建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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:广发证券股份有限公司
报告送出日期:2016年4月20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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月18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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信睿盈灵活配置混合	
基金主代码	000994	
交易代码	000994	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年2月3日	
报告期末基金份额总额	347,356,033.66份	
投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置和主动的投资管理,在精选个股、个券的基础上适度集中投资,在严格控制风险的前提下,谋求基金资产的长期、稳定增值。	
投资策略	本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率(全价)×35%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,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	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信睿盈灵活配置混合A	建信睿盈灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	000994	000995
报告期末下属分级基金的份额总额	209,637,018.90份	137,719,014.76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(2016年1月1日-2016年3月31日)	
	建信睿盈灵活配置混合A	建信睿盈灵活配置混合C
1.本期已实现收益	-29,989,790.46	-20,548,482.12
2.本期利润	-43,330,074.16	-30,304,720.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2091	-0.2151
4.期末基金资产净值	191,714,483.25	123,978,620.26
5.期末基金份额净值	0.915	0.900

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

建信睿盈灵活配置混合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	-18.81%	2.80%	-8.70%	1.58%	-10.11%	1.22%

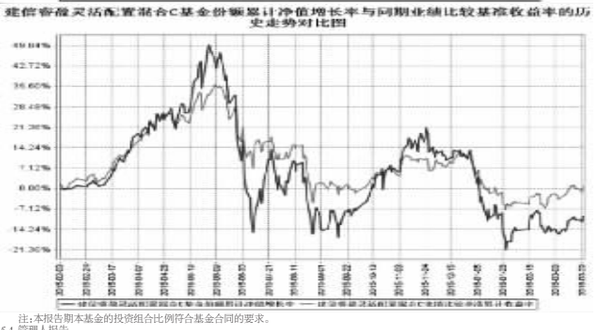
建信睿盈灵活配置混合C

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	-19.06%	2.79%	-8.70%	1.58%	-10.36%	1.21%

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

建信睿盈灵活配置混合A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

建信睿盈灵活配置混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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	2015年2月3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,美国通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,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《建信睿盈灵活配置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

本报告期内未出现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。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 投资组合报告附注

资产配置方面,本基金在年初股票资产的配置比例较高,由于熔断机制等原因股票市场在一月份产生较大幅度的下跌,对股票净值产生了较大的负面影响。

股票选择方面,本基金主要持有了高景气度行业中具有竞争力且估值合理的公司,包括新能源(电动汽车产业链、储能)、光通信、血制品、畜禽养殖及其后周期、环保、云计算等行业中的龙头公司。这些公司整体上在一季度表现表现良好,取得了较好的收益。

4.5 投资组合的业绩表现

本报告期睿盈灵活A净值增长率-18.81%,波动率2.80%,睿盈灵活C净值增长率-19.06%,波动率2.79%;业绩比较基准收益率-8.70%,波动率1.58%。

§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	172,967,738.05	46.70
	其中:股票	172,967,738.05	46.70
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	95,000,000.00	25.65
	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	101,227,361.59	27.33
8	其他资产	1,221,279.54	0.33
9	合计	370,416,379.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	13,505,625.00	4.28
B	采矿业	-	-
C	制造业	133,888,377.12	42.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,348,770.01	2.01
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	19,224,965.92	6.09
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	172,967,738.05	54.79

注:以上行业分类以2016年3月31日的证监会行业分类标准为依据。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通投票。

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

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	300068	南都电源	1,086,195	19,149,617.85	6.07
2	002426	胜利精密	766,322	17,065,990.94	5.41
3	600485	信威集团	726,377	15,537,204.03	4.92
4	002573	清新环境	804,674	14,548,505.92	4.61
5	300498	温氏股份	262,500	13,505,625.00	4.28
6	300408	三环集团	354,678	12,154,815.06	3.85
7	600498	烽火通信	475,228	11,956,736.48	3.79
8	300043	互动娱乐	855,539	11,139,117.78	3.53
9	002466	天齐锂业	55,700	9,346,460.00	2.96
10	002099	海翔药业	896,000	9,210,880.00	2.92

