

建信收益增强债券型证券投资基金

2015 第三季度报告



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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李青	基金经理	2009年02月2日		10	硕士，2002年7月进入中国建设银行，从事基金托管管理，任主任科员，2005年9月进入建信基金管理有限责任公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、投资管理部副总监、固定收益部副总监，2007年11月3日至2012年2月17日任建信货币市场基金基金经理，2008年12月1日起兼任建信增强收益债券型证券投资基金基金经理，2011年6月10日起兼任建信信用增利债券型证券投资基金基金经理。

注：1. 本基金于2009年2月2日成立，基金经理李青自2009年2月2日起担任本基金基金经理。

2. 基金经理李青在报告期内未发生任何违法违规事项，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

3. 基金经理李青在报告期内未发生任何利益冲突行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

4. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

5. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反基金合同约定的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

6. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反中国证监会规定的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

7. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反证券交易所规则的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

8. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反基金业协会规定的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

9. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

10. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

11. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

12. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

13. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

14. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

15. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

16. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

17. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

18. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

19. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

20. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

21. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

22. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

23. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

24. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

25. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

26. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

27. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

28. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

29. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

30. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

31. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

32. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

33. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

34. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

35. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

36. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

37. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

38. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

39. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

40. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

41. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

42. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

43. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

44. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

45. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

46. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

47. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

48. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

49. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

50. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

51. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

52. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

53. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

54. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

55. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

56. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

57. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

58. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

59. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

60. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

61. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

62. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

63. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

64. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

65. 基金经理李青在报告期内未发生任何违反其他相关法律法规的行为，也未发生任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，宏观经济仍将处于低速增长阶段，财政政策将继续发力，宽松的货币政策将难以改变，对债券市场而言，我们认为风险偏好下降带来的资产配置是个中期过程，这个过程和基本面因素有利于债市，但央行应对汇率政策变化对国内短期货币市场带来的冲击以及四季度末物价因素的超预期形成对债券市场尤其是长期债券市场较为重要的制约因素。股票市场上，我们仍然认为在震荡下行背景下，相对价值投资在选股和仓位管理上仍具有较好的投资机会，投资者主题性机会也值得关注。

本基金将在严控风险的前提下，加强组合投资的灵活性，权益市场方面，采取相对防御与均衡的投资策略，精选个股，力求为持有人取得较好的投资收益。

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	181,791,664.20	1.39
其中：股票	181,791,664.20	1.39	
2	固定收益投资	1,287,191,316.80	96.43
其中：债券	1,287,191,316.80	96.43	
3	货币资金	—	—
4	资产支持证券	—	—
5	衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
7	其他资产	—	—
8	合计	1,468,953,021.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	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	1,468,953,021.00	0.46
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	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	金融业	—	—
J	房地产业	—	—
K	租赁和商务服务业	—	—
L	科学研究和技术服务业	—	—
M	水利、环境和公共设施管理业	—	—
N	卫生和社会工作	—	—
O	教育、文化和体育业	—	—
P	其他	—	—
合计		181,791,664.20	1.39

注：以上行业分类以2015年9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10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	600064	黄山旅游	465,700	8,796,782.00	0.63
2	300450	先施股份	72,800	5,656,560.00	0.46
3	601888	中国国旅	83,366	4,368,322.00	0.36

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	国债	47,019,700.00	3.72
2	央行票据	—	—
3	金融债券	320,071,280.00	26.41
4	企业债券	320,071,280.00	26.41
5	企业短期融资券	628,035,013.80	49.46
6	中期票据	—	—
7	资产支持证券	—	—
8	其他	—	—
合计		1,287,191,316.80	101.89

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5名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	11150182	15国债02	600,000	49,150,071.47	0.61
2	11150525	15国债05	400,000	39,307,081.46	0.36
3	01150828	15国开债001	300,000	29,999,020.00	0.29
4	01150829	15国开债002	300,000	29,999,438.59	0.29
5	01150807	15国开债003	300,000	29,991,110.66	0.29
6	11151787	15国债07	300,000	28,502,548.77	0.37
7	11150511	15国债05	200,000	20,082,253.18	0.26
8	01150800	15国开债004	200,000	19,999,280.32	0.27
9	01150513	15国债05	200,000	19,886,602.37	0.27
10	041509002	15国债02	200,000	19,984,326.45	0.27

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10名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	11150182	15国债02	600,000	49,150,071.47	0.61
2	11150525	15国债05	400,000	39,307,081.46	0.36
3	01150828	15国开债001	300,000	29,999,020.00	0.29
4	01150829	15国开债002	300,000	29,999,438.59	0.29
5	01150807	15国开债003	300,000	29,991,110.66	0.29
6	11151787	15国债07	300,000	28,502,548.77	0.37
7	11150511	15国债05	200,000	20,082,253.18	0.26
8	01150800	15国开债004	200,000	19,999,280.32	0.27
9	01150513	15国债05	200,000	19,886,602.37	0.27
10	041509002	15国债02	200,000	19,984,326.45	0.27

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10名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.2 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.3 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.4 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.5 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.6 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.7 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.8 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.9 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.10 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.11 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.12 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.13 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.14 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.15 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.16 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.17 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.18 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.19 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.20 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.21 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.22 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.23 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.24 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.25 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.26 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.27 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.28 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.29 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

5.8.30 报告期内基金投资的前十名股票中，除黄山旅游外，其他股票均在证监会规定的停牌期间内。

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	111253	15国债01	780,000	80,160,000.00	6.36
2	150205	15国债06	700,000	70,380,000.00	5.57
3	150210	15国债10	600,000	62,424,000.00	4.94
4	150405	15国开05	600,000	60,714,000.00	4.81
5	10155611	15国债06	500,000	52,610,000.00	4.16

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10名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未有资产支持证券。

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5名贵金属投资明细

本基金本报告期末未有贵金属。

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5名权证投资明细

本基金本报告期末未有权证。

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 本报告期本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.3 本报告期股指期货投资评价

5.9.4 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.5 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.6 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.7 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.8 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.9 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细