# 建信嘉薪宝货币市场基金

## 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 | 建信嘉薪宝货币 |
| 基金主代码 | 000686 |
| 交易代码 | 000686 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年6月17日 |
| 报告期末基金份额总额 | 485,189,973.35份 |
| 投资目标 | 在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将采取个券选择策略、利率策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款利率(税前) |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。 |
| 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 | 3,952,909.33 |
| 2.本期利润 | 3,952,909.33 |
| 3.期末基金资产净值 | 485,189,973.35 |

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本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

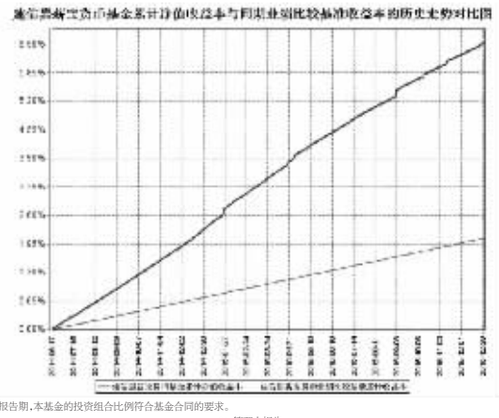
2.持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.8234% | 0.0067% | 0.3403% | 0.0000% | 0.4831% | 0.0067% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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 | | |
| 于倩倩 | 本基金的基金经理 | 2014年6月17日 | - | 7 | 于倩倩女士,硕士,2008年6月加入国泰人寿保险公司,任固定收益研究专员;2009年9月加入金元惠理基金管理公司(现金元比联基金管理公司),任债券研究员;2011年6月加入我公司,历任债券研究员、基金经理助理,2013年8月5日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财债券基金的基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币基金的基金经理。 |
| 陈建良 | 固定收益投资部总经理助理、本基金的基金经理 | 2014年6月17日 | - | 8 | 2005年6月加入中国建设银行厦门分行,任客户经理;2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部,任债券交易员;2013年9月加入我公司,历任基金经理助理、基金经理、固定收益投资部总监助理。2013年12月10日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信月盈安心理财基金基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币基金的基金经理。 |

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《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同》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

本基金本报告期净值收益率为0.8234%,波动率为0.0067%;业绩比较基准收益率为0.3403%,波动率为0.0000%。

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,全球经济大概率会在深化调整中保持低增长态势。中国目前仍处在动力转换的关键期,所以2016年在保持总需求稳定增长的同时,宏观调控的重点要转向结构性改革,更加重视发挥供给政策的作用,降低企业生产运营成本,提高企业生产效率和核心竞争力,促进增长新动力加快成长,为“十三五”开局奠定良好基础。

2016年的债牛基础仍未动摇,国内经济去杠杆会导致经济增速下行,投资回报收益中枢的下沉会为收益曲线的下移腾挪出空间,但是随着国内刚兑预期的逐渐打破,债市信用风险的爆发导致各评级债券的收益率出现一定分化,因此未来会谨慎配置高等级债券,不断加强信用债的筛选。另外美联储启动加息周期,中美利差会进一步拉大,资金向海外寻求投资机会可能成为常态,即资金流出将成为我国未来一段时间国内货币环境的一大特征,因此流动性问题仍需要注意。

2016年,该基金未来仍将保持稳健的投资风格,以存款和存单为主信用债投资为辅,在保证组合流动性的同时力争保证组合能够跟随市场的发展变化,为投资人获得合理的收益。

§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 | 固定收益投资 | 248,875,762.46 | 47.80 |
| | 其中:债券 | 248,875,762.46 | 47.80 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 261,266,479.45 | 50.18 |
| 4 | 其他资产 | 10,542,284.20 | 2.02 |
| 5 | 合计 | 520,684,526.11 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | | 11.96 |
| | 其中:买断式回购融资 | | 0.00 |
| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 34,999,747.50 | 7.21 |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 110 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 116 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 76 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 10.57 | 7.21 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | 14.42 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 2.05 | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 36.97 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 30.82 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 12.36 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 105.14 | 7.21 |

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 | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 59,983,227.76 | 12.36 |
| | 其中:政策性金融债 | 39,985,931.35 | 8.24 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 69,979,693.05 | 14.42 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 118,912,841.65 | 24.51 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 248,875,762.46 | 51.29 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 9,944,673.79 | 2.05 |

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 111510315 | 15兴业CD315 | 400,000 | 39,696,899.88 | 8.18 |
| 2 | 041558086 | 15康缘集CP001 | 300,000 | 29,996,760.20 | 6.18 |
| 3 | 150307 | 15进出07 | 200,000 | 20,045,226.45 | 4.13 |
| 4 | 071507007 | 15中信建投CP007 | 200,000 | 19,997,296.41 | 4.12 |
| 5 | 111517165 | 15光大CD165 | 200,000 | 19,856,310.08 | 4.09 |
| 6 | 111517167 | 15光大CD167 | 200,000 | 19,850,397.30 | 4.09 |
| 7 | 111509191 | 15浦发CD191 | 200,000 | 19,791,600.73 | 4.08 |
| 8 | 111592902 | 15杭州银行CD100 | 200,000 | 19,717,633.66 | 4.06 |
| 9 | 011599151 | 15中天SCP001 | 100,000 | 10,000,000.53 | 2.06 |
| 10 | 110212 | 11国开12 | 100,000 | 9,996,031.11 | 2.06 |

