建信收益增强债券型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月27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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月22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2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信增强债券
基金主代码	530009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月2日
报告期末基金份额总额	1,398,708,508.37份
投资目标	在保持资产流动性的基础上,发挥投研团队在固定收益、股票及金融衍生产品方面的综合研究实力,在有效控制风险的前提下追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建信用类债券投资组合,运用基本面研究择机介入上市公司股票及参与新股申购,以实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	30%×中债企业债总指数+70%×中债国债总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,但高于货币市场基金以及不涉及股票二级市场投资的债券型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	建信增强债券A / 建信增强债券C
下属两级基金的交易代码	530009 / 531009
报告期末下属两级基金的份额总额	483,714,287.16份 / 914,994,221.21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(2010年7月1日-2010年9月30日)	
	建信增强债券A	建信增强债券C
1.本期已实现收益	12,645,053.96	22,359,427.61
2.本期利润	28,220,100.60	52,172,683.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0536	0.0528
4.期末基金资产净值	530,302,200.57	997,789,857.28
5.期末基金份额净值	1.096	1.090

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

1、建信增强债券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	5.08%	0.18%	1.06%	0.06%	4.02%	0.12%

2、建信增强债券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	5.01%	0.20%	1.06%	0.06%	3.95%	0.14%

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

建信收益增强债券型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009年6月2日至2010年9月30日)

注:1、本基金债券类资产(含可转换债券)投资比例不低于基金资产的80%,其中,本基金持有公司债、金融债、企业债、资产支持证券等除国债、中央银行票据以外的固定收益类资产的比例不低于债券资产的30%,本基金投资于股票(含一级市场新股申购)等权益类品种的比例为基金资产的0-20%,现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

2、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		
钟敬捷先生	本基金基金经理	2009-6-2	-	5	CFA,硕士,加拿大籍华人。1995年7月毕业于南开大学金融系,获经济学学士学位,2004年5月毕业于加拿大不列颠哥伦比亚大学,获共商管理硕士学位,曾先后任职于广东发展银行珠海分行,深圳发展银行珠海分行,嘉实基金管理有限公司等,从事外汇交易、信贷、债券研究及投资组合管理等工作。2008年5月加入本公司。2008年6月15日起任建信稳定增利基金基金经理。
李菁女士	本基金基金经理	2009-6-2	-	5	硕士,2002年7月进入中国建设银行股份有限公司基金托管部工作,从事基金托管业务,任主任科员。2005年9月加入本公司,先后任债券研究员和本基金基金经理助理,2007年11月1日起至今任建信货币基金基金经理。
卓利伟先生	本基金基金经理	2009-6-25	-	5	硕士,1994年9月起在杭州经济建设集团工商公司投资部任职;1997年11月起在北京恒逸实业有限公司投资部任职;2003年1月起任上海石油交易所筹备组成员;2005年1月加入巨荣投资控股集团有限公司,任投资部副经理。2005年8月加入本公司研究部,历任研究员、高级研究员,2008年3月起任建信短久价值基金基金经理助理。自2009年3月25日起任建信恒久价值基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《建信收益增强债券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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,本基金管理人不存在与本基金投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

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

在二季度各项调控政策频出后,三季度宏观经济经历了增长环比向下探底然后回升的过程。随着经济环比的回升和通胀预期的升温,债券市场各期限品种收益率在7月下旬开始缓慢回升,转债和股票等权益市场表现较好。

作为股票收益增强的债券型基金,本季度基金在利率产品方面维持前期中性偏低的久期策略和信用产品配置比例。权益市场方面,本基金加大了对转债品种的配置比例,精选个股并积极参与了新股投资,取得了一定的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

