建信深证100指数增强型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31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:2015年1月22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2015年1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信深证100指数增强
基金主代码	530018
交易代码	530018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月16日
报告期末基金份额总额	134,362,927.02份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对深证100指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略,以深证100指数作为基金投资组合的标的指数,结合深入的基本面研究及数量化投资技术,在指数化投资基础上优化调整投资组合,在控制与比较基准偏离风险的前提下,力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,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,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。
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

§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10月1日 - 2014年12月31日）
1.本期已实现收益	44,300,209.18
2.本期利润	58,322,338.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.2416
4.期末基金资产净值	163,300,256.88
5.期末基金份额净值	1.2154

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。

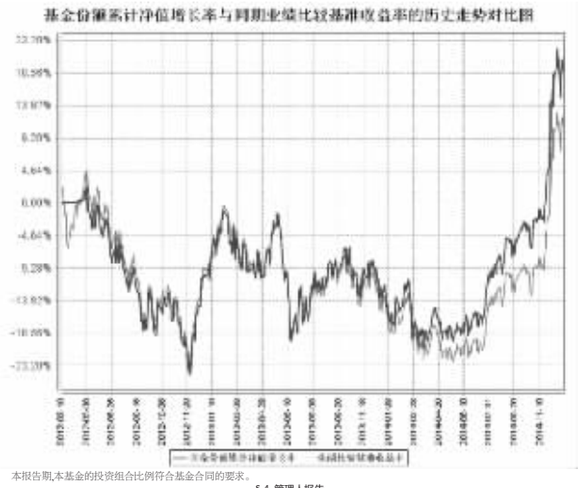
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	27.53%	1.41%	26.28%	1.41%	1.25%	0.00%

3.2.2 目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



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	2012年3月16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9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》及其他有关法律法规的规定和《建信深证100指数增强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

本基金管理人以量化分析研究为基础,利用量化模型进行指数增强和风险管理,量化增强策略获得了较好的表现。在报告期间,本基金超额收益较为稳健,同时保持适当的跟踪误差,从11月中旬开始,市场风格发生了非常大的转变,本基金管理人及时调整模型,基本保持了稳健的超额收益。

在报告期末,本基金积极应对指数成份股的调整,较好控制了跟踪误差及交易成本。

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27.53%,波动率1.41%,业绩比较基准收益率26.28%,波动率1.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年四季度市场在宽松货币政策的刺激下出现大涨,投资者热情被大大激发,以蓝筹股为代表的大盘指数大幅上涨,成交屡创历史天量。展望2015年一季度,预计投资热情仍会持续,同时大盘股强小盘股弱的格局仍将维持。行情的变数在于经济基本面是否大幅低于预期以及流动性是否发生重要改变。

本基金管理人将根据基金合同,继续坚持量化分析研究,进一步改进指数增强策略,努力克服市场的波动,持续获取稳健的超额收益。

§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	152,904,761.82	88.60
	其中:股票	152,904,761.82	88.60
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	13,941,236.55	8.08
7	其他资产	5,728,798.64	3.32
8	合计	172,574,797.01	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	62,268.55	0.04
C	制造业	64,014,268.26	39.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	139,048.00	0.09
E	建筑业	1,020,465.60	0.62
F	批发和零售业	1,873,440.00	1.15
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	8,801,381.26	5.39
J	金融业	27,449,007.54	16.81
K	房地产业	11,717,375.40	7.18
L	租赁和商务服务业	2,817,292.96	1.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,696,195.85	1.65
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	2,885,850.39	1.77
S	综合	1,379,369.25	0.84
	合计	124,855,963.06	76.46

以上行业分类以2014年12月31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

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	585,200.00	0.36
B	采掘业	261,459.00	0.16
C	制造业	14,531,003.84	8.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,668,383.95	1.02
E	建筑业	564,590.60	0.35
F	批发和零售业	1,860,714.70	1.14
G	交通运输、仓储和邮政业	301,883.40	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	903,416.22	0.55
J	金融业	2,306,188.20	1.41
K	房地产业	3,391,030.80	2.08
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	106,058.45	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	623,353.60	0.38
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	945,516.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	28,048,798.76	17.18

