建信转债增强债券型证券投资基金

2015 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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2016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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信转债增强债券
基金主代码	530020
交易代码	530020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月29日
报告期末基金份额总额	107,681,349.18份
投资目标	通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置,并充分利用可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,实施对大类资产的配置,在控制风险并保持良好流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的超额收益。
投资策略	本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置,根据各项重要的经济指标分析宏观经济及展变动趋势,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,综合股市估值水平和债市收益率情况及风险分析,进行灵活的大类资产配置进而在固定收益类资产,权益类资产以及货币类资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。
业绩比较基准	60%×天相可转债指数收益率+30%×中国债券总指数收益率+10%×沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,债券型基金的风险高于货币市场基金,低于混合型和股票型基金,属于中低风险收益的品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信转债增强债券A / 建信转债增强债券C
下属分级基金的交易代码	530020 / 531020
报告期末下属分级基金的份额总额	44,456,274.23份 / 63,225,074.95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10月1日 - 2015年12月31日)	
	建信转债增强债券A	建信转债增强债券C
1. 本期已实现收益	1,830,210.30	2,425,664.29
2. 本期利润	3,176,387.02	4,319,926.21
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0675	0.0645
4. 期末基金资产净值	112,678,369.61	158,133,244.91
5. 期末基金份额净值	2.535	2.501

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

建信转债增强债券A

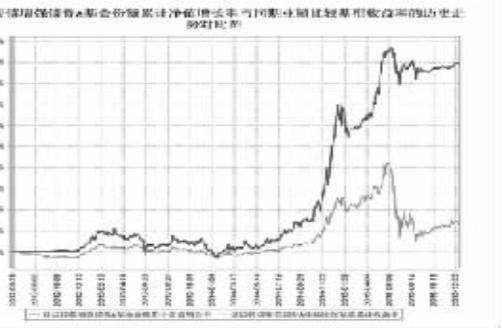
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.71%	0.20%	5.83%	0.84%	-3.12%	-0.64%

建信转债增强债券C

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	2.63%	0.20%	5.83%	0.84%	-3.20%	-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

建信转债增强债券A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: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		
彭云峰	本基金的基金经理	2012年5月29日	-	10	硕士,曾任中经网数据有限公司财经分析师、国都证券有限责任公司债券研究员兼宏观研究员,2006年5月起就职于鹏华基金管理公司,历任债券研究员、社保组合投资经理、债券基金经理等职,2010年5月31日至2011年6月14日任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理,彭云峰于2011年6月加入本公司,2011年11月30日至2013年5月3日任建信保本混合型证券投资基金基金经理;2012年2月17日至2014年1月21日任建信货币市场基金基金经理;2012年5月29日起任建信转债增强债券型证券投资基金基金经理;2013年7月26日起任建信双债增强债券型证券投资基金基金经理;2013年11月5日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金经理;2015年5月26日起任建信新经济灵活配置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

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《建信转债增强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, 本基金管理人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%的情况有1次,原因是投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

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年四季度,中国经济增速相对平稳,10-11月消费增速和工业增加值增速小幅回升,投资增速和出口增速有所回落,通胀水平保持在较低水平。为降低社会融资成本,稳定经济增速,央行于2015年10月24日降低存贷款基准利率和存款准备金率。12月中下旬召开的中央经济工作会议决定2016年继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策,推进供给侧结构性改革,主要抓好去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板五大任务。

四季度债券市场持续上涨,只在11月上旬出现小幅调整,各期限、各品种收益率都明显下降。四季度债券收益率曲线呈现平坦化下行态势,10年期国债收益率下行超过40bp,10年期国开债收益率下行超过50bp, 短期国债收益率下行幅度较小,不到10bp;信用利差继续维持低位,期限利差较三季度有所收窄。四季度股票市场表现较好,以创业板为代表的成长类股票涨幅较大。由于可转债品种较少,且估值偏高,四季度可转债总体涨幅不大。

四季度本基金将可转债投资比例保持在相对较低的水平,股票投资比例则相对较高。本基金可转债投资以08江铜债为主,阶段性投资估值相对合理的可转债品种,积极投资新发可转债。本基金股票投资以低估值蓝筹股为主,兼顾成长性较好的股票,并根据市场情况灵活调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期转债增强A净值增长率2.71%,波动率0.2%,转债增强C净值增长率2.63%,波动率0.2%;业绩比较基准收益率5.83%,波动率0.84%。

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2016年一季度,我们认为中国经济增速可能会小幅回落,通胀仍将处于较低水平。由于目前存贷款基准利率已经降至较低水平,而且美联储逐步加息背景下人民币相对美元贬值压力加大,预计货币政策大幅放松的可能性不大,主要放松方式可能是小幅降低存款准备金率,以及通过公开市场操作等方式投放流动性。财政政策或会更加积极,对稳增长起更大作用。

