# 建信保本混合型证券投资基金

## 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 | 建信保本混合 |
| 基金主代码 | 530012 |
| 交易代码 | 530012 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年1月18日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,481,857,348.47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,在为适用保本条款的每份基金份额提供人民币1.00元的保本保证的基础上,寻求组合资产的稳定增长和保本周期收益的最大化。 |
| 投资策略 | 本基金采用恒定比例组合保险策略(Constant-Proportion Portfolio Insurance,CPPI),通过良好的资产配置、组合管理和风险控制,来实现保本和增值的目标。 |
| 业绩比较基准 | 三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,属证券投资基金中的低风险品种。 |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 基金保证人 | 中国投资担保有限公司 |

### §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(2013年7月1日 — 2013年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 9,495,620.23 |
| 2.本期利润 | 11,317,837.90 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0074 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,570,313,509.99 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.060 |

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。

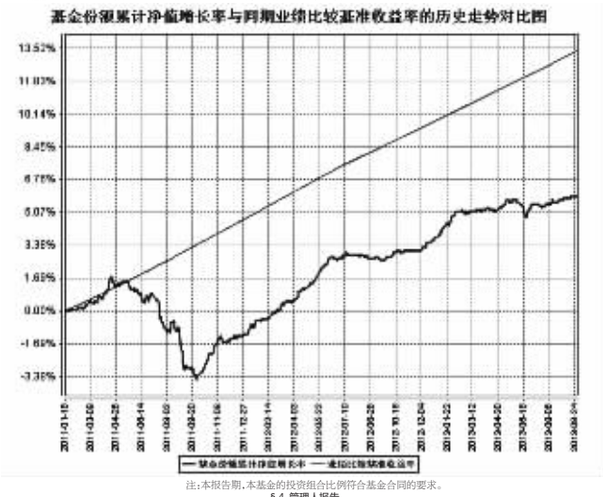
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 0.76% | 0.05% | 1.09% | 0.01% | -0.33% | 0.04% |

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




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 | | |
| 黎颖芳 | 本基金的基金经理 | 2011年1月18日 | - | 13 | 硕士,2000年7月毕业于湖南大学金融保险学院,同年进入天成基金管理公司,在金融工程部、规划发展部任职,2005年11月加入本公司研究部,历任研究员、高级研究员、基金经理助理,2009年2月19日至2011年5月11日任建信稳定增利债券型证券投资基金基金经理;2011年01月18日起任建信保本混合型证券投资基金基金经理;2012年11月15日起任建信纯债债券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《建信保本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

面对上半年经济重拾下滑趋势,新政府再提稳增长和"增长底线"论,引导投资回升和企业预期改变,3季度经济出现反弹。反弹的动力来自于房地产和基础设施的拉动,但在原有增长模式下大部分产能过剩行业盈利能力恶化,企业和地方政府的负债已处于相当高的水平。在此宏观环境下,央行货币政策立场中性偏紧,同时积极推进利率市场化改革。3季度权益市场基本反映经济反弹,沪深300股票指数涨幅达9.47%,中信标普转债指数涨1.92%,债券市场遭遇流动性和基本面双杀,中债净价指数下跌2.84%,中债全价指数下跌2.68%。

本基金3季度以持有安全资产为主,少量参与权益市场投资,3季度基金净值上涨0.76%。

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0.76%,波动率0.05%,业绩比较基准收益率1.09%,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

过去几个季度,政府一方面着手推进中长期改革和转型,另一方面兼顾对抗短期经济下滑失速,稳增长和促改革成为宏观调控的关键词。我们判断四季度经济增长的动力较之3季度会有所减弱,原因来自于房地产贷款的收缩和基础设施投资可能在此回落,但全年7.5%的经济增速目标仍可顺利实现。从中长期看,债务风险或成为经济体系中最大风险。在这场风险没有完全暴露或者没有找到解决方案之前,原有增长模式下对信用资源的渴求会导致市场资金面持续处于紧平衡状态。在这一过程中,权益市场难以有趋势性上涨行情,债券市场或依赖信用风险管理获得相对稳健的票息收入。

四季度本基金面临产品保本期到期,基金安全资产将以流动性管理为主,,风险资产保持相对较低的仓位,在遵守基金合同基础上力争继续为投资者创造稳健的收益。

### §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 | 21,020,560.54 | 1.33 |
| | 其中:股票 | 21,020,560.54 | 1.33 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,471,043,339.40 | 93.35 |
| | 其中:债券 | 1,471,043,339.40 | 93.35 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 20,000,230.00 | 1.27 |
| | 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 | 6,134,907.94 | 0.39 |
| 6 | 其他资产 | 57,600,213.30 | 3.66 |
| 7 | 合计 | 1,575,799,251.18 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 16,240,560.54 | 1.03 |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | 4,780,000.00 | 0.30 |
| 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 | 21,020,560.54 | 1.34 |

