

建信恒稳价值混合型证券投资基金 2015 年年度报告

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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
8.6 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.....	52
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	52

8.8	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贵金属投资明细	52
8.9	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	52
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.12	投资组合报告附注	53
§9	基金份额持有人信息	54
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	54
§10	开放式基金份额变动	55
§11	重大事件揭示	55
11.1	基金份额持有人大会决议	55
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
11.4	基金投资策略的改变	56
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8	其他重大事件	58
§12	备查文件目录	59
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	60
12.3	查阅方式	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信恒稳价值混合型证券投资基金
基金简称	建信恒稳价值混合
基金主代码	530016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 22 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	20,743,835.46 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制下行风险的基础上，通过动态的资产配置平衡当期收益与长期资本增值，争取实现长期稳健回报。
投资策略	本基金以追求稳健收益、超越业绩比较基准——三年期定期存款利率为投资目标。因此，本基金投资以获取正的投资收益为首要目标，在基金投资运作过程中，严格控制投资风险是实现投资目标的关键，基金管理人应在控制风险的前提下追求投资收益。
业绩比较基准	同期三年期银行定期存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，主要投资于相似条件下到期收益率较高的优良债券品种及价值型股票，风险高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金，属于中等风险和预期收益的证券投资基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	张建春
	联系电话	010-66228888	010-63639180
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95595
传真		010-66228001	010-63639132
注册地址		北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

	16 层	
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市西城区太平桥大街 25 号 中国光大中心
邮政编码	100033	100033
法定代表人	许会斌	唐双宁

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 、《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	18,128,286.96	15,955,214.35	14,618,318.69
本期利润	12,242,401.71	20,205,670.46	12,361,236.21
加权平均基金份额本期利润	0.4348	0.4022	0.1929
本期加权平均净值利润率	23.52%	33.23%	17.06%
本期基金份额净值增长率	20.27%	43.82%	16.77%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	19,621,803.65	23,129,763.27	7,296,298.70
期末可供分配基金份额利润	0.9459	0.5453	0.1254
期末基金资产净值	40,365,639.11	68,615,107.92	65,488,477.75
期末基金份额净值	1.946	1.618	1.125
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	112.08%	76.34%	22.61%

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、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）；

3、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。

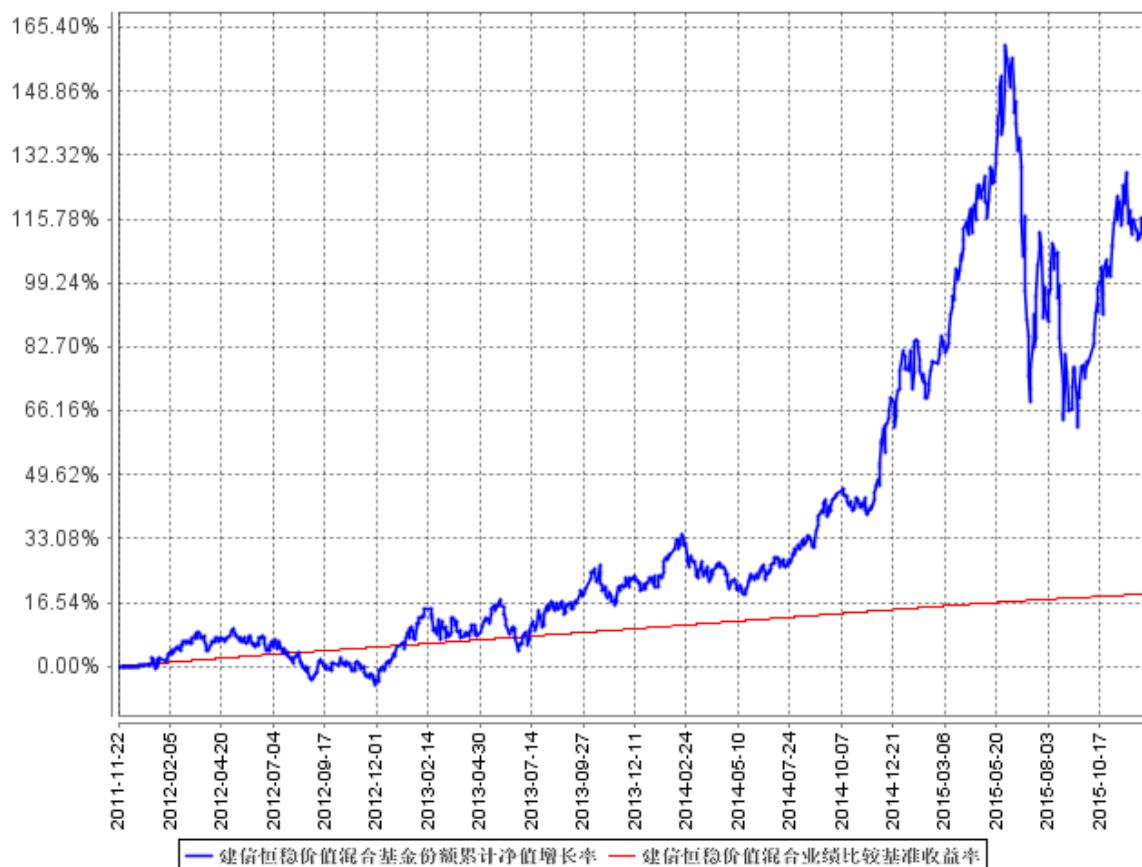
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%	1.84%	0.72%	0.01%	17.94%	1.83%
过去六个月	-2.11%	2.66%	1.54%	0.01%	-3.65%	2.65%
过去一年	20.27%	2.32%	3.47%	0.01%	16.80%	2.31%
过去三年	101.99%	1.60%	12.75%	0.01%	89.24%	1.59%
自基金合同生效起至今	112.08%	1.41%	18.81%	0.01%	93.27%	1.40%

