# 建信收益增强债券型证券投资基金

## 2013 第三季度 报告

2013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:2013年10月24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2013年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 建信收益增强债券 | |
| 基金主代码 | 530009 | |
| 交易代码 | 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 | 582,431,760.12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 | 346,359,558.71份 | 236,072,201.41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(2013年7月1日—2013年9月30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 | 2,129,097.89 | 942,039.99 |
| 2. 本期利润 | 1,758,091.86 | −287,307.96 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0032 | −0.0011 |
| 4. 期末基金资产净值 | 365,723,168.77 | 245,098,904.97 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.056 | 1.038 |

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

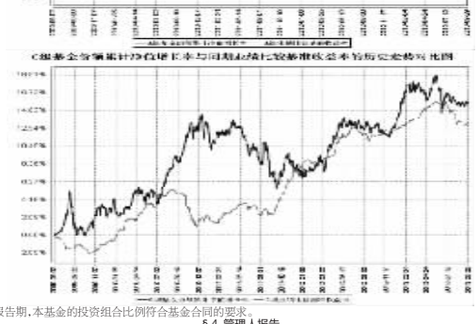
建信收益增强债券A

| 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 | 0.00% | 0.18% | −1.81% | 0.10% | 1.81% | 0.08% |

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 | −0.10% | 0.18% | −1.81% | 0.10% | 1.71% | 0.08% |

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




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 | 投资管理部副总监、本基金的基金经理 | 2009年6月2日 | − | 8 | 硕士。2002年7月进入中国建设银行,从事基金托管业务,任主任科员。2005年9月进入建信基金管理有限责任公司,历任债券研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、投资管理部副总监。2007年11月3日至2012年2月17日任建信货币市场基金基金经理,2009年6月2日起任建信收益增强基金基金经理,2011年6月16日起任建信信用增强债券基金基金经理。 |

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《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

三季度,宏观经济增长动能有所恢复,PMI指数连续突破50,发电量、工业增加值等指标在整个三季度也出现强劲反弹,与此同时居民物价指数也略有上升,但房地产新开工面积和销售面积增速仍有所回落,经济继续强劲复苏的基础仍有待观察。国际方面,欧美经济仍在缓慢复苏中,虽然9月18日美联储仍决定延迟退出QE,然而在此之前延续二季度末对美联储量化宽松退出预期和全球流动性环境改变的担忧,流动性预期仍然处于偏紧状态。国内政策方面,央行仍然通过回购和央票等公开市场操作手段来引导市场资金利率,收短放长的操作虽然使得短期市场回购利率在三季度并未达到如6月末的高峰值,但对流动性偏紧的预期以及商业银行在一定约束条件下对资产收益率的要求使得整个三季度市场资金都处于稳中偏紧的状态。在此背景下,股票市场在对经济增长预期升温的推动下,三季度呈现上涨趋势,而债券市场各品种都出现了下跌,长端品种下跌较短端更多,收益率曲线仍然比较平坦化。

本基金在三季度经历了较大程度的赎回,由于前期杠杆比例不高,基金安全渡过了集中赎回期。回顾三季度的基金管理工作,基金减持了部分中低评级信用债,在季末小幅增持了中长期利率产品,而权益市场方面,以绝对收益为目的调整了股票持仓并维持中性的权益资产比例配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期收益增强A基金净值增长率0.00%,波动率0.18%,收益增强C基金净值增长率−0.10%,波动率0.18%;业绩比较基准收益率−1.81%,波动率0.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然近期美联储量化宽松政策退出时间延迟,国际流动性或将有所恢复,但市场利率化背景下商业银行行为模式的转变应是长期影响社会融资成本的因素,我们对下个季度的资金环境仍然持相对谨慎的态度。整体而言,我们认为债券市场方面,长期利率产品和高等级信用产品将处于窄幅波动阶段,而资金成本的抬高使得目前平坦化的收益率曲线很难回到前期牛市陡峭形态,仍需充分警惕信用事件对信用产品整体估值的影响。权益市场方面,我们仍然认为市场难以实现系统性的估值扩张行情,但部分长期估值具备安全边际和增长比较确定且有持续性的股票仍具有一定投资价值。

本基金将在严控风险的前提下,积极关注长期利率产品和高等级信用债市场波动带来的机会,加强组合投资的灵活性,权益市场方面,采取相对防御与均衡的投资策略,精选个股,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 | 83,226,308.82 | 10.23 |
| | 其中:股票 | 83,226,308.82 | 10.23 |
| 2 | 固定收益投资 | 706,259,022.53 | 86.77 |
| | 其中:债券 | 706,259,022.53 | 86.77 |
| | 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 | 4,043,511.56 | 0.50 |
| 6 | 其他资产 | 20,400,885.22 | 2.51 |
| 7 | 合计 | 813,929,728.13 | 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 | 6,217,407.54 | 1.02 |
| B | 采矿业 | − | − |
| C | 制造业 | 50,270,613.82 | 8.23 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | − | − |
| E | 建筑业 | − | − |
| F | 批发和零售业 | − | − |
| 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 | 26,738,287.46 | 4.38 |
| J | 金融业 | − | − |
| K | 房地产业 | − | − |
| 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 | 83,226,308.82 | 13.63 |

