建信优选成长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	建信优选成长混合
基金主代码	530003
交易代码	530003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月8日
报告期末基金份额总额	1,300,419,778.46份
投资目标	通过投资于具有良好业绩成长性和投资价值的上市公司，实现基金资产长期增值。
投资策略	本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数+20%×中国债券总指数+5%×1年定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。
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	106,535,569.59
2.本期利润	441,845,493.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.3251
4.期末基金资产净值	2,382,856,991.94
5.期末基金份额净值	1.8324

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、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	20.85%	1.90%	16.01%	1.46%	4.84%	0.44%

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		
姚锦	权益投资部副总经理、研究部首席策略分析师、本基金的基金经理	2012年2月17日	-	11	博士，曾任天津通广三星电子有限公司工程师，天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职。2009年3月17日至2011年3月3日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理；2009年12月17日至2011年5月5日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理，历任我公司研究部首席策略分析师、权益投资部副总监兼研究部首席策略分析师，2012年2月17日起任信伟优选成长混合型证券投资基金基金经理，2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任混合型证券投资基金基金经理；2014年1月20日起任建信保本基金的基金经理，该基金于1月23日起转型为建信积极配置混合型证券投资基金基金，姚锦继续担任该基金的基金经理。

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，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《建信优选成长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年四季度，由于欧元区经成为全球流动性的主要供给方，市场对欧央行的持续宽松持有较高的预期，因此在欧央行出台相对保守的货币政策之后，欧元升值、美元贬值。而美国加息符合市场预期，出台之后美元短期走势符合历史规律，出现小幅走弱，除阿根廷比索外，其他新兴市场国家货币基本稳定。中国国内经济数据较弱，加入SDR之后人民币出现小幅度贬值，国内政策的重点是供给侧改革，从三期叠加，新常态到供给侧改革，政策的重点从指出问题到解决问题。

四季度股票市场整体环境较为稳定，成长和主题等板块结构性表现较好，而年底由于保险资金的集中增持，部分低估值蓝筹股票表现较优。受益于流动性宽松，债券市场收益率曲线平坦化下移，信用利差扩大。在债券持有收益下降而流动性宽裕的情况下，资产荒是四季度股票市场重点讨论的问题，具有配置意义的高股息蓝筹股也有阶段性表现。本基金在四季度积极参与成长和主题性机会的阶段性交易机会，换手率有所增加，增加受益于资金成本下降的水电行业配置，另外出于16年一季度基本面好转的预期，增加了航空行业的配置。债券方面，本基金对于前期配置的十年期金融债实现收益。

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20.85%，波动率1.9%，业绩比较基准收益率16.01%，波动率1.46%。

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，美联储加息可能是影响最大的经济事件，美联储加息的幅度剩约中国货币政策的空间，美联储加息的节奏影响中国流动性预期。在供给侧改革的政策下，稳定的宏观环境更多需要通过积极的财政政策来实现。从结构上看，周期品受益于供给侧改革，在去产能去库存的大环境下，加上估值较低，从政策预期到基本面改善都有可以参与的机会。而“供给侧+结构性+改革”决定了真正能够创新成长的龙头也会有更好的发展，新的产业也会不断打开发展空间，这些都需要持续的跟踪和研究。债券市场上，供给侧改革环境下信用风险暴露增加，有助于风险定价体系的形成。

在基金操作上，本基金仍将坚持精选个股，选择具有长期趋势性的行业和个股进行投资，根据市场情绪影响针对估值水平进行操作。

§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	2,030,815,730.31	84.61
	其中：股票	2,030,815,730.31	84.61
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	358,694,231.09	14.94
8	其他资产	10,838,000.60	0.45
9	合计	2,400,347,962.00	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	926,312,910.98	38.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	208,933,627.25	8.77
E	建筑业	18,685.00	0.00
F	批发和零售业	30,299,899.00	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	384,865,748.20	16.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	288,406,693.34	12.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	61,575,642.00	2.58
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	89,145,619.32	3.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	41,256,905.22	1.73
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,030,815,730.31	85.23