基于以上判断,我们对2016年一季度债券市场相对乐观。由于供给侧改革可能加大对产能过剩行业的调整,预计相关行业信用风险将上升。我们对利率债和高等级信用债相对看好,对中低等级信用债则非常谨慎。由于债券收益率相对较低,以及债券发行量可能较多,预计2016年一季度债券收益率下行空间有限。

目前沪深300指数成分股总体估值相对合理,部分板块被低估,结构性改革有助于中国经济转型升级,将会对产能过剩行业带来积极变化。2014年以来货币政策相对宽松对经济的积极影响可能会逐步显现。基于以上原因,我们对一季度股票市场谨慎乐观,部分行业和个股可能存在着较好的投资机会。一季度可转债市场可能发行和上市较多新品种,有助于改善可转债整体估值偏高的局面。

§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	43,900,482.00	10.71
	其中:股票	43,900,482.00	10.71
2	固定收益投资	275,389,527.78	67.21
	其中:债券	275,389,527.78	67.21
	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	1,760,775.90	0.43
7	其他资产	88,681,072.37	21.64
8	合计	409,731,858.05	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	872,100.00	0.32
C	制造业	20,838,260.00	7.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,229,122.00	3.41
E	建筑业	1,416,000.00	0.52
F	批发和零售业	3,234,040.00	1.19
G	交通运输、仓储和邮政业	6,447,760.00	2.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,863,200.00	0.69
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	-	-
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	43,900,482.00	16.21

注:以上行业分类以2015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	601006	大秦铁路	748,000	6,447,760.00	2.38
2	000860	顺鑫农业	294,000	6,262,200.00	2.31
3	600900	长江电力	379,950	5,152,122.00	1.90
4	600585	海螺水泥	300,000	5,130,000.00	1.89
5	600642	申能股份	540,000	4,077,000.00	1.51
6	000709	河北钢铁	1,099,000	3,659,670.00	1.35
7	600755	厦门国贸	347,000	3,234,040.00	1.19
8	000999	华润三九	110,000	3,003,000.00	1.11
9	600089	特变电工	207,000	2,436,390.00	0.90
10	600958	东方证券	80,000	1,863,200.00	0.69

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	12,691,550.40	4.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,077,000.00	11.48
	其中:政策性金融债	31,077,000.00	11.48
4	企业债券	229,237,987.70	84.65
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,382,989.68	0.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	275,389,527.78	101.69

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	126018	08江铜债	2,300,750	227,383,122.50	83.96
2	140440	14农发40	300,000	31,077,000.00	11.48
3	020082	15贴债08	38,000	3,757,820.00	1.39
4	020078	15贴债04	30,000	2,950,800.00	1.09
5	019509	15国债09	29,000	2,906,380.00	1.07

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1
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。

5.10.2
基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	164,576.73
2	应收证券清算款	87,081,303.30
3	应收股利	-
4	应收利息	1,435,192.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,681,072.37

5.10.4 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。

5.10.5 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未存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信转债增强债券A	建信转债增强债券C
报告期期初基金份额总额	49,346,254.83	70,484,014.25
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	4,889,980.60	7,258,939.30
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	44,456,274.23	63,225,074.95

注: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转债增强债券型证券投资基金设立的文件;
2、《建信转债增强债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信转债增强债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信转债增强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
2016年1月21日

建信中证500指数增强型证券投资基金

2015 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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2016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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31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	96,671,968.72份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金,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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	23,443,393.89
2.本期利润	56,933,384.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.5922
4.期末基金资产净值	217,908,975.34
5.期末基金份额净值	2.2541

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。

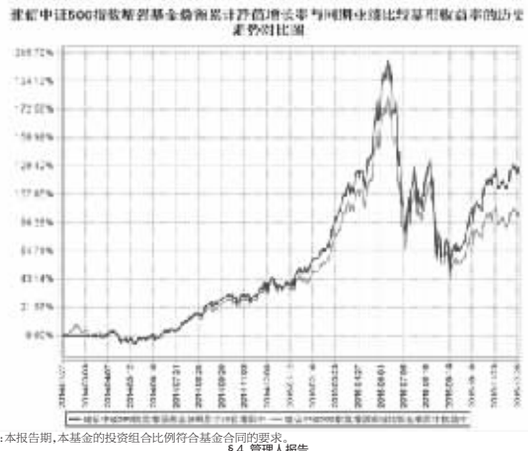
3.2 基金净值表现

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	36.31%	1.95%	23.13%	1.94%	13.18%	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

