上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2013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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	责任ETF
基金主代码	510090
交易代码	510090
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2010年5月28日
报告期末基金份额总额	454,581,114.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	上证社会责任指数
风险收益特征	本基金属于股票指数型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。本基金为指数型基金，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。
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（2012年10月1日-2012年12月31日）
1.本期已实现收益	-1,340,427.33
2.本期利润	59,791,010.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.1314
4.期末基金资产净值	401,952,438.77
5.期末基金份额净值	0.884

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

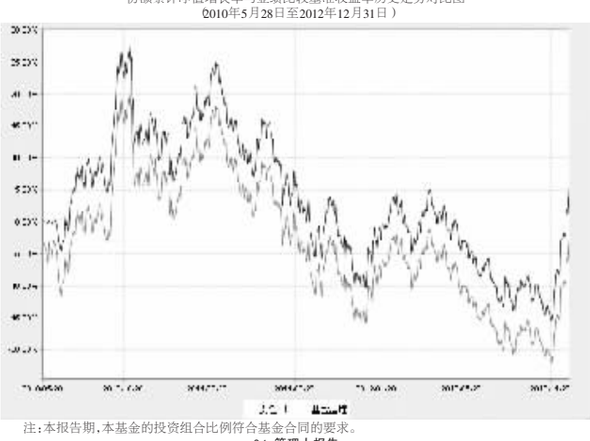
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.40%	1.40%	17.77%	1.40%	-0.37%	0.00%

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

上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2010年5月28日至2012年12月31日）



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		
叶乐天先生	本基金基金经理	2012-3-21	-	4	曾就职于中国国际金融有限公司，先后担任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资；2011年9月加入我公司，担任基金经理助理。2012年3月21日起任上证社会责任ETF及联接基金基金经理。

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《上证社会责任交易型指数证券投资基金基金合同》的规定。

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 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控制在了基金合同约定的范围之内。

报告期内，本基金跟踪误差主要来自基金净值保留位数有限造成的舍入误差以及所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。权重结构上的差异源自部分股票由于舍入取整等原因，申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比有所变化。本基金管理人在量化分析基础上，采取了适当的组合调整策略，尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值增长率17.40%，波动率 1.40%，业绩比较基准收益率17.77%，波动率1.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在四季度初期，指数延续三季度的颓势继续下跌，但到12月份，在银行股等权重股的带领下，指数走出了一波明显的反弹行情，市场情绪也得到了一定程度的修复。预计一季度初期，指数在市场情绪的推动下仍会维持震荡向上的走势。

本基金管理人将根据基金合同，以量化分析研究为基础，克服各种因素的不利影响，不断优化和改进量化模型，将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

§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	400,294,367.83	99.41
	其中：股票	400,294,367.83	99.41
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,387,863.34	0.59
6	其他各项资产	454.24	0.00
7	合计	402,682,685.41	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

本基金本报告期未未持有积极投资股票。

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	-	-
B	采掘业	36,995,679.89	9.20
C	制造业	69,568,640.26	17.31
C0	食品、饮料	2,279,685.36	0.57
C1	纺织、服装、皮毛	2,093,579.00	0.52
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,676,010.44	1.16
C5	电子	3,725,346.97	0.93
C6	金属、非金属	8,085,834.26	2.01
C7	机械、设备、仪表	32,533,917.35	8.09
C8	医药、生物制品	16,174,266.88	4.02
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,415,678.48	0.60
E	建筑业	25,784,474.29	6.41
F	交通运输、仓储业	4,371,082.03	1.09
G	信息技术业	13,220,984.52	3.29
H	批发和零售贸易	11,500,074.85	2.86
I	金融、保险业	211,064,453.51	52.51
J	房地产业	23,465,186.28	5.84
K	社会服务业	1,908,113.72	0.47
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	400,294,367.83	99.59

注：以上行业分类以2012年12月31日的证监会行业分类标准为依据。

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	600016	民生银行	4,478,283	35,199,304.38	8.76
2	600036	招商银行	2,451,793	33,712,153.75	8.39
3	601318	中国平安	664,239	30,083,384.31	7.48
4	601166	兴业银行	1,497,113	24,986,815.97	6.22
5	601328	交通银行	4,669,427	23,066,969.38	5.74
6	600000	浦发银行	2,219,184	22,014,305.28	5.48
7	600030	中信证券	1,365,454	18,242,465.44	4.54
8	601088	中国神华	653,917	16,576,795.95	4.12
9	601601	中国太保	623,260	14,023,350.00	3.49
10	601668	中国建筑	2,973,913	11,598,260.70	2.89