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	600718	东软集团	3,900,000	121,095,000.00	5.08
2	600715	*ST松江	2,654,943	110,073,936.78	4.62
3	600900	长江电力	7,499,935	101,699,118.60	4.27
4	600029	南方航空	10,254,476	87,880,859.32	3.69
5	600115	东方航空	10,091,466	76,796,056.26	3.22
6	300017	网宿科技	1,212,064	72,711,719.36	3.05
7	002465	海格通信	4,355,285	72,689,706.65	3.05
8	000333	美的集团	2,199,968	72,202,949.76	3.03
9	000651	格力电器	2,999,946	67,048,793.10	2.81
10	002308	威创股份	2,499,953	61,623,841.45	2.59

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	1,704,639.79
2	应收证券清算款	8,718,041.77
3	应收股利	-
4	应收利息	73,638.71
5	应收申购款	341,680.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,838,000.60

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	002465	海格通信	72,689,706.65	3.05	重大事项临时停牌

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,404,962,759.77
报告期期间基金总申购份额	115,303,453.31
减:报告期期间基金总赎回份额	219,846,434.62
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	1,300,419,778.46

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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	2,965,973.76
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	2,965,973.76
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.23

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期末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优选成长混合型证券投资基金设立的文件；

2、《建信优选成长混合型证券投资基金基金合同》；

3、《建信优选成长混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信优选成长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

建信中小盘先锋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：招商证券股份有限公司
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。

基金托管人招商证券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	建信中小盘先锋股票
基金主代码	000729
交易代码	000729
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月20日
报告期末基金份额总额	238,917,603.20份
投资目标	本基金主要投资于具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	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，此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	85%×中证500指数收益率+15%×中债综合全价（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金，混合型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

§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	23,294,806.40
2.本期利润	116,503,653.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.4304
4.期末基金资产净值	416,361,948.68
5.期末基金份额净值	1.743

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	30.17%	1.83%	20.92%	1.74%	9.25%	0.09%

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		
顾中汉	权益投资部副总经理、本基金的基金经理	2014年8月20日	-	11	硕士。曾任北京市房管局科员，2004年4月起就职于易方达基金管理公司，历任交易员、研究员、基金经理助理、投资经理。2010年1月至2011年5月任社保109组合的投资经理。顾中汉于2011年6月加入本公司，历任基金经理、研究部副总监、权益投资部副总监。2011年10月11日起任建信恒久价值混合型证券投资基金基金经理；2011年12月13日至2013年5月3日任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理；2014年8月20日起任建信中小盘先锋股票基金的基金经理；2015年5月22日起任建信核心精选混合基金经理。

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，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《建信中小盘先锋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

四季度，A股市场大幅反弹，上证综指上涨15.9%，沪深300指数上涨16.5%，中证500指数上涨24.4%，创业板综指上涨39.1%。

四季度经济经济增长压力非常大，政府出台了一系列有利措施稳增长、改革、转型、调整经济结构仍是主要政策方向。股市大幅下跌，风险大部分释放后，投资者信心有所恢复。货币政策持续宽松，部分股票进入价值区域，投资机会显现，市场出现反弹。

本基金一贯求取自下而上精选个股的投资策略，重点配置企业盈利增长较快、估值安全边际相对较高的个股配置，TMT、医药、公用事业、农林牧渔等业绩较为确定的板块，获得一定的收益。

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30.17%，波动率1.83%，业绩比较基准收益率20.92%，波动率1.74%。

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16年一季度，本基金认为中央经济工作会议确定16年宏观经济重点在于去产能、去库存、去杠杆、降成本和补短板，承担较大的经济增长压力，进行结构调整将是经济主基调，人民币贬值幅度预期被打破，资金流出压力增大，会造成流动性收紧、对资产价格产生压力。资本市场制度设计、股市规则变动使得投资者行为产生影响。

密切关注几个重大因素：市场已经对人民币汇率形成贬值预期，若汇率再大幅波动，对股市将是较大风险；去产能、去杠杆、供给侧改革导致不良资产产生、人员下岗，投资者信心和风险可能会受到影响；债券市场信用风险在累积，若连续出现违约，将打击对投资者信心。

