深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2014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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	深F60ETF
场内简称	深F60
基金主代码	159916
交易代码	159916
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月8日
报告期末基金份额总额	120,566,039.00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	深证基本面60指数收益率
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。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,830,078.86
2.本期利润	31,584,130.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.2362
4.期末基金资产净值	196,022,389.19
5.期末基金份额净值	1.6259

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。

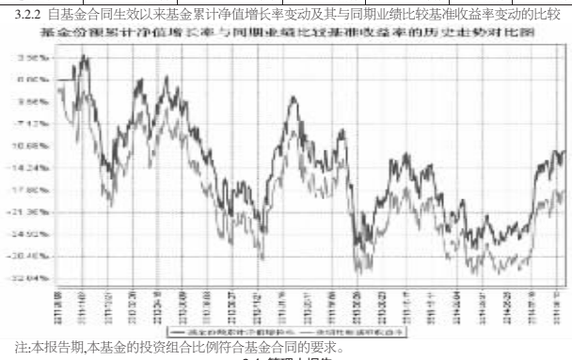
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	16.59%	0.97%	16.18%	0.98%	0.41%	-0.01%

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	2011年9月8日	-	11	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、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《深证基本面60交易型开放式指数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

在二季度末经济指标短暂反弹后,进入三季度,工业增加值、发电量增速以及PMI指数等各项指标仍旧下滑,货币信贷增速也持续下滑,经济增长仍旧乏力。政策方面,配合国务院降低社会融资成本政策宗旨,货币信贷政策较为宽松,本季度不仅实施了定向降息政策,也在不同情况下对商业银行实施SLF操作,并在9月18日公开市场操作中下调了14天正回购利率。另一方面,针对房地产投资和销量增速持续下滑的情况,政府放松了住房按揭贷款政策,商业房地产企业债务融资的阀门也逐步打开。国际方面,欧美经济出现分化,美元指数持续攀升,沪港通等制度安排稳妥推进。在此背景下,除7月份因为新股冲击的短暂时间外,银行间流动性整体充裕,利率债在经历了7月份的微幅下跌后迅速反弹,信用债则维持强势,股票市场涨幅较大。

回顾三季度的基金管理工作,本基金在三季度经历了规模的较大波动,季初根据申购资金配置了流动性较好的信用产品,8月中旬后随着规模的逐步稳定,增加了长期债券和转债的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期信用增强A净值增长率2.1%,波动率0.11%,信用增强C净值增长率2.01%,波动率0.10%;业绩比较基准收益率1.62%,波动率0.1%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下季度,房地产投资增速和社会融资总量增速是值得关注的指标,在前期各项稳增长政策出台后,如果后续效果仍不理想,四季度定向的政策工具仍将持续使用,防范经济断崖式下跌的稳增长政策基调短期内仍然维持主导地位,其间各项改革主题也将不断涌现。

整体而言,我们认为债券市场方面,利率收益率曲线如此平坦化的现状下,如果短端收益率难以下行,长端利率债的空间有限,利率产品将呈现震荡行情;同时,随着政府性债务管理办法的出台和落实,今年市场普遍认为刚性兑付的城投债将逐步出现分化,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,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	194,969,067.78	99.15
	其中:股票	194,969,067.78	99.15
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,673,079.00	0.85
7	其他资产	6,707.33	0.00
8	合计	196,648,854.11	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	采矿业	11,110,777.42	5.67
C	制造业	119,667,530.04	61.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,548,194.82	2.32
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,399,592.96	3.26
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	23,052,495.35	11.76
K	房地产业	26,966,001.04	13.76
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	3,224,476.15	1.64
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	194,969,067.78	99.46

注:以上行业分类以2014年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

无。

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	000002	万 科A	2,113,358	19,400,626.44	9.90
2	000651	格力电器	371,909	10,313,036.57	5.26
3	000001	平安银行	804,310	8,155,703.40	4.16
4	000157	中联重科	1,473,314	7,204,505.46	3.68
5	000858	五 粮 液	353,000	6,519,910.00	3.33
6	002024	苏宁云商	747,616	6,399,592.96	3.26
7	000333	美的集团	294,732	5,862,219.48	2.99
8	000709	河北钢铁	2,495,330	5,689,352.40	2.90
9	000338	潍柴动力	272,916	5,534,736.48	2.82
10	000100	TCL 集团	1,966,147	5,308,596.90	2.71

