建信优选成长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:中国工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。

基金托管人中国工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	建信优选成长股票
基金主代码	530003
交易代码	530003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月8日
报告期末基金份额总额	1,541,178,233.20份
投资目标	通过投资于具有良好业绩成长性和投资价值的上市公司,实现基金资产长期增值。
投资策略	本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数+20%×中国债券总指数+5%×1年定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	883,454,177.04
2.本期利润	921,517,120.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.4990
4.期末基金资产净值	3,203,434,463.43
5.期末基金份额净值	2.0786

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。

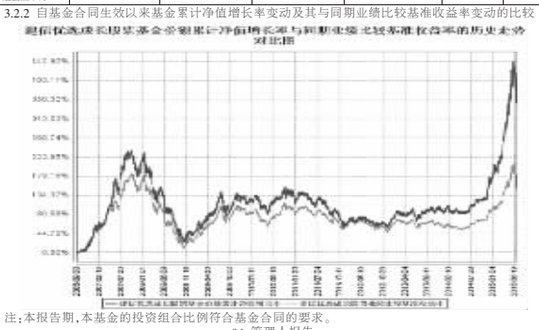
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	28.09%	2.69%	9.41%	2.05%	18.68%	0.64%

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		
姚锦	权益投资部副总监、研究部首席策略分析师、本基金的基金经理	2012年2月17日	-	11	博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师,天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职,2009年3月17日至2011年3月3日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理;2009年12月17日至2011年5月5日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理,现任我公司研究部首席策略分析师,2012年2月17日起任建信优选成长股票型证券投资基金基金经理,2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任股票型证券投资基金基金经理;2014年1月20日起任建信保本基金的基金经理,该基金于1月23日起转型为建信积极配置混合型证券投资基金基金,姚锦继续担任该基金的基金经理。

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,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,严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信优选成长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

2015年二季度由于美国消费数据好转,美联储加息时间基本确认为15年下半年之后。其余主要经济体的最终需求看起来仍旧低迷,欧洲是否能够出现阶段性的温和复苏,以及美元加息是否会引起金融市场和新兴市场经济波动是重要的关注点。国内稳增长措施逐渐见效,地产销量放大房价回升,经济政策的重点是否转到财政政策需要关注。

在改革和转型的大环境下,加杠杆推动资金不断进入股票市场,整个二季度市场相继经历了龙头股票上涨,题材股上涨,和去杠杆带来的大幅调整。稳增长见效,政策宽松低于预期,以及去杠杆是影响股票市场快速调整的主要原因,表现为前期股票市场的风险偏好快速上升,以及6月的快速下降。本基金在个股选择上偏重于管理好,市场空间大、卡位好的龙头股票,因此在前期受益于龙头股票的上涨,但是题材和补涨的市场中表现被动。本基金对于市场快速上涨持较为谨慎的态度,较早减持高估值股票,重点配置了景气程度较高的航空等行业。

在信托、银行理财之后,2014年下半年到2015年上半年,由于股票市场上涨,衍生出来的两融受益权和打新基金成为新的无风险收益率的锚。股票市场的上涨主要受益于风险偏好的提升,因此在情绪的带动下表现为大幅波动。银行资金不愿意配置到低收益高风险的实业中,导致货币政策传导失灵。展望三季度,由于股票市场的快速调整,使得市场无风险收益率大幅降低,加大了银行资金对于债券的配置需求,有利于债券资产的表现。从中长期来看,有利于股票市场的制度建设,有利于股票市场的长期发展。

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28.09%,波动率2.69%,业绩比较基准收益率9.41%,波动率2.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在基金操作上,本基金仍将坚持精选个股,选择具有长期趋势性的行业和个股进行投资,根据市场情绪影响针对估值水平进行操作。另外,本基金将择机加大在债券资产上的配置。

§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	2,808,141,580.86	84.29
	其中:股票	2,808,141,580.86	84.29
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	508,831,633.36	15.27
7	其他资产	14,632,835.82	0.44
8	合计	3,331,606,050.04	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	1,098,006,768.20	34.28
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	22,985,915.76	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	1,185,701,649.04	37.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	344,751,809.45	10.76
J	金融业	21,285,863.41	0.66
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	33,311,475.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	44,200,000.00	1.38
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	34,319,000.00	1.07
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	23,579,100.00	0.74
	合计	2,808,141,580.86	87.66

