

建信安心保本六号混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

2016 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 1 月 19 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 17 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信安心保本六号混合
基金主代码	002573
交易代码	002573
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 28 日
报告期末基金份额总额	4,538,205,275.40 份
投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金的资产包括风险资产和安全资产，本基金投资策略分为两个层次：一层为基金在风险资产和安全资产两大类资产上的配置策略；另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。
业绩比较基准	2 年期银行定期存款收益率（税前）。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属于证券投资基金中的中低风险品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金保证人	北京首创融资担保有限公司

§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（2016年10月1日—2016年12月31日）
1. 本期已实现收益	12,307,721.62
2. 本期利润	-55,524,227.76
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0121
4. 期末基金资产净值	4,557,324,040.12
5. 期末基金份额净值	1.004

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。

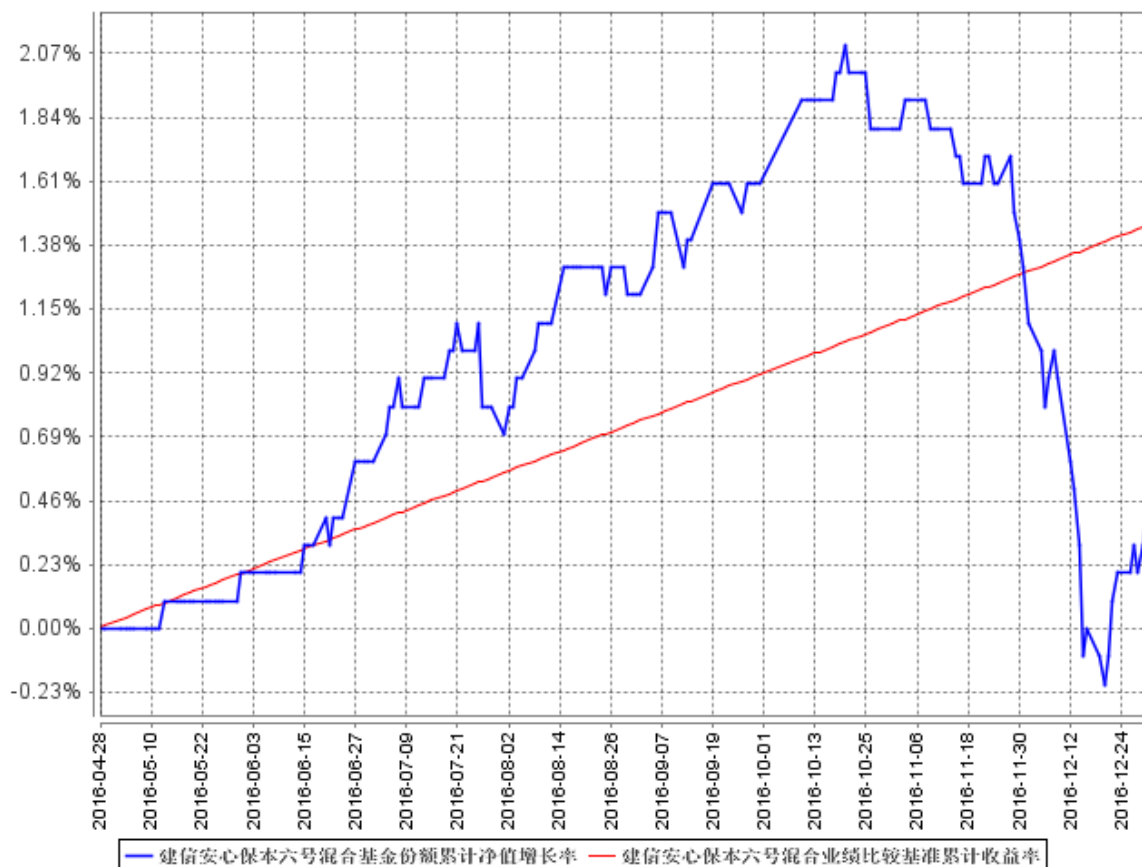
3.2 基金净值表现

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	-1.18%	0.12%	0.54%	0.01%	-1.72%	0.11%

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

建信安心保本六号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：1. 本基金基金合同于 2016 年 4 月 28 日生效，截至报告期末未满一年。

2. 本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§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		
朱建华	本基金的基金经理	2016 年 4 月 28 日	-	9	硕士。曾任大连博达系统工程公司职员、中诚信国际信用评级公司项目组长，2007 年 10 月起任中诚信证券评估有限公司公司评级部总经理助理，2008 年 8 月起任国泰基金管理公司高级研究员。朱建华于 2011 年 6 月加入本公

