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

2015 第二季度 报告

2015年6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:2015年7月17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2015年7月15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2015年4月1日起至6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	74,184,587.12份
投资目标	本基金将他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或本基金日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较高收益的品种。
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F60ETF
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,其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(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	21,140,190.45
2.本期利润	25,220,077.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.2852
4.期末基金资产净值	123,048,580.72
5.期末基金份额净值	1.6587

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。

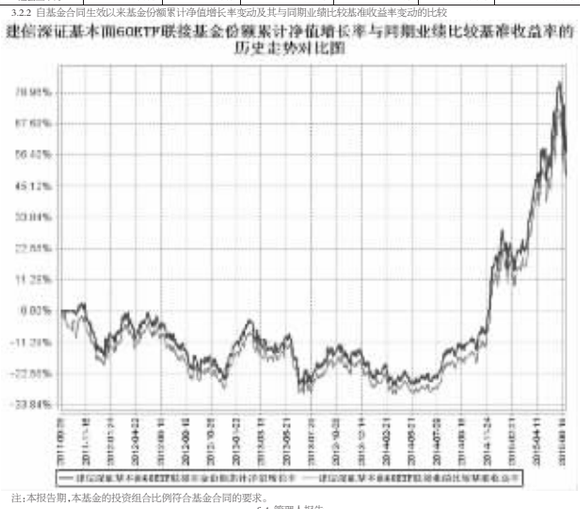
3.2 基金净值表现

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	18.53%	2.36%	17.72%	2.40%	0.81%	-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

建信深证基本面60ETF联接基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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	金融工程及指数投资部总监、本基金的基金经理	2011年9月8日	-	12	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;2015年3月25日起任建信双利分级股票基金的基金经理。

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,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《建信深证基本面60交易型开放式指数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

在报告期间,本基金绝大部分资产投资于基本面60ETF,因此基金的跟踪误差和偏离度主要取决于基本面60ETF的表现。

报告期内,长期纾缓股票的估值调整给基金净值造成了额外的波动,使得基金跟踪误差有所放大,由于申赎造成的基金份额变动以及成份股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18.53%,波动率2.36%,业绩比较基准收益率17.72%,波动率2.4%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场在二季度的大部分时间内基本上保持单边上涨的态势,但在临近季末时,出现了快速下跌,市场波动率迅速放大,这一形势预计在三季度初期还将延续,市场参与者在经历大幅波动后,预期会对之前单边上涨阶段各自的行为模式进行检讨,并对未来的策略进行适当修正。

本基金管理人将根据基金合同规定,继续将不低于90%的基金资产投资于基本面60ETF,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	2,001,200.89	1.60
	其中:股票	2,001,200.89	1.60
2	基金投资	114,445,750.00	91.52
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,082,457.23	5.66
8	其他资产	1,519,082.50	1.21
9	合计	125,048,490.62	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	1,861,902.64	1.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,252.80	0.03
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	-	-
K	房地产业	102,045.45	0.08
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	2,001,200.89	1.63

注:以上行业分类以2015年6月30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	000630	铜陵有色	148,800	1,534,128.00	1.25
2	002269	美邦服饰	15,122	179,346.92	0.15
3	000024	招商地产	2,795	102,045.45	0.08
4	000778	新兴铸管	6,147	79,665.12	0.06
5	000878	云南铜业	2,200	53,900.00	0.04
6	000539	粤电力A	3,120	37,252.80	0.03
7	000066	长城电脑	690	14,862.60	0.01

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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持有股指期货。

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持有股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中,中信证券股份有限公司(600030)于2015年1月19日发布公告:2015 年 1 月 16 日收市后,中国证监会在例行的新闻发布会上,通报证券公司融资融券业务检查情况,提及本公司等 3 家证券公司由于存在为到期融资融券合约展期的问题,对本公司等 3 家证券公司采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。2015 年 1 月 16 日约 17 时,本公司通过网络报道知悉上述处罚。广发证券股份有限公司(000776)于2015年1月19日发布公告:2015 年 1 月 16 日,中国证监会公开通报 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司因存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题,且涉及客户数量较多,受到责令限期改正的行政监管措施。海通证券股份有限公司(600837)于2015年1月19日发布公告:2015 年 1 月 16 日,中国证监会公开通报 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司因存在违规为到期融资融券合约展期问题,受到暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

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	126,524.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,710.22
5	应收申购款	1,390,847.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,519,082.50

5.12.4 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。

5.12.5 报告期末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	000630	铜陵有色	1,534,128.00	1.25	重大事项停牌
2	002269	美邦服饰	179,346.92	0.15	重大事项停牌
3	000024	招商地产	102,045.45	0.08	重大事项停牌
4	000778	新兴铸管	79,665.12	0.06	重大事项停牌
5	000878	云南铜业	53,900.00	0.04	重大事项停牌
6	000539	粤电力A	37,252.80	0.03	重大事项停牌
7	000066	长城电脑	14,862.60	0.01	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	109,099,878.14
报告期期间基金总申购份额	11,399,290.84
减:报告期期间基金总赎回份额	46,314,581.86
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	74,184,587.12

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基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未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深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件;

2、《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合同》;

3、《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招募说明书》;

4、《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7月17日

建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月17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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月15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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信双利分级股票
场内简称	建信双利
基金主代码	165310
交易代码	165310
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月6日
报告期末基金份额总额	201,350,892.98份
投资目标	本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过自上而下的方式,通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析,深入挖掘上述趋势将以产生和转换的内在驱动因素以及潜在的投资主题,在前述主题筛选和主题配置的基础上,本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具,采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票标建股票投资组合。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。 从本基金所分离的两类基金份额来看,建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额;建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信双利 建信稳健 建信进取
下属分级基金的场内简称	建信双利 建信稳健 建信进取
下属分级基金的交易代码	165310 150036 150037
报告期末下属分级基金的份额总额	184,898,570.98份 6,580,928.00份 9,871,394.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。 建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额。 建信进取份额将表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。