注:以上行业分类以2013年09月30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 | 002065 | 东华软件 | 550,000 | 18,078,500.00 | 2.96 |
| 2 | 002604 | 龙力生物 | 476,070 | 8,907,269.70 | 1.46 |
| 3 | 300074 | 华平股份 | 299,958 | 8,659,787.46 | 1.42 |
| 4 | 600261 | 阳光照明 | 586,523 | 6,926,836.63 | 1.13 |
| 5 | 600108 | 亚盛集团 | 670,702 | 6,217,407.54 | 1.02 |
| 6 | 002465 | 海格通信 | 299,888 | 5,649,889.92 | 0.92 |
| 7 | 002292 | 奥飞动漫 | 200,000 | 5,632,000.00 | 0.92 |
| 8 | 002660 | 茂硕电源 | 516,200 | 4,790,336.00 | 0.78 |
| 9 | 300175 | 朗源股份 | 884,300 | 4,103,152.00 | 0.67 |
| 10 | 002444 | 巨星科技 | 542,012 | 4,054,249.76 | 0.66 |

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 | 79,100,000.00 | 12.95 |
| 2 | 央行票据 | − | − |
| 3 | 金融债券 | 40,134,000.00 | 6.57 |
| | 其中:政策性金融债 | 40,134,000.00 | 6.57 |
| 4 | 企业债券 | 419,158,670.80 | 68.62 |
| 5 | 企业短期融资券 | − | − |
| 6 | 中期票据 | 129,833,000.00 | 21.26 |
| 7 | 可转债 | 38,033,351.73 | 6.23 |
| 8 | 其他 | − | − |
| 9 | 合计 | 706,259,022.53 | 115.62 |

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 | 019307 | 13国债07 | 500,000 | 50,045,000.00 | 8.19 |
| 2 | 1282429 | 12广汇MIN2 | 500,000 | 49,925,000.00 | 8.17 |
| 3 | 1280043 | 12中石油05 | 500,000 | 48,060,000.00 | 7.87 |
| 4 | 1280003 | 12中石油02 | 500,000 | 47,815,000.00 | 7.83 |
| 5 | 122205 | 12沪交运 | 400,000 | 40,400,000.00 | 6.61 |

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 272,438.33 |
| 2 | 应收证券清算款 | 622,535.23 |
| 3 | 应收股利 | − |
| 4 | 应收利息 | 19,433,168.64 |
| 5 | 应收申购款 | 72,743.02 |
| 6 | 其他应收款 | − |
| 7 | 待摊费用 | − |
| 8 | 其他 | − |
| 9 | 合计 | 20,400,885.22 |

5.9.4 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) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110015 | 石化转债 | 19,578,000.00 | 3.21 |
| 2 | 113001 | 中行转债 | 15,004,500.00 | 2.46 |
| 3 | 110017 | 中海转债 | 1,952,913.20 | 0.32 |

5.9.5 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 | 002065 | 东华软件 | 18,078,500.00 | 2.96 | 筹划发行股份购买资产事项 |
| 2 | 002292 | 奥飞动漫 | 5,632,000.00 | 0.92 | 临时停牌 |

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 805,173,388.23 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 261,202,324.75 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 3,036,012.62 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | 461,273,932.56 |
| 报告期期间基金份额总额 | 28,166,135.96 |
| 报告期期末基金份额总额 | − |
| 报告期期末基金份额总额 | 346,359,558.71 |
| | 236,072,201.41 |

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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收益增强债券型证券投资基金设立的文件;

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招募说明书》;

4、《建信收益增强债券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
2013年10月24日

# 建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

## 2013 第三季度 报告

2013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:2013年10月24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2013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)(场内简称:建信300) | |
| 基金主代码 | 165309 | |
| 交易代码 | 165309 | |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式(LOF) | |
| 基金合同生效日 | 2009年11月5日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 3,183,485,652.02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(2013年7月1日—2013年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | −56,089,579.77 |
| 2.本期利润 | 219,444,632.78 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0649 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,272,093,558.97 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.714 |

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。

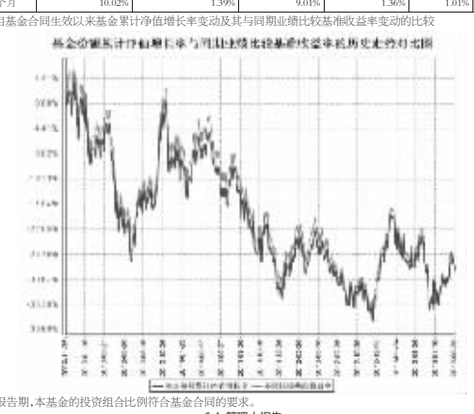
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 10.02% | 1.39% | 9.01% | 1.36% | 1.01% | 0.03% |