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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

5.6 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资产支持证券投资明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

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五名权证投资明细

无。

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 报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

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

无。

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	6,326.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	381.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,707.33

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	140,566,039.00
报告期期间基金总申购份额	500,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	20,500,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	120,566,039.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金设立的文件;

2、《深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金合同》;

3、《深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

4、《深证基本面60交易型开放式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。

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
2014年10月24日

建信信用增强债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信信用增强债券	
场内简称	建信信用	
基金主代码	165311	
交易代码	165311	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月16日	
报告期末基金份额总额	895,244,137.41份	
投资目标	在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益,实现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债券投资组合。同时,在固定收益资产所提供的稳健收益基础上,适当参与新股发行申购及增发新股申购,为基金份额持有人增加收益,实现基金资产的长期增值。	
业绩比较基准	中国债券总指数收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于中等风险基金产品。其预期风险和收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 由于主要投资于除国债、中央银行票据以外的信用类金融工具,因此本基金投资蕴含一定的信用风险,预期风险和收益水平高于一般的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	交通银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	建信信用增强债券A	建信信用增强债券C
下属两级基金的交易代码	165311	165314
报告期末下属两级基金的份额总额	536,006,153.95份	359,237,983.46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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)	
	建信信用增强债券A	建信信用增强债券C
1.本期已实现收益	7,000,956.47	8,155,197.51
2.本期利润	13,398,757.09	15,027,994.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.0217	0.0176
4.期末基金资产净值	573,020,603.11	383,486,708.66
5.期末基金份额净值	1.069	1.068

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

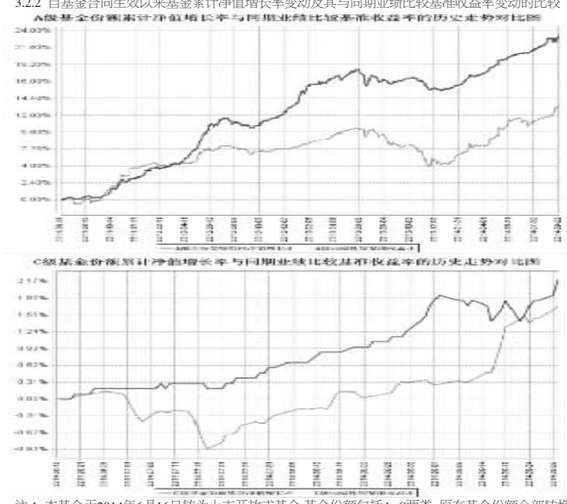
建信信用增强债券A

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	2.10%	0.11%	1.62%	0.10%	0.48%	0.01%

建信信用增强债券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	2.01%	0.10%	1.62%	0.10%	0.39%	0.00%

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:1、本基金于2014年6月16日转为上市开放式基金,基金份额包括A、C两类。原有基金份额全部转换为建信信用增强A类份额,C类份额为新增份额。

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		
李菁	投资管理部副总监、本基金的基金经理	2011年6月16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,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《建信信用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

在二季度末经济指标短暂反弹后,进入三季度,工业增加值、发电量增速以及PMI指数等各项指标仍旧下滑,货币信贷增速也持续下滑,经济增长仍旧乏力。政策方面,配合国务院降低社会融资成本政策宗旨,货币信贷政策较为宽松,本季度不仅实施了定向降息政策,也在不同情况下对商业银行实施SLF操作,并在9月18日公开市场操作中下调了14天正回购利率。另一方面,针对房地产投资和销量增速持续下滑的情况,政府放松了住房按揭贷款政策,商业房地产企业债务融资的阀门也逐步打开。国际方面,欧美经济出现分化,美元指数持续攀升,沪港通等制度安排稳妥推进。在此背景下,除7月份因为新股冲击的短暂时间外,银行间流动性整体充裕,利率债在经历了7月份的微幅下跌后迅速反弹,信用债则维持强势,股票市场涨幅较大。