§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(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	120,495,815.17
2.本期利润	54,445,216.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.2264
4.期末基金资产净值	318,552,618.71
5.期末基金份额净值	1.582

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。

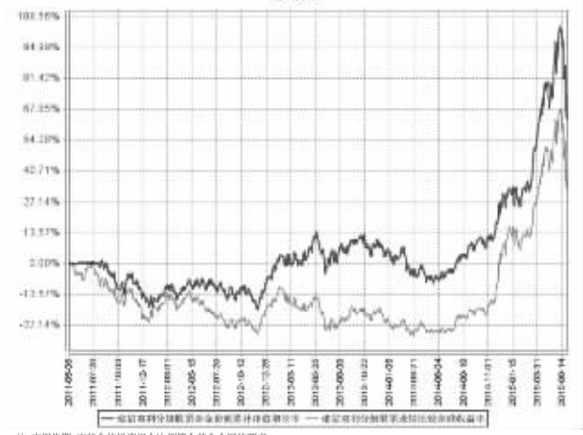
3.2 基金净值表现

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	12.68%	2.47%	9.98%	2.48%	2.70%	-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

建信双利分级股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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	金融工程及指数投资部总监、本基金的基金经理	2015年3月25日	-	12	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;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;2015年3月25日起任建信双利分级股票基金的基金经理。

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,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《建信双利策略主题分级股票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

在报告期内,本基金配置较为均衡,适当控制了组合波动率,并通过个股选择,力争为投资者带来稳定收益。投资组合持仓相对分散,以保持组合的整体流动性。

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12.68%,波动率2.47%,业绩比较基准收益率9.98%,波动率2.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场在二季度的大部分时间内基本上保持单边上涨的态势,但在临近季末时,出现了快速下跌,市场波动率迅速放大,这一形势预计在三季度初期还将延续。市场参与者在经历大幅波动后,预期会对之前单边上涨阶段各自的行为模式进行检讨,并对未来的策略进行适当修正。

本基金属于高仓位、主动投资的股票型基金,将会通过吸收投研团队的研究成果,优化组合配置,力争给持有人带来超额收益。

§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	297,764,795.56	90.87
	其中:股票	297,764,795.56	90.87
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	29,453,138.31	8.99
7	其他资产	454,297.21	0.14
8	合计	327,672,231.08	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	13,793,977.31	4.33
C	制造业	98,330,686.24	30.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,732,495.82	4.31
E	建筑业	21,196,429.00	6.65
F	批发和零售业	4,743,778.00	1.49
G	交通运输、仓储和邮政业	17,032,263.78	5.35
H	住宿和餐饮业	1,633,040.00	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,489,341.98	3.61
J	金融业	102,954,865.61	32.32
K	房地产业	10,570,143.02	3.32
L	租赁和商务服务业	447,430.80	0.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	995,584.00	0.31
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	844,760.00	0.27
S	综合	-	-
	合计	297,764,795.56	93.47

注:以上行业分类以2015年6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	601318	中国平安	226,078	18,524,831.32	5.82
2	600030	中信证券	446,189	12,006,945.99	3.77
3	600837	海通证券	504,800	11,004,640.00	3.45
4	000333	美的集团	238,159	8,878,567.52	2.79
5	600519	贵州茅台	32,600	8,399,390.00	2.64
6	002021	中捷资源	633,000	7,861,860.00	2.47
7	600900	长江电力	634,336	7,846,736.32	2.46
8	002252	上海莱士	118,617	7,762,296.48	2.44
9	000776	广发证券	340,597	7,714,522.05	2.42
10	601377	兴业证券	559,122	7,654,380.18	2.40

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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持有股指期货。

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	138,507.44
2	应收证券清算款	10,552,403.16
3	应收股利	-
4	应收利息	16,704,401.01
5	应收申购款	2,696,562.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,091,873.88

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	110030	格力转债	8,974,392.30	0.85
2	113501	洛阳转债	8,323,173.60	0.79

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未存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信双利	建信稳健	建信进取
报告期期初基金份额总额	276,928,449.10	9,802,604.00	14,703,908.00
报告期期间基金总申购份额	5,245,445.93	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	105,329,514.05	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	8,054,190.00	-3,221,676.00	-4,832,514.00
报告期期末基金份额总额	184,898,570.98	6,580,928.00	9,871,394.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§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

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未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双利策略主题分级股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信双利策略主题分级股票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7月17日

建信收益增强债券型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月17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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月15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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信收益增强债券
基金主代码	530009
交易代码	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
报告期末基金份额总额	720,624,048.03份
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。
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
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
下属分级基金的场内简称	- -
下属分级基金的交易代码	530009 531009
下属分级基金的前端交易代码	- -
下属分级基金的后端交易代码	- -
报告期末下属分级基金的份额总额	491,023,427.94份 229,600,620.09份
下属分级基金的风险收益特征	- -

§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(2015年4月1日 - 2015年6月30日)	
	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
1.本期已实现收益	30,360,664.05	22,340,029.85
2.本期利润	27,099,697.00	36,373,921.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0687	0.1273
4.期末基金资产净值	727,876,416.60	332,193,377.07
5.期末基金份额净值	1.482	1.447

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

建信收益增强债券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	8.41%	0.73%