5.6 影子定价“与”摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.2053% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0717% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1278% |

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提摊销。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.8.2

本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3

基金投资的前十名债券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

5.8.4 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 3,001,347.30 |
| 4 | 应收申购款 | 7,537,517.49 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | 3,419.41 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 10,542,284.20 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 461,898,621.29 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 8,328,284,969.54 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 8,304,993,617.48 |
| 报告期期末基金份额总额 | 485,189,973.35 |

注:上述总申购份额含红利再投资份额。

§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嘉薪宝货币市场基金设立的文件;

2、《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同》;

3、《建信嘉薪宝货币市场基金招募说明书》;

4、《建信嘉薪宝货币市场基金托管协议》;

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

# 建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金

## 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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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 | 建信潜力新蓝筹股票 |
| 基金主代码 | 000756 |
| 交易代码 | 000756 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年9月10日 |
| 报告期末基金份额总额 | 97,756,055.84份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于股票市场,通过股票精选和组合投资,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,力争创造高于业绩比较基准的投资回报。 |
| 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,综合分析证券市场的走势,主动判断市场时机,通过稳健的资产配置,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,以最大限度地降低投资组合的风险,提高收益。 |
| 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 | 交通银行股份有限公司 |

§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

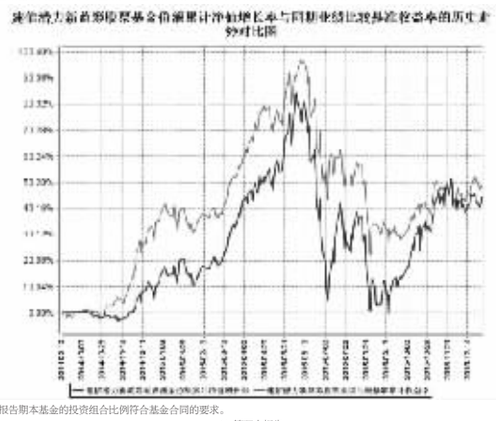
| 主要财务指标 | 报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 10,863,083.27 |
| 2.本期利润 | 26,554,825.05 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2721 |
| 4.期末基金资产净值 | 138,209,660.79 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.414 |

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 | 24.47% | 2.18% | 14.50% | 1.42% | 9.97% | 0.76% |

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 | | |
| 许杰 | 本基金的基金经理 | 2014年9月10日 | - | 13 | 硕士,特许金融分析师(CFA)。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员。2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司,历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职。2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理,2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理,2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011年10月加入我公司,2012年3月21日起任建信恒稳价值混合型证券投资基金基金经理,2012年8月14日起任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理;2014年9月10日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金经理;2015年2月3日起任建信睿盈灵活配置混合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《建信潜力新蓝筹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

由于认识到去杠杆接近尾声,本基金四季度初提高了股票的配置比例,主要投资方向是代表经济转型方向的创新和新消费行业,集中投资了未来成长空间大、进入壁垒高、目前处于快速增长阶段的行业中的龙头企业。

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24.47%,波动率2.18%,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

A股市场2016年可能呈震荡行情,全年看可能仍有一定的上涨空间。

经济方面,全年可能仍处于L型底部徘徊阶段;流动性可能仍比较充裕,整体仍有利于股票市场;货币政策宽松基调未变,但边际力度减弱。人民币贬值构成最大的风险点,但对整体社会流动性的影响有限。中国经济的基本面决定了人民币不会失控大幅贬值。同时,在大宗商品价格低迷及国内工业品价格连续多年通缩的背景下,人民币适度贬值不会导致通胀,通胀水平仍将保持在较低的水平上。央行仍然有能力通过降息降准、公开市场操作等手段维持社会流动性充裕;股市政策方面,在注册制、战略新兴板、深港通等有望推出的背景下,2016年股票供给会大幅增加。

因此,2016年股票选择的重要性进一步提高,讲故事搞概念的股票可能重蹈覆辙,而真正成长空间大、竞争力强的企业以及基本面改善的企业可能成为投资者关注的焦点。

本基金2016年将集中投资于三类企业:创新和新型服务类等成长类行业中竞争力突出,有望持续高增长,未来能够成为大市值的公司;行业或公司基本面发生变化,有估值提升空间的股票;产能过剩行业整合过程中产生的机会。