以上行业分类以2014年12月31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	000002	万 科A	648,850	9,019,015.00	5.52
2	000001	平安银行	432,164	6,845,477.76	4.19
3	300315	掌趣科技	337,225	6,602,865.50	4.04
4	000651	格力电器	172,608	6,407,208.96	3.92
5	000562	宏源证券	172,402	6,271,984.76	3.84
6	000776	广发证券	212,570	5,516,191.50	3.38
7	000783	长江证券	244,655	4,115,097.10	2.52
8	000625	长安汽车	218,800	3,594,884.00	2.20
9	000333	美的集团	122,942	3,373,528.48	2.07
10	000100	TCL 集团	845,753	3,213,861.40	1.97

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

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	600376	首开股份	104,600	1,054,368.00	0.65
2	600674	川投能源	48,415	1,003,642.95	0.61
3	600791	京能置业	148,080	993,616.80	0.61
4	002167	东方锆业	71,300	985,366.00	0.60
5	300175	朗源股份	147,400	972,840.00	0.60

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 报告期末本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	54,998.78
2	应收证券清算款	5,363,649.91
3	应收股利	-
4	应收利息	7,564.67
5	应收申购款	302,585.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,728,798.64

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

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	300315	掌趣科技	6,602,865.50	4.04	重大事项停牌
2	000562	宏源证券	6,271,984.76	3.84	换股吸收合并停牌

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	302,363,241.15
报告期期间基金总申购份额	20,178,249.74
减:报告期期间基金总赎回份额	188,178,563.87
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	134,362,927.02

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深证100指数增强型证券投资基金设立的文件;

2、《建信深证100指数增强型证券投资基金基金合同》;

3、《建信深证100指数增强型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信深证100指数增强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
2015年1月22日

建信双息红利债券型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月22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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信双息红利债券	
基金主代码	530017	
交易代码	530017	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年12月13日	
报告期末基金份额总额	1,412,771,137.01份	
投资目标	通过主动管理债券组合,力争在追求基金资产稳定增长基础上为投资者取得高于投资业绩比较基准的回报。	
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,适当进行股票投资,本基金的股票投资作为债券投资的辅助和补充,以本金安全为最重要因素。	
业绩比较基准	90%×中国债券总指数收益率+10%×中证红利指数收益率。	
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股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	建信双息红利债券A	建信双息红利债券C
下属两级基金的交易代码	530017	531017
报告期末下属两级基金的份额总额	1,292,070,271.76份	120,700,865.25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10月1日 - 2014年12月31日）	
	建信双息红利债券A	建信双息红利债券C
1.本期已实现收益	133,050,476.10	7,438,746.64
2.本期利润	223,844,793.67	9,344,844.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.1528	0.2015
4.期末基金资产净值	1,598,116,930.30	139,478,685.58
5.期末基金份额净值	1.237	1.156

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

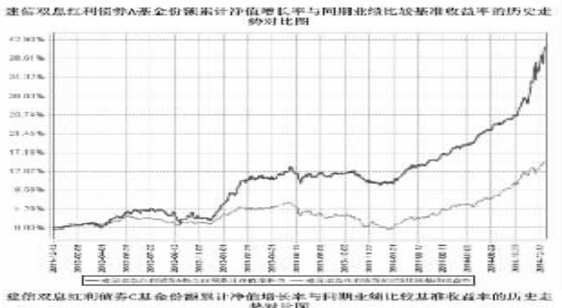
建信双息红利债券A

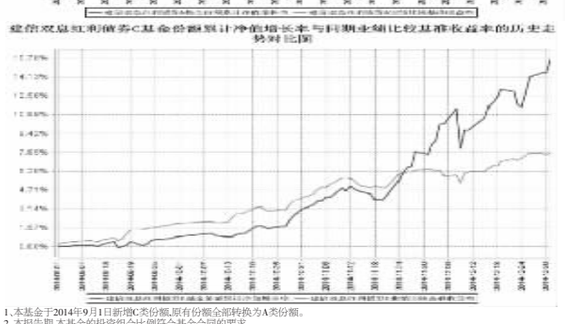
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	14.43%	0.61%	5.79%	0.26%	8.64%	0.35%

