

# 建信大安全战略精选股票型证券投资基金 2015 年第 4 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。

基金托管人中信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	建信大安全战略精选股票
基金主代码	001473
交易代码	001473
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 29 日
报告期末基金份额总额	121,932,684.91 份
投资目标	本基金主要投资于同大安全主题相关的优质证券，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值和稳定回报。
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，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。本基金主要投资于同大安全主题相关的行业的优质证券，坚持“自下而上”的个股选择策略，选择投资标的，多维度认可标的价值，重点研究具有竞争力比较优势、未来成长空间大、持续经营能力强的上市公司。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标。
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	中信证券股份有限公司

### §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	19,170,158.43
2. 本期利润	36,934,548.34
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2114
4. 期末基金资产净值	139,115,514.38
5. 期末基金份额净值	1.1409

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。

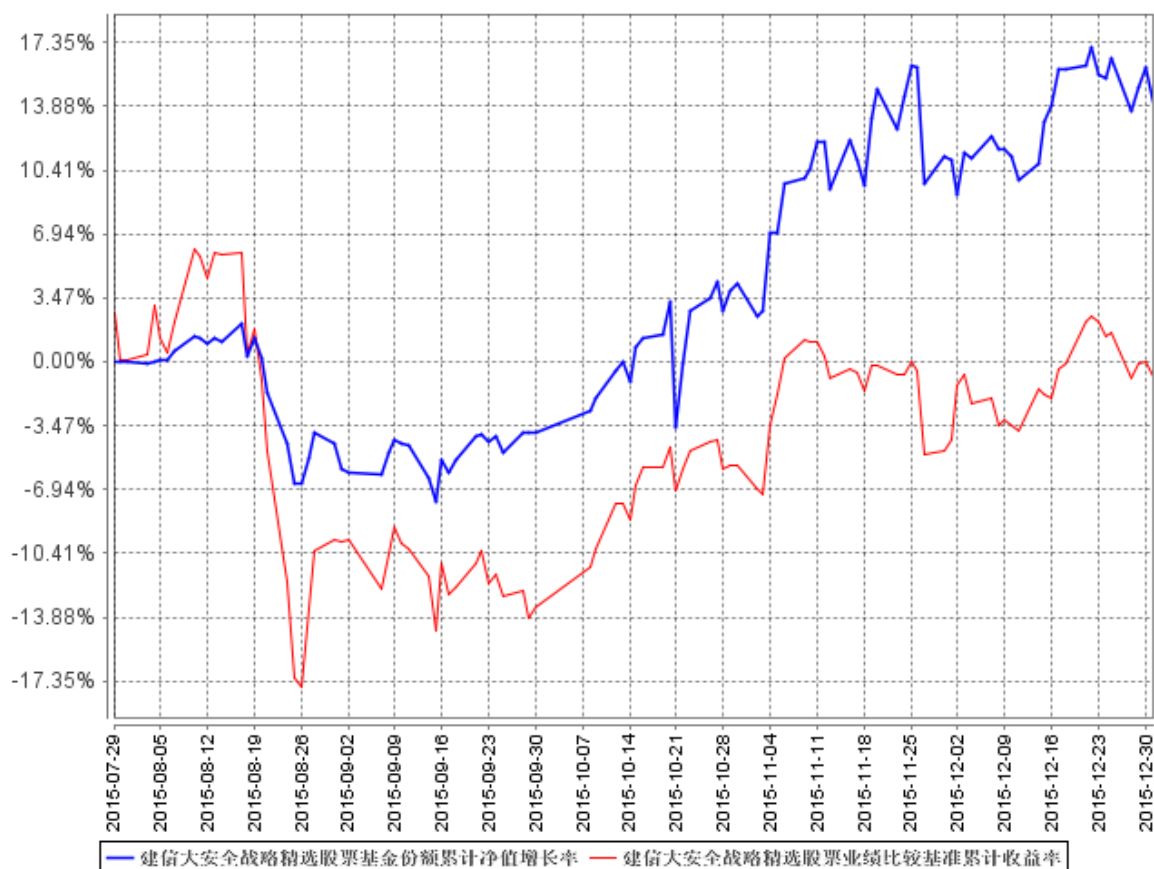
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	18.66%	1.85%	14.50%	1.42%	4.16%	0.43%