建信中证500指数增强型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: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		
叶乐天	本基金的基金经理	2014年1月27日	-	7	硕士。曾就职于中国国际金融有限公司,先后担任市场风险管理分析员、量化分析经理、从事风险模型、量化研究与投资;2011年9月加入我公司,担任基金经理助理,2012年3月21日起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;2013年3月28日起任建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金的基金经理;2014年1月27日起任中证500指数增强基金经理;2015年8月26日起任建信精工制造指数增强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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信中证500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, 本基金管理人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%的情况有1次,原因是投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

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

报告期间,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,在四季度市场波动较大的情况下,及时调整了量化增强策略,获得了较为显著且稳定的超额收益。

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36.31%,波动率1.95%,业绩比较基准收益率23.13%,波动率1.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾2015年四季度,投资者情绪从三季度的大幅下跌中逐步恢复过来,股市呈现震荡上行的走势,波动率逐步恢复常态。展望2016年一季度,2015年的大幅震荡给投资者带来的心理阴影仍未完全散去,不可轻言乐观,但整体波动率会小于2015年。一季度是年报发布密集期,仍需紧密关注上市公司的情况,精选个股。

本基金管理人将坚持量化分析研究,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	178,642,255.39	81.09
	其中:股票	178,642,255.39	81.09
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	30,975,900.44	14.06
7	其他资产	10,670,598.75	4.84
8	合计	220,288,754.58	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	2,316,640.00	1.06
B	采矿业	4,790,532.05	2.20
C	制造业	82,160,889.63	37.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,053,042.00	0.94
E	建筑业	4,362,427.51	2.00
F	批发和零售业	9,065,820.06	4.16
G	交通运输、仓储和邮政业	3,744,575.84	1.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,316,203.00	4.28
J	金融业	344,657.25	0.16
K	房地产业	12,823,259.25	5.88
L	租赁和商务服务业	498,485.60	0.23
M	科学研究和技术服务业	1,081,461.70	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	2,385,210.96	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,356,030.00	0.62
R	文化、体育和娱乐业	1,844,972.00	0.85
S	综合	1,615,804.10	0.74
	合计	139,760,010.95	64.14

注:以上行业分类以2015年12月31日的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	-	-
B	采掘业	1,299,210.20	0.60
C	制造业	20,969,689.08	9.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,228,472.54	1.48
E	建筑业	1,890,619.00	0.87
F	批发和零售业	2,688,681.00	1.23
G	交通运输、仓储和邮政业	1,301,174.00	0.60
H	住宿和餐饮业	274,600.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,560,739.52	1.63
J	金融业	815,920.00	0.37
K	房地产业	876,584.00	0.40
L	租赁和商务服务业	10,824.10	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	793,950.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	80,262.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	1,091,519.00	0.50
S	综合	-	-
	合计	38,882,244.44	17.84

注:以上行业分类以2015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

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	600094	大名城	188,700	2,003,994.00	0.92
2	600859	王府井	69,900	1,902,678.00	0.87
3	600654	中安消	65,700	1,894,788.00	0.87
4	000616	海航投资	235,500	1,851,030.00	0.85
5	000667	美好集团	370,700	1,838,672.00	0.84
6	600835	上海机电	60,200	1,824,662.00	0.84
7	000758	中色股份	119,500	1,778,160.00	0.82
8	002221	东华能源	74,289	1,736,876.82	0.80
9	002180	艾派克	37,499	1,730,578.85	0.79
10	600064	南京高科	91,200	1,728,240.00	0.79

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	600686	金龙汽车	71,400	1,370,166.00	0.63
2	600827	百联股份	65,100	1,163,337.00	0.53
3	000023	深天地A	37,000	1,040,070.00	0.48
4	000883	湖北能源	167,700	1,029,678.00	0.47
5	601669	中国电建	128,100	1,028,643.00	0.47

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持仓和损益明细

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1601	IC1601	14	20,717,200.00	-408,120.00	-
公允价值变动总额合计(元)				-408,120.00	
股指期货投资本期收益(元)				5,563,989.45	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				-351,469.45	

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,同时兼顾基差的变化,以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

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	4,518,357.45
2	应收证券清算款	5,807,621.08
3	应收股利	-
4	应收利息	7,279.17
5	应收申购款	337,341.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,670,598.75

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	600859	王府井	1,902,678.00	0.87	重大事项
2	600654	中安消	1,894,788.00	0.87	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	000023	深天地A	1,040,070.00	0.48	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	93,603,334.06
报告期期间基金总申购份额	46,871,550.16
减:报告期期间基金总赎回份额	43,802,915.50
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	96,671,968.72

注: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证500指数增强型证券投资基金设立的文件;
2、《建信中证500指数增强型证券投资基金基金合同》;
3、《建信中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信中证500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
2016年1月21日

建信周盈安心理财债券型证券投资基金

2015 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:2016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2016年1