建信双息红利债券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	14.68%	0.62%	5.79%	0.26%	8.89%	0.36%

3.2.2 目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





1、本基金于2014年9月1日新增C类份额,原有份额全部转换为A类份额。

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		
钟敬律	投资管理部副总监、本基金的基金经理	2011年12月13日	-	9	特许金融分析师（CFA）,硕士,加拿大籍华人。1995年7月毕业于南开大学金融系,获经济学学士学位;2004年5月毕业于加拿大不列颠哥伦比亚大学,获工商管理硕士学位。曾先后任职于广东发展银行珠海分行、深圳发展银行珠海分行、富文基金管理有限公司等,从事外汇交易、信贷、债券研究及投资组合管理等工作。2008年5月加入建信基金管理公司,2009年6月2日至2011年5月11日任建信收益增强债券型证券投资基金基金经理;2008年8月15日起任建信稳定增利债券型证券投资基金基金经理;2011年12月13日起任建信双息红利债券型证券投资基金基金经理;2013年9月3日起任建信安心保本混合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》及其他有关法律法规的规定和《建信双息红利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

宏观经济方面,四季度经济延续了三季度的弱势。PMI指数由9月51.1下降到12月50.1,工业增加值由9月份8%一直下降到11月份的7.2%,PPI、CPI同比增速均有所下滑。

经济下降与地方政府债务整顿以及前期社会融资总量增速下降有关,最主要表现在投资增速在四季度依旧在低位,基建与房地产投资持续回落,消费和出口虽然表现尚可,但不足以抵消投资增速不振的影响。

四季度国际金融市场出现较大动荡,布伦特原油价格由9月底的90多美元/桶下降到当前50多美元/桶的水平,卢布大幅贬值,包括油价在内的大宗商品价格暴跌是国内物价指数走低的重要原因之一。

四季度货币政策总体宽松,10月央行将公开市场正回购利率下调10BP,并且向银行实行了定向宽松的措施。11月份央行降息,12月份央行对贷存比统计口径进行了修改,扩大了计入存款的项目,总体上增加了银行可用贷款额度,有利于银行信用的派生。

债券市场方面,四季度市场波动较大,但整体来看收益率有所下降。收益率波动较大,一方面是由于受到IPO和年底资金面的影响,另一方面则是由于12月初中证登出台了企业债回购资格标准的限定,造成了收益率的大幅度上行。城投债方面,政府出台了包括"43号文"等一系列规定,造成了市场对城投债务是否会不属于政府债务产生疑问,进而对城投债的进行担忧上升,城投债在四季度表现较差。

股票和转债市场在四季度表现都非常好。

本基金在四季度较大幅度地增加了股票和转债的配置,取得了不错的收益。本基金在四季度增加了信用债的配置,增配品种集中在高等级信用债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期双息红利A净值增长率14.43%,波动率0.61%,双息红利C净值增长率14.68%,波动率0.62%;业绩比较基准收益率5.79%,波动率0.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