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	601111	中国国航	20,482,870	330,593,521.80	10.32
2	600029	南方航空	21,416,714	311,399,021.56	9.72
3	600115	东方航空	24,961,004	307,519,569.28	9.60
4	300059	东方财富	3,000,000	189,270,000.00	5.91
5	000651	格力电器	2,653,448	169,555,327.20	5.29
6	601021	春秋航空	1,315,400	157,229,762.00	4.91
7	000333	美的集团	3,558,515	132,661,439.20	4.14
8	002465	海格通信	3,683,880	118,584,097.20	3.70
9	002580	圣阳股份	6,389,160	113,343,698.40	3.54
10	600060	海信电器	4,600,000	113,114,000.00	3.53

注:截至本报告期末,本基金持有的前十名股票投资中中国国航(601111)占比超出基金资产净值10%,该股票因筹划非公开发行股票事项于2015年6月30日起停牌。基金管理人将在该股票复牌后10个交易日内进行调整。

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投资股指期货。

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	1,260,208.95
2	应收证券清算款	6,376,718.31
3	应收股利	-
4	应收利息	79,717.17
5	应收申购款	6,916,191.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,632,835.82

5.11.4 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。

5.11.5 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	601111	中国国航	330,593,521.80	10.32	筹划非公开发行股票
2	601021	春秋航空	157,229,762.00	4.91	筹划非公开发行股票

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,889,772,463.37
报告期期间基金总申购份额	841,241,041.07
减:报告期期间基金总赎回份额	1,189,835,271.24
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	1,541,178,233.20

注:上述总申购份额含转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§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优选成长股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信优选成长股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信优选成长股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信优选成长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

建信优化配置混合型证券投资基金

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:中国工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。

基金托管人中国工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	建信优化配置混合
基金主代码	530005
交易代码	530005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月1日
报告期末基金份额总额	2,300,110,191.37份
投资目标	通过合理的资产配置和积极的证券选择,在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。
投资策略	基金管理人对宏观经济、行业及上市公司、债券、货币市场工具等进行定性与定量相结合的研究,运用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在大类资产配置这一宏观层面与个股个券选择这一微观层面优化投资组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:60%×富时中国A600指数+40%×中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,997,100,226.79
2.本期利润	1,083,057,965.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.3410
4.期末基金资产净值	3,859,104,655.74
5.期末基金份额净值	1.6778

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。

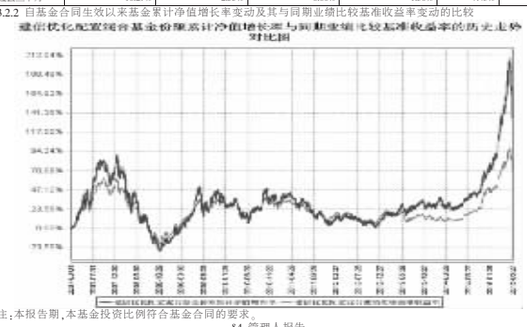
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	16.29%	2.55%	8.86%	1.56%	7.43%	0.99%

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,本基金投资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		
邱宇航	本基金的基金经理	2015年5月20日	-	8	硕士。2007年7月加入本公司,从事行业研究,历任研究员、基金经理助理,2011年7月11日至2014年3月27日任建信恒久价值股票型证券投资基金基金经理;2013年6月14日起任建信消费升级混合型证券投资基金基金经理;2015年5月20日起任建信优化配置混合基金基金经理。
陶灿	本基金的基金经理	2011年7月11日	-	8	硕士。2007年7月加入本公司,从事行业研究,历任研究员、基金经理助理,2011年7月11日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理;2014年5月14日起任建信改革红利股票型证券投资基金基金经理。
马志强	本基金的基金经理	2013年11月13日	2015年5月20日	10	博士,曾就职于东北证券公司、北京高汇投资管理有限公司、北京蓝巢投资有限公司,2004年11月起就职于天弘基金管理公司,2008年12月2日至2011年3月23日任天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理,2011年3月加入本公司,2011年8月2日至2015年3月25日任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理;2013年11月13日至2015年5月20日任建信优化配置基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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,严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信优化配置混合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

2015年2季度,A股走势出现大幅波动,一方面市场经过长期大幅上涨有自发调整的需要,另一方面杠杆的运用又加剧了市场的波动。

本基金面对市场波动,采用审慎的投资策略,并缩小了风险敞口。

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16.29%,波动率2.55%,业绩比较基准收益率8.86%,波动率1.56%。

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3季度,市场经过大规模的风险释放和降低杠杆的过程之后,有望重新出清;市场的内部结构调整会孕育新的方向。