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

本报告期本基金未投资国债期货。

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	1,167,741.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	33,013.67
5	应收申购款	20,524.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,221,279.54

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	600485	信威集团	15,537,204.03	4.92	重大事项
2	002573	清新环境	14,548,505.92	4.61	重大事项
3	300043	互动娱乐	11,139,117.78	3.53	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信睿盈灵活配置混合A	建信睿盈灵活配置混合C
报告期期初基金份额总额	207,473,293.13	143,048,340.58
报告期期间基金总申购份额	10,447,361.66	7,603,660.69
减:报告期期间基金总赎回份额	8,283,635.89	12,932,986.51
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	209,637,018.90	137,719,014.76

注:上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,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	5,132,443.53
报告期期间买入/申购总份额	-
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	5,132,443.53
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.48

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睿盈灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信睿盈灵活配置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4月20日

建信全球资源混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月20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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月18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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	建信全球资源混合(QDII)
基金主代码	539003
交易代码	539003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月26日
报告期末基金份额总额	28,823,243.99份
投资目标	通过全球化的资产配置和组合管理,优选资源类相关行业的股票进行投资,在控制风险的同时,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在投资策略方面,将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等多种方式进行投资组合的构建。
业绩比较基准	50%×MSCI全球能源行业净总收益指数收益率(MSCI ACWI Energy Net Total Return Index)+50%×MSCI全球原材料行业净总收益指数收益率(MSCI ACWI Material Net Total Return Index)。
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	中国银行股份有限公司

2.2 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.	Deutsche Bank AG, Singapore Branch
	中文	信安环球投资有限公司	德意志银行新加坡分行
注册地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	One Raffles Quay, Level 17, South Tower, Singapore
办公地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	One Raffles Quay, #16-00, South Tower, Singapore
邮政编码		IA 50392-0490	048583

§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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-473,209.42
2.本期利润	-20,731.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0007
4.期末基金资产净值	19,991,336.57
5.期末基金份额净值	0.694

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。

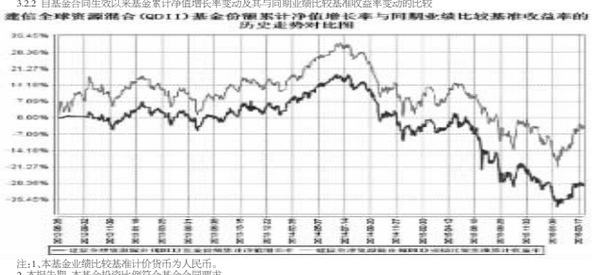
3.2 基金净值表现

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	-0.29%	1.63%	5.61%	1.63%	-5.90%	0.00%

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

建信全球资源混合(QDII)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1.本基业绩比较基准计价货币为人民币。

2.本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

§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		
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	2012年6月26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。
李博涵	本基金的基金经理	2013年8月5日	-	10	李博涵先生,硕士,加拿大籍华人。曾就职于美国联邦快递北京分公司、美国联合航空公司北京分公司和美国万事达卡国际组织北京分公司。2005年2月起加入加拿大蒙特利尔银行,任全球资本市场投资助理;2006年8月起加入加拿大帝国商业银行,任全球资本市场投资顾问;2008年8月加入我公司海外投资部,任高级研究员兼基金经理助理,2013年8月5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务	证券从业年限	说明
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。
李晓西	投资组合经理	14	李晓西是信安环球股票定量研究部总经理,负责所有股票策略的量化研究。他的研究职责包括为公司专属的全球研究平台(GRP)股票选择模型,投资组合构建和风险管理进行全球股票量化研究并实施模型开发。他也担任全球核心、全球全部国家、全球机遇、全球价值&收入和其它专门的全球基金的基金经理。晓西在2006年加入公司。此前,晓西是Hantang Securities Co., Ltd., Beijing的高级经理。他的经历还包括Yinjian Industrial Co., Ltd., Beijing的投资组合经理。他从杜克大学获得MBA学位,从北京工商大学获得会计学硕士学位并从对外经济贸易大学会计学专业毕业。晓西是金融风险管理师持证人和Global Association of Risk Professionals成员。他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。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《建信全球资源混合型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2016年第一季度国际原油价格呈现V型反弹的行情。油价在二月中旬达到26美元/桶的最低点后,迅速反弹到42美元/桶,主要原因为本季度欧佩克、俄罗斯等产油国达成石油冻产的初步协议,推动石油等原材料价格触底反弹,利好新兴市场的原材料出口国。美联储3月份FOMC会议维持利率水平不变,并表达了未来推迟加息的意愿,另外欧洲和日本央行也推出了货币宽松政策,全球宽松的货币环境促使石油和大宗商品价格V型反转。另外中国固定资产投资在春节后加速,开工量增加,钢铁和铝经历了补库存过程,房地产销量大幅上升也增加了投资人对未来需求增长的预期,铜和铁矿石等大宗商品价格在1季度震荡上行。2月中旬开始,资源类相关股票在大宗商品价格上涨和宽松货币政策的双重利好下大幅上涨。

