

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

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		-	-
交易金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		27,899,801.05	27,501
应付赎回款		2,179,333.54	2,184,576.92
应付管理人报酬		997,323.93	1,345,893.04
应付托管费		199,648.61	269,178.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		875,778.17	1,610,915.54
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		244,653.14	246,595.91
负债合计		278,395,354.64	5,657,436.03
所有者权益：			
实收基金		2,918,574,929.18	2,983,210,254.01
未分配利润		-1,020,098,264.39	-928,751,206.80
所有者权益合计		1,898,476,664.79	2,054,459,047.21
负债所有者权益合计		2,167,871,419.43	2,062,116,383.24

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.647元，基金份额总额2,918,574,929.18份。
6.2 报告期末，建信沪深300指数证券投资基金(LOF)本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

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		-107,821,213.63	-226,904,560.21
1.利息收入		1,136,168.15	1,327,247.41
其中：存款利息收入		153,291.44	269,854.26
债券利息收入		982,876.71	1,102,893.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-88,858,196.31	-69,800,053.26
其中：股票投资收益		-106,741,356.94	-98,404,947.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益		142,590.00	107,460.00
资产支持证券投资收益		-	-
公允价值变动收益(损失以“-”填列)		-	-
汇兑收益(损失以“-”填列)		-	-
其他收入		17,440,570.63	28,497,434.13
二、费用		-20,246,320.45	-158,963,421.94
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-	-
其二：费用		9,314,301.19	14,758,062.51
1.管理人报酬		6,534,228.70	10,129,662.36
2.托管费		1,306,845.78	2,025,932.45
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,228,980.52	2,358,362.83
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		244,246.19	244,104.87
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-117,135,514.82	-341,662,622.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-117,135,514.82	-341,662,622.72

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
单位：人民币元
本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,983,210,254.01	-926,751,206.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动(公允价值变动)	-117,135,514.82	-117,135,514.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(含申购、赎回、转入、转出)	-64,635,324.83	14,787,925.23
四、本期向基金份额持有人分配利润或股利(含税)	-	-49,847,367.60
五、其他	-	-
六、期末所有者权益(基金净值)	2,801,439,419.16	-1,020,098,264.39

6.4 基金管理人及其基金经理
4.1.1 基金管理人及其基金经理
4.1.2 基金经理
4.1.3 基金经理

4.2 基金管理人及其基金经理
4.2.1 基金管理人及其基金经理
4.2.2 基金经理

4.3 基金管理人及其基金经理
4.3.1 基金管理人及其基金经理
4.3.2 基金经理

4.4 基金管理人及其基金经理
4.4.1 基金管理人及其基金经理
4.4.2 基金经理

4.5 基金管理人及其基金经理
4.5.1 基金管理人及其基金经理
4.5.2 基金经理

4.6 基金管理人及其基金经理
4.6.1 基金管理人及其基金经理
4.6.2 基金经理

4.7 基金管理人及其基金经理
4.7.1 基金管理人及其基金经理
4.7.2 基金经理

4.8 基金管理人及其基金经理
4.8.1 基金管理人及其基金经理
4.8.2 基金经理

4.9 基金管理人及其基金经理
4.9.1 基金管理人及其基金经理
4.9.2 基金经理

4.10 基金管理人及其基金经理
4.10.1 基金管理人及其基金经理
4.10.2 基金经理

4.11 基金管理人及其基金经理
4.11.1 基金管理人及其基金经理
4.11.2 基金经理

4.12 基金管理人及其基金经理
4.12.1 基金管理人及其基金经理
4.12.2 基金经理

4.13 基金管理人及其基金经理
4.13.1 基金管理人及其基金经理
4.13.2 基金经理

4.14 基金管理人及其基金经理
4.14.1 基金管理人及其基金经理
4.14.2 基金经理

4.15 基金管理人及其基金经理
4.15.1 基金管理人及其基金经理
4.15.2 基金经理

4.16 基金管理人及其基金经理
4.16.1 基金管理人及其基金经理
4.16.2 基金经理

4.17 基金管理人及其基金经理
4.17.1 基金管理人及其基金经理
4.17.2 基金经理

4.18 基金管理人及其基金经理
4.18.1 基金管理人及其基金经理
4.18.2 基金经理

4.19 基金管理人及其基金经理
4.19.1 基金管理人及其基金经理
4.19.2 基金经理

4.20 基金管理人及其基金经理
4.20.1 基金管理人及其基金经理
4.20.2 基金经理

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上期 2013年1月1日至2013年6月30日
中国工商银行	344,312,698.99	148,710,611
中国建设银行	148,710,611	249,590,520.21
中国工商银行	261,158.67	-

注：本基金的前行存款由基金管理人中国工商银行管理，按银行同业利率计息。
6.4.8.4 本基金在季期间参与关联方承销证券的情况
6.4.8.5 本基金本报告期及上年度末期间未发生承销期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 因认购新股/增发导致于期末持有的流通受限证券
6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限证券

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.2	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.3 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.4 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.4	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.5 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.6 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.6	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.7 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.8 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.8	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.9 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.10 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.10	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.11 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.12 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.12	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.13 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.14 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.14	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.15 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.16 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.16	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.17 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.18 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.18	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.19 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.20 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.20	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.21 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.22 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.22	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.23 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.24 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.24	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.25 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.26 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.26	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.27 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.28 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.28	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.29 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.30 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.30	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.31 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.32 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.32	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.33 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.34 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.34	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.35 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.36 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.36	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.37 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.38 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.38	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.39 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.40 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.40	暂时停牌	-	-	-

6.4.9.41 期末持有流通受限证券公允价值变动损益
6.4.9.42 期末持有流通受限证券公允价值变动损益

股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
6.4.9.42	暂时停牌	-	-	-

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
基金合同生效日期：2009年11月15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
基金份额持有人大会：2014年8月25日

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000215</			