建信月盈安心理财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

基金简称	建信月盈安心理财	
基金主代码	530028	
交易代码	530028	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月20日	
报告期末基金份额总额	1,328,796,308.62份	
投资目标	严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报,并力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金通过积极主动的组合管理,充分运用各种短期投资工具,力争为持有人创造低风险基础上的投资收益。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过150天。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)	
风险收益特征	本基金属于债券基金,长期风险收益水平低于股票基金、混合基金,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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
下属分级基金的交易代码	530028	531028
报告期末下属分级基金的份额总额	755,768,033.75份	573,028,274.87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(2015年4月1日-2015年6月30日)	
	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
1.本期已实现收益	10,682,467.85	7,080,788.63
2.本期利润	10,682,467.85	7,080,788.63
3.期末基金资产净值	755,768,033.75	573,028,274.87

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(不含公允价值变动收益)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收益,由于该基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信月盈安心理财A

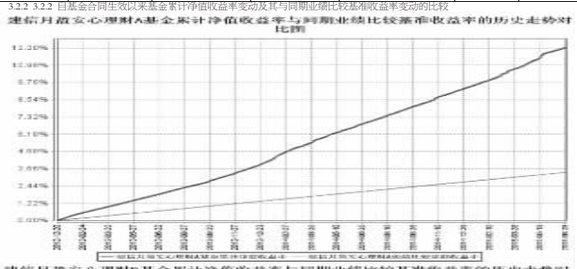
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.3368%	0.0137%	0.3366%	0.0000%	1.0002%	0.0137%

建信月盈安心理财B

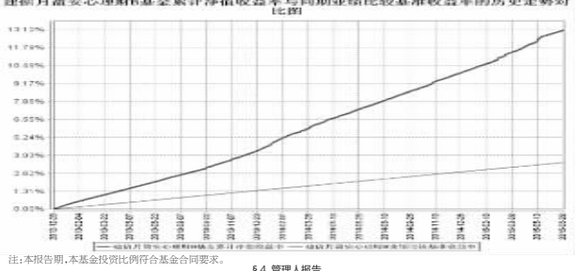
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.4103%	0.0137%	0.3366%	0.0000%	1.0737%	0.0137%

3.2.2 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信月盈安心理财A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



建信月盈安心理财B基金累计净值收益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,本基金投资比例符合基金合同要求。

§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		
陈建良	固定收益投资部总监助理、本基金的基金经理	2014年1月21日	-	8	2005年6月加入中国建设银行厦门分行,任客户经理;2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部,任债券交易员;2013年9月加入我公司投资管理部,任基金经理助理。2013年12月10日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信月盈安心理财基金基金经理;2014年6月17日起任建信嘉誉宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币基金的基金经理。
高珊	本基金的基金经理	2012年12月20日	-	9	硕士。2006年7月至2007年6月期间在中信建投证券公司工作,任交易员。2007年6月加入建信基金管理公司,历任初级交易员、交易员。2009年7月起任建信货币市场基金的基金经理助理。2012年8月28日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年1月29日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年9月17日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年12月20日起任建信货币市场基金基金经理。

4.2 管理人对投资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《建信月盈安心理财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

二季度,全球经济复苏进程持续分化。美国经济优于预期,年内加息概率仍较大;由于希腊对IMF的债务违约问题,欧元区复苏并不稳固,且与欧洲央行2%的通胀目标仍有相当大的差距;日本经济仍在较低水平徘徊;新兴经济体也呈现明显的分化格局,俄罗斯经济出现衰退,中国、巴西等新兴市场国家的经济增速下滑,印度经济增长势头不减。欧美日之间的经济不平衡增长,导致美元汇率在2015年二季度从回落,被动加固,伊朗核谈前景增长导致原油价格易上难下,全球通货紧缩压力有所缓解。新兴经济体整体面临的资本流动形势较为平稳,人民币汇率持稳。

国内方面,央行从4月份就开启货币宽松环境,几乎每个月都有降准或者降息,通过逆回购、正回购、PSL、MLF等工具的综合运用不断引导短期利率下行。财政投放及外汇占款也增加了货币供应量,共同支撑了短期资金面的稳定态势,并锁定了长期利率的估值上限。整个二季度收益率曲线呈现牛陡走势,主要因为短端受益于资金利率对货币宽松政策性高于长端利率,且反应速度也快于长端利率。

建信月盈理财债券型证券投资基金在本运作周期内坚持稳健的投资风格,保持了较为中性的久期和凸度的杠杆比例,并且有效的根据中期周期内理论排资金和配置债券,抓住了新股申购等流动性紧张时点配置高收益率的债券、逆回购和定期存款等资产,取得收益表现良好,规模实现正增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期月盈A净值收益率1.3368%,波动率0.0137%;月盈B净值收益率1.4103%,波动率0.0137%;业绩比较基准收益率0.3366%,波动率0.0000%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度部分经济指标略微好转,但经济回升的基础仍不牢固,深层次矛盾并没有完全解决,展望下半年经济增长仍有不行压力。在经济减速过程中实现结构调整和经济转型,需要继续推进积紧适度的货币政策,但同时需要继续深化经济体制改革,更多依赖差别化和定向化的结构性宽松政策。