### 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

建信大安全战略精选股票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：本基金基金合同于 2015 年 7 月 29 日生效，截至报告期末仍处于建仓期。

## §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		
王东杰	本基金的基金经理	2015 年 7 月 29 日	-	7	博士。2008 年 7 月至 2012 年 5 月在高华证券有限责任公司工作，历任分析员、经理；2012 年 5 月加入我公司，历任初级研究员、研究员、研究主管、基金经理，2015 年 5 月 13 日起任建信回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；

					2015 年 7 月 29 日起 任建信大安全战略精 选股票型证券投资基 金基金经理。
--	--	--	--	--	--

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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《建信大安全战略精选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

A 股在经历了 3 季度的股灾后，4 季度出现了明显的超跌反弹。上证综指上涨 15.93%，创业板上涨 30.32%。板块方面，所有行业全部上涨，表现较好的是股灾期间下跌较多的计算机、通信等板块，以及阶段性景气度较好的 VR，IP 等概念板块。

本基金在 4 季度初显著提升了股票配置比例，整个 4 季度均保持了较高的股票仓位，并集中配置了业绩确定性高，估值相对合理的个股。业绩与基准同步，取得了可观的正收益。

#### 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 18.66%，波动率 1.85%，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

展望 2016 年，我们认为市场上涨阻力较大：1) 国内经济依旧疲弱，改革进入深水区，不确定性加大；2) 经过 2012 年以来的结构性牛市和全市场牛市，市场整体估值存在一定程度的泡沫；3) 美联储加息，人民币贬值，市场交易结构变化等都会对市场产生影响。

操作方面，本基金会在 1 季度保持中等偏低的股票仓位，重点布局业绩确定性高、估值相对合理的个股，并关注以下几类机会：1) 供给侧改革带来的周期行业机会；2) 教育、VR 等长期空间较大的行业；3) 注册制来临前壳资源集中变现的机会。

## §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	120,652,569.11	85.68
	其中：股票	120,652,569.11	85.68
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	16,806,843.90	11.94
8	其他资产	3,353,263.55	2.38
9	合计	140,812,676.56	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	12,059,141.00	8.67
B	采矿业	-	-
C	制造业	68,213,355.20	49.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,147,904.00	1.54
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,320,052.00	3.82
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	7,148,674.91	5.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	13,793,485.86	9.92
L	租赁和商务服务业	3,557,744.15	2.56
M	科学研究和技术服务业	2,213,813.11	1.59
N	水利、环境和公共设施管理业	6,198,398.88	4.46
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	120,652,569.11	86.73

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	600867	通化东宝	245,225	6,662,763.25	4.79
2	600730	中国高科	283,800	4,946,634.00	3.56
3	300203	聚光科技	141,200	4,841,748.00	3.48
4	300070	碧水源	90,044	4,661,577.88	3.35
5	002035	华帝股份	254,300	4,521,454.00	3.25
6	002089	新海宜	158,400	3,565,584.00	2.56
7	002400	省广股份	141,461	3,557,744.15	2.56
8	000488	晨鸣纸业	367,100	3,274,532.00	2.35
9	600382	广东明珠	200,300	3,176,758.00	2.28
10	002036	汉麻产业	99,300	3,058,440.00	2.20

### 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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，中国高科集团股份有限公司（600730）于 2015 年 7 月 23 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（编号：京调查通字 15046 号）。因该公司涉嫌未披露关联方交易等信息披露违法违规事项，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对该公司立案调查。上述信息该公司已于 2015 年 7 月 24 日在中国证券报、上海证券报、证券时报及上海证券交易所网站上进行了披露。



### 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	402,620.83
2	应收证券清算款	2,897,841.28
3	应收股利	-
4	应收利息	4,142.88
5	应收申购款	48,658.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,353,263.55

### 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	242,923,059.75
报告期期间基金总申购份额	14,340,041.88
减：报告期期间基金总赎回份额	135,330,416.72
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	121,932,684.91

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大安全战略精选股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信大安全战略精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信大安全战略精选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信大安全战略精选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