建信嘉薪宝货币市场基金

【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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	建信嘉薪宝货币
基金主代码	000686
交易代码	000686
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月17日
报告期末基金份额总额	310,776,353.58份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取个券选择策略、利率策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
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1月1日-2015年3月31日)
1. 本期已实现收益	3,530,910.30
2.本期利润	3,530,910.30
3.期末基金资产净值	310,776,353.58

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(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加入本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

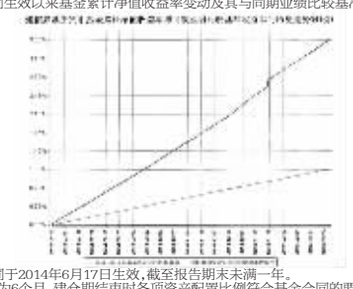
2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.2093%	0.0125%	0.3329%	0.0000%	0.8764%	0.0125%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2014年6月17日生效,截至报告期末未满一年。

2、本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置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		
于倩倩	本基金的基金经理	2014年6月17日	-	6	于倩倩女士,硕士。2008年6月加入国泰人寿保险公司,任固定收益研究专员;2009年9月加入金元惠理基金管理公司(原金元比联基金管理公司),任债券研究员;2011年6月加入我公司,历任债券研究员,基金经理助理,2013年8月5日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财债券基金的基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币基金的基金经理。
陈建良	本基金的基金经理	2014年6月17日	-	7	2005年6月加入中国建设银行厦门分行,任客户经理;2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部,任债券交易员;2013年9月加入我公司投资管理部,任基金经理助理。2013年12月10日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信月盈安心理财基金基金经理;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币基金的基金经理。

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《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同》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

回顾2015年1季度,债券市场整体呈现小幅下跌,收益率先下后上,以净价计,金融债跌幅最大,国债跌幅最小,赚钱机会关键在于把握波段操作,核心影响因素在于政策宽松预期的演绎以及兑现;具体而言,

经济基本面仍笼罩在疲态的阴霾中;这体现在,其一,油价大幅下跌后,石油产业链上游出现的补库存活动,并未带来整体生产活动的改善,其二,去年首次降息后,房地产销售端的回暖程度差强人意,高库存仍制约开工意愿,其三,1-2月信贷数据虽然超预期,但社融增速仍然低迷,表外向表内转移的融资行为仍难提振投资,可能的证据在于投资资金来源增速的表现仍然低迷,其四,相对亮点在于基建投资,但考虑到大量地方政府债务的接续压力,市场对其持续性保持怀疑;

然而政策正在行动,预期在博弈中渐似临近拐点;这体现在,其一,2月全面降准以及再度降息,向市场宣告全面政策并不在排斥中,且时点早于预期,这与基本面的形势是相契合的(贬值压力+通缩患者),其二,房地产政策再次放大招,二套房首付比例下调以及税收免征期限缩短,都意在激活房地产市场的销售端,其三,财政政策终于迈出积极的一步,不止体现在政府工作报告中赤字率的提升,更重要的是地方政府债务问题出台了实质性的置换方案,这成为降低融资成本的重要一环;政策连续重拳出台,为3月债市带来3重调整压力,其一,宽信用的剑已在路上,权益资产大好,其二,准利率品的供给大增,其三,地方置换债的投资资金来源能否寄希望于央妈?目前看央妈在这一问题上仍然按兵不动;

资金面在1季度是紧平衡的格局:尽管全面降准兑现,还有逆回购重启,以及各种形式的结构放水(SLO/SLF/PSL/地方国库现金招标),但新股、春节、缴税、贬值压力等等因素都叠加在一起,使得货币市场利率的中枢仍维持在偏高的水平,直到3月中旬后央行逐步引导逆回购利率下行后,才看到资金利率的明显回落;

本基金以管理流动性为第一要务,在保证正常季节性赎回压力的前提下,考虑到1季度短端相对突出的价值,策略上适当增加了债券的配比,积极把握资金波动的时点,参与了一级投标及二级调整的机会,同时同业存款纳入一般存款后,线下同业存款的报价优势更加突出,也适当增加了3个月内存款的配比,总体而言,本基金利用适度杠杆策略,保持债券配比和剔余期限在中等水平,为投资者获得了相对较好的收益;

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值收益率为1.2093%,波动率为0.0125%;业绩比较基准收益率为0.3329%,波动率为0.0000%。

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2015年2季度,关注宽货币能否跟进宽财政的脚步;具体来看,

基本面而言,观察3个纬度数据的走向,其一,4月份公布1季度经济数据,大概率仍难看到明显改善,而金融数据特别是信贷增量能否持续超预期?其二,3月份房地产政策再度放出大招后,2季度高频数据端能否看到相对明显的回暖?其三,开工旺季即将到来,制造业库存端能否看到相对积极的表现?