三季度本基金A净值增长率5.08%,波动率0.18%,业绩比较基准收益率1.06%,波动率0.06%。

三季度本基金C净值增长率5.01%,波动率0.20%,业绩比较基准收益率1.06%,波动率0.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们认为国内宏观经济运行将较为平稳,地产调控仍将持续化进行,而以节能减排为核心的新兴产业是否能成为新的经济增长点仍值得关注。外围经济的持续低迷所导致的再次量化宽松政策以及美国中期选举等外部因素都使得人民币升值和欧债对国内通胀的容忍程度再次成为关注的焦点。我们认为四季度国内经济增长将保持平稳、市场流动性相对宽松但通胀预期仍将有所上升,由此我们判断四季度债券市场仍将难有起色,权益市场方面,应积极关注通胀预期和人民币升值这两条主线所带来的投资机会,并积极挖掘基于内需服务、具有长期竞争力的优秀上市公司。总体来讲,四季度我们将保持偏低的久期策略,加强组合投资的灵活性,重点寻找个股和转债的投资机会,力求为持有人获得较好的绝对收益。

§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	180,446,364.48	10.29
	其中:股票	180,446,364.48	10.29
2	固定收益投资	1,327,540,254.59	75.71
	其中:债券	1,327,540,254.59	75.71
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	18,881,253.73	1.08
6	其他各项资产	226,508,263.70	12.92
7	合计	1,753,376,136.50	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	11,291,098.65	0.74
B	采掘业	-	-
C	制造业	99,518,767.27	6.51
C0	食品、饮料	17,618,400.00	1.15
C1	纺织、服装、皮毛	1,179,478.10	0.08
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,663,200.00	0.11
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,511,555.96	0.56
C5	电子	27,404,062.78	1.79
C6	金属、非金属	2,499,991.89	0.16
C7	机械、设备、仪表	34,306,095.52	2.25
C8	医药、生物制品	6,335,983.02	0.41
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,649,120.90	0.37
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	5,180,000.00	0.34
H	批发和零售贸易	17,230,000.00	1.13
I	金融、保险业	26,980,000.00	1.77
J	房地产业	8,409,377.66	0.55
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	6,188,000.00	0.40
	合计	180,446,364.48	11.81

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	601601	中国太保	1,000,000	21,800,000.00	1.43
2	002475	立讯精密	411,026	15,487,459.68	1.01
3	601717	郑煤机	478,632	15,234,856.56	1.00
4	600361	华联综超	1,000,000	12,970,000.00	0.85
5	000858	五粮液	330,000	11,328,900.00	0.74
6	600239	云南城投	499,963	8,409,377.66	0.55
7	600887	伊利股份	150,000	6,289,500.00	0.41
8	600790	轻纺城	700,000	6,188,000.00	0.40
9	300118	东方日升	123,245	5,716,103.10	0.37
10	002086	东方海洋	300,000	5,685,000.00	0.37

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	137,558,880.00	9.00
2	央行票据	270,224,000.00	17.68
3	金融债券	180,316,000.00	11.80
	其中:政策性金融债	180,316,000.00	11.80
4	企业债券	343,601,260.00	22.49
5	企业短期融资券	50,065,000.00	3.28
6	可转债	252,656,401.29	16.53
7	公司债	93,118,713.30	6.09
8	其他	-	-
9	合计	1,327,540,254.59	86.88

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	1001042	10央行票据42	2,000,000	200,140,000.00	13.10
2	090223	09国开23	1,300,000	129,961,000.00	8.50
3	113001	中行转债	892,520	93,946,655.20	6.15
4	113002	工行转债	811,700	90,610,071.00	5.93
5	122036	09沪张江	730,670	77,443,713.30	5.07

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	579,217.37
2	应收证券清算款	201,228,131.66
3	应收股利	-
4	应收利息	22,829,798.21
5	应收申购款	1,871,116.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	226,508,263.70

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产的净值比例(%)
1	110003	新钢转债	38,236,807.80	2.50
2	110007	博汇转债	3,907,074.60	0.26
3	110008	王府转债	1,484,037.50	0.10
4	125709	新钢转债	16,379,155.19	1.07