回顾三季度的基金管理工作,本基金在三季度经历了规模的较大波动,季初根据申购资金配置了流动性较好的信用产品,8月中旬后随着规模的逐步稳定,增加了长期债券和转债的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期信用增强A净值增长率2.1%,波动率0.11%,信用增强C净值增长率2.01%,波动率0.10%;业绩比较基准收益率1.62%,波动率0.1%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下季度,房地产投资增速和社会融资总量增速是值得关注的指标,在前期各项稳增长政策出台后,如果后续效果仍不理想,四季度定向的政策工具仍将持续使用,防范经济断崖式下跌的稳增长政策基调短期内仍然维持主导地位,其间各项改革主题也将不断涌现。

整体而言,我们认为债券市场方面,利率收益率曲线如此平坦化的现状下,如果短端收益率难以下行,长端利率债的空间有限,利率产品将呈现震荡行情;同时,随着政府性债务管理办法的出台和落实,今年市场普遍认为刚性兑付的城投债将逐步出现分化,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,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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,473,097,166.18	97.41
	其中:债券	1,473,097,166.18	97.41
	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	3,643,070.32	0.24
7	其他资产	35,566,733.23	2.35
8	合计	1,512,306,969.73	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

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

无。

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	4,973,948.00	0.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	184,259,000.00	19.26
	其中:政策性金融债	184,259,000.00	19.26
4	企业债券	433,362,620.00	45.31
5	企业短期融资券	221,260,000.00	23.13
6	中期票据	432,201,000.00	45.19
7	可转债	197,040,598.18	20.60
8	其他	-	-
9	合计	1,473,097,166.18	154.01

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	011414002	14中粮SCP002	1,000,000	100,470,000.00	10.50
2	101472005	14宁国投MTN001	800,000	80,720,000.00	8.44
3	124852	14冀渤海	700,000	71,050,000.00	7.43
4	101474009	14沪世茂MTN002	600,000	60,300,000.00	6.30
5	1082118	10广交投MTN2	600,000	59,844,000.00	6.26

5.6 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资产支持证券投资明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

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五名权证投资明细

无。

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

无。

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	29,323.95
2	应收证券清算款	11,494,036.06
3	应收股利	-
4	应收利息	23,000,189.80
5	应收申购款	1,028,060.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,123.20
8	其他	-
9	合计	35,566,733.23

5.10.4 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	113002	工行转债	53,208,035.10	5.56
2	110015	石化转债	27,257,500.00	2.85
3	110020	南山转债	24,430,421.40	2.55
4	113001	中行转债	18,640,800.00	1.95
5	110023	民生转债	4,339,312.80	0.45
6	127002	徐工转债	3,291,222.56	0.34
7	110019	恒丰转债	2,437,422.40	0.25

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信信用增强债券A	建信信用增强债券C
报告期期初基金份额总额	456,914,895.50	373,818,339.19
报告期期间基金总申购份额	318,498,564.90	1,144,832,378.59
减:报告期期间基金总赎回份额	239,407,306.45	1,159,412,734.32
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	536,006,153.95	359,237,983.46

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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信用增强债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信信用增强债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信信用增强债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信信用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
2014年10月24日

建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 第三季度 报告

2014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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2014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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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2014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	建信深证基本面60ETF联接
基金主代码	530015
交易代码	530015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月8日
报告期末基金份额总额	232,214,309.51份
投资目标	本基金将绝大部分基金资产投资于目标ETF,密切跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标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目标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,或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金管理人将对投资组合进行适当调整,以降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×深证基本面60指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为深证基本面60ETF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	中国民生银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159916
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月8日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年10月24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	中国民生银行股份有限公司

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	深证基本面60指数收益率
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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-3,138,425.42
2.本期利润	29,567,573.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.1205
4.期末基金资产净值	204,527,729.97
5.期末基金份额净值	0.8808

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。

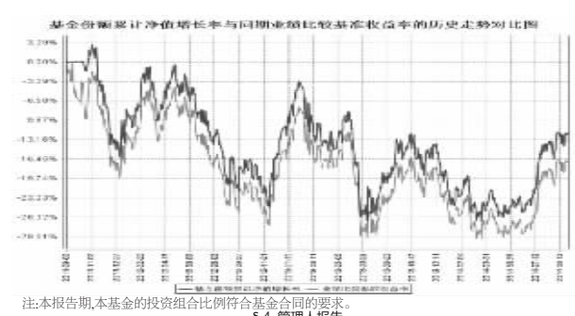
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	15.70%	0.92%	15.33%	0.93%	0.37%	-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		
梁洪昀	投资管理部总监、本基金的基金经理	2011年9月8日	-	11	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、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