建信健康民生混合型证券投资基金

【2015】第一季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4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。

基金托管人光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信健康民生混合
基金主代码	000547
交易代码	000547
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月21日
报告期末基金份额总额	69,834,685.51份
投资目标	本基金主要投资于有利于提升居民健康水平和促进国计民生的行业及公司,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	本基金的股票投资包含健康和民生这两大主题,本基金将精选有利于提升居民健康水平和促进国计民生的公司进行投资。 在债券组合的构造和调整上,本基金综合运用久期管理、期限配置策略、类属配置管理、套利策略等组合管理手段进行日常管理,获取稳健增值的机会。
业绩比较基准	70%×沪深300指数收益率+30%×中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,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	中国光大银行股份有限公司

§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1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	18,151,457.92
2.本期利润	22,452,024.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.2668
4.期末基金资产净值	105,655,645.51
5.期末基金份额净值	1.513

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。

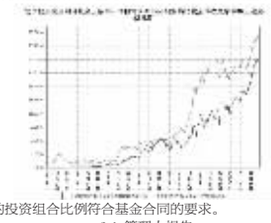
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	22.41%	1.47%	10.22%	1.28%	12.19%	0.19%

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		
娄锋	本基金的基金经理	2014年3月21日	-	7	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(LOF),娄锋继续担任该基金基金经理;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。

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《建信健康民生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1季度市场大幅上涨,代表经济转型方向的TMT领涨市场。经济方面,国内经济继续下行,美国经济一枝独秀;政策方面,美国开始讨论加息时点,国内继续推行宽松的货币政策;上市公司方面,2014年年报总体业绩平淡。

本基金1季度基于对政策、经济基本面和企业盈利的判断,结合市场的估值水平,在低估值蓝筹股和成长股之间进行了均衡配置,积极参与了主题投资。

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22.41%,波动率1.47%,业绩比较基准收益率10.22%,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

展望未来,美国经济保持回升态势,QE退出,美国开启加息周期;欧洲经济受部分国际信用危机影响复苏出现波动;国内经济在2014年四季度以来一系列货币和行业政策的刺激下预计将逐步企稳,"一带一路"政策有望给中国经济带来活力。

本基金在2015年2季度将采取相对均衡的配置策略,积极寻找受益于政策放松的低估值蓝筹行业和公司;本基金将继续在医药、环保、TMT和消费四大行业中自下而上寻找业绩增速与估值相匹配的优质成长股投资,灵活参与市场主题投资。

§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	90,269,621.35	81.68
	其中:股票	90,269,621.35	81.68
2	固定收益投资	574,856.52	0.52
	其中:债券	574,856.52	0.52
	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	18,960,449.93	17.16
7	其他资产	707,752.34	0.64
8	合计	110,512,680.14	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	3,380,252.00	3.20
B	采矿业	5,330,826.00	5.05
C	制造业	49,841,332.55	47.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,271,982.00	2.15
F	批发和零售业	9,507,019.00	9.00
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	5,720,609.80	5.41
J	金融业	5,982,732.00	5.66
K	房地产业	5,383,200.00	5.10
L	租赁和商务服务业	1,077,588.00	1.02
M	科学研究和技术服务业	1,774,080.00	1.68
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	90,269,621.35	85.44

注:以上行业分类以2015年3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	600271	航天信息	121,900	6,333,924.00	5.99
2	000024	招商地产	120,000	3,952,800.00	3.74
3	600651	飞乐音响	309,300	3,495,090.00	3.31
4	000998	隆平高科	150,100	3,380,252.00	3.20
5	601318	中国平安	40,000	3,129,600.00	2.96
6	600693	东百集团	240,800	3,079,832.00	2.91
7	601988	中国银行	651,400	2,853,132.00	2.70
8	600188	兖州煤业	183,600	2,818,260.00	2.67
9	601058	赛轮金宇	140,300	2,813,015.00	2.66
10	002465	海格通信	100,000	2,801,000.00	2.65

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	574,856.52	0.54
8	其他	-	-
9	合计	574,856.52	0.54

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	128008	齐峰转债	4,011	574,856.52	0.54

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

本基金报告期内未投资于国债期货。

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	203,725.91
2	应收证券清算款	246,563.29
3	应收股利	-
4	应收利息	6,748.92
5	应收申购款	250,714.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	707,752.34

5.11.4 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	128008	齐峰转债	574,856.52	0.54

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	600271	航天信息	6,333,924.00	5.99	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	99,742,671.51
报告期期间基金总申购份额	12,644,480.42
减:报告期期间基金总赎回份额	42,552,466.42
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	69,834,685.51

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合同规定的投资范围。

7.2 基金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健康民生混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信健康民生混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信健康民生混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信健康民生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4月21日

建信深证100指数增强型证券投资基金

【2015】第一季度报告

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:2015年4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2015年4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2015年1月1日起至3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	102,228,441.99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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	27,413,767.65
2.本期利润	30,354,747.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.2467
4.期末基金资产净值	151,349,378.66
5.期末基金份额净值	1.4805