5.8.5 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)	占基金资产的净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002475	立讯精密	15,487,459.68	1.01	网下发行获配锁定期三个月
2	601717	郑煤机	15,234,856.56	1.00	网下发行获配锁定期三个月
3	300118	东方日升	5,716,103.10	0.37	网下发行获配锁定期三个月

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信增强债券A	建信增强债券C
本报告期期初基金份额总额	552,377,280.96	1,075,650,762.96
本报告期基金总申购份额	180,694,874.99	211,987,245.45
减:本报告期基金总赎回份额	249,357,868.79	372,643,787.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	483,714,287.16	914,994,221.21

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准建信收益增强债券型证券投资基金募集的文件;
2、《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信收益增强债券型证券投资基金托管协议》;
4、关于申请募集建信收益增强债券型证券投资基金之法律意见书;
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。

7.2 存放地点

备查文件目录第1至5项和第7项备查文件存放在基金管理人办公场所、营业场所;第6项文件存放在基金托管人的办公场所。

7.3 查阅方式

基金投资者在营业时间可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复印件或复制件。

建信基金管理有限责任公司
二〇一〇年十月二十七日

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

2010 第三季度报告

2010年9月30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:2010年10月27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2010年10月22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2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信沪深300指数(LOF)
基金主代码	165309
交易代码	165309
基金运作方式	契约型、上市开放式
基金合同生效日	2009年11月5日
报告期末基金份额总额	5,966,201,807.62份
投资目标	本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
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(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	-21,417,365.94
2.本期利润	552,368,142.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.1014
4.期末基金资产净值	4,999,343,460.05
5.期末基金份额净值	0.838

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	13.86%	1.28%	13.79%	1.25%	0.07%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年11月5日至2010年9月30日)

注:1、本基金基金合同2009年11月9日生效,至本报告日未满一年。

2、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		
梁洪昀先生	投资管理部副总监,本基金基金经理	2009-11-5	-	7	注册金融分析师(CFA),2003年1月获清华大学经济学博士学位,2003年1月至2005年8月,就职于大成基金管理有限公司,历任金融工程组研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年9月加入本公司,历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监,现任投资管理部副总监。

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,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》及其他有关法律法规的规定和《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)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,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金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

在报告期内,本基金根据基金合同规定,采取了对指数的被动复制策略,将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度的绝对值控制在了基金合同约定的范围之内。

在报告期内,本基金管理人在量化分析的基础上,采取了适当的组合调整策略,应对农业银行快速进入指数后成份股构成及权重的变化,基本实现了预期的效果。

在报告期内,本基金跟踪误差主要源自标的指数中工商银行和建设银行两只股票限于法律法规相关规定无法投资而必须寻找其他股票进行替代。本基金管理人在量化分析研究基础上,采取了相应的替代策略,并不断根据市场最新情况对替代方案进行调整,以达到尽可能降低跟踪误差及偏离度的目标。

在报告期内,部分权重股票连续停牌,并造成基金估值调整,亦对基金的跟踪误差产生了比较明显的放大作用。三季度后期这些股票复牌后,这一影响随之消失。

在报告期内,个别交易日的大额申购赎回等其他因素也对基金的跟踪误差及偏离度产生了一定影响,本基金管理人亦在日常管理中通过选择适当的策略尽力克服了这些不利影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

三季度本基金净值增长率13.86%,波动率1.28%,业绩比较基准收益率13.79%,波动率1.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们判断宏观经济运行将基本保持平稳,沪深300指数的波动性总体上将与三季度相仿,但部分时段可能会有所加剧。明年1月初指数将迎来新一次成份股变化,在四季度末时,基金组合需要提前进行相应调整。本基金管理人将根据基金合同,继续秉承被动复制策略,并以量化分析研究为基础,克服不到成份股无法投资、基金日常申赎及成份股调整等各种因素造成的不利影响,将基金的跟踪误差及偏离度尽可能保持在较低水平。