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

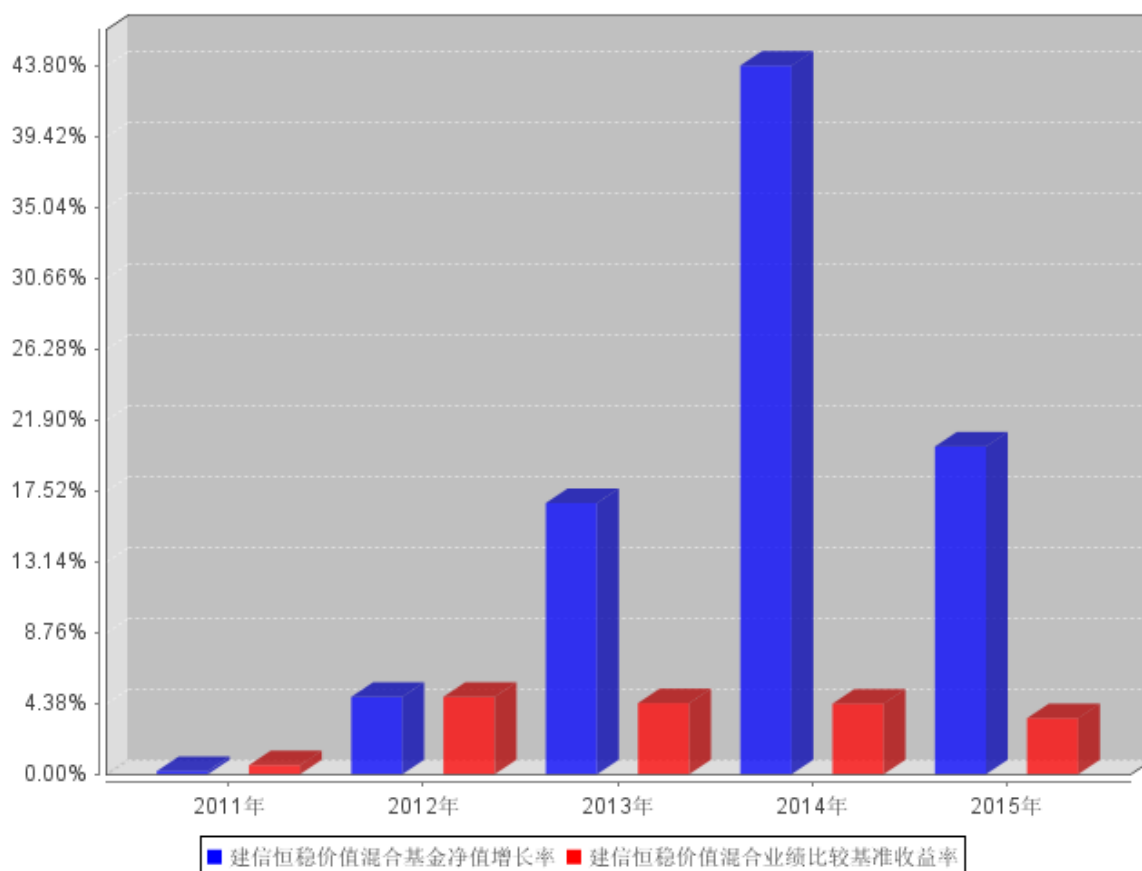
建信恒稳价值混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信恒稳价值混合自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2011 年 11 月 22 日生效，2011 年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
2013	1.000	4,695,602.85	1,003,060.45	5,698,663.30	
合计	1.000	4,695,602.85	1,003,060.45	5,698,663.30	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年

9月19日，注册资本2亿元。目经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、量化衍生品及海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司和华东、西北两个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“最可信赖、持续领先的综合性、专业化资产管理公司”。

截至2015年12月31日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深300指数证券投资基金（LOF）、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信中证500指数增强型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建

信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金共 61 只开放式基金，管理的公募基金资产规模共计为 3146.88 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	2012 年 3 月 21 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。

					<p>2011 年 10 月加入我公司，</p> <p>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，</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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。</p>
--	--	--	--	--	--

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下（日内、3日内、5日内）管理的不同投资组合（包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下：

