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
送出日期:2014年8月25日

建信收益增强债券型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2014年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	
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	
报告期末基金份额总额	307,346,716.44份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
下属分级基金的交易代码:	530009	531009
报告期末下属分级基金的份额总额	159,346,360.71份	148,000,355.73份

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	李芳菲
	联系电话	010-66228888	010-66060069
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	lifangfei@abcchina.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95599
传真		010-66228001	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	5,754,883.90	5,603,433.78
本期利润	12,004,237.47	11,748,021.56
加权平均基金份额本期利润	0.0732	0.0686
本期基金份额净值增长率	7.18%	6.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1047	0.0827
期末基金资产净值	176,032,355.10	160,237,944.98
期末基金份额净值	1.105	1.083

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(不含公允价值变动收益)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收益;

2.期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分);

3.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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.19%	0.18%	0.68%	0.08%	0.51%	0.10%
过去三个月	5.14%	0.19%	3.64%	0.11%	1.50%	0.08%
过去六个月	7.18%	0.20%	6.28%	0.11%	0.90%	0.09%
过去一年	4.64%	0.24%	2.12%	0.12%	2.52%	0.12%
过去三年	10.72%	0.26%	13.93%	0.11%	-3.21%	0.15%
自基金合同生效起至今	23.01%	0.27%	17.78%	0.11%	5.23%	0.16%

建信收益增强债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.21%	0.19%	0.68%	0.08%	0.53%	0.11%
过去三个月	5.04%	0.19%	3.64%	0.11%	1.40%	0.08%
过去六个月	6.91%	0.21%	6.28%	0.11%	0.63%	0.10%
过去一年	4.23%	0.24%	2.12%	0.12%	2.11%	0.12%
过去三年	9.57%	0.26%	13.93%	0.11%	-4.36%	0.15%
自基金合同生效起至今	20.74%	0.27%	17.78%	0.11%	2.96%	0.16%

注:本基金的业绩比较基准为:30%×中债企业债总指数+70%×中债国债总指数。中债企业债总指数、中债国债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司(简称"中债公司")编制的、分别反映我国国债市场和企业债市场整体价格和投资回报情况的指数。其中,中债国债总指数样本券包括在银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有记帐式国债;中债企业债总指数样本券包括在银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有中央企业债和地方企业债。该两个指数具有广泛的市场代表性,能够分别反映我国国债、企业债市场的总体走势。

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:本报告期基金投资组合比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日,注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司,信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司,其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%,信安金融服务公司出资额占注册资本的25%,中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部,以及深圳、成都、上海、北京四家分公司,设立了子公司--建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持"诚信、专业、规范、创新"的核心价值观,恪守"持有人利益重于泰山"的原则,以"建设财富生活"为崇高使命,坚持规范运作,致力成为"最可信赖、持续领先的综合性、专业化资产管理公司"。

截至2014年6月30日,公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)、建信创新中国股票型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、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、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信中证500指数增强型证券投资基金、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金和建信货币市场基金,共计42只开放式基金,管理的基金净资产规模共计为551.21亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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债券基金基金经理,2011年6月16日起任建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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内宏观经济整体仍然呈现疲态,房地产投资增速下滑,工业增加值、发电量增速以及制造业景气度指数均显示经济仍然尚未企稳,欧美经济仍在缓慢复苏的通道中,美联储量化宽松政策处于逐步退出过程中,人民币汇率双向波动幅度逐步加大。政策方面,3月份后稳增长政策逐步明朗,一方面降低企业融资成本以提升实体经济的活力,主要体现在央行各项定向贷款以及两次定向降准政策,公开市场操作也从净回笼变为净投放,货币信贷政策相对宽松,包括季末出台的存贷比指标的调整政策;另一方面,五部委联合发布的127号文也意图对去年快速增长的非标业务进行合理疏导,继续引导商业银行资产配置行为。在此背景下,随着流动性的逐步宽裕,债券市场各期限品种收益率均有较大幅度下行,股票市场则经历了先升后降的过程。

回顾上半年的基金管理工作,本基金在逐步拉长了组合久期和杠杆比例,增加了信用产品的配置,对大盘转债和长期利率债进行了波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期收益增强A/净值增长率7.18%,波动率0.2%,收益增强C/净值增长率6.91%,波动率0.21%;业绩比较基准收益率6.28%,波动率0.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们认为政府各项稳增长政策对实体经济的传导过程值得密切关注,在房地产政策未出现明显转向之前,房地产对经济的拉动作用仍呈边际递减趋势,而市场仍然担忧基础建设能否在下阶段成功抵消房地产增速下滑对经济增长的负面冲击。整体而言,我们认为债券市场方面,在稳增长各项政策刺激下,对经济增长和通胀的预期短时间内将从极度悲观情形有所转向,利率产品将呈现震荡行情,而收益率曲线则将继续陡峭化,信用产品仍将出现较大分化,资质较好的中短端信用产品仍有较好的投资价值。