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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名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 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	454.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	454.24

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报告期末前十名（前五名）股票中存在流通受限情况的说明

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的情况。

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§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	455,581,114.00
本报告期基金总申购份额	3,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	4,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	454,581,114.00

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准上证社会责任交易型指数证券投资基金募集设立的文件；

2、《上证社会责任交易型指数证券投资基金基金合同》；

3、《上证社会责任交易型指数证券投资基金招募说明书》；

4、《上证社会责任交易型指数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。

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

二〇一三年一月二十一日

建信沪深300指数证券投资基金（LOF）

2012 第四季度 报告

2012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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2013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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013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2012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	4,323,026,557.24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（2012年10月1日-2012年12月31日）
1.本期已实现收益	-55,701,621.81
2.本期利润	271,670,581.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0629
4.期末基金资产净值	3,169,337,197.05
5.期末基金份额净值	0.733

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

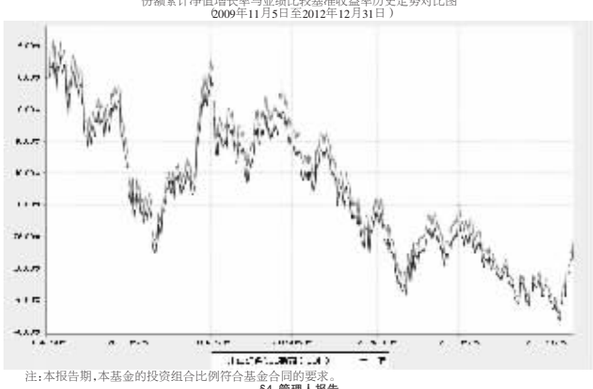
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.40%	1.23%	9.53%	1.22%	-0.13%	0.01%

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）

份额累计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2012年12月31日）



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		
梁洪昀先生	投资管理部执行总监，本基金基金经理	2009-11-5	-	10	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，历任金融工程部研究员、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、投资管理部副总监。2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任ETF及联接基金基金经理；2011年9月8日起任深证基本面60ETF及联接基金基金经理；2012年3月16日起任建信深证100指数基金的基金经理。

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，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《建信沪深300指数型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定。

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 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控制在了基金合同约定的范围之内。

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规定无法投资，必须寻找其他股票进行替代。本基金管理人以量化分析研究为基础，制定及执行了相应的替代策略，并持续根据市场情况对替代方案进行优化和调整，以尽可能降低跟踪误差及偏离度。

在报告期内，个别交易日的大额申购赎回、成份股分红、停牌等因素也对跟踪误差及偏离度产生了一定影响。本基金管理人已在日常管理中通过选择适当的策略尽力克服这些不利影响。

在报告期末，本基金根据应对指数成份股的调整，较好地控制了跟踪误差及交易成本。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值增长率9.40%，波动率 1.23%，业绩比较基准收益率9.53%，波动率1.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在四季度初期，指数延续三季度的颓势继续下跌，但到12月份，在银行股等权重股的带领下，指数走出了一波明显的反弹行情，市场情绪也得到了一定程度的修复。预计一季度初期，市场仍然有望保持比较积极的情绪。

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，克服个别成份股无法投资、基金日常申赎、成份股停牌等各种因素造成的不利影响，不断优化和改进量化模型，将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

§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	3,000,906,196.34	94.51
	其中：股票	3,000,906,196.34	94.51
2	固定收益投资	89,937,000.00	2.83
	其中：债券	89,937,000.00	2.83
	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	78,650,048.26	2.48
6	其他各项资产	5,849,794.37	0.18
7	合计	3,175,343,038.97	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

本基金本报告期未未持有积极投资股票。

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	17,930,918.21	0.57
B	采掘业	299,851,268.80	9.46
C	制造业	994,693,678.91	31.38
C0	食品、饮料	188,864,040.99	5.96
C1	纺织、服装、皮毛	9,170,796.28	0.29
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	60,733,058.50	1.92
C5	电子	53,530,350.04	1.69
C6	金属、非金属	229,030,755.82	7.23
C7	机械、设备、仪表	311,886,241.47	9.84
C8	医药、生物制品	140,523,430.66	4.43
C99	其他制造业	955,005.15	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	72,798,251.85	2.30
E	建筑业	103,620,323.73	3.27
F	交通运输、仓储业	80,023,448.49	2.52
G	信息技术业	72,297,617.27	2.28
H	批发和零售贸易	71,830,545.87	2.27
I	金融、保险业	1,025,767,822.47	32.37
J	房地产业	181,235,488.70	5.72
K	社会服务业	30,155,561.76	0.95
L	传播与文化产业	8,467,984.08	0.27
M	综合类	42,233,286.20	1.33
	合计	3,000,906,196.34	94.69