当时间窗为 1 日时，配了 11556 对投资组合，有 2201 对投资组合未通过 T 检验，其中 659 对投资组合的正溢价率占优频率小于 55%，其它 1542 对正溢价率占优频率大于 55% 的投资组合中，其中 981 对平均溢价率低于 2%，其它 561 对平均溢价率超过 2% 的投资组合中，其中 559 对贡献率均未超过 5%，另外 2 对溢价金额占组合净资产比例很小，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为 3 日时，配了 12297 对投资组合，有 3181 对投资组合未通过 T 检验，但其中 939 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 2242 对正溢价率占优频率大于 55% 的投资组合中，其中 1911 对平均溢价率低于 5%，其它 331 对平均溢价率超过 5% 的投资组合中，其中 330 对贡献率均未超过 5%，另外 1 对溢价金额占组合净资产比例很小，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为 5 日时，配了 12704 对投资组合，有 3824 对投资组合未通过 T 检验，但其中 1156 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 2668 对正溢价率占优频率大于 55% 的投资组合，其中 2506 对平均溢价率低于 10%，其它 162 对平均溢价率超过 10% 的投资组合中，其贡献率均未超过 5%，同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金判断在流动性相对充裕的背景下股票市场将呈现向上的趋势，因此全年基本上保持了较高的股票仓位。本基金重点持有两类公司：一类是代表中国经济结构转型方向的创新类和新型消费类公司，如云计算、大数据、互联网、教育、体育、影视等方面的龙头企业；另外一类是受益于地产小周期向上的传统蓝筹股。由于整体蓝筹股市场表现弱于成长股，而本基金持有成长股的比例低于基金整体的平均水平，因此本基金的相对收益不够理想。

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 20.27%，波动率 2.32%，业绩比较基准收益率 3.47%，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

2016 年中国经济政策的重点在于供给侧改革，预计经济仍处于探明底部的阶段。在经济结构调整、工业品价格通缩的背景下，货币政策预计仍然会保持适度宽松，市场利率将可能仍旧在底部徘徊。但是由于美国进入加息周期，人民币面临贬值压力，央行在维持人民币汇率稳定和货币宽松之间面临两难选择，将可能对市场的资金面造成阶段性扰动。

因此，2016 年股票选择的重要性进一步提高，真正成长空间大、竞争力强的企业依靠自身的快速成长将成为市场关注的焦点。

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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2015 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司监察稽核部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期

向公司董事会、总经理和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施：

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备季度监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由监察稽核部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司年度监察稽核工作计划，实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发“三条底线”违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与外方股东信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完

整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的核心价值观，树立并坚持诚信、规范、专业、创新的经营理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）。

自2015年3月26日起，公司按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值价格，对

公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)进行估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，自 2015 年 6 月 29 日至 2015 年 12 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2015 年度，中国光大银行股份有限公司在建信恒稳价值混合型证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对建信恒稳价值混合型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2015 年度，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——建信基金管理有限责任公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——建信基金管理有限责任公司编制的“建信

恒稳价值混合型证券投资基金 2015 年年度报告”进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 21957 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信恒稳价值混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的建信恒稳价值混合型证券投资基金(以下简称“建信恒稳价值混合基金”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是建信恒稳价值混合基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

审计意见段	我们认为，上述建信恒稳价值混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了建信恒稳价值混合基金 2015 年 12 月 31 日和 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国 · 上海市	
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信恒稳价值混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	10,092,266.70	7,927,830.64
结算备付金		262,455.84	393,250.57
存出保证金		61,008.61	66,293.22
交易性金融资产	7.4.7.2	31,243,748.67	57,965,020.09
其中：股票投资		31,243,748.67	51,149,414.09
基金投资		-	-
债券投资		-	6,815,606.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	3,333,663.32
应收利息	7.4.7.5	2,299.70	18,711.16
应收股利		-	-
应收申购款		2,180.95	291,964.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		41,663,960.47	69,996,733.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		246,156.85	-
应付赎回款		43,089.20	524,061.34
应付管理人报酬		52,609.06	74,966.20
应付托管费		8,768.16	12,494.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	751,138.34	467,378.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	196,559.75	302,724.96
负债合计		1,298,321.36	1,381,625.18
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	20,743,835.46	42,419,579.45
未分配利润	7.4.7.10	19,621,803.65	26,195,528.47
所有者权益合计		40,365,639.11	68,615,107.92
负债和所有者权益总计		41,663,960.47	69,996,733.10

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.946 元，基金份额总额 20,743,835.46 份。

7.2 利润表

会计主体：建信恒稳价值混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		14,545,831.30	22,564,963.22
1. 利息收入		108,025.00	248,136.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	101,795.03	127,582.72
债券利息收入		6,229.97	30,255.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	90,298.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,243,423.70	18,006,252.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	19,517,899.50	15,497,022.12
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	479,480.81	2,134,404.86
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	246,043.39	374,825.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-5,885,885.25	4,250,456.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	80,267.85	60,118.06
减：二、费用		2,303,429.59	2,359,292.76
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	780,477.00	912,829.00
2. 托管费	7.4.10.2.2	130,079.47	152,138.21
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,019,260.87	911,825.55
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	373,612.25	382,500.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,242,401.71	20,205,670.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,242,401.71	20,205,670.46