下半年货币政策放松的空间相对有限,资金利率中枢有可能出现抬升。在信用债供给增加已成定局的情况下,2015年下半年的债券市场走势将取决于股市对债市的资金分流效应是否将逐渐减退。随着股市震荡不断加剧,配资、打新等资金短期内会选择观望或进入债市避险,预计股市对债市的分流高峰已经过去,下半年资产配置的天平有望逐渐向债市倾斜。届时长端收益率下降幅度料大于短端,前期陡峭化的收益率曲线有望平坦化。

建信月盈理财债券型证券投资基金仍将保持稳健的投资风格,以存款为主信用债投资为辅,在保证组合流动性的同时力争保证组合能够跟随市场的发展变化,为投资人获得合理的收益。

§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	固定收益投资	1,060,092,977.16	61.07
	其中:债券	1,060,092,977.16	61.07
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	150,000,345.00	8.64
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	503,807,138.10	29.03
4	其他资产	21,842,380.66	1.26
5	合计	1,735,742,840.92	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	22.30
	其中:买断式回购融资	0.00
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	405,899,126.25	30.55
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定,"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	97

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过150天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	32.65	30.55
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	26.35	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	8.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	43.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	18.05	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	128.98	30.55

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	摊余成本(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	160,080,661.95	12.05
	其中:政策性金融债	80,086,359.25	6.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	900,012,315.21	67.73
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,060,092,977.16	79.78
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011599259	15海亮SCP001	1,000,000	99,981,183.31	7.52
2	140443	14农发43	800,000	80,086,359.25	6.03
3	041462049	14金港CP001	500,000	50,222,127.62	3.78
4	011599287	15象屿SCP002	500,000	50,001,058.00	3.76
5	011499069	14宁城建SCP001	500,000	50,000,346.43	3.76
6	071502004	15国泰君安CP004	500,000	49,996,559.26	3.76
7	011537006	15中建材SCP006	500,000	49,994,226.69	3.76
8	011599179	15山水SCP001	500,000	49,990,866.69	3.76
9	011599275	15红狮SCP002	500,000	49,988,803.60	3.76
10	011599070	15联合水泥SCP002	500,000	49,979,868.64	3.76

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	51
报告期内偏离度的最高值	0.4942%
报告期内偏离度的最低值	0.1895%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3298%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提摊益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.8.2

本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 基金投资的前十名债券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	19,641,405.79
4	应收申购款	2,200,974.87
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	21,842,380.66

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
报告期期初基金份额总额	890,732,806.09	307,386,221.87
报告期期间基金总申购份额	678,959,394.02	360,238,845.70
减:报告期期间基金总赎回份额	813,924,166.36	94,596,792.70
报告期期末基金份额总额	755,768,033.75	573,028,274.87

注:上述总申购份额含红利再投资份额。

§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月盈安心理财债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信月盈安心理财债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信月盈安心理财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7月17日

建信中小盘先锋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:招商证券股份有限公司
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。

基金托管人招商证券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	建信中小盘先锋股票
基金主代码	000729
交易代码	000729
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月20日
报告期末基金份额总额	271,508,735.59份
投资目标	本基金主要投资于具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势,判断当前所处的经济周期,进而对未来做出科学预测。在此基础上,结合对流动性及资金流向的分析,综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。此外,本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控,适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	85%×中证500指数收益率+15%×中债综合全价(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金,混合型基金,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	招商证券股份有限公司

§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	49,260,496.73
2.本期利润	928,596.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0053
4.期末基金资产净值	482,291,078.76
5.期末基金份额净值	1.776

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。

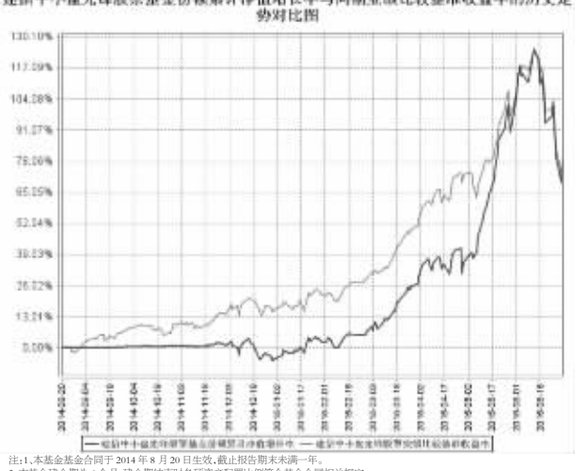
3.2 基金净值表现

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	40.17%	3.01%	19.71%	2.46%	20.46%	0.55%