注：以上行业分类以2012年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

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	600016	民生银行	14,654,783	115,186,594.38	3.63
2	600036	招商银行	8,072,922	111,002,677.50	3.50
3	601318	中国平安	1,990,186	90,135,523.94	2.84
4	601166	兴业银行	4,675,552	78,034,962.88	2.46
5	601328	交通银行	14,373,835	71,006,744.90	2.24
6	600000	浦发银行	6,648,348	65,951,612.16	2.08
7	601288	农业银行	21,963,232	61,497,049.60	1.94
8	000002	万 科A	5,742,530	58,114,403.60	1.83
9	600030	中信证券	4,091,032	54,656,187.52	1.72
10	600519	贵州茅台	246,672	51,559,381.44	1.63

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	89,937,000.00	2.84
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	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	89,937,000.00	2.84

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	900,000	89,937,000.00	2.84

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	611,951.42
2	应收证券清算款	3,063,624.55
3	应收股利	-
4	应收利息	1,514,312.93
5	应收申购款	659,905.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,849,794.37

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可转换债券。

5.8.5报告期末前十名（前五名）股票中存在流通受限情况的说明

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

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	000002	万 科A	58,114,403.60	1.83	筹划重大事项

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§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	4,301,986,578.51
本报告期基金总申购份额	193,762,131.22
减：本报告期基金总赎回份额	172,722,152.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,323,026,557.24

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出分额。

§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

二〇一三年一月二十一日

建信收益增强债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2013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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信收益增强债券	
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	1,458,091,221.06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	建信收益增强债券A	建信收益增强债券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	1,139,958,130.56份	318,133,090.50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（2012年10月1日-2012年12月31日）	
	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
1.本期已实现收益	3,423,566.41	-64,410.71
2.本期利润	15,372,441.77	4,543,503.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0235	0.0115
4.期末基金资产净值	1,176,339,540.57	323,800,312.12
5.期末基金份额净值	1.032	1.018

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、建信收益增强债券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	0.77%	0.14%	0.73%	0.04%	0.04%	0.10%

2、建信收益增强债券C：

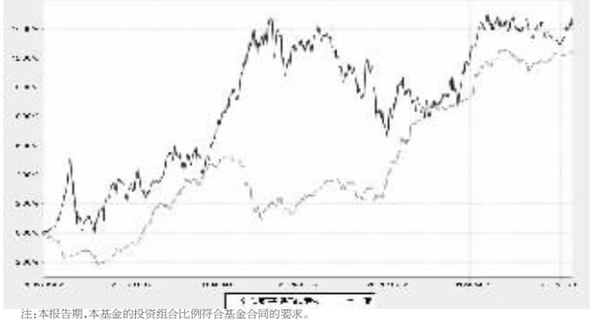
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.80%	0.14%	0.73%	0.04%	0.07%	0.10%

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

份额累计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2012年12月31日）



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		
李菁女士	本基金基金经理	2009-6-2	-	7	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日至2012年2月17日任建信货币市场基金基金经理；2011年4月16日起任建信信用增强债券基金的基金经理。

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 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

四季度，宏观经济整体环境有所恢复，工业增加值、制造业采购经理指数等经济指标逐月有所好转，居民消费价格指数仍在低位徘徊，房地产成交量和房价均有所上行。海外经济方面，欧美经济仍在缓慢复苏中，而随着美国财政悬崖的临近，美元指数则出现了先扬后抑的走势。国内政策方面，四季度仍然延续前期思路，货币政策方面仍采用多期限回购手段调控市场流动性，在货币信贷增速仍在低位运行的同时，随着信用产品和理财产品的连续发行，贷款占社会融资总量中的比重逐步下降。随着季末中央经济工作会议的召开，积极稳妥推进城镇化建设以及继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策的定调，市场对经济企稳恢复的信心逐步增强。在此背景下，债券市场收益率均有所上行，利率产品调整幅度大于信用产品，股票市场则呈现先抑后扬的行情。

回顾本季度的基金管理工作，本基金在12月初进行大比例分红而基金规模也有所增长，提高了信用产品和转债的配置比例，为投资人赚取了一定的正收益。

4.4.2报