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。

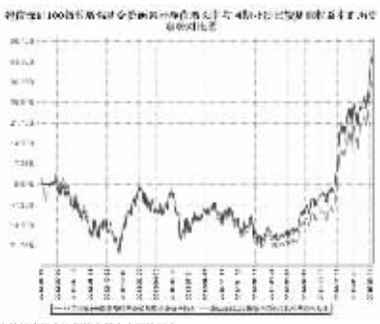
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	21.81%	1.54%	22.27%	1.55%	-0.46%	-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



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	投资管理部总监、本基金的基金经理	2012年3月16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9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,量化增强策略表现比较稳定,报告期内,基金超额收益的积累过程基本保持平稳。

在报告期内,本基金所持仓的个别股票经历了长期停牌期间的估值调整以及复牌后重新按市价估值的过程,导致基金组合的跟踪误差有所放大。本基金管理人通过模型及组合的适当调整,尽力克服了不利影响。

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21.81%,波动率1.54%,业绩比较基准收益率22.27%,波动率1.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年一季度股票市场继续表现强势,投资者情绪高涨,标的指数不断上涨,吸引了场外资金持续涌入。展望2015年二季度,预计指数仍有进一步冲高的可能,同时波动率会有所放大。市场将迎来业绩密集披露期,上市公司业绩对股票市场表现的影响需要重点关注。

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	141,646,157.94	89.81
	其中:股票	141,646,157.94	89.81
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	14,022,849.34	8.89
7	其他资产	2,046,988.22	1.30
8	合计	157,715,995.50	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	611,442.00	0.40
C	制造业	63,792,741.67	42.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	778,734.14	0.51
F	批发和零售业	4,540,287.65	3.00
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	6,121,314.55	4.04
J	金融业	20,235,397.80	13.37
K	房地产业	10,482,122.60	6.93
L	租赁和商务服务业	1,501,852.38	0.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,524,418.74	2.33
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	3,888,948.56	2.57
S	综合	490,980.00	0.32
	合计	115,968,240.09	76.62

注:以上行业分类以2015年3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	452,344.50	0.30
B	采掘业	-	-
C	制造业	14,756,458.57	9.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,585,207.95	1.05
E	建筑业	445,809.00	0.29
F	批发和零售业	956,077.00	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	949,498.00	0.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,218,162.90	0.80
J	金融业	3,021,754.40	2.00
K	房地产业	1,452,385.50	0.96
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	3,790.00	0.00
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	543,798.03	0.36
S	综合	292,632.00	0.19
	合计	25,677,917.85	16.97

注:以上行业分类以2015年3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	585,760	8,095,203.20	5.35
2	000776	广发证券	259,370	7,236,423.00	4.78
3	000625	长安汽车	227,397	5,250,596.73	3.47
4	000333	美的集团	155,158	5,112,456.10	3.38
5	000651	格力电器	114,473	5,011,627.94	3.31
6	300027	华谊兄弟	124,327	3,888,948.56	2.57
7	002415	海康威视	112,035	3,439,474.50	2.27
8	000001	平安银行	210,264	3,311,658.00	2.19
9	000166	申万宏源	190,818	3,293,518.68	2.18
10	002024	苏宁云商	251,125	3,282,203.75	2.17

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	300219	鸿利光电	127,108	2,459,539.80	1.63
2	300045	华力创通	71,300	1,962,176.00	1.30
3	000671	阳 光 城	65,625	1,316,437.50	0.87
4	600674	川投能源	57,715	1,300,318.95	0.86
5	601099	太平洋	90,160	1,246,912.80	0.82

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

本基金本报告期内未投资于国债期货。

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	89,915.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,711.99
5	应收申购款	1,951,360.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,046,988.22

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

5.11.5.1 报告期末指数投资的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	000625	长安汽车	5,250,596.73	3.47	重大事项

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

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	000671	阳 光 城	1,316,437.50	0.87	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	134,362,927.02
报告期期间基金总申购份额	49,091,122.94
减:报告期期间基金总赎回份额	81,225,607.97
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	102,228,441.99

注:上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,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4月21日

建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金

【2015】第一季度报告

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:2015年4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2015年4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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信央视50
场内简称	央视50
基金主代码	165312
交易代码	165312
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月28日
报告期末基金份额总额	507,709,586.45份
投资目标	本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化,实现对央视财经50指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数,并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金对标的指数的跟踪目标:力争使得日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准:95%×央视50价格指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,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,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。 从本基金所分离的两类基金份额来看,建信央视50A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额;建信央视50B份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险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	交通银行股份有限公司

下属分级基金简称	建信央视50	建信央视50A	建信央视50B
下属分级基金交易代码	165312	150123	150124
下属分级基金报告期末基金份额总额	63,147,736.45份	222,280,925.00份	222,280,925.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,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,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。	建信央视50A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额。	建信央视50B份额将表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险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1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	54,333,900.95
2.本期利润	98,696,952.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.1773
4.期末基金资产净值	686,661,677.36
5.期末基金份额净值	1.3525

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	14.59%	1.65%	14.82%	1.63%	-0.23%	0.02%

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