刚刚结束的中央经济工作会议将保增长放到首要任务。展望2015年一季度,我们预计保增长的措施可能会继续出台,贷款将保持不低的增速,虽然其结构和质量有待商榷。

在经济下行压力较大、政府努力降低企业融资成本的背景下,预期一季度央行依然会维持相对宽松的资金面,但资金面将会受到IPO和春节等时点的冲击,资金利率波动较大。

总体上,我们对债券市场的看法偏中性,要关注信贷数据和资金面波动对债券市场的冲击。一季度本基金将控制好组合久期,积极选择资质良好的信用债予以配置。由于股票和转债市场上涨较多,本基金将密切留意两个市场的风险,坚持自下而上选择有价值的品种予以配置,争取在下一季度为投资者获得良好的回报。

§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	328,924,756.76	15.18
	其中:股票	328,924,756.76	15.18
2	固定收益投资	1,715,168,430.74	79.16
	其中:债券	1,715,168,430.74	79.16
	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	67,656,475.87	3.12
7	其他资产	54,981,058.64	2.54
8	合计	2,166,730,722.01	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	185,044,704.75	10.65
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	48,274,086.71	2.78
K	房地产业	43,697,443.80	2.51
L	租赁和商务服务业	51,908,521.50	2.99
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	328,924,756.76	18.93

以上行业分类以2014年12月31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	601318	中国平安	645,201	48,202,966.71	2.77
2	600271	航天信息	1,354,320	41,320,303.20	2.38
3	600067	冠城大通	4,326,598	35,045,443.80	2.02
4	002344	海宁皮城	2,099,950	33,410,204.50	1.92
5	002385	大北农	2,163,773	29,037,833.66	1.67
6	002282	博深工具	1,686,165	28,361,295.30	1.63
7	000625	长安汽车	1,660,151	27,276,280.93	1.57
8	002465	海格通信	1,400,800	27,063,456.00	1.56
9	002646	青青稞酒	1,060,382	22,745,193.90	1.31
10	600358	国旅联合	2,551,492	18,498,317.00	1.06

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	121,090,080.00	6.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,534,500.00	1.18
	其中:政策性金融债	20,534,500.00	1.18
4	企业债券	417,238,947.40	24.01
5	企业短期融资券	210,073,000.00	12.09
6	中期票据	663,528,000.00	38.19
7	可转债	282,703,903.34	16.27
8	其他	-	-
9	合计	1,715,168,430.74	98.71

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	101456084	14国高速MTN001	1,500,000	152,805,000.00	8.79
2	113002	工行转债	702,890	104,864,159.10	6.04
3	011499076	14包钢集SCP001	1,000,000	99,830,000.00	5.75
4	101459044	14龙高速MTN001	600,000	60,750,000.00	3.50
5	110028	冠城转债	360,000	53,042,400.00	3.05

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	442,553.68
2	应收证券清算款	11,855,379.93
3	应收股利	-
4	应收利息	22,712,483.79
5	应收申购款	19,970,641.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,981,058.64

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	104,864,159.10	6.04
2	110023	民生转债	23,505,900.00	1.35
3	127002	徐工转债	17,880,600.00	1.03
4	113005	平安转债	13,024,519.80	0.75

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	建信双息红利债券A	建信双息红利债券C
报告期期初基金份额总额	1,299,289,435.19	667,638.73
报告期期间基金总申购份额	1,707,955,036.78	189,752,885.82
减:报告期期间基金总赎回份额	1,715,174,200.21	69,719,659.30
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	1,292,070,271.76	120,700,865.25

总申购份额含红利再投资和转换入份额,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双息红利债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信双息红利债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信双息红利债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信双息红利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
2015年1月22日

建信全球资源股票型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月22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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月20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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信全球资源股票（QDII）
基金主代码	539003
交易代码	539003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月26日
报告期末基金份额总额	57,528,286.33份
投资目标	通过全球化的资产配置和组合管理,优选资源类相关行业的股票进行投资,在控制风险的同时,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在投资策略方面,将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等多种方式进行投资组合的构建。
业绩比较基准	50%×MSCI全球能源行业净总收益指数收益率 MSCI ACWI Energy Net Total Return Index +50%×MSCI全球原材料行业净总收益指数收益