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

| 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 | 500,000 | 4,780,000.00 | 0.30 |
| 2 | 600418 | 江淮汽车 | 499,923 | 4,614,289.29 | 0.29 |
| 3 | 601216 | 内蒙君正 | 399,901 | 3,747,072.37 | 0.24 |
| 4 | 000625 | 长安汽车 | 356,900 | 3,676,070.00 | 0.23 |
| 5 | 002444 | 巨星科技 | 321,282 | 2,403,189.36 | 0.15 |
| 6 | 002660 | 茂硕电源 | 193,778 | 1,798,259.84 | 0.11 |
| 7 | 300175 | 朗源股份 | 362 | 1,679.68 | 0.00 |

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 | 76,857,561.00 | 4.89 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 93,875,400.00 | 5.98 |
| | 其中:政策性金融债 | 93,875,400.00 | 5.98 |
| 4 | 企业债券 | 567,357,378.40 | 36.13 |
| 5 | 企业短期融资券 | 702,752,000.00 | 44.75 |
| 6 | 中期票据 | 30,201,000.00 | 1.92 |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,471,043,339.40 | 93.68 |

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 | 088064 | 08蒙路债 | 800,000 | 80,960,000.00 | 5.16 |
| 2 | 1080178 | 10玉溪开投债01 | 800,000 | 80,648,000.00 | 5.14 |
| 3 | 041352001 | 13南方水泥CP001 | 700,000 | 70,273,000.00 | 4.48 |
| 4 | 122880 | 10天业债 | 600,030 | 60,093,004.50 | 3.83 |
| 5 | 126011 | 08石化债 | 558,520 | 54,986,294.00 | 3.50 |

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 | 140,208.32 |
| 2 | 应收证券清算款 | 20,019,448.61 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 37,358,244.42 |
| 5 | 应收申购款 | 82,311.95 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 57,600,213.30 |

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处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十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 | 1,577,864,804.40 |
| 报告期基金总申购份额 | 6,436,855.94 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 102,444,311.87 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,481,857,348.47 |

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保本混合型证券投资基金基金设立的文件;

2、《建信保本混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信保本混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信保本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
2013年10月24日

# 建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 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

2.1 基金产品情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 建信责任 |
| 基金主代码 | 530010 |
| 交易代码 | 530010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年5月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 387,676,342.76份 |
| 投资目标 | 通过将他大部分基金财产投资于上证社会责任ETF,密切跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为上证社会责任ETF的联接基金,主要通过投资于上证社会责任ETF以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖上证社会责任ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金经理会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。 |
| 业绩比较基准 | 95%×上证社会责任指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率 |
| 风险收益特征 | 本基金为上证社会责任ETF的联接基金,风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金,同时,本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及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 |

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 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 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2010年8月9日 |
| 基金管理人名称 | 建信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人名称 | 中国工商银行股份有限公司 |

2.1.2 目标基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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。 |

### §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 | -1,854,518.23 |
| 2.本期利润 | 31,472,918.39 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0821 |
| 4.期末基金资产净值 | 371,358,521.62 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.958 |

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。

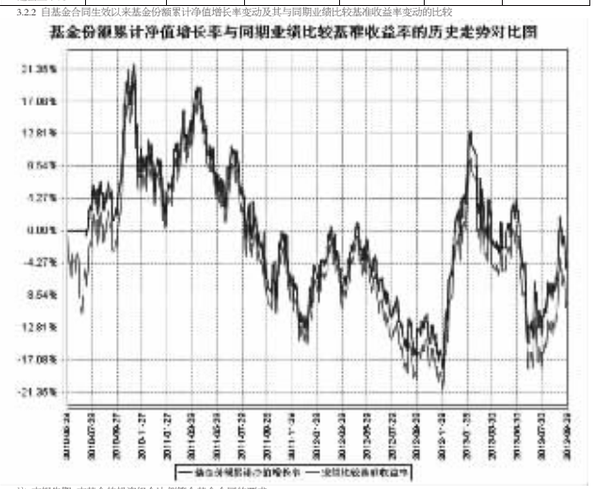
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 9.61% | 1.51% | 8.11% | 1.50% | 1.50% | 0.01% |

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




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 | 本基金的基金经理 | 2012年3月21日 | - | 5 | 硕士,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;2013年3月28日起任建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金的基金经理。 |

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,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《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同》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

本基金绝大部分资产投资于上证社会责任ETF,因此基金的跟踪误差和偏离度主要取决于责任ETF的表现。此外,由于申赎造成的基金份额变动以及成份股的集中分红也会对本基金的跟踪误差和偏离度造成一定影响。在报告期内,基金跟踪误差和日均偏离度均被控制在基金合同约定的范围内。

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9.61%,波动率1.51%,业绩比较基准收益率8.11%,波动率1.50%。

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,整个实体经济仍在低位运行,并没有表现出非常明显的复苏趋势。与此同时,转型和改革的呼声和政策预期越发强烈。在这样的背景下,市场更加关注收益与经济转型和改革的个股,随着三中全会的召开,预计四季度市场仍然是个股的结构性行情。

