

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

[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:中国工商银行股份有限公司
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监事会在报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金的有关规定,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、误导性陈述或重大遗漏。
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。

本报告所载财务数据未经审计。

本报告期自2014年1月1日至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)(场内简称:建信300)

基金代码 165309

交易代码 165309

基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2009年11月5日

报告期末基金份额总额 2,731,623,70.27份

基金类型 基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
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监事会在报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金的有关规定,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、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告所载财务数据未经审计。

本报告期自2014年1月1日至3月31日止。

§ 2.1 基金产品概况

本基金采取指数化投资方式,通过严谨的资产配置和数量化风险

控制,在严格控制风险和保证基金资产净值增长率最小化的原则下,力争获得与沪深300指数相当的投资收益。

本基金将95%的资产投资于沪深300指数成分股,为证券投资基金中的较高风险

和较高收益产品。

本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行

机构存款利率(税后)。

本基金的管理费率为0.63%。

本基金的托管费率为0.12%。

基金合同管理人:建信基金管理有限责任公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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 -35,592,680.68

2.本期利润 -148,924,452.58

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0525

4.期末基金资产净值 1,739,029,918.81

5.期末基金份额净值 0.6337

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.基金净值是指基金资产总值减去负债后的价值,不包括待摊费用,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率为净值与同期业绩比较基准收益的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益③ 收益标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.53% 1.13% -7.48% 1.13% -0.07% 0.00%

3.2.2 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的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益③ 收益标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -7.53% 1.13% -7.48% 1.13% -0.07% 0.00%

3.3 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

3.3.1 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 000016 民生银行 8,326,200 63,786,922.00 3.67

2 601318 中国平安 1,632,810 61,283,433.60 3.53

3 600036 招商银行 6,107,817 59,978,762.94 3.45

4 601166 兴业银行 4,068,052 38,273,855.04 2.23

5 600000 潘东银行 3,818,004 37,110,98.88 2.13

6 601288 农业银行 12,789,607 30,950,488.94 1.78

7 000002 万科A 3,302,268 26,15,748.12 1.54

8 600837 海通证券 2,760,504 25,507,056.96 1.47

9 600030 中信证券 2,349,394 24,379,118.82 1.42

10 000651 格力电器 820,870 22,984,360.00 1.32

3.3.2 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

3.4 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

3.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.6 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债券投资明细

3.7 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权证投资明细

3.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.9 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债券投资明细

3.10 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

3.11 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

3.12 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债券投资明细

3.13 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

3.14 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

3.15 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债券投资明细

3.16 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

3.17 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

3.18 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债券投资明细

3.19 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

3.20 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

3.21 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债券投资明细

3.22 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

3.23 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

3.24 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债券投资明细

3.25 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

3.26 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

3.27 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债券投资明细

3.28 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

3.29 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

3.30 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债券投资明细

3.31 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

3.32 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

3.33 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债券投资明细

3.34 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

3.35 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

3.36 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债券投资明细

3.37 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

3.38 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

3.39 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债券投资明细

3.40 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

3.41 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

3.42 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债券投资明细

3.43 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

3.44 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

3.45 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债券投资明细

3.46 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

3.47 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

3.48 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债券投资明细

3.49 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

3.50 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

3.51 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债券投资明细

3.52 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

3.53 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

3.54 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债券投资明细

3.55 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

3.56 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

3.57 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债券投资明细

3.58 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

3.59 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

3.60 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债券投资明细

3.61 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

3.62 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

3.63 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债券投资明细

3.64 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

3.65 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

3.66 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债券投资明细

3.67 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

3.68 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

3.69 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债券投资明细

3.70 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

3.71 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

3.72 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债券投资明细

3.73 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