建信社会责任股票型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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:２０１３年１月２１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2013年1月17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2012年10月1日起至12月31日止。

§２ 基金产品概况

基金简称	建信社会责任股票
基金主代码	530019
交易代码	530019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月14日
报告期末基金份额总额	138,043,923.76份
投资目标	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	采用自上而下的资产配置和自下而上的股票选择相结合的投资策略,本基金在长期价值投资理念的基础上,坚持社会责任投资,重点考察企业社会责任的履行,立足企业基本面,努力实现本基金的投资目标。
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,一般情况下其风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金,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	中国农业银行股份有限公司

§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(2012年10月1日–2012年12月31日)	2012年8月14日–2012年09月30日
1.本期已实现收益	–3,261,307.99	1,465,676.19
2.本期利润	4,519,525.65	1,465,676.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0225	0.0019
4.期末基金资产净值	143,495,933.07	263,162,841.35
5.期末基金份额净值	1.039	1.002

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。

2、上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、本基金2012年08月14日成立,成立当期未满2个月。

3.2基金净值表现

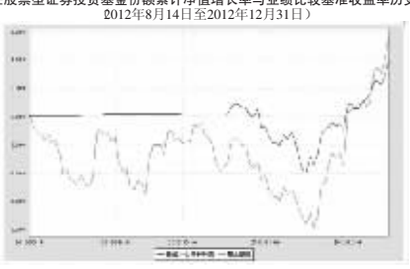
3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.69%	0.54%	7.68%	0.96%	–3.99%	–0.42%

3.2.2日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

建信社会责任股票型证券投资基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

2012年8月14日至2012年12月31日）



注:本基金于2012年8月14日成立,仍处于建仓期。

§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		
许杰	本基金基金经理	2012–8–14	–	10	硕士。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员,2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司,历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职,2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合型证券投资基金基金经理,2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票型证券投资基金基金经理,2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金经理。2011年10月加入我公司,2012年3月21日起任建信恒稳价值混合基金基金经理。
姚锦	本基金基金经理	2012–8–14	–	8	博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师,2004年4月起就职于天弘基金管理公司,历任研究员、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日任天弘永利债券基金基金经理;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基金基金经理。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《建信社会责任股票型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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

资产配置方面:股票配置的比例偏低。由于过分关注年底流动性紧张对股票市场的负面影响,而忽略了经济好转对投资者预期产生的变化。

在行业配置和股票选择方面:重点持有了基本面向好或发生了向上的拐点,而同时有估值安全边际的公司,例如汽车、家电、电力和铁路相关的龙头公司。这些公司基本上都取得了较好的收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率3.69%,波动率0.54%,业绩比较基准收益率7.68%,波动率0.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计2013年股票市场将取得一定程度的上涨。从国家政策的角度来看,积极的财政政策和稳健的货币政策（社会融资总量合理增长）有利于股市。海外经济总体上处于复苏阶段,美国将持续其复苏进程,欧洲将在底部徘徊,有可能逐渐走出底部。中国经济将在2013年实现弱复苏或温和复苏。货币供给正常增长,但预计实体经济对资金的需求将比较旺盛,因此2013年股市流动性宽松,但幅度有限。

2012年,上市公司盈利增长稀缺,但总体流动性不差（社会融资总量大幅上升,实体经济需求不足),因此成长性公司享有很高的估值溢价。2013年,上市公司盈利增长普遍,成长性溢价水平将降低。盈利上升成为推动股价上升的最大动力,原来高成长公司的估值溢价将降低。个股可能分化严重:盈利恢复高增长而原来估值低的股票有望实现盈利和估值双推动带来的股价上升（扭转型股票实现的超额收益可能最大),估值高的股票如果成长不达预期将出现股价向下的回归。

本基金2013年将保持偏积极的股票仓位,重点配置估值偏低,而有技术或渠道等壁垒,竞争结构良好的细分行业中的优势企业。

§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	108,468,127.40	57.83
	其中:股票	108,468,127.40	57.83
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	79,060,346.77	42.15
6	其他各项资产	28,751.87	0.02
7	合计	187,557,226.04	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	采掘业	–	–
C	制造业	57,583,510.13	40.13
C0	食品、饮料	–	–
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,441,444.26	9.37
C5	电子	8,556,800.00	5.96
C6	金属、非金属	–	–
C7	机械、设备、仪表	35,585,265.87	24.80
C8	医药、生物制品	–	–
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,564,125.57	8.06
E	建筑业	6,627,200.00	4.62
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	2,046,486.00	1.43
H	批发和零售贸易	5,026,817.10	3.50
I	金融、保险业	15,824,148.60	11.03
J	房地产业	7,845,840.00	5.47
K	社会服务业	1,950,000.00	1.36
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	108,468,127.40	75.59