本基金管理人将根据基金合同规定,继续将不低于90%的基金资产投资于责任ETF,同时适当对所直接持有的股票组合进行优化,以控制跟踪误差及偏离度。

### §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 | 15,082,036.27 | 4.05 |
| | 其中:股票 | 15,082,036.27 | 4.05 |
| 2 | 基金投资 | 335,699,000.00 | 90.11 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 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 | 20,790,459.49 | 5.58 |
| 7 | 其他资产 | 972,102.68 | 0.26 |
| 8 | 合计 | 372,543,598.44 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 1,028,907.12 | 0.28 |
| C | 制造业 | 3,366,648.44 | 0.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 145,011.72 | 0.04 |
| E | 建筑业 | 958,937.45 | 0.26 |
| F | 批发和零售业 | 581,074.92 | 0.16 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 127,240.38 | 0.03 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 371,328.40 | 0.10 |
| J | 金融业 | 7,679,058.07 | 2.07 |
| K | 房地产业 | 766,221.27 | 0.21 |
| L | 租赁和商务服务业 | 57,608.50 | 0.02 |
| 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 | 15,082,036.27 | 4.06 |

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

| 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 | 184,778 | 1,766,477.68 | 0.48 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 135,019 | 1,474,407.48 | 0.40 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 93,537 | 1,044,808.29 | 0.28 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 27,385 | 977,644.50 | 0.26 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 91,532 | 923,557.88 | 0.25 |
| 6 | 601328 | 交通银行 | 128,473 | 552,433.90 | 0.15 |
| 7 | 601601 | 中国太保 | 25,662 | 450,881.34 | 0.12 |
| 8 | 601088 | 中国神华 | 26,933 | 448,973.11 | 0.12 |
| 9 | 601668 | 中国建筑 | 122,705 | 395,110.10 | 0.11 |
| 10 | 600104 | 上汽集团 | 27,023 | 365,621.19 | 0.10 |

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 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基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金 | 股票型 | 交易型开放式指数基金 | 建信基金管理有限责任公司 | 335,699,000.00 | 90.40 |

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

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 | 38,386.39 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 1,814.22 |
| 4 | 应收利息 | 4,501.67 |
| 5 | 应收申购款 | 927,400.40 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 972,102.68 |

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

本基金本报告期末前十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 | 389,327,404.50 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 47,162,557.37 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 48,813,619.11 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 387,676,342.76 |

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上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金设立的文件;

2、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同》;

3、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金招募说明书》;

4、《建信上证社会责任交易型开放式证券投资基金联接基金托管协议》;

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

# 建信全球机遇股票型证券投资基金

## 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

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 建信全球机遇股票(QDII) |
| 基金主代码 | 539001 |
| 交易代码 | 539001 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年9月14日 |
| 报告期末基金份额总额 | 222,960,208.88份 |
| 投资目标 | 本基金通过全球化的资产配置和组合管理,在分散和控制投资风险的同时追求基金资产长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金采取"自上而下"的资产配置与"自下而上"的证券选择相结合、定量研究与定性研究相结合、组合构建与风险控制相结合的投资策略进行投资组合的构建。 |
| 业绩比较基准 | 标准普尔全球BMI市场指数总收益率(S&P Global BMI)×70%+标准普尔BMI中国(除A,B股)指数总收益率(S&P BMI China ex-A-B-Shares)×30% |
| 风险收益特征 | 本基金是全球股票型基金,其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。 |
| 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 |

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | 英文 | Principal Global Investors, LLC. | Brown Brothers Harriman & Co. |
| | 中文 | 信安环球投资有限公司 | 布朗兄弟哈里曼银行 |
| 注册地址 | | 801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490 | 140 Broadway New York |
| 办公地址 | | 801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490 | 140 Broadway New York |
| 邮政编码 | | IA 50392-0490 | NY10005 |

### §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 | 3,497,965.29 |
| 2.本期利润 | 14,409,850.94 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0610 |
| 4.期末基金资产净值 | 213,986,278.42 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.960 |

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。

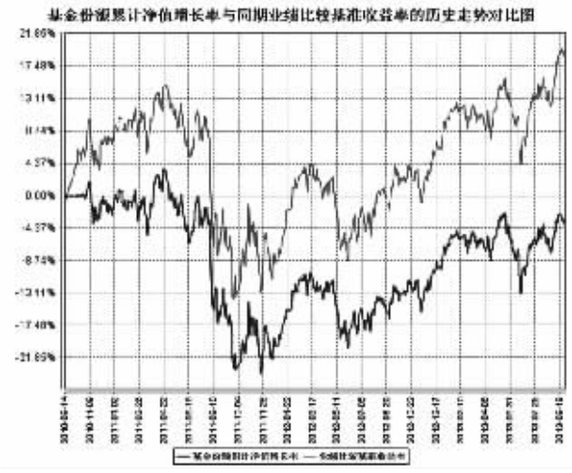
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 6.67% | 0.63% | 9.85% | 0.65% | -3.18% | -0.02% |

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




注:1、本基金业绩比较基准计价货币为人民币。

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 | | |
| 赵英楷 | 海外投资部总监、本基金的基金经理 | 2011年4月20日 | - | 15 | 美国哥伦比亚大学商学院MBA。曾任美国美林证券公司研究员、高盛证券公司