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信恒稳价值混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	42,419,579.45	26,195,528.47	68,615,107.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,242,401.71	12,242,401.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-21,675,743.99	-18,816,126.53	-40,491,870.52

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	25,062,912.51	20,946,069.94	46,008,982.45
2. 基金赎回款	-46,738,656.50	-39,762,196.47	-86,500,852.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	20,743,835.46	19,621,803.65	40,365,639.11
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	58,192,179.05	7,296,298.70	65,488,477.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,205,670.46	20,205,670.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-15,772,599.60	-1,306,440.69	-17,079,040.29
其中：1. 基金申购款	46,986,974.08	13,425,906.62	60,412,880.70
2. 基金赎回款	-62,759,573.68	-14,732,347.31	-77,491,920.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	42,419,579.45	26,195,528.47	68,615,107.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

孙志晨

丁颖

宋亚辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信恒稳价值混合型基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中

国证监会”)证监许可[2011]第 1596 号《关于核准建信恒稳价值混合型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信恒稳价值混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2011 年 10 月 24 日至 2011 年 11 月 18 日止。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 868,246,359.39 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 430 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信恒稳价值混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 11 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 868,315,781.01 份基金份额,其中认购资金利息折合 69,421.62 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信恒稳价值混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证、货币市场工具及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金持有的股票、权证市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产净值的 30%-80%;债券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的 20%-70%,其中保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为同期三年期银行定期存款利率(税前)。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2016 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年

12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利

终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该

组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
活期存款	10,092,266.70	7,927,830.64
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	10,092,266.70	7,927,830.64

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	30,408,820.42	31,243,748.67	834,928.25
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	30,408,820.42	31,243,748.67	834,928.25
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	44,853,236.30	51,149,414.09	6,296,177.79
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,390,970.29	6,815,606.00
	银行间市场	-	-
	合计	6,390,970.29	6,815,606.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	51,244,206.59	57,965,020.09	6,720,813.50

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产、负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

应收活期存款利息	2,139.65	3,454.09
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	129.91	194.70
应收债券利息	-	15,029.48
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	30.14	32.89
合计	2,299.70	18,711.16

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	751,138.34	467,378.31
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	751,138.34	467,378.31

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	93.01	1,670.47
预提费用	196,466.74	301,054.49
-	-	-
合计	196,559.75	302,724.96

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	42,419,579.45	42,419,579.45

本期申购	25,062,912.51	25,062,912.51
本期赎回（以“-”号填列）	-46,738,656.50	-46,738,656.50
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	20,743,835.46	20,743,835.46

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,129,763.27	3,065,765.20	26,195,528.47
本期利润	18,128,286.96	-5,885,885.25	12,242,401.71
本期基金份额交易产生的变动数	-19,944,974.09	1,128,847.56	-18,816,126.53
其中：基金申购款	20,415,708.65	530,361.29	20,946,069.94
基金赎回款	-40,360,682.74	598,486.27	-39,762,196.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,313,076.14	-1,691,272.49	19,621,803.65

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	95,630.66	121,629.65
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,718.21	4,021.67
其他	1,446.16	1,931.40
合计	101,795.03	127,582.72

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	349,506,835.75	304,727,581.86

减：卖出股票成本总额	329,988,936.25	289,230,559.74
买卖股票差价收入	19,517,899.50	15,497,022.12

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	479,480.81	2,134,404.86
债券投资收益——赎回差价收入	0.00	0.00
债券投资收益——申购差价收入	0.00	0.00
合计	479,480.81	2,134,404.86

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	14,375,605.41	32,169,909.56
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,851,103.13	29,917,382.29
减：应收利息总额	45,021.47	118,122.41
买卖债券差价收入	479,480.81	2,134,404.86

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间未投资贵金属。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未投资贵金属。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未投资贵金属。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未投资贵金属。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未投资衍生工具。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未投资衍生工具。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
股票投资产生的股利收益	246,043.39	374,825.52
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	246,043.39	374,825.52

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
1. 交易性金融资产	-5,885,885.25	4,250,456.11
——股票投资	-5,461,249.54	3,825,820.40
——债券投资	-424,635.71	424,635.71

——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-5,885,885.25	4,250,456.11

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
基金赎回费收入	62,322.01	57,555.28
基金转换费收入	17,945.84	2,562.78
合计	80,267.85	60,118.06

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
交易所市场交易费用	1,019,260.87	911,825.55
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,019,260.87	911,825.55

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	299,912.25	300,000.00
其他费用	200.00	-
债券托管账户维护费	13,500.00	22,500.00
银行划款手续费	-	-

合计	373,612.25	382,500.00
----	------------	------------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司(“建信基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司(“中国光大银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	780,477.00	912,829.00
其中：支付销售机构的客户维护费	277,400.94	321,329.65

注：1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	130,079.47	152,138.21

注：支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交

易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2011 年 11 月 22 日）持有的基金份额	0.00	-
期初持有的基金份额	0.00	9,388,732.39
期间申购/买入总份额	0.00	-
期间因拆分变动份额	0.00	-
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	9,388,732.39
期末持有的基金份额	0.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	-

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	10,092,266.70	95,630.66	7,927,830.64	121,629.65