本基金在下半年将更加重视个股的增长质量,布局重点仍放在各细分领域的龙头个股。

§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	2,676,924,039.50	60.94
	其中:股票	2,676,924,039.50	60.94
2	固定收益投资	11,937,216.50	0.27
	其中:债券	11,937,216.50	0.27
	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	1,698,557,675.93	38.67
7	其他资产	5,549,878.69	0.13
8	合计	4,392,968,810.62	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	103,385,351.78	2.68
B	采矿业	81,722,971.59	2.12
C	制造业	1,565,862,757.87	40.58
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	73,148,436.06	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	194,944,950.44	5.05
H	住宿和餐饮业	6,635,616.75	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	478,581,366.06	12.40
J	金融业	19,044,000.00	0.49
K	房地产业	153,598,588.95	3.98
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	2,676,924,039.50	69.37

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	600271	航天信息	3,668,272	237,373,881.12	6.15
2	600594	益佰制药	3,541,734	205,880,997.42	5.33
3	600570	恒生电子	1,797,613	201,422,536.65	5.22
4	300017	网宿科技	3,730,880	173,187,449.60	4.49
5	300203	聚光科技	3,622,887	149,226,715.53	3.87
6	600366	宁波韵升	3,910,788	120,100,299.48	3.11
7	300202	聚龙股份	2,591,877	104,711,830.80	2.71
8	000596	古井贡酒	2,077,624	96,983,488.32	2.51
9	002153	石基信息	669,019	86,965,779.81	2.25
10	603008	喜临门	4,370,391	82,338,166.44	2.13

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,937,216.50	0.31
8	其他	-	-
9	合计	11,937,216.50	0.31

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	110031	航信转债	82,150	11,937,216.50	0.31

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投资股指期货。

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	2,309,070.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	264,227.78
5	应收申购款	2,976,580.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,549,878.69

5.11.4 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。

5.11.5 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	300203	聚光科技	149,226,715.53	3.87	筹划非公开发行股票事项停牌
2	600366	宁波韵升	120,100,299.48	3.11	重大资产重组停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,219,438,284.95
报告期期间基金总申购份额	157,904,238.72
减:报告期期间基金总赎回份额	2,077,232,332.30
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	2,300,110,191.37

注:上述总申购份额含转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§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优化配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信优化配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信优化配置混合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

建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	建信优势动力股票(LOF)
场内简称	建信优势
基金主代码	165313
交易代码	165313
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年3月19日
报告期末基金份额总额	538,560,428.45份
投资目标	采取定量和定性相结合的方法,寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力、但是价值被低估的优势上市公司,通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险,在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产来获取超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人对经济环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析,作出投资决策。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,一般情况下其风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。属于较高风险收益特征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(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	309,542,308.07
2.本期利润	102,426,748.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.1506
4.期末基金资产净值	828,768,970.78
5.期末基金份额净值	1.539

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。

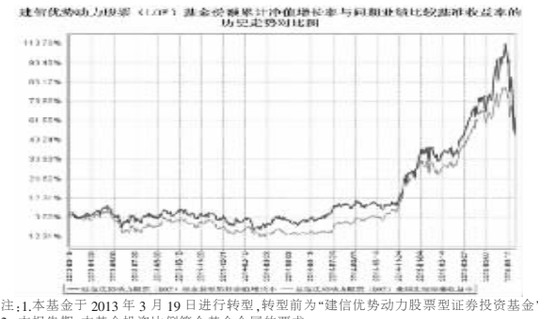
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	5.12%	2.73%	8.75%	1.96%	-3.63%	0.77%

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2013年3月19日进行转型,转型前为"建信优势动力股票型证券投资基金"。

2. 本报告期,本基金投资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		
姜锋	本基金的基金经理	2013年3月19日	-	8	硕士。2007年7月加入本公司,从事行业研究。任研究员、2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理。该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理;2014年3月21日起任建信健康民生混合型证券投资基金基金经理;2015年4月22日起任建信环保产业股票基金基金经理。
万志勇	权益投资部总监、本基金的基金经理	2013年3月19日	-	14	硕士。曾就职于西安创新互联网孵化器有限公司、北方证券有限责任公司、大成基金管理有限公司、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司、银巨田基金管理有限公司。银华基金管理有限公司、2008年10月23日至2009年11月11日任银华领先策略基金基金经理,2009年6月1日至2010年6月19日任银华和谐主题基金基金经理,2010年7月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究部执行总监、研究部执行总监兼投资管理部副总监、投资管理部副总监、权益投资部总监,2010年11月17日起任建信内生动力股票型证券投资基金基金经理;2011年5月6日至2012年5月18日任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理;2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理,该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金(LOF)。万志勇继续担任该基金基金经理。

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