§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 | 122,750,129.01 | 87.02 |
| | 其中:股票 | 122,750,129.01 | 87.02 |
| 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 | 17,776,426.86 | 12.60 |
| 8 | 其他资产 | 534,119.58 | 0.38 |
| 9 | 合计 | 141,060,675.45 | 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 | 2,772,817.25 | 2.01 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 67,412,038.68 | 48.78 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 5,407,017.79 | 3.91 |
| F | 批发和零售业 | 3,562,362.00 | 2.58 |
| 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 | 30,181,753.74 | 21.84 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 4,244,571.03 | 3.07 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,991,919.52 | 5.06 |
| 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 | 2,177,649.00 | 1.58 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 122,750,129.01 | 88.81 |

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 | 002594 | 比亚迪 | 89,198 | 5,744,351.20 | 4.16 |
| 2 | 300166 | 东方国信 | 177,365 | 5,681,000.95 | 4.11 |
| 3 | 600485 | 信威集团 | 207,743 | 5,557,125.25 | 4.02 |
| 4 | 002051 | 中工国际 | 213,463 | 5,407,017.79 | 3.91 |
| 5 | 300017 | 网宿科技 | 89,295 | 5,356,807.05 | 3.88 |
| 6 | 600718 | 东软集团 | 162,902 | 5,058,107.10 | 3.66 |
| 7 | 002573 | 清新环境 | 214,508 | 4,813,559.52 | 3.48 |
| 8 | 002426 | 胜利精密 | 173,357 | 4,510,749.14 | 3.26 |
| 9 | 300043 | 互动娱乐 | 256,767 | 4,413,824.73 | 3.19 |
| 10 | 600730 | 中国高科 | 243,521 | 4,244,571.03 | 3.07 |

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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 | 194,142.13 |
| 2 | 应收证券清算款 | 290,579.69 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,740.63 |
| 5 | 应收申购款 | 42,657.13 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 534,119.58 |

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 | 300043 | 互动娱乐 | 4,413,824.73 | 3.19 | 筹划发行股份购买资产 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 95,419,664.27 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 27,866,358.75 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 25,529,967.18 |
| 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 | 97,756,055.84 |

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潜力新蓝筹股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信潜力新蓝筹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

# 建信内生动力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:中国工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。

基金托管人中国工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 | 建信内生动力混合 |
| 基金主代码 | 530011 |
| 交易代码 | 530011 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年11月16日 |
| 报告期末基金份额总额 | 473,627,264.34份 |
| 投资目标 | 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 | 本基金将采取积极、主动的资产配置策略,重点投资于消费性内生动力行业、投资性内生动力行业、服务性内生动力行业中具有持续竞争优势的上市公司股票,力求实现基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准 | 本基金投资业绩比较基准为: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 | 中国工商银行股份有限公司 |

§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 | 32,830,738.02 |
| 2.本期利润 | 92,561,077.96 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2460 |
| 4.期末基金资产净值 | 681,193,550.34 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.438 |

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。

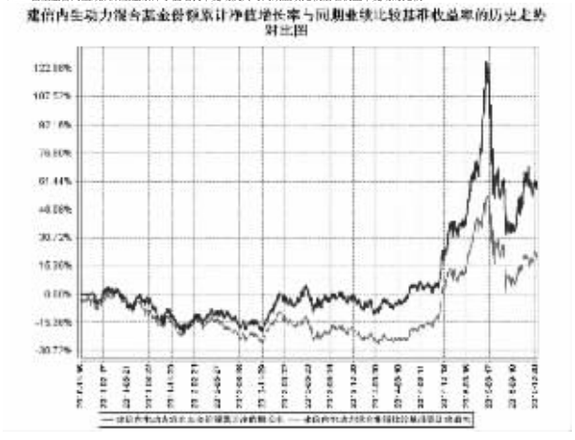
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 18.85% | 1.93% | 13.17% | 1.25% | 5.68% | 0.68% |

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 | | |
| 吴尚伟 | 研究部总经理助理、本基金的基金经理 | 2014年11月25日 | - | 8 | 硕士:2004年9月至2007年4月任长城伟业期货经纪有限公司深圳分公司投资顾问;2008年8月至2011年7月任银华基金管理公司研究员;2011年7月加入我公司,历任研究员、研究主管、研究部总监助理。2014年11月25日起任建信内生动力混合基金经理。 |

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《建信内生动力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

2015年4季度市场振荡上行,10月和11月中小板、创业板表现优秀,12月份大盘蓝筹股表现更强。4季度市场情绪有较好的恢复,稳增长措施加码,流动性继续改善,人民币汇率保持基本稳定,管理机构监管思路变化,保险机构举牌上市公司等一系列积极因素,促进了市场走强。

本基金结合市场的估值水平和个股的风险收益比,适当增加了组合的权益类资产比例,重点关注了业绩确定性较强的医药、家电和传媒等行业,同时配置了成长性较好的细分行业,如大数据、虚拟现实、自动驾驶等。

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18.85%,波动率1.93%,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,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;16年全年CPI压力不大。货币政策方面预计依旧