政策面而言,货币政策预计还是有所作为,2季度由于缴税、新股、债务置换等多重因素,季节性的资金需求理论上是上升的,央行对冲的节奏是影响短期预期波动的关键,1季度经济数据公布前后是可能的时间窗口;

资金面而言,除了传统的季节影响因素外,关注2点变化,其一是注册制改革下新股审批的速度,4月已增加至30家,后续每月是否持续放量?其二,如果宽货币与宽信用同步,理论上线下价格的竞争力应好于线上,因为同业存款纳入一般存款口径后,配资产的同业吸存资金一定程度上能够反应实体融资需求的变化;当然如果宽货币的进程好于预期,则可能引导短端资金成本的全面回落;

债券市场经过3月份的大幅调整后,收益率水平回到了前期高点附近,如果央行能够持续引导短端资金成本回落,则一定程度上应有波段性的操作机会,空间和持续性仍然受制于宽货币与宽信用的协调性;

本基金以管理流动性为第一要务,在保证正常流动性应对能力的前提下,本基金将积极捕捉季节因素带来的资金波动机会,适当布局资金至打新时点及传统季末赎回时点,适当参与一级市场短券投标机会,保持剩余期限在中等水平,控制债券配比在合理水平,继续利用杠杆策略以期为投资者获得稳定的收益;

§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	固定收益投资	149,928,787.89	43.23
	其中:债券	149,928,787.89	43.23
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	190,341,280.24	54.88
4	其他资产	6,573,399.56	1.90
5	合计	346,843,467.69	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	10.22
	其中:买断式回购融资	0.00

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	35,639,782.18	11.47
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	100
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	29.07	11.47
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	19.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	28.95	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	12.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	19.30	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	109.49	11.47

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	摊余成本(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	49,976,483.23	16.08
	其中:政策性金融债	29,978,995.33	9.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	99,952,304.66	32.16
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	149,928,787.89	48.24
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140207	14国开07	200,000	20,001,780.82	6.44
2	041551007	15海亮CP001	200,000	20,000,800.36	6.44
3	071536001	15华安证券CP001	200,000	19,997,487.90	6.43
4	041454053	14万达CP002	200,000	19,996,297.76	6.43
5	041456058	14三安CP002	200,000	19,993,939.71	6.43
6	011599137	15巨化SCP001	200,000	19,971,134.67	6.43
7	041477001	14蓝色光标CP001	100,000	10,000,271.18	3.22
8	011599141	15津保税SCP001	100,000	9,989,860.98	3.21
9	110212	11国开12	100,000	9,977,214.51	3.21

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1960%
报告期内偏离度的最低值	0.0638%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1153%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

基金投资的前十名债券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

5.8.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,407,079.26
4	应收申购款	3,166,320.30
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,573,399.56

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	330,504,183.81
报告期期间基金总申购份额	327,097,459.33
减:报告期期间基金总赎回份额	346,825,289.56
报告期期末基金份额总额	310,776,353.58

注:上述总申购份额含红利再投资份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投资	2015年3月31日	985,449.58	985,449.58	-
合计			-	-	

注:本基金的利润分配按日结转基金份额,列示在"红利再投资"项下一并披露。

§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嘉薪宝货币市场基金设立的文件;

2、《建信嘉薪宝货币市场基金基金合同》;

3、《建信嘉薪宝货币市场基金招募说明书》;

4、《建信嘉薪宝货币市场基金托管协议》;

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

建信中证500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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	81,691,536.48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1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	11,678,983.98
2.本期利润	37,472,126.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.6106
4.期末基金资产净值	159,424,420.79
5.期末基金份额净值	1.9515