本基金将在严控风险的前提下,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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策;对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督;对因经常环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成(具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定)。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件,发现估值问题;提议基金估值调整的相关方案并进行校验;根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案,报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理,并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的,由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果,基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金和理财类基金)。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配,符合相关法律法规和基金合同中关于利润分配条款的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管建信收益增强债券型证券投资基金的过程中,本基金托管人一中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》、《建信收益增强债券型证券投资基金托管协议》的约定,对建信收益增强债券型证券投资基金管理人一建信基金管理有限责任公司2014年1月1日至2014年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司在建信收益增强债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的建信收益增强债券型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:建信收益增强债券型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		1,241,518.55	14,137,852.92
结算备付金		10,991,485.65	9,930,543.81
存出保证金		80,131.47	185,081.26
交易性金融资产		456,440,948.39	396,645,651.48
其中:股票投资		23,559,100.16	15,538,363.88
基金投资		-	-
债券投资		432,881,848.23	381,107,287.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		989,150.36	-
应收利息		7,968,519.17	4,620,279.97
应收股利		-	-
应收申购款		512,916.08	131,228.04
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		478,224,669.67	425,650,637.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		139,339,779.33	17,099,871.45
应付证券清算款		-	13,408,935.73
应付赎回款		1,066,345.02	728,457.26
应付管理人报酬		192,018.56	238,474.52
应付托管费		54,862.45	68,135.55
应付销售服务费		52,788.07	74,028.18
应付交易费用		623,233.56	943,218.06
应交税费		-	-
应付利息		8,854.39	1,544.72
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		616,488.21	615,123.26
负债合计		141,954,369.59	33,177,788.73
所有者权益:			
实收基金		307,346,716.44	384,396,744.40
未分配利润		28,923,583.64	8,076,104.35
所有者权益合计		336,270,300.08	392,472,848.75
负债和所有者权益总计		478,224,669.67	425,650,637.48

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.094元,基金份额总额307,346,716.44份。其中建信收益增强基金A类基金份额净值1.105元,基金份额总额159,346,360.71份;建信收益增强基金C类基金份额净值1.083元,基金份额总额148,000,355.73份。

6.2 利润表

会计主体:建信收益增强债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		28,451,548.20	42,570,431.14
1.利息收入		10,704,660.38	24,662,906.70
其中:存款利息收入		60,392.81	152,215.42
债券利息收入		10,620,864.38	24,422,299.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		23,403.19	88,391.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		5,335,143.77	31,694,261.58
其中:股票投资收益		3,773,460.82	7,192,230.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,163,793.11	22,953,738.98
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		397,889.84	1,548,292.11
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		12,393,941.35	-13,877,607.46
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		17,802.70	90,870.32
减:二、费用		4,699,289.17	11,468,305.58
1.管理人报酬		1,226,338.03	4,235,438.71
2.托管费		350,382.31	1,210,125.29
3.销售服务费		354,706.13	599,763.41
4.交易费用		290,959.13	1,516,427.83
5.利息支出		2,256,206.80	3,696,873.99
其中:卖出回购金融资产支出		2,256,206.80	3,696,873.99
6.其他费用		220,696.77	209,676.35
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		23,752,259.03	31,102,125.56
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		23,752,259.03	31,102,125.56

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信收益增强债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	384,396,744.40	8,076,104.35	392,472,848.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,752,259.03	23,752,259.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-77,050,027.96	-2,904,779.74	-79,954,807.70
其中:1.基金申购款	59,503,097.84	2,772,619.63	62,275,717.47
2.基金赎回款	-136,553,125.80	-5,677,399.37	-142,230,525.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	307,346,716.44	28,923,583.64	336,270,300.08
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,458,091,221.06	42,048,631.63	1,500,139,852.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,102,125.56	31,102,125.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-391,715,508.08	-17,947,000.06	-409,662,508.14
其中:1.基金申购款	42,958,240.09	2,386,673.11	45,344,913.20
2.基金赎回款	-434,673,748.17	-20,333,673.17	-455,007,421.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,066,375,712.98	55,203,757.13	1,121,579,470.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

孙志晨 何斌 秦绪华

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无

6.4.8.1.2 权证交易

无

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,226,338.03	4,235,438.71
其中:支付销售机构的客户维护费	219,701.23	355,965.65

注:1.支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.70%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.70% / 当年天数;

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	350,382.31	1,210,125.29

注:支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C	合计
中国建设银行	-	289,153.45	289,153.45
农业银行	-	15,178.64	15,178.64
建信基金管理有限责任公司	-	19,630.33	19,630.33
合计	-	323,962.42	323,962.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C	合计
中国建设银行	-	457,161.17	457,161.17
中国农业银行	-	21,457.71	21,457.71
建信基金管理有限责任公司	-	57,521.99	57,521.99
合计	-	536,140.87	536,140.87

注:支付基金销售机构的销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给建信基金管理有限责任公司,再由建信基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日C类基金份额销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值X0.40% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	1,241,518.55	19,245.39	4,986,530.54	59,076.02

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002727	一心堂	2014年6月25日	2014年7月2日	新股流通受限	12.20	12.20	500	6,100.00	6,100.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额41,339,779.33元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1180177	11国网债01	2014年7月1日	99.84	300,000	29,952,000.00
1280017	12中石油03	2014年7月1日	97.81	120,000	11,737,200.00
合计				420,000	41,689,200.00

-

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额98,000,000.00元,于2014年7月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2014年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为194,108,948.39元,属于第二层级的余额为262,332,000.00元,无属于第三层级的余额(2013年06月30日:属于第一层级的余额为59,857,486.71元,属于第二层级的余额为1,164,367,956.97元,无属于第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,559,100.16	4.93
	其中:股票	23,559,100.16	4.93
2	固定收益投资	432,881,848.23	90.52
	其中:债券	432,881,848.23	90.52
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	12,233,004.20	2.56
7	其他各项资产	9,550,717.08	2.00
8	合计	478,224,669.67	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	4,018,180.56	1.19
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,991,331.60	5.05
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	6,100.00	0.00
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	-	-
K	房地产业	2,543,488.00	0.76
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	23,559,100.16	7.01

注:以上行业分类以2014年06月30日的证监会行业分类标准为依据。

7.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002456	欧菲光	230,800	4,946,044.00	1.47
2	000998	隆平高科	146,222	4,018,180.56	1.19
3	000860	顺鑫农业	249,983	3,509,761.32	1.04
4	600535	天士力	85,100	3,299,327.00