				<p>司，历任高级债券研究员、货币市场基金的基金经理助理，2012 年 8 月 28 日至 2015 年 8 月 11 日任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理；</p> <p>2012 年 11 月 15 日至 2014 年 3 月 6 日任建信纯债债券型证券投资基金基金经理；</p> <p>2012 年 12 月 20 日至 2014 年 3 月 27 日任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理；</p> <p>2013 年 5 月 14 日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金经理；2013 年 12 月 10 日起任建信稳定添利债券型证券投资基金基金经理；2016 年 3 月 14 日起任建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；</p> <p>2016 年 4 月 28 日起任建信安心保本六号基金经理；2016 年 6 月 1 日任建信转债增强债券基金经理；2016 年 11 月 1 日起任建信瑞丰添利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《建信安心保本六号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 2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，整体宏观经济出现小周期的回暖态势，企业利润特别是上游企业利润回升明显，黑色钢铁为代表的大宗商品价格继续大涨，国际原油价格创出一年多的新高，并带动 ppi 和 cpi 的超预期。纵观四季度，经济的企稳回升主要来自于年初以来以基建为主的需求端的扩张，其中以国企和政府的融资需求占主导地位，民间投资继续回落，大量融资又进入金融领域，资金的空转也是造成市场上资金泛滥的重要原因。虽然全年固定资产投资增速仅 10 个百分点左右，但是基数已经远超 09 年的规模。四季度，政府加强了对地产的调控措施，房价上涨得到一定遏制，地产投资增速出现下滑。从周期看，目前经济的小周期回暖并未改变长周期经济继续下滑的态势，特别是信贷周期已经出现增速下降的前提下将可能带动地产周期和库存周期的高位回落，对未来经济基本面和大宗商品价格形成压制。四季度国内货币政策由之前的偏宽松转为收紧流动性，而美元的走强使货币政策更不敢放松，金融进入紧缩期。金融的全面去杠杆并导致资金面的持续紧张，回购利率创年内新高，银行同业理财首先受到冲击，银行体系为保流动性对债基和货币基金大规模赎回，加上年底 mpa 考核、对表外理财收缩的担忧、美国总统选举等因素综合影响，债券市场在四季度后半段抽血严重，出现大跌。四季度权益市场整体表现较差，虽然蓝筹一度有所表现，但受对险资举盘的限制以及资金面紧张的影响，12 月 A 股市场再次出现较大下跌，特别是中小

创最低点已经接近全年低点。经历下跌后，A 股成交量与换手率也达到全年低点。转债市场方面，四季度受资金面前松后紧的影响，转债呈现先涨后跌，特别是 12 月份因流动性冲击造成转债短期内纷纷破位下行，目前从溢价率和纯债的价值看转债整体上价值并不突出加上存量有限流动性不佳，难以获得增量资金关注，但超跌后存在补涨需求。

本季度，建信安心保本六号因受年底债券大跌的拖累净值出现回撤，虽然年底有所回升但相比年内高点仍有较大距离，权益方面，本基金对权益仓位进行了减持。目前本基金没有杠杆，主要以流动性好的固定收益类资产为主，久期也比之前有所降低，在保持净值稳定的基础上再寻求进攻性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-1.18%，波动率 0.12%，业绩比较基准收益率 0.54%，波动率 0.01%。

§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	171,160,647.09	3.75
	其中：股票	171,160,647.09	3.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,934,930,523.20	64.23
	其中：债券	2,934,930,523.20	64.23
	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	954,191,370.27	20.88
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	109,790,710.27	2.40
7	银行存款和结算备付金合计	423,102,630.79	9.26
8	其他资产	85,877,000.15	1.88
9	合计	4,569,262,171.50	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	116,413,275.12	2.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	27,070,124.74	0.59
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	21,654,875.00	0.48
J	金融业	106,780.00	0.00
K	房地产业	5,900,000.00	0.13
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	-	-
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	171,160,647.09	3.76

以上行业分类以 2016 年 12 月 31 日的中国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股票。

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	300287	飞利信	1,800,000	21,420,000.00	0.47
2	000860	顺鑫农业	849,988	18,699,736.00	0.41
3	300450	先导智能	529,910	18,011,640.90	0.40
4	300054	鼎龙股份	800,000	17,480,000.00	0.38
5	002221	东华能源	1,399,908	17,344,860.12	0.38
6	300415	伊之密	799,976	16,103,516.88	0.35
7	002106	莱宝高科	1,299,975	14,611,719.00	0.32

8	600875	东方电气	1,199,974	12,947,719.46	0.28
9	002727	一心堂	449,975	9,539,470.00	0.21
10	603899	晨光文具	400,000	7,280,000.00	0.16

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	公允价值（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	1,862,091,600.00	40.86
	其中：政策性金融债	1,626,894,600.00	35.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	963,013,000.00	21.13
6	中期票据	81,432,000.00	1.79
7	可转债（可交换债）	28,393,923.20	0.62
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,934,930,523.20	64.40

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150205	15 国开 05	3,300,000	329,208,000.00	7.22
2	160304	16 进出 04	3,000,000	299,550,000.00	6.57
3	011699625	16 悦达 SCP001	2,000,000	200,640,000.00	4.40
4	1620031	16 江西银 行绿色金 融 01	1,900,000	186,447,000.00	4.09
5	160207	16 国开 07	1,700,000	164,934,000.00	3.62

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	419,276.50
2	应收证券清算款	18,138,208.51
3	应收股利	-
4	应收利息	67,318,815.98
5	应收申购款	699.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	85,877,000.15
---	----	---------------

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	300450	先导智能	18,011,640.90	0.40	重大资产重组
2	600875	东方电气	12,947,719.46	0.28	重大事项
3	002727	一心堂	9,539,470.00	0.21	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	4,672,138,955.78
报告期期间基金总申购份额	4,143,720.72
减：报告期期间基金总赎回份额	138,077,401.10
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	4,538,205,275.40

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安心保本六号混合型证券投资基金设立的文件；

- 2、《建信安心保本六号混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信安心保本六号混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信安心保本六号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
2017 年 1 月 19 日