本基金将延续一贯的风格，追求价值与高质量的成长，努力寻找投资机会，尽力为持有人获得良好的回报。

§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	347,549,724.61	81.71
	其中：股票	347,549,724.61	81.71
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	76,003,698.88	17.87
8	其他资产	1,810,961.86	0.43
9	合计	425,364,385.35	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	16,422,705.40	3.94
B	采矿业	-	-
C	制造业	225,022,823.10	54.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,298,345.40	4.63
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,310,223.10	4.88
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	11,153,265.90	2.68
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	14,287,779.00	3.43
M	科学研究和技术服务业	10,384,372.35	2.49
N	水利、环境和公共设施管理业	19,812,193.36	4.76
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	8,923,992.00	2.14
S	综合	1,934,025.00	0.46
	合计	347,549,724.61	83.47

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	600271	航天信息	312,745	22,348,757.70	5.37
2	600651	飞乐音响	1,414,421	20,862,709.75	5.01
3	002236	大华股份	388,744	14,344,653.60	3.45
4	601888	中国国旅	240,900	14,287,779.00	3.43
5	000998	隆平高科	582,244	13,828,295.00	3.32
6	000488	晨鸣纸业	1,446,250	12,900,550.00	3.10
7	601199	江南水务	668,716	12,739,039.80	3.06
8	002412	汉森制药	470,259	12,443,053.14	2.99
9	600420	现代制药	292,532	12,216,136.32	2.93
10	000826	启迪桑德	272,236	10,785,990.32	2.59

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	1,303,110.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,042.34
5	应收申购款	467,808.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,810,961.86

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	600271	航天信息	22,348,757.70	5.37	重大资产重组
2	600420	现代制药	12,216,136.32	2.93	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	302,695,797.01
报告期期间基金总申购份额	49,320,709.81
减:报告期期间基金总赎回份额	113,098,903.62
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	238,917,603.20

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

本基金本报告期末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中小盘先锋股票型证券投资基金设立的文件；

2、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》；

3、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信中小盘先锋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

建信月盈安心理财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：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	建信月盈安心理财	
基金主代码	530028	
交易代码	530028	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月20日	
报告期末基金份额总额	2,771,534,659.67份	
投资目标	严格控制风险并保持良好流动性的基础上，通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报，并力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金通过积极主动的组合管理，充分运用各种短期投资工具，力争为持有人创造低风险基础上的投资收益。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过150天。	
业绩比较基准	七天通知存款利率（税前）	
风险收益特征	本基金属于债券基金，长期风险收益水平低于股票基金、混合基金，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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
下属分级基金的交易代码	530028	531028
报告期末下属分级基金的份额总额	749,239,955.04份	2,022,294,704.63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）	
	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
1. 本期已实现收益	5,901,763.67	13,232,056.18
2.本期利润	5,901,763.67	13,232,056.18
3.期末基金资产净值	749,239,955.04	2,022,294,704.63

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，由于该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

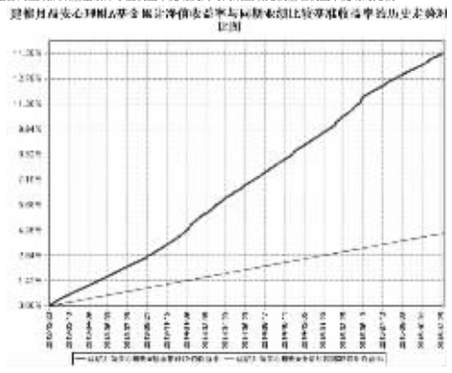
建信月盈安心理财A

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	0.8413%	0.0051%	0.3403%	0.0000%	0.5010%	0.0051%

建信月盈安心理财B

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	0.9151%	0.0051%	0.3403%	0.0000%	0.5748%	0.0051%

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		
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1月21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日起任建信嘉新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市基金的基金经理。
高珊	本基金的基金经理	2012年12月20日	-	9	硕士。2006年7月至2007年6月期间在中信建投证券公司工作，任交易员。2007年6月加入建信基金管理公司，历任初级交易员、交易员，2009年7月起任建信货币市场基金的基金经理助理。2012年8月28日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理；2012年12月20日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理；2013年1月29日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理；2013年9月17日起任建信周