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未实施利润分配。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末，本基金未持有因认购新发、增发证券而流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300043	互动娱乐	2015年12月17日	重大并购事项停牌	17.19	-	-	79,508	1,470,128.78	1,366,742.52	-
600271	航天信息	2015年10月12日	重大资产重组停牌	71.46	-	-	10,473	903,428.62	748,400.58	-
300242	明家科技	2015年12月18日	重大资产重组停牌	49.96	2016年1月22日	44.96	12,791	554,224.94	639,038.36	-

注：本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

至本报告期末，本基金银行间市场无债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程

度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按信用评级列示的债券投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年末未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
AAA	-	4,693,910.00
AAA 以下	-	2,121,696.00
未评级	-	-
合计	-	6,815,606.00

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据及

同业存单等。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除 7.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资和买入返售金融资产等，本基金的基金管理人每日通过影子价格对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,092,266.70	-	-	-	10,092,266.70
结算备付金	262,455.84	-	-	-	262,455.84
存出保证金	61,008.61	-	-	-	61,008.61
交易性金融资产	-	-	-	-31,243,748.67	31,243,748.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,299.70	2,299.70
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	9.94	-	-	2,171.01	2,180.95
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,415,741.09	-	-	-31,248,219.38	41,663,960.47
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	246,156.85	246,156.85
应付赎回款	-	-	-	43,089.20	43,089.20
应付管理人报酬	-	-	-	52,609.06	52,609.06
应付托管费	-	-	-	8,768.16	8,768.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	751,138.34	751,138.34
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	196,559.75	196,559.75
负债总计	-	-	-	1,298,321.36	1,298,321.36
利率敏感度缺口	10,415,741.09	-	-	-29,949,898.02	40,365,639.11
上年度末 2014年12月31日					
资产					
银行存款	7,927,830.64	-	-	-	7,927,830.64
结算备付金	393,250.57	-	-	-	393,250.57
存出保证金	66,293.22	-	-	-	66,293.22
交易性金融资产	1,443,360.00	3,250,550.00	2,121,696.00	51,149,414.09	57,965,020.09

衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,333,663.32	3,333,663.32
应收利息	-	-	-	18,711.16	18,711.16
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	5,417.71	-	-	286,546.39	291,964.10
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,836,152.14	3,250,550.00	2,121,696.00	54,788,334.96	69,996,733.10
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	524,061.34	524,061.34
应付管理人报酬	-	-	-	74,966.20	74,966.20
应付托管费	-	-	-	12,494.37	12,494.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	467,378.31	467,378.31
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	302,724.96	302,724.96
负债总计	-	-	-	1,381,625.18	1,381,625.18
利率敏感度缺口	9,836,152.14	3,250,550.00	2,121,696.00	53,406,709.78	68,615,107.92

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年12月31日）	上年度末（2014年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-	0.00
	市场利率下降25个基点	-	0.00

注：于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本

基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	31,243,748.67	77.40	51,149,414.09	74.55
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	6,815,606.00	9.93
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	31,243,748.67	77.40	57,965,020.09	84.48

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
		业绩比较基准上升 5%	2,238,076.96
业绩比较基准下降 5%	-2,238,076.96	-3,175,983.78	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 28,489,567.21 元，属于第二层次的余额为 2,754,181.46 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 56,634,374.69 元，第二层次的 1,330,645.40 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 26 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	31,243,748.67	74.99
	其中：股票	31,243,748.67	74.99
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	10,354,722.54	24.85
7	其他各项资产	65,489.26	0.16
8	合计	41,663,960.47	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	873,046.39	2.16
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,405,775.03	40.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,231,392.62	3.05
F	批发和零售业	1,034,835.00	2.56
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	8,062,010.14	19.97
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,263,675.00	3.13

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	1,991,493.96	4.93
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	381,520.53	0.95
S	综合	-	-
	合计	31,243,748.67	77.40

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。

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300166	东方国信	52,800	1,691,184.00	4.19
2	002594	比亚迪	25,572	1,646,836.80	4.08
3	600485	信威集团	60,040	1,606,070.00	3.98
4	300017	网宿科技	24,619	1,476,893.81	3.66
5	300043	互动娱乐	79,508	1,366,742.52	3.39
6	002573	清新环境	60,434	1,356,138.96	3.36
7	600730	中国高科	72,500	1,263,675.00	3.13
8	600718	东软集团	40,464	1,256,407.20	3.11
9	002051	中工国际	48,614	1,231,392.62	3.05
10	300068	南都电源	59,873	1,187,880.32	2.94
11	600289	亿阳信通	58,700	1,156,390.00	2.86
12	002426	胜利精密	41,810	1,087,896.20	2.70
13	600812	华北制药	125,000	1,076,250.00	2.67
14	600775	南京熊猫	54,500	1,043,675.00	2.59
15	002308	威创股份	42,300	1,042,695.00	2.58
16	002665	首航节能	33,494	1,021,567.00	2.53
17	300101	振芯科技	33,700	994,487.00	2.46
18	002657	中科金财	11,600	927,884.00	2.30