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

建信中小盘先锋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:1.本基金基金合同于2014年8月20日生效,截止报告期末未满一年。

2.本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§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		
顾中汉	权益投资部副总监,本基金的基金经理	2014年8月20日	-	11	硕士,曾任北京市房管局科员,2004年4月起就职于易方达基金管理公司,历任交易员、研究员、基金经理助理、投资经理,2010年1月至2011年5月任社保109组合的投资经理。顾中汉于2011年6月加入本公司,2011年10月11日起任建信恒久价值股票型证券投资基金基金经理;2011年12月13日至2013年5月3日任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理;2014年8月20日起任建信中小盘先锋股票基金的基金经理;2015年5月22日起任建信核心精选股票基金经理。

4.2 管理人对投资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《建信中小盘先锋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

市场对2015年宏观经济继续有下行压力,货币政策将持续宽松,政府态度上希望股市上涨达成共识,增量资金不断入场,追逐符合转型方向的新兴产业。但资本市场加强监管,新股发行节奏加快影响的家和以及股市去杠杆导致季末股市大幅波动,风险显现。

本基金采取自下而上精选个股的投资策略,重点配置企业盈利增长较快、估值安全边际相对较高的个股配置,TMT、医药、化工、机械等业绩较为确定的板块,获得一定的回报。

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40.17%,波动率3.01%,业绩比较基准收益率19.71%,波动率2.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,本基金认为经济增速继续放缓,企业盈利仍旧面临很大压力,稳增长、促改革将成为主要政策方向,防止系统性金融风险将被提高到重要地位,股市将进入去杠杆的过程,投资者信心受到重创,较难恢复。

三季度需要关注几个对股市产生重大影响的因素:股市快速大幅下跌导致杠杆资金连锁反应,可能带来股灾的风险;防范股市系统性风险政策可能会引起市场短期内大幅反弹。总体上看,相当部分股票估值仍然较高,股市去杠杆过程也将是股市调整过程。

本基金将延续一贯的风格,追求价值与高质量的成长,努力寻找投资机会,尽力为持有人获得良好的回报。

§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	398,129,883.87	67.70
	其中:股票	398,129,883.87	67.70
2	固定收益投资	549,271.80	0.09
	其中:债券	549,271.80	0.09
	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	153,376,689.97	26.08
7	其他资产	36,018,769.69	6.12
8	合计	588,074,615.33	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	22,994,432.16	4.77
B	采矿业	-	-
C	制造业	278,971,572.76	57.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,720,866.00	6.16
E	建筑业	10,112,388.63	2.10
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	28,382,493.00	5.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	18,144,895.68	3.76
N	水利、环境和公共设施管理业	9,803,235.64	2.03
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	398,129,883.87	82.55

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	600651	飞乐音响	1,901,010	39,103,775.70	8.11
2	600886	国投电力	2,101,900	29,720,866.00	6.16
3	600050	中国联通	3,872,100	28,382,493.00	5.88
4	000858	五粮液	734,220	23,274,774.00	4.83
5	002236	大华股份	606,294	19,352,904.48	4.01
6	600594	益佰制药	326,769	18,995,081.97	3.94
7	600271	航天信息	276,678	17,903,833.38	3.71
8	002250	联化科技	761,383	17,054,979.20	3.54
9	300332	天壕节能	662,066	16,684,063.20	3.46
10	000800	一汽轿车	591,179	14,708,533.52	3.05

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	549,271.80	0.11
8	其他	-	-
9	合计	549,271.80	0.11

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	3,780	549,271.80	0.11

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

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	860,325.70
2	应收证券清算款	30,499,225.01
3	应收股利	-
4	应收利息	65,957.65
5	应收申购款	4,593,261.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,018,769.69

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	600886	国投电力	29,720,866.00	6.16	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	93,391,592.54
报告期期间基金总申购份额	532,118,395.51
减:报告期期间基金总赎回份额	354,001,252.46
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	271,508,735.59

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中小盘先锋股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信中小盘先锋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

建信中证500指数增强型证券投资基金

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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	建信中证500指数增强
基金主代码	000478
交易代码	000478
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月27日
报告期末基金份额总额	102,697,484.72份
投资目标	本基金为股票指数增强基金,在对标的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,力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略,以中证500指数作为基金投资组合的标的指数,结合深入的宏观面、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,以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。 在资产配置策略方面,本基金以追求基金资产收益长期增长为目标,根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合,并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段,严格将跟踪误差控制在规定范围内,控制与标的指数主动偏离的风险。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标,同时根据需要进行积极操作,以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值,控制组合风险,达到在有效跟踪标的指数的基础上,力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税前)。
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	中信银行股份有限公司

§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	69,071,002.33
2.本期利润	29,196,462.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.2940
4.期末基金资产净值	247,818,495.31
5.期末基金份额净值	2.4131

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