注:以上行业分类以2012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	601299	中国北车	1,469,951	6,629,479.01	4.62
2	601390	中国中铁	2,180,000	6,627,200.00	4.62
3	600104	上汽集团	366,988	6,473,668.32	4.51
4	002055	得润电子	1,010,000	5,797,400.00	4.04
5	600143	金发科技	1,069,934	5,766,944.26	4.02
6	002595	豪迈科技	248,000	5,577,520.00	3.89
7	601318	中国平安	116,000	5,253,640.00	3.66
8	601628	中国人寿	233,949	5,006,508.60	3.49
9	002073	软控股份	640,000	4,838,400.00	3.37
10	000543	皖能电力	629,905	4,818,773.25	3.36

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8投资组合报告附注

5.8.1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。

5.8.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.8.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	18,604.09
5	应收申购款	10,147.78
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	28,751.87

5.8.4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。

5.8.5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不存在流通受限情况。

§６ 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	262,670,242.44
本报告期基金总申购份额	11,503,358.15
减:本报告期基金总赎回份额	136,129,676.83
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	138,043,923.76

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 备查文件目录

7.1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、《建信社会责任股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信社会责任股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信社会责任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。

7.2存放地点:

基金管理人或基金托管人处。

7.3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
二〇一三年一月二十一日

建信优势动力股票型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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:２０１３年１月２１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2013年1月17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2012年10月1日起至12月31日止。

§２ 基金产品概况

基金简称	建信优势动力封闭
基金主代码	150003
交易代码	150003
基金运作方式	契约型封闭式,封闭期为5年;基金合同生效满1年后,若基金折价率连续60个交易日超过15%，则基金管理人将召集基金份额持有人大会，审议基金转换运作方式为上市开放式基金(LOF)的事项。
基金合同生效日	2008年3月19日
报告期末基金份额总额	4,642,655,005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,而且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	90%×沪深300指数收益率+10%×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(2012年10月1日–2012年12月31日)
1.本期已实现收益	–86,796,161.32
2.本期利润	337,037,742.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0726
4.期末基金资产净值	4,234,791,103.78
5.期末基金份额净值	0.912

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。

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

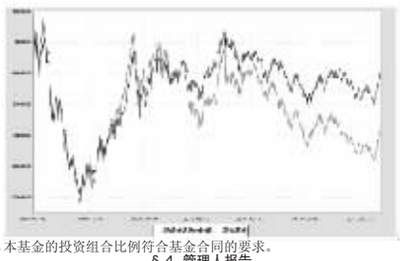
3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.57%	0.91%	9.09%	1.15%	–0.52%	–0.24%

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

建信优势动力股票型证券投资基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

2008年3月19日至2012年12月31日）



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		
万志勇先生	投资管理部副总监,本基金基金经理	2011–7–11	–	11	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（原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。2010年11月17日起任建信内生动力股票基金基金经理;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。
姜锋先生	本基金基金经理	2011–7–11	–	5	2007年7月加入本公司,任研究员。2011年7月11日起任建信优势动力股票型证券投资基金的基金经理。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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

2012年4季度先抑后扬,沪深300指数上涨10%。行业表现上,金融、地产等周期性行业大幅上涨,传统的消费板块涨幅较小。

报告期内,本基金减持了业绩不佳的股票,重点配置了基本面良好与估值具备优势的银行和地产股。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率8.57%,波动率0.91%,业绩比较基准收益率9.09%,波动率1.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,美国经济预计随着财政悬崖问题的解决仍将保持回暖态势,欧洲经济有望逐步摆脱欧债危机的影响,国内经济在一系列微调政策的背景下呈现回升迹象。

本基金在2013年1季度将继续采取相对均衡的配置策略,积极寻找业绩可预见性强的消费股、成长性与估值匹配的成长股和基本面持续改善的周期股,尽力为基金持有人创造回报。