19	002477	雏鹰农牧	51,629	873,046.39	2.16
20	300302	同有科技	10,619	769,346.55	1.91
21	600271	航天信息	10,473	748,400.58	1.85
22	600146	商赢环球	20,700	679,788.00	1.68
23	300242	明家科技	12,791	639,038.36	1.58
24	002672	东江环保	31,500	635,355.00	1.57
25	002364	中恒电气	21,900	617,799.00	1.53
26	300077	国民技术	13,600	614,448.00	1.52
27	300098	高新兴	23,500	493,265.00	1.22
28	600562	国睿科技	7,465	464,248.35	1.15
29	000963	华东医药	5,300	434,388.00	1.08
30	603883	老百姓	5,500	390,335.00	0.97
31	300133	华策影视	12,807	381,520.53	0.95
32	002580	圣阳股份	17,118	342,360.00	0.85
33	300059	东方财富	5,586	290,639.58	0.72
34	000705	浙江震元	11,200	210,112.00	0.52
35	300207	欣旺达	6,109	171,662.90	0.43
36	603800	道森股份	1,000	53,930.00	0.13

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	5,823,685.00	8.49
2	002573	清新环境	5,320,113.00	7.75
3	002477	雏鹰农牧	5,191,219.30	7.57
4	002470	金正大	5,101,656.25	7.44
5	300017	网宿科技	4,891,608.25	7.13
6	601318	中国平安	4,790,843.28	6.98
7	601633	长城汽车	4,468,948.20	6.51
8	600048	保利地产	4,456,287.00	6.49
9	601668	中国建筑	4,365,230.00	6.36
10	300133	华策影视	4,005,420.45	5.84
11	300450	先导智能	3,929,305.50	5.73
12	300274	阳光电源	3,874,646.42	5.65

13	000776	广发证券	3,850,564.39	5.61
14	600446	金证股份	3,771,155.00	5.50
15	002051	中工国际	3,760,625.00	5.48
16	002065	东华软件	3,574,511.54	5.21
17	300124	汇川技术	3,558,971.48	5.19
18	002657	中科金财	3,533,642.56	5.15
19	300005	探路者	3,518,578.15	5.13
20	600271	航天信息	3,498,660.00	5.10
21	002594	比亚迪	3,471,468.75	5.06
22	300059	东方财富	3,400,754.00	4.96
23	002580	圣阳股份	3,281,995.00	4.78
24	002563	森马服饰	3,265,855.00	4.76
25	002595	豪迈科技	3,232,624.41	4.71
26	002612	朗姿股份	3,170,708.00	4.62
27	300003	乐普医疗	3,118,413.00	4.55
28	002104	恒宝股份	3,053,624.44	4.45
29	600068	葛洲坝	2,947,546.00	4.30
30	300302	同有科技	2,938,583.50	4.28
31	300166	东方国信	2,913,337.53	4.25
32	600837	海通证券	2,853,851.82	4.16
33	300155	安居宝	2,807,395.00	4.09
34	002271	东方雨虹	2,805,072.43	4.09
35	601111	中国国航	2,802,570.00	4.08
36	600436	片仔癀	2,773,594.78	4.04
37	600730	中国高科	2,769,251.00	4.04
38	600109	国金证券	2,767,148.00	4.03
39	000625	长安汽车	2,730,458.91	3.98
40	000024	招商地产	2,725,994.00	3.97
41	002275	桂林三金	2,659,062.52	3.88
42	300043	互动娱乐	2,589,399.75	3.77
43	000961	中南建设	2,582,011.00	3.76
44	600388	龙净环保	2,579,696.00	3.76
45	601800	中国交建	2,482,552.60	3.62
46	600067	冠城大通	2,454,967.06	3.58
47	601628	中国人寿	2,344,463.00	3.42
48	600000	浦发银行	2,332,871.00	3.40

49	601169	北京银行	2,170,323.00	3.16
50	600570	恒生电子	2,164,092.00	3.15
51	300115	长盈精密	2,154,157.00	3.14
52	002465	海格通信	2,146,076.58	3.13
53	601328	交通银行	2,129,172.00	3.10
54	601601	中国太保	2,122,886.00	3.09
55	600289	亿阳信通	2,098,310.00	3.06
56	600118	中国卫星	2,005,923.00	2.92
57	600485	信威集团	1,975,533.00	2.88
58	300267	尔康制药	1,923,619.00	2.80
59	601098	中南传媒	1,902,904.15	2.77
60	600036	招商银行	1,884,640.00	2.75
61	600066	宇通客车	1,876,363.65	2.73
62	002664	信质电机	1,870,349.00	2.73
63	002426	胜利精密	1,868,488.00	2.72
64	000090	天健集团	1,851,738.86	2.70
65	002583	海能达	1,835,150.00	2.67
66	000049	德赛电池	1,815,876.62	2.65
67	600690	青岛海尔	1,803,724.00	2.63
68	300104	乐视网	1,772,761.00	2.58
69	002074	国轩高科	1,772,616.50	2.58
70	300367	东方网力	1,769,279.43	2.58
71	002185	华天科技	1,747,706.00	2.55
72	000858	五粮液	1,735,801.00	2.53
73	000002	万科A	1,718,821.00	2.51
74	600718	东软集团	1,652,599.00	2.41
75	600993	马应龙	1,651,104.00	2.41
76	000920	南方汇通	1,619,642.00	2.36
77	601311	骆驼股份	1,607,659.00	2.34
78	600340	华夏幸福	1,602,578.00	2.34
79	002665	首航节能	1,564,290.00	2.28
80	600885	宏发股份	1,554,587.84	2.27
81	300202	聚龙股份	1,486,607.00	2.17
82	601336	新华保险	1,485,489.28	2.17
83	000488	晨鸣纸业	1,484,285.81	2.16
84	300242	明家科技	1,466,548.34	2.14