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




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 | 投资管理部总监、本基金的基金经理 | 2009年11月5日 | − | 10 | 特许金融分析师(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8月加入建信基金管理有限责任公司,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、投资管理部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理;2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2011年9月8日起任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2012年3月16日起任建信深证100指数增强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 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,由于操作层面的原因,工商银行和建设银行两只股票仍然暂未纳入本基金投资范围,必须寻找其他股票进行替代,这是本基金报告期内跟踪误差的主要来源。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。

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10.02%,波动率1.39%,业绩比较基准收益率9.01%,波动率1.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年三季度,经济数据有所好转,对宏观经济复苏的预期使市场走出一波小的行情。上海自贸区等政策的出台也使相关概念个股有比较抢眼的表现。展望四季度,十八届三中全会即将召开,市场还将不断预期各种政策的出台,从而支撑起相关的结构性行情。

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 | 2,147,685,265.90 | 93.71 |
| | 其中:股票 | 2,147,685,265.90 | 93.71 |
| 2 | 固定收益投资 | 69,713,000.00 | 3.04 |
| | 其中:债券 | 69,713,000.00 | 3.04 |
| | 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 | 67,056,286.37 | 2.93 |
| 6 | 其他资产 | 7,273,334.82 | 0.32 |
| 7 | 合计 | 2,291,727,887.09 | 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 | 16,060,538.51 | 0.71 |
| B | 采矿业 | 150,373,655.45 | 6.62 |
| C | 制造业 | 775,897,700.11 | 34.15 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 63,977,332.59 | 2.82 |
| E | 建筑业 | 75,997,082.13 | 3.34 |
| F | 批发和零售业 | 74,276,963.68 | 3.27 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 48,647,181.71 | 2.14 |
| H | 住宿和餐饮业 | − | − |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 54,402,319.08 | 2.39 |
| J | 金融业 | 716,470,932.11 | 31.53 |
| K | 房地产业 | 108,562,931.39 | 4.78 |
| L | 租赁和商务服务业 | 16,265,917.78 | 0.72 |
| M | 科学研究和技术服务业 | − | − |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,870,388.62 | 0.70 |
| 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 | 8,399,497.51 | 0.37 |
| S | 综合 | 22,482,825.23 | 0.99 |
| | 合计 | 2,147,685,265.90 | 94.52 |

注:以上行业分类以2013年9月30日的中国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

5.3.1 报告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 | 10,137,449 | 96,914,012.44 | 4.27 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 7,506,040 | 81,965,956.80 | 3.61 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 4,976,116 | 55,583,215.72 | 2.45 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 1,403,761 | 50,114,267.70 | 2.21 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 4,689,172 | 47,313,745.48 | 2.08 |
| 6 | 600837 | 海通证券 | 3,390,379 | 42,413,641.29 | 1.87 |
| 7 | 601288 | 农业银行 | 15,564,609 | 38,911,522.50 | 1.71 |
| 8 | 000002 | 万 科A | 4,055,758 | 37,029,070.54 | 1.63 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 2,885,465 | 35,462,364.85 | 1.56 |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 6,875,976 | 29,566,696.80 | 1.30 |

5.3.2 报告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 | 69,713,000.00 | 3.07 |
| 2 | 央行票据 | − | − |
| 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 | 69,713,000.00 | 3.07 |

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 | 130007 | 13附息国债07 | 700,000 | 69,713,000.00 | 3.07 |

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 343,630.38 |
| 2 | 应收证券清算款 | 5,636,562.07 |
| 3 | 应收股利 | 230,307.19 |
| 4 | 应收利息 | 882,073.76 |
| 5 | 应收申购款 | 170,733.07 |
| 6 | 其他应收款 | − |
| 7 | 待摊费用 | 10,028.35 |
| 8 | 其他 | − |
| 9 | 合计 | 7,273,334.82 |

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中在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。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中在在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,675,646,335.35 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 25,905,364.56 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 518,066,047.89 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | − |
| 报告期期末基金份额总额 | 3,183,485,652.02 |

注:上述总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金本报告期末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。

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
2013年10月24日

# 上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金

## 2013 第三季度 报告

2013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:2013年10月24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2013年7月1日起至9月30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 | |
| 基金合同生效日 | 2010年5月28日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 413,581,114.00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(2013年7月1日—2013年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 1,619,663.65 |
| 2.本期利润 | 31,867,178.53 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0754 |
| 4.期末基金资产净值 | 344,340,625.95 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.833 |

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 | 10.04% | 1.59% | 8.51% | 1.58% | 1.53% | 0.01% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率