

# 建信深证100指数增强型证券投资基金

## 【2015】第三季度报告

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:2015年10月27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2015年10月23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,基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。

本报告自2015年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

基金名称	建信深证100指数增强
基金代码	530018
交易代码	530018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月16日
报告期末基金份额总额	64,474,494.27份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对深证100指数进行有效跟踪的基础上,结合增强的主动管理,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略,以深证100指数作为基金投资组合的跟踪基准,结合增强的主动管理,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准	95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金,其风险和收益高于货币型基金、债券型基金、混合型基金,属于较高风险、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	交通银行股份有限公司

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-10,227,752.33
2.本期公允价值变动收益	-31,285,261.16
3.本期公允价值变动收益	-40,492
4.本期基金净值	575,349.77
5.本期基金净值	11,960

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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

3.2.1 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

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。

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:2015年10月27日

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2015年10月23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,基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。

本报告自2015年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

基金名称	建信深证100指数增强
基金代码	530018
交易代码	530018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月16日
报告期末基金份额总额	64,474,494.27份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金,在对深证100指数进行有效跟踪的基础上,结合增强的主动管理,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略,以深证100指数作为基金投资组合的跟踪基准,结合增强的主动管理,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差,力争实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准	95%×深证100价格指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金,其风险和收益高于货币型基金、债券型基金、混合型基金,属于较高风险、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	交通银行股份有限公司

注:以上行业分类以2015年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

### §2.2 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	769,816.00	1.17
C	制造业	4,082,043.39	6.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	575,278.00	0.88
E	建筑业	497,303.00	0.76
F	批发和零售业	484,107.64	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	153,107.00	0.23
H	住宿和餐饮业	177,394.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	448,875.00	0.68
J	金融业	574,703.00	0.88
K	房地产业	342,002.00	0.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	88,791.00	0.14
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	56,452.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	46,050.00	0.07
S	综合	94,132.00	0.14
		8,525,746.41	13.46

注:以上行业分类以2015年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

### §2.2 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	769,816.00	1.17
C	制造业	4,082,043.39	6.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	575,278.00	0.88
E	建筑业	497,303.00	0.76
F	批发和零售业	484,107.64	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	153,107.00	0.23
H	住宿和餐饮业	177,394.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	448,875.00	0.68
J	金融业	574,703.00	0.88
K	房地产业	342,002.00	0.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	88,791.00	0.14
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	56,452.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	46,050.00	0.07
S	综合	94,132.00	0.14
		8,525,746.41	13.46

注:以上行业分类以2015年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

### §2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	232,882	2,964,715.16	4.52
2	000076	广发证券	176,370	2,289,367.00	3.53
3	000725	京东方A	706,081	1,972,479.00	3.01
4	000661	格力电器	120,054	1,942,473.22	2.96
5	002024	苏宁云开	133,427	1,617,136.24	2.47
6	000033	荣信股份	60,380	1,522,022.24	2.30
7	300069	东方园林	40,400	1,460,788.00	2.23
8	000166	华芳集团	115,618	1,318,042.44	2.01
9	300104	乐视网	32,162	1,314,762.66	2.00
10	000688	长江电力	50,400	415,260.00	0.63
1	600000	浦发银行	47,800	374,274.00	0.57
3	300377	三维丝	16,200	373,572.00	0.57
4	600269	广晟有色	9,900	336,610.00	0.51
6	601788	光大证券	21,194	326,547.00	0.50

注:以上行业分类以2015年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

### §2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	600000	浦发银行	47,800	374,274.00	0.57
2	601788	光大证券	21,194	326,547.00	0.50
3	300377	三维丝	16,200	373,572.00	0.57
4	600269	广晟有色	9,900	336,610.00	0.51
6	601788	光大证券	21,194	326,547.00	0.50

注:以上行业分类以2015年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

### §2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	600000	浦发银行	47,800	374,274.00	0.57
2	601788	光大证券	21,194	326,547.00	0.50
3	300377	三维丝	16,200	373,572.00	0.57
4	600269	广晟有色	9,900	336,610.00	0.51
6	601788	光大证券	21,194	326,547.00	0.50

注:以上行业分类以2015年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

### §2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	600000	浦发银行	47,800	374,274.00	0.57
2	601788	光大证券	21,194	326,547.00	0.50
3	300377	三维丝	16,200	373,572.00	0.57
4	600269	广晟有色	9,900	336,610.00	0.51
6	601788	光大证券	21,194	326,547.00	0.50

注:以上行业分类以2015年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

### §2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1	600600	长江电力	50,400	415,260.00	0.63	重大资产重组
2	300066	三维丝	373,572	374,274.00	0.57	重大资产重组
3	600269	广晟有色	328,410.00		0.51	筹划非公开发行股票
§ 6 开放式基金份额变动						
报告期末前基金基金份额总额						61,975,740
报告期间基金总申购份额						21,353,472
减:报告期间基金总赎回份额						28,454,930
报告期间基金净申购份额(份额减少以“-”填列)						
报告期末基金基金份额总额						54,874,282
注:总申购份额含转入份额,总赎回份额含转出份额。						