85	300050	世纪鼎利	1,461,033.00	2.13
86	002024	苏宁云商	1,402,494.00	2.04

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	10,465,680.33	15.25
2	600048	保利地产	8,731,583.74	12.73
3	002573	清新环境	6,633,125.40	9.67
4	000002	万科A	6,135,296.33	8.94
5	601628	中国人寿	5,822,740.99	8.49
6	601166	兴业银行	5,710,734.47	8.32
7	002470	金正大	5,573,778.63	8.12
8	000776	广发证券	5,395,943.98	7.86
9	600388	龙净环保	5,312,721.31	7.74
10	600690	青岛海尔	5,202,876.90	7.58
11	300017	网宿科技	5,165,368.60	7.53
12	002051	中工国际	4,898,228.20	7.14
13	002477	雏鹰农牧	4,751,391.66	6.93
14	600837	海通证券	4,742,699.65	6.91
15	000024	招商地产	4,735,477.18	6.90
16	601668	中国建筑	4,703,791.00	6.86
17	601633	长城汽车	4,573,770.15	6.67
18	600109	国金证券	4,510,055.82	6.57
19	300274	阳光电源	4,377,723.36	6.38
20	601328	交通银行	4,172,226.01	6.08
21	002580	圣阳股份	4,125,031.40	6.01
22	600685	中船防务	3,782,749.01	5.51
23	300005	探路者	3,697,287.03	5.39
24	300133	华策影视	3,690,998.55	5.38
25	002595	豪迈科技	3,664,756.44	5.34
26	000625	长安汽车	3,586,728.57	5.23
27	600446	金证股份	3,540,529.71	5.16
28	300124	汇川技术	3,537,614.02	5.16
29	300003	乐普医疗	3,533,991.87	5.15
30	601336	新华保险	3,298,916.90	4.81

31	300450	先导智能	3,271,809.10	4.77
32	002465	海格通信	3,227,406.44	4.70
33	600036	招商银行	3,224,559.22	4.70
34	002104	恒宝股份	3,176,721.66	4.63
35	300302	同有科技	3,097,334.30	4.51
36	002658	雪迪龙	3,085,286.00	4.50
37	600089	特变电工	3,039,558.49	4.43
38	600068	葛洲坝	2,993,741.71	4.36
39	600436	片仔癀	2,978,760.47	4.34
40	002563	森马服饰	2,977,078.52	4.34
41	002065	东华软件	2,951,407.57	4.30
42	000651	格力电器	2,881,441.30	4.20
43	002271	东方雨虹	2,808,355.12	4.09
44	601111	中国国航	2,699,202.85	3.93
45	002657	中科金财	2,586,718.36	3.77
46	300155	安居宝	2,555,418.65	3.72
47	300059	东方财富	2,514,531.07	3.66
48	002275	桂林三金	2,495,803.10	3.64
49	600067	冠城大通	2,452,492.17	3.57
50	000961	中南建设	2,448,367.88	3.57
51	601800	中国交建	2,391,212.50	3.49
52	601098	中南传媒	2,384,389.51	3.48
53	000333	美的集团	2,280,619.00	3.32
54	002366	台海核电	2,269,497.26	3.31
55	600000	浦发银行	2,243,325.00	3.27
56	600118	中国卫星	2,226,064.97	3.24
57	002466	天齐锂业	2,183,500.25	3.18
58	300267	尔康制药	2,162,313.28	3.15
59	300202	聚龙股份	2,145,277.07	3.13
60	002664	信质电机	2,111,953.24	3.08
61	002594	比亚迪	2,108,244.38	3.07
62	601169	北京银行	2,094,406.68	3.05
63	601601	中国太保	2,077,410.76	3.03
64	600271	航天信息	2,023,248.22	2.95
65	002074	国轩高科	1,998,396.18	2.91
66	600066	宇通客车	1,985,724.46	2.89
67	002612	朗姿股份	1,941,941.69	2.83
68	300115	长盈精密	1,921,761.36	2.80

