建信创新中国股票型证券投资基金

【2014】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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22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2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信创新中国股票
基金主代码	000308
交易代码	000308
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月24日
报告期末基金份额总额	284,551,373.89份
投资目标	在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,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	本基金将采取积极、主动的资产配置策略,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。
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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	26,715,621.12
2.本期利润	10,431,227.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0212
4.期末基金资产净值	273,458,012.30
5.期末基金份额净值	0.961

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。

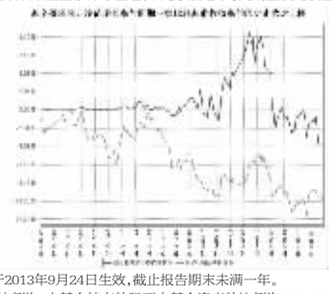
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-4.85%	1.27%	-5.33%	0.89%	0.48%	0.38%

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:1、本基金合同于2013年9月24日生效,截止报告期末未满一年。

2、基金的投资组合比例为:本基金持有的股票占基金资产的比例为60%-95%;债券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-40%,其中,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

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。如果法律法规对上述比例要求有变更的,本基金投资范围将及时做出相应调整,以调整变更后的比例为准。

3、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		
乔林建	本基金的基金经理	2013年9月24日	-	11	硕士,2002年6月起就职于新华人寿保险公司,历任研究员、投资经理;2006年6月起就职于新华资产管理公司,任高级投资经理。2008年2月加入我公司,历任高级投资经理、资深投资经理、基金经理助理,2013年1月5日至2014年3月6日任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理;2013年9月24日起任建信创新中国股票型证券投资基金基金经理;2013年11月13日起任建信核心精选基金经理。

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《建信创新中国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

2014年一季度A股呈现冲高回落的特征,上证综指下跌3.91%,创业板指数上涨1.79%。主导市场走向的因素主要是(1)短期经济走势(2)蓝筹股和成长股的估值差异。

2014年一季度国内经济走势低于预期,房地产销售数据低迷,一二线城市房价开始松动;发电量、工业增加值等主要宏观经济指标均显示经济仍处于下行通道,煤炭、钢铁、铜等工业品价格出现较大跌幅。同时,人民币汇率升值趋势得到了逆转,单季度创出升值周期以来的最大跌幅。

一季度市场的结构性分化仍比较明显,市场风格在1、2月份偏好成长股,3月份开始转向低估值蓝筹。代表经济转型方向的新兴产业冲高回落,传媒、计算机等高估值股票波动剧烈。

本基金在2014年一季度采取了较为灵活的投资策略,前期配置了信息服务、电子、医药等成长股,后期增持了房地产等低估值蓝筹,获得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-4.85%,波动率1.27%,业绩比较基准收益率-5.33%,波动率0.89%。

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2014年二季度,本基金认为短期经济难有明确的趋势性方向,制约经济上行的长期因素依然存在,而政策托底有助于防范经济的大幅下滑。本基金认为,2014年二季度股票市场仍然以捕捉结构性机会为主。

本基金将延续一贯的风格,在2014年二季度采取相对均衡的投资策略,灵活调整权益资产的配置,精选优质个股。基金组合将继续重点配置以下三类股票:一是适度增持低估值蓝筹股;二是坚定持有增长速度稳健、增长质量好的消费股;三是严格精选估值和基本面匹配的成长股。

§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	196,420,196.83	70.93
	其中:股票	196,420,196.83	70.93
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	79,771,775.77	28.81
7	其他资产	726,624.13	0.26
8	合计	276,918,596.73	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	2,645,888.90	0.97
B	采矿业	-	-
C	制造业	120,039,662.55	43.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,398,656.00	0.51
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,131,457.28	3.34
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	13,807,566.50	5.05
J	金融业	6,601,125.16	2.41
K	房地产业	21,737,606.85	7.95
L	租赁和商务服务业	12,560,129.92	4.59
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,392,775.07	1.97
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	3,105,328.60	1.14
S	综合	-	-
	合计	196,420,196.83	71.83

注:以上行业分类以2014年03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	600887	伊利股份	253,741	9,091,540.03	3.32
2	002437	誉衡药业	127,254	6,777,548.04	2.48
3	600109	国金证券	354,518	6,601,125.16	2.41
4	300058	蓝色光标	115,599	5,779,950.00	2.11
5	600803	威远生化	447,077	5,454,339.40	1.99
6	300070	碧水源	163,269	5,392,775.07	1.97
7	002400	省广股份	153,392	4,908,544.00	1.79
8	002158	汉钟精机	287,975	4,886,935.75	1.79
9	000671	阳光城	508,095	4,801,497.75	1.76
10	000625	长安汽车	500,679	4,791,498.03	1.75

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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	668,173.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,706.80
5	应收申购款	43,743.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	726,624.13

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	862,130,170.09
报告期期间基金总申购份额	17,112,947.88
减:报告期期间基金总赎回份额	594,691,744.08
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	284,551,373.89

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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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创新中国股票型证券投资基金设立的文件;
2、《建信创新中国股票型证券投资基金基金合同》;
3、《建信创新中国股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信创新中国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
2014年4月22日

