

建信深证100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: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、监事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对基金内容的真准确性、准确性、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的规定，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

注:以上行业分类以2015年12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

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	98,847.00	0.12
B	采掘业	830,362.00	1.04
C	制造业	7,688,073.26	9.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	871,976.40	1.09
E	建筑业	684,349.00	0.86
F	批发和零售业	971,196.14	1.21
G	交通运输、仓储和邮政业	205,956.00	0.26
H	住宿和餐饮业	57,666.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	439,162.00	0.56
J	金融业	324,644.00	0.41
K	房地产业	373,967.00	0.47
L	租赁和商务服务业	23,280.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	117,890.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	128,346.00	0.16
O	居民、服务和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	166,896.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	13,960.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	12,996,540.89	16.21

注:以上行业分类以2015年12月31日的中国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	000002	万科A	257,692	6,296,415.63	7.26
2	000033	美的集团	100,268	3,200,467.96	4.10
3	000776	万丰奥威	124,170	2,415,106.50	3.01
4	300069	东方财富	42,000	1,285,260.00	2.73
5	000166	申万宏源	180,218	2,122,014.76	2.66
6	300104	乐视网	34,662	2,038,126.60	2.54
7	000651	格力电器	63,754	1,781,001.00	2.24
8	000725	京东方A	994,581	1,765,906.57	2.20
9	000783	长江证券	127,397	1,588,480.74	1.98
10	000917	立思辰	5,585,156.32	1.98	

注:以上行业分类以2015年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.3.1 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	000002	万科A	257,692	6,296,415.63	7.26
2	000033	美的集团	100,268	3,200,467.96	4.10
3	000776	万丰奥威	124,170	2,415,106.50	3.01
4	300069	东方财富	42,000	1,285,260.00	2.73
5	000166	申万宏源	180,218	2,122,014.76	2.66
6	300104	乐视网	34,662	2,038,126.60	2.54
7	000651	格力电器	63,754	1,781,001.00	2.24
8	000725	京东方A	994,581	1,765,906.57	2.20
9	000783	长江证券	127,397	1,588,480.74	1.98
10	000917	立思辰	5,585,156.32	1.98	

注:以上行业分类以2015年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.3.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(手)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债	39,300	584,784.00	0.73
2	100003	国债	30,200	467,756.00	0.58
3	100007	国债	124,170	2,415,106.50	3.01
4	100009	国债	42,000	1,285,260.00	2.73
5	100016	国债	180,218	2,122,014.76	2.66
6	300104	国债	34,662	2,038,126.60	2.54
7	000651	国债	63,754	1,781,001.00	2.24
8	000725	国债	994,581	1,765,906.57	2.20
9	000783	国债	127,397	1,588,480.74	1.98
10	000917	国债	5,585,156.32	1.98	

注:以上行业分类以2015年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.3.3 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资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债	39,300	584,784.00	0.73
2	100003	国债	30,200	467,756.00	0.58
3	100007	国债	124,170	2,415,106.50	3.01
4	100009	国债	42,000	1,285,260.00	2.73
5	100016	国债	180,218	2,122,014.76	2.66
6	300104	国债	34,662	2,038,126.60	2.54
7	000651	国债	63,754	1,781,001.00	2.24
8	000725	国债	994,581	1,765,906.57	2.20
9	000783	国债	127,397	1,588,480.74	1.98
10	000917	国债	5,585,156.32	1.98	

注:以上行业分类以2015年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.3.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及金融衍生品投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债	39,300	584,784.00	0.73
2	100003	国债	30,200	467,756.00	0.58
3	100007	国债	124,170	2,415,106.50	3.01
4	100009	国债	42,000	1,285,260.00	2.73
5	100016	国债	180,218	2,122,014.76	2.66
6	300104	国债	34,662	2,038,126.60	2.54
7	000651	国债	63,754	1,781,001.00	2.24
8	000725	国债	994,581	1,765,906.57	2.20
9	000783	国债	127,397	1,588,480.74	1.98
10	000917	国债	5,585,156.32	1.98	

注:以上行业分类以2015年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.3.5 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期权投资明细

序号	股票期权代码	股票期权名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

<tbl_r cells="6" ix="5"