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。

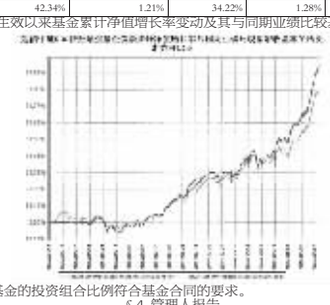
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	42.34%	1.21%	34.22%	1.28%	8.12%	-0.07%

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		
叶乐天	本基金的基金经理	2014年1月27日	-	6	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。

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

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,在一季度市场波动较大的情况下,及时调整了量化增强策略,获得了较为明显的超额收益。

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42.34%,波动率1.21%,业绩比较基准收益率34.22%,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

2015年一季度,尽管经济基本面并没有出现明显的改善,但从2014年末开始酝酿的投资者看涨情绪持续,以及改革政策的不断出台,指数延续去年年底的涨势,屡创多年来的新高,大小盘轮番上涨,成交活跃。展望2015年二季度,指数大概率仍会延续上涨势头,同时波动率也会继续放大,需要关注上市公司的年报和一季报情况,注意风险控制。

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	145,627,171.90	86.31
	其中:股票	145,627,171.90	86.31
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	13,404,591.81	7.94
7	其他资产	9,697,147.10	5.75
8	合计	168,728,910.81	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	3,211,538.08	2.01
B	采矿业	3,236,620.08	2.03
C	制造业	64,099,399.00	40.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,790,736.52	1.12
E	建筑业	2,346,855.17	1.47
F	批发和零售业	6,959,795.27	4.37
G	交通运输、仓储和邮政业	4,818,814.21	3.02
H	住宿和餐饮业	1,282,696.00	0.80
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,174,148.65	4.50
J	金融业	3,828,134.69	2.40
K	房地产业	11,557,346.50	7.25
L	租赁和商务服务业	1,444,459.44	0.91
M	科学研究和技术服务业	1,325,222.10	0.83
N	水利、环境和公共设施管理业	567,463.15	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,939,336.00	1.22
S	综合	328,719.00	0.21
	合计	115,911,283.86	72.71

注:以上行业分类以2015年03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	483,384.00	0.30
B	采掘业	92,304.00	0.06
C	制造业	18,058,167.19	11.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,023,314.59	1.90
E	建筑业	553,718.40	0.35
F	批发和零售业	1,696,780.48	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	774,764.14	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,643,320.43	1.66
J	金融业	41,850.00	0.03
K	房地产业	1,126,669.81	0.71
L	租赁和商务服务业	28,686.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	440,450.00	0.28
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	577,027.00	0.36
S	综合	175,482.00	0.11
	合计	29,718,888.04	18.64

注:以上行业分类以2015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

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	601099	太平洋	169,122	2,338,957.26	1.47
2	300059	东方财富	36,981	1,538,409.60	0.96
3	000988	华工科技	92,749	1,483,984.00	0.93
4	600410	华胜天成	51,988	1,466,061.60	0.92
5	600694	大商股份	27,304	1,457,487.52	0.91
6	000550	江铃汽车	33,600	1,444,128.00	0.91
7	002118	紫鑫药业	71,800	1,413,024.00	0.89
8	600426	华鲁恒升	105,532	1,379,303.24	0.87
9	300134	大富科技	25,380	1,365,444.00	0.86
10	000671	阳光城	67,975	1,363,578.50	0.86

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	002202	金风科技	65,644	1,251,174.64	0.78
2	600674	川投能源	48,800	1,099,464.00	0.69
3	600252	中恒集团	49,958	984,672.18	0.62
4	000878	云南铜业	60,588	920,937.60	0.58
5	002053	云南盐化	43,112	898,022.96	0.56

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	36,216.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,372.99
5	应收申购款	9,658,557.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,697,147.10

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

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

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	1,363,578.50	0.86	重大事项

注:本基金截至2015年03月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	65,861,621.20
报告期期间基金总申购份额	66,463,648.45
减:报告期期间基金总赎回份额	50,633,733.17
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	81,691,536.48

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
2015年4月21日

建信双债增强债券型证券投资基金

【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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	建信双债增强债券	
基金主代码	000207	
交易代码	000207	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年7月25日	
报告期末基金份额总额	290,232,035.75份	
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资人创造较高的当期收入和总回报。	
投资策略	本基金主要通过采取债券类属配置策略、信用债投资策略、可转债投资策略等投资策略以实现投资目标。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	
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