深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金

【2014】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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22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2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	深F60ETF(场内简称:深F60)
基金主代码	159916
交易代码	159916
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月8日
报告期末基金份额总额	148,066,039.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略,跟踪标的指数的表现,即按照标的指数成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	深证基本面60指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,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	中国民生银行股份有限公司

§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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-3,228,160.04
2.本期利润	-20,103,444.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1317
4.期末基金资产净值	202,542,435.64
5.期末基金份额净值	1.3679

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。

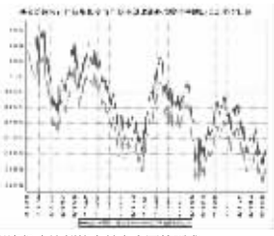
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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标准差③	①-③	②-④
过去三个月	-8.76%	1.33%	-8.63%	1.34%	-0.13%	-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	2011年9月8日	-	10	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8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。

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《深证基本面60交易型开放式指数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

在报告期内,本基金一直接近满仓运作。本基金管理人根据基金合同规定,采取了对指数的被动复制策略,将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。

报告期内,本基金跟踪误差主要来自基金所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。这种差异源自部分股票由于舍入取整等原因,申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比有所变化。本基金管理人在量化分析基础上,采取了适当的组合调整策略,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

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-8.76%,波动率1.33%,业绩比较基准收益率-8.63%,波动率1.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年一季度,宏观经济数据不够理想,经济增长的前景显得比较黯淡,受此影响,标的指数震荡向下。展望二季度,在稳增长预期及传统经济活动旺季到来的共同作用下,预计标的指数可望企稳回升,但难以形成趋势性变化。

本基金管理人将根据基金合同,以量化分析研究为基础,克服各种因素的不利影响,不断优化和改进量化模型,将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

§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	201,345,863.99	99.12
	其中:股票	201,345,863.99	99.12
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	1,780,475.68	0.88
7	其他资产	1,492.35	0.00
8	合计	203,127,832.02	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	7,759,515.50	3.83
C	制造业	129,782,717.86	64.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,880,063.76	1.92
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,262,552.04	5.07
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	-	-
J	金融业	23,827,226.76	11.76
K	房地产业	22,872,029.03	11.29
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	2,961,759.04	1.46
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	201,345,863.99	99.41

注:以上行业分类以2014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

无。

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	2,043,359	16,530,774.31	8.16
2	000651	格力电器	408,893	11,449,004.00	5.65
3	002024	苏宁云商	1,461,902	10,262,552.04	5.07
4	000001	平安银行	900,659	9,700,097.43	4.79
5	000100	TCL集团	3,220,664	8,148,279.92	4.02
6	000333	美的集团	161,619	7,285,784.52	3.60
7	000157	中联重科	1,340,183	6,526,691.21	3.22
8	000709	河北钢铁	3,358,438	6,481,785.34	3.20
9	000063	中兴通讯	454,449	5,744,235.36	2.84
10	000776	广发证券	559,930	5,532,108.40	2.73

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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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	1,075.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	416.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,492.35

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	156,566,039.00
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	8,500,000.00
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	148,066,039.00

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金设立的文件;
2、《深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金合同》;
3、《深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;
4、《深证基本面60交易型开放式指数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
2014年4月22日

建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2014】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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月22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2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

基金简称	建信深证基本面60ETF联接
基金主代码	530015
交易代码	530015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月8日
报告期末基金份额总额	270,052,248.45份
投资目标	本基金将绝大部分基金资产投资于目标ETF,密切跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖目标ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金管理人将对投资组合进行适当调整,以降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×深证基本面60指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为深证基本面60ETF的联接基金,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。同时,本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险收益的品种。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159916
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月8日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年10月24日
基金管理人名称	建信基金管理有限责任公司
基金托管人名称	中国民生银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略,跟踪标的指数的表现,即按照标的指数成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	深证基本面60指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

§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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-3,649,947.07
2.本期利润	-19,031,941.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0684
4.期末基金资产净值	201,987,690.93
5.期末基金份额净值	0.7480

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。

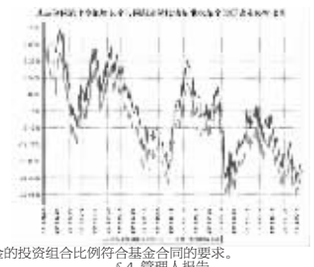
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-8.34%	1.26%	-8.19%	1.27%	-0.15%	-0.01%

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	2011年9月8日	-	10	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8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。

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《建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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

在报告期间,本基金绝大部分资产投资于基本面60ETF,因此基金的跟踪误差和偏离度主要取决于基本面60ETF的表现。此外,由于申赎造成的基金份额变动以及成份股分红也会对本基金的跟踪误差和偏离度造成一定影响。在报告期内,基金跟踪误差和日均偏离度均被控制在基金合同约定的范围内。

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-8.34%,波动率1.26%,业绩比较基准收益率-8.19%,波动率1.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年一季度,宏观经济数据不够理想,经济增长的前景显得比较黯淡,受此