§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	4,709,185,922.27	91.13
	其中:股票	4,709,185,922.27	91.13
2	固定收益投资	101,340,000.00	1.96
	其中:债券	101,340,000.00	1.96
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	351,809,198.36	6.81
6	其他各项资产	5,226,775.58	0.10
7	合计	5,167,561,896.21	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	3,709,957.60	0.07
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,709,957.60	0.07

5.2.2 指数投资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	19,854,166.74	0.40
B	采掘业	519,848,039.19	10.40
C	制造业	1,584,965,448.43	31.70
C0	食品、饮料	247,872,812.42	4.96
C1	纺织、服装、皮毛	19,656,393.71	0.39
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	6,582,759.45	0.13
C4	石油、化学、塑胶、塑料	115,581,713.31	2.31
C5	电子	23,144,832.55	0.46
C6	金属、非金属	405,084,886.95	8.10
C7	机械、设备、仪表	553,096,528.20	11.06
C8	医药、生物制品	195,742,588.66	3.92
C99	其他制造业	18,202,933.18	0.36
D	电力、煤气及水的生产和供应业	154,173,028.42	3.08
E	建筑业	153,553,946.28	3.07
F	交通运输、仓储业	206,251,735.66	4.13
G	信息技术业	153,841,425.01	3.08
H	批发和零售贸易	167,314,691.21	3.35
I	金融、保险业	1,324,233,180.02	26.49
J	房地产业	257,075,155.99	5.14
K	社会服务业	44,606,940.00	0.89
L	传播与文化产业	9,404,831.74	0.19
M	综合类	110,353,375.98	2.21
	合计	4,705,475,964.67	94.12

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	3,212,194	169,892,940.66	3.40
2	600036	招商银行	12,265,201	158,834,352.95	3.18
3	601328	交通银行	24,115,743	139,871,309.40	2.80
4	600016	民生银行	22,683,857	115,687,670.70	2.31
5	601166	兴业银行	4,251,442	98,293,339.04	1.97
6	600000	浦发银行	7,017,186	90,942,730.56	1.82
7	000002	万科A	9,280,838	77,959,039.20	1.56
8	601088	中国神华	3,162,098	74,657,133.78	1.49
9	600030	中信证券	6,674,671	71,018,499.44	1.42
10	601601	中国太保	3,013,615	65,696,807.00	1.31

5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600816	安信信托	272,791	3,709,957.60	0.07

注:该只股票原为指数投资持有,2010年7月1日沪深300指数调整时被列为非成份股。

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	101,340,000.00	2.03
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	101,340,000.00	2.03

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	0801044	08央行票据44	1,000,000	101,340,000.00	2.03

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 基金投资的前十名股票中,不在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	580,672.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,456,031.66
4	应收利息	2,115,466.80
5	应收申购款	74,604.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,226,775.58

5.8.4 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。

5.8.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2 期末积极投资前五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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600816	安信信托	3,709,957.60	0.07	重要事项未公告

注:该只股票原为指数投资持有,2010年7月1日沪深300指数调整时被列为非成份股。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	5,272,284,014.34
本报告期基金总申购份额	997,649,834.34
减:本报告期基金总赎回份额	303,732,041.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,966,201,807.62

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信沪深300指数证券投资基金(LOF)设立的文件;
2、《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金合同》;
3、《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)招募说明书》;
4、《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)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。

7.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

7.3 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
二〇一〇年十月二十七日

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月27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2010年10月25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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务数据未经审计。

本报告期自2010年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	万家双引擎灵活配置混合
基金主代码	519183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月27日
报告期末基金份额总额	70,012,399.04份
投资目标	本基金通过股票、债券的有效配置,把握价值、成长风格特征,精选个股,构造风格类资产组合。在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金根据对宏观经济环境、经济增长前景及证券市场发展状况的综合分析,确定大类资产的动态配置。本基金股票投资组合采取自下而上的策略,以量化指标分析为基础,结合定性分析,精选具有明显价值、成长风格特征且具备估值优势的股票,构建投资组合,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金