69	000090	天健集团	1,869,794.93	2.73
70	002583	海能达	1,853,061.03	2.70
71	000049	德赛电池	1,832,581.20	2.67
72	600340	华夏幸福	1,819,994.21	2.65
73	300104	乐视网	1,764,072.22	2.57
74	600993	马应龙	1,680,443.33	2.45
75	601311	骆驼股份	1,677,297.32	2.44
76	000858	五粮液	1,675,394.22	2.44
77	300367	东方网力	1,637,087.32	2.39
78	600570	恒生电子	1,624,737.46	2.37
79	000920	南方汇通	1,579,831.33	2.30
80	600885	宏发股份	1,522,691.07	2.22
81	000963	华东医药	1,479,890.40	2.16
82	600730	中国高科	1,436,780.86	2.09
83	002024	苏宁云商	1,432,899.02	2.09
84	603555	贵人鸟	1,411,800.00	2.06
85	601988	中国银行	1,410,072.27	2.06
86	000488	晨鸣纸业	1,402,079.00	2.04

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	315,544,520.37
卖出股票收入（成交）总额	349,506,835.75

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未投资于国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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，中国证监会决定对公司立案调查。上述信息公司已于 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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	61,008.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,299.70
5	应收申购款	2,180.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,489.26

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300043	互动娱乐	1,366,742.52	3.39	重大并购事项停牌

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,022	6,864.27	49,407.11	0.24%	20,694,428.35	99.76%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	107,956.89	0.52%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年11月22日）基金份额总额	868,315,781.01
本报告期期初基金份额总额	42,419,579.45
本报告期基金总申购份额	25,062,912.51
减:本报告期基金总赎回份额	46,738,656.50
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	20,743,835.46

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

我公司于2015年3月26日召开2015年度第一次临时股东会，会议决定选举许会斌、孙志晨、曹伟、张维义、袁时奋、殷红军、李全、王建国、伏军为第四届董事会董事，杨文升、欧阳伯权、顾建国不再继续担任公司董事。同日，我公司召开第四届董事会第一次会议，会议选举许会斌先生为公司董事长，杨文升先生不再担任公司董事长。公司已将前述董事任免情况报告备案至中国证监会和北京监管局。公司目前现有9名董事，其中与控股股东中国建设银行股份有限公司有关联关系的董事为3名，符合《证券投资基金管理公司管理办法》第四十一条第三款的监管要求。

2015年5月22日，公司副总经理王新艳女士由于个人原因离职，公司第四届董事会第一次临时会议已批准其离职。2015年7月30日公司董事会决定路彩营不再担任我公司督察长职务。

同日，公司董事会决定聘任张威威、曲寅军、吴曙明三人担任我公司高管，张威威、曲寅军的职务为公司副总裁，吴曙明为督察长。2015年8月25日，公司副总裁何斌先生由于个人原因离职，公司第四届董事会第四次临时会议已批准其离职。公司根据监管要求，向中国基金业协会履行了高管任免备案程序。同时，公司对上述高级管理人员离任进行了离任审查并按规定向监管机构报备。基金管理人上述人员的重大变动已依法进行了披露。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为人民币60,000.00元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	1	188,911,522.38	28.61%	169,274.64	28.17%	-
中金公司	1	185,176,286.42	28.05%	168,585.00	28.06%	-
申万宏源	1	111,694,016.99	16.92%	104,020.76	17.31%	-
东方证券	1	66,035,393.98	10.00%	60,118.71	10.00%	-
齐鲁证券	1	48,241,378.50	7.31%	43,426.81	7.23%	-

中信建投	1	34,203,639.32	5.18%	31,811.75	5.29%	-
中信证券	1	25,963,167.37	3.93%	23,659.85	3.94%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为；

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；

（4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本报告期内新增中信证券、申万宏源、东方证券、齐鲁证券各一个交易单元，银河证券两个交易单元，无剔除交易单元。

4、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	12,726,001.20	74.07%	-	-	-	-
中金公司	4,367,250.19	25.42%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	87,358.10	0.51%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于建信恒稳价值混合基金参加中国光大银行电子渠道基金定投费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 12 月 31 日
2	关于公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2016 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 12 月 26 日
3	关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行基金定投业务费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 12 月 14 日
4	关于旗下基金产品参加“京东全场基金 0 折购”活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 12 月 2 日
5	关于旗下基金产品参加“京东全场基金 0 折购”活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 8 月 11 日
6	建信基金管理有限责任公司关于新增北京微动利投资管理有限公司为旗下代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 7 月 17 日
7	关于新增北京植信基金为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 7 月 13 日
8	关于旗下基金产品参加“京东全场基金 0 折购”活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 7 月 7 日
9	关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行及手机银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 6 月 26 日

10	建信基金管理有限责任公司关于新增上海汇付金融服务有限公司为旗下代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 6 月 2 日
11	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 5 月 28 日
12	关于公司旗下部分开放式基金开通基金转换业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 5 月 27 日
13	关于继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 3 月 28 日
14	关于新增北京晟视天下投资管理有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 3 月 21 日
15	关于公司旗下部分开放式基金参加和讯科技申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 3 月 11 日
16	关于公司旗下部分开放式基金在工商银行开通基金转换业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 3 月 4 日
17	关于旗下部分开放式基金 2015 年参加中国工商银行基金定投费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 1 月 15 日
18	建信基金管理有限责任公司关于开展直销网上交易基金转换费率优惠活动的更新公告	指定报刊和/或公司网站	2015 年 1 月 6 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信恒稳价值混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信恒稳价值混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信恒稳价值混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信恒稳价值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。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 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3月29日