本报告期基金净值增长率-0.29%,波动率1.63%,业绩比较基准收益率5.61%,波动率1.63%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,自2016年1月1日至2016年3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 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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	15,591,774.21	75.76
	其中:普通股	15,322,781.79	74.46
	优先股	-	0.00
	存托凭证	268,992.42	1.31
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	1,842,165.66	8.95
3	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中:远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	3,139,911.85	15.26
8	其他资产	5,763.89	0.03
9	合计	20,579,615.61	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	15,310,207.26	76.58
美国	281,566.95	1.41
合计	15,591,774.21	77.99

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
材料	6,645,277.10	33.24
信息技术	612,497.46	3.06
必需消费品	17,031.63	0.09
电信服务	251,445.69	1.26
工业	236,855.49	1.18
非必需消费品	204,583.47	1.02
医疗保健	27,123.08	0.14
金融	750,353.32	3.75
能源	4,576,150.68	22.89
公用事业	2,270,456.29	11.36
合计	15,591,774.21	77.99

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国石化	CNE1000002Q2	香港证券交易所	中国香港	288,000	1,221,477.84	6.11
2	CNOOC LTD	中国海洋石油	HK0883013259	香港证券交易所	中国香港	152,000	1,160,150.64	5.80
3	PETROCHINA CO LTD-H	中国石油	CNE1000003W8	香港证券交易所	中国香港	198,000	851,314.86	4.26
4	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	海螺水泥	CNE1000001W2	香港证券交易所	中国香港	43,000	745,258.80	3.73
5	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中国神华	CNE1000002R0	香港证券交易所	中国香港	69,500	706,512.68	3.53
6	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上海石化	CNE1000004C8	香港证券交易所	中国香港	202,000	661,483.85	3.31
7	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	BMG653181005	香港证券交易所	中国香港	108,000	528,247.17	2.64
8	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	CNE1000002N9	香港证券交易所	中国香港	170,000	509,949.00	2.55
9	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江西铜业	CNE1000003K3	香港证券交易所	中国香港	54,000	418,908.11	2.10
10	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源	BMG5320C1082	香港证券交易所	中国香港	74,000	415,591.77	2.08

注:所有证券代码采用ISIN码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

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(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	499,493.17
3	应收股利	22,986.59
4	应收利息	225.33
5	应收申购款	2,884.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	397,820.63
9	合计	923,409.79

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	24,195,128.55
报告期期间基金总申购份额	929,118.02
减:报告期期间基金总赎回份额	544,759.44
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	24,579,487.13

§7 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全球机遇混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信全球机遇混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信全球机遇混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信全球机遇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4月20日

建信全球机遇混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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4月20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4月18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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

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
交易代码	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
报告期末基金份额总额	24,579,487.13份
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。
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

2.2 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

§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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-630,383.55
2.本期利润	-1,209,801.56
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0499
4.期末基金资产净值	24,904,988.93
5