差继续维持低位，期限利差较三季度有所收窄。四季度股票市场表现较好，以创业板为代表的成长类股票涨幅较大。由于可转债品种较少，且估值偏高，四季度可转债总体涨幅不大。

2015年四季度，本基金结束了第一个为期两年的投资周期，并开始第二个投资周期。为应对可能出现的大额赎回，本基金在10月下旬降低了债券投资比例。在12月初自由开放期结束之后逐步增加债券投资。由于基金规模较小，本基金主要投资交易所信用债和国债，便于加杠杆投资，由于可转债整体估值偏高，波动较大，本基金四季度对可转债的投资相对谨慎。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期安心回报两年A净值增长率0.87%，波动率0.05%，安心回报两年C净值增长率0.77%，波动率0.05%，业绩比较基准收益率0.55%，波动率0.01%。

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年一季度，我们认为中国经济增速可能会小幅回落，通胀仍将处于较低水平。由于目前存贷款基准利率已经降至较低水平，而且美联储逐步加息背景下人民币相对美元贬值压力加大，预计货币政策大幅放松的可能性不大，主要放松方式可能是小幅降低存款准备金率，以及通过公开市场操作等方式投放流动性。财政政策或会更加积极，对稳增长起更大作用。

基于以上判断，我们对2016年一季度债券市场相对乐观。由于供给侧改革可能加大对产能过剩行业的调整，预计相关行业信用风险将上升。我们对利率债和高等级信用债相对看好，对中低等级信用债则非常谨慎。由于债券收益率相对较低，以及债券发行量可能较多，预计2016年一季度债券收益率下行空间有限。

目前沪深300指数成分股总体估值相对合理，部分板块被低估。结构性改革有助于中国经济转型升级，将会对产能过剩行业带来积极变化。2014年以来货币政策相对宽松对经济的积极影响可能会逐步显现。基于以上原因，我们对一季度股票市场谨慎乐观，部分行业和个股可能存在看好的投资机会。一季度可转债市场可能发行和上市较多新品种，有助于改善可转债整体估值偏高的局面。

2016年一季度，本基金将坚持谨慎投资，稳中求进，追求绝对收益。本基金将把债券组合久期控制在相对较低水平，将杠杆比例保持在较高水平。本基金将主要投资剩余期限2年以内的信用债，少量投资2年以内的利率债，以交易所上市的品种为主。适度投资银行间市场2年以内的信用债和短期融资券。在安全性较强的情况下，本基金择机适度投资可转债，精选品种，灵活操作。根极申购新发可转债和可交换债。我们将密切关注债券市场、宏观经济形势，以及政策动态，积极调整投资组合。在控制风险的基础上，力争获取更多投资收益。

§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	－	－
	其中：股票	－	－
2	固定收益投资	216,689,486.37	96.46
	其中：债券	216,689,486.37	96.46
	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	786,376.74	0.35
7	其他资产	7,160,881.42	3.19
8	合计	224,636,744.53	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	48,613,244.40	23.90
2	央行票据	－	－
3	金融债券	70,048,004.10	34.43
	其中：政策性金融债	70,048,004.10	34.43
4	企业债券	47,541,245.50	23.37
5	企业短期融资券	30,153,000.00	14.82
6	中期票据	20,218,000.00	9.94
7	可转债	115,992.37	0.06
8	回业存单	－	－
9	其他	－	－
10	合计	216,689,486.37	106.52

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	018001	国开1301	700,410	70,048,004.10	34.43
2	1182003	11鲁黄金MTN1	200,000	20,218,000.00	9.94
3	011599798	15连云港SCP003	200,000	20,028,000.00	9.85
4	020082	15贴现08	141,230	13,966,234.70	6.87
5	041559001	15宏图CP001	100,000	10,125,000.00	4.98

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	25,335.21
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	7,135,546.21
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	7,160,881.42

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	138,800,771.11
报告期期间基金总申购份额	117,593,461.06
减：报告期期间基金总赎回份额	94,302,420.95
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	162,091,811.22

§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	－
报告期期间买入申购总份额	58,422,590.07
报告期期间卖出/赎回总份额	－
报告期期末管理人持有的本基金份额	58,422,590.07
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	29.53

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2015年12月2日	58,422,590.07	60,000,000.00	－
合计			58,422,590.07	60,000,000.00	

§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安心回报两年定期开放债券型证券投资基金设立的文件；

2、《建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》；

3、《建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信安心回报两年定期开放债券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

建信安心保本混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	建信安心保本混合
基金主代码	000270
交易代码	000270
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月3日
报告期末基金份额总额	274,647,105.06份
投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，寻求组合资产的稳定增长和保本周期收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略来实现保本和增值的目标，恒定比例投资组合保险策略不仅能从投资组合资产配置的水平上基本消除投资到期时基金净值低于本金的可能性，而且能在一定程度上使基金分享股市整体性上涨带来的收益。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率（税前）。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的中低风险品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金保证人	重庆市三峡担保集团有限公司

§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	18,513,323.88
2.本期利润	11,608,679.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.0408
4.期末基金资产净值	422,906,074.35
5.期末基金份额净值	1.540

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。

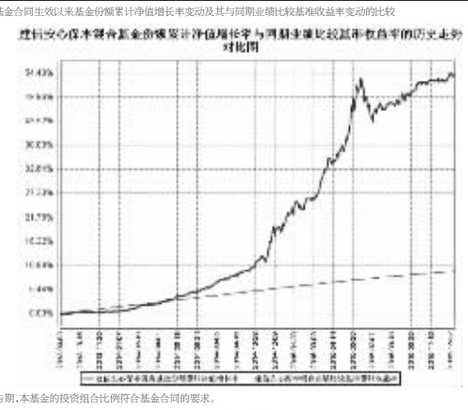
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.74%	0.20%	0.72%	0.01%	2.02%	0.19%

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



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		
钟敬棣	固定收益部首席固定收益投资官、本基金的基金经理	2013年9月3日	－	10	特许金融分析师（CFA），硕士，加拿大籍华人。1995年7月毕业于南开大学金融系，获经济学学士学位，2004年5月毕业于加拿大不列颠哥伦比亚大学，获工商管理硕士学位，曾先后任职于广东发展银行珠海分行、深圳发展银行珠海分行、嘉实基金管理有限公司等，从事外汇交易、信贷、债券研究及投资组合管理等工作。2008年5月加入建信基金管理公司，2009年6月2日至2011年5月11日任建信收益增强