§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	3,010,692,202.05	70.93
	其中:股票	3,010,692,202.05	70.93
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	1,215,243,361.41	28.63
6	其他各项资产	18,916,982.88	0.45
7	合计	4,244,852,546.34	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	采掘业	43,153,960.02	1.02
C	制造业	1,160,522,212.28	27.40
C0	食品、饮料	267,442,649.69	6.32
C1	纺织、服装、皮毛	56,822,324.16	1.34
C2	木材、家具	8,184,475.00	0.19
C3	造纸、印刷	3,276,527.45	0.08
C4	石油、化学、塑胶、塑料	69,322,109.16	1.64
C5	电子	28,657,531.74	0.68
C6	金属、非金属	41,752,737.45	0.99
C7	机械、设备、仪表	504,544,346.27	11.91
C8	医药、生物制品	180,519,511.36	4.26
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	88,393,249.19	2.09
E	建筑业	77,930,450.64	1.84
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	78,361,468.88	1.85
H	批发和零售贸易	247,807,118.65	5.85
I	金融、保险业	534,426,143.77	12.62
J	房地产业	600,474,492.42	14.18
K	社会服务业	140,561,084.95	3.32
L	传播与文化产业	39,062,021.25	0.92
M	综合类	–	–
	合计	3,010,692,202.05	71.09

注:以上行业分类以2012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

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	600016	民生银行	30,361,704	238,642,993.44	5.64
2	600048	保利地产	14,260,420	193,941,712.00	4.58
3	600519	贵州茅台	831,784	173,859,491.68	4.11
4	601318	中国平安	2,759,543	124,979,702.47	2.95
5	000651	格力电器	4,619,035	117,785,392.50	2.78
6	000581	威孚高科	3,636,457	116,002,978.30	2.74
7	000625	长安汽车	17,397,824	115,695,529.60	2.73
8	300070	碧水源	2,658,982	106,625,178.20	2.52
9	601166	兴业银行	6,191,024	103,328,190.56	2.44
10	000002	万 科A	9,866,996	99,853,999.52	2.36

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8投资组合报告附注

5.8.1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。

5.8.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.8.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,250,000.00
2	应收证券清算款	17,064,387.48
3	应收股利	–
4	应收利息	602,595.40
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	18,916,982.88

5.8.4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可转换债券。

5.8.5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	000002	万 科A	99,853,999.52	2.36	筹划重大事项

§６ 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位:份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	10,003,950
报告期期间买入总份额	–
报告期期间卖出总份额	–
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	10,003,950
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	0.22

§７ 备查文件目录

7.1备查文件目录

1、中国证监会批准设立优势动力股票型证券投资基金的文件;

2、《建信优势动力股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信优势动力股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信优势动力股票型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批准文件和营业执照;

6、基金托管人业务资格批准文件和营业执照;

7、本报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

7.2存放地点

基金管理人或基金托管人处。

7.3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
二〇一三年一月二十一日

建信深证100指数增强型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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:２０１３年１月２１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2013年1月17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2012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	619,829,630.72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(2012年10月1日–2012年12月31日)
1.本期已实现收益	–28,299,329.86
2.本期利润	25,788,251.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0413
4.期末基金资产净值	555,960,346.27
5.期末基金份额净值	0.8970

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

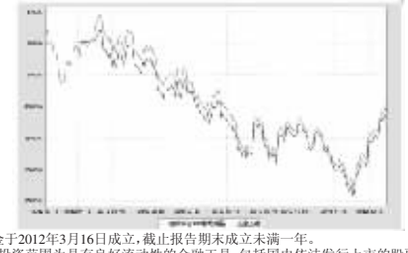
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.01%	1.31%	4.94%	1.28%	0.07%	0.03%

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

建信深证１００指数增强型证券投资基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

2012年3月16日至2012年12月31日）



注:1、本基金于2012年3月16日成立,截止报告期末成立未满一年。

2、本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。股票资产占基金资产的比例不低于90%,其中,投资于深证100指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于80%。现金或到期一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

3、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		
梁洪昀先生	投资管理部执行总监,本基金基金经理	2012–3–16	–	10	注册金融分析师(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月加入本公司，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。2009年11月5日起任建信沪深300指数基金的基金经理、2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任ETF及联接基金基金经理;2011年9月8日起任深证基本面60ETF及联接基金基金经理。

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《建信深证100指数增强型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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,进行指数增强和风险管理,量化增强策略总体上获得了预期中的表现。在报告期间,本基金超额收益较为稳健,同时较好地控制了跟踪误差。本基金在报告期内遇到一些额度较大的申购赎回,这在一定程度上增加了基金的交易成本。在报告期末,本基金积极应对指数成份股的调整,较好地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

本报告期本基金净值增长率5.01%,波动率1.31%,业绩比较基准收益率4.94%,波动率1.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在四季度初期,市场延续三季度的颓势继续下跌并创出新低,但到12月份,在银行股等权重股的带领下,指数走出了一波明显的反弹行情,市场情绪也得到了一定程度的修复。预计一季度初期,较为积极的市场情绪仍会得以维持。

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,并尽量控制超额收益回撤风险。

§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	525,764,401.37	93.53
	其中:股票	525,764,401.37	93.53
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生