

# 建信转债增强债券型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

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

送出日期：2015 年 8 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2015 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

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 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 14        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 15        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 15        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 16        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....      | 16        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>16</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 16        |
| 6.2 利润表.....                                 | 17        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 18        |
| 6.4 报表附注.....                                | 20        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 39        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 40        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 41        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 41        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 43        |
| 7.6 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.....      | 43        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 43        |
| 7.8 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贵金属投资明细.....   | 43        |
| 7.9 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.....      | 44        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 44        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                           | 44        |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....                    | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 45        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....                | 45        |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 46        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>               | <b>46</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                 | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 46        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....  | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....       | 47        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                    | 47        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....             | 47        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....     | 47        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....            | 47        |
| 10.8 其他重大事件.....                       | 48        |
| <b>§11 备查文件目录.....</b>                 | <b>49</b> |
| 11.1 备查文件目录.....                       | 49        |
| 11.2 存放地点.....                         | 49        |
| 11.3 查阅方式.....                         | 49        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 建信转债增强债券型证券投资基金  |                 |
| 基金简称            | 建信转债增强债券         |                 |
| 基金主代码           | 530020           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2012 年 5 月 29 日  |                 |
| 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     |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 162,424,164.68 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 建信转债增强债券 A       | 建信转债增强债券 C      |
| 下属分级基金的交易代码:    | 530020           | 531020          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 66,646,786.93 份  | 95,777,377.75 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置，并充分利用可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，实施对大类资产的配置，在控制风险并保持良好流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的超额收益。   |
| 投资策略   | 本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置，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，综合股市估值水平和债市收益率情况及风险分析，进行灵活的大类资产配置进而在固定收益类资产、权益类资产以及货币类资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。 |
| 业绩比较基准 | 60%×天相可转债指数收益率+30%×中国债券总指数收益率+10%×沪深 300 指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，债券型基金的风险高于货币市场基金，低于混合型和股票型基金，属于中低风险收益的品种。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      | 基金管理人             | 基金托管人                |
|---------|-------------------|----------------------|
| 名称      | 建信基金管理有限责任公司      | 中国民生银行股份有限公司         |
| 信息披露负责人 | 姓名                | 吴曙明                  |
|         | 联系电话              | 010-66228888         |
|         | 电子邮箱              | xinxipilu@ccbfund.cn |
| 客户服务电话  | 400-81-95533 010- | 95568                |

|       |                                 |                    |
|-------|---------------------------------|--------------------|
|       | 66228000                        |                    |
| 传真    | 010-66228001                    | 010-58560798       |
| 注册地址  | 北京市西城区金融大街<br>7号英蓝国际金融中心<br>16层 | 北京市西城区复兴门内大街<br>2号 |
| 办公地址  | 北京市西城区金融大街<br>7号英蓝国际金融中心<br>16层 | 北京市西城区复兴门内大街<br>2号 |
| 邮政编码  | 100033                          | 100031             |
| 法定代表人 | 许会斌                             | 洪崎                 |

## 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》                                    |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的住所  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                    |
|--------|--------------|-------------------------|
| 注册登记机构 | 建信基金管理有限责任公司 | 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 基金级别          | 建信转债增强债券 A                     | 建信转债增强债券 C                     |
|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2015年1月1日 -<br>2015年6月30日) | 报告期(2015年1月1日 -<br>2015年6月30日) |
| 本期已实现收益       | 220,504,709.44                 | 330,967,367.14                 |
| 本期利润          | 61,963,712.12                  | 90,298,231.10                  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.3935                         | 0.3804                         |
| 本期加权平均净值利润率   | 18.26%                         | 17.85%                         |
| 本期基金份额净值增长率   | 25.70%                         | 25.38%                         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015年6月30日)               |                                |
| 期末可供分配利润      | 101,221,916.31                 | 142,712,449.03                 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 1.5188                         | 1.4900                         |
| 期末基金资产净值      | 167,868,703.24                 | 238,489,826.78                 |

|              |                  |         |
|--------------|------------------|---------|
| 期末基金份额净值     | 2.519            | 2.490   |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2015年6月30日) |         |
| 基金份额累计净值增长率  | 151.90%          | 149.00% |

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上本期公允价值变动收益；

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）；

3、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 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

建信转债增强债券 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月      | -2.63%   | 1.19%       | -16.74%    | 3.61%         | 14.11%  | -2.42% |
| 过去三个月      | 21.46%   | 1.35%       | -3.59%     | 2.49%         | 25.05%  | -1.14% |
| 过去六个月      | 25.70%   | 1.63%       | -1.35%     | 2.01%         | 27.05%  | -0.38% |
| 过去一年       | 129.00%  | 1.65%       | 34.25%     | 1.56%         | 94.75%  | 0.09%  |
| 过去三年       | 151.40%  | 1.16%       | 38.39%     | 0.96%         | 113.01% | 0.20%  |
| 自基金合同生效起至今 | 151.90%  | 1.14%       | 36.55%     | 0.95%         | 115.35% | 0.19%  |

建信转债增强债券 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月      | -2.70%   | 1.19%       | -16.74%    | 3.61%         | 14.04%  | -2.42% |
| 过去三个月      | 21.35%   | 1.35%       | -3.59%     | 2.49%         | 24.94%  | -1.14% |
| 过去六个月      | 25.38%   | 1.62%       | -1.35%     | 2.01%         | 26.73%  | -0.39% |
| 过去一年       | 128.23%  | 1.65%       | 34.25%     | 1.56%         | 93.98%  | 0.09%  |
| 过去三年       | 148.75%  | 1.16%       | 38.39%     | 0.96%         | 110.36% | 0.20%  |
| 自基金合同生效起至今 | 149.00%  | 1.14%       | 36.55%     | 0.95%         | 112.45% | 0.19%  |

注：本基金的业绩比较基准为： $60\% \times$ 天相可转债指数收益率 $+30\% \times$ 中国债券总指数收益率 $+10\% \times$ 沪深 300 指数收益率。

天相可转债指数是以沪深两市所有可转债的交易价格，按发行公司公告的实际未转股规模帕氏加权计算，反映两市可转债的总体走势。天相可转债指数的基期为 1999 年 12 月 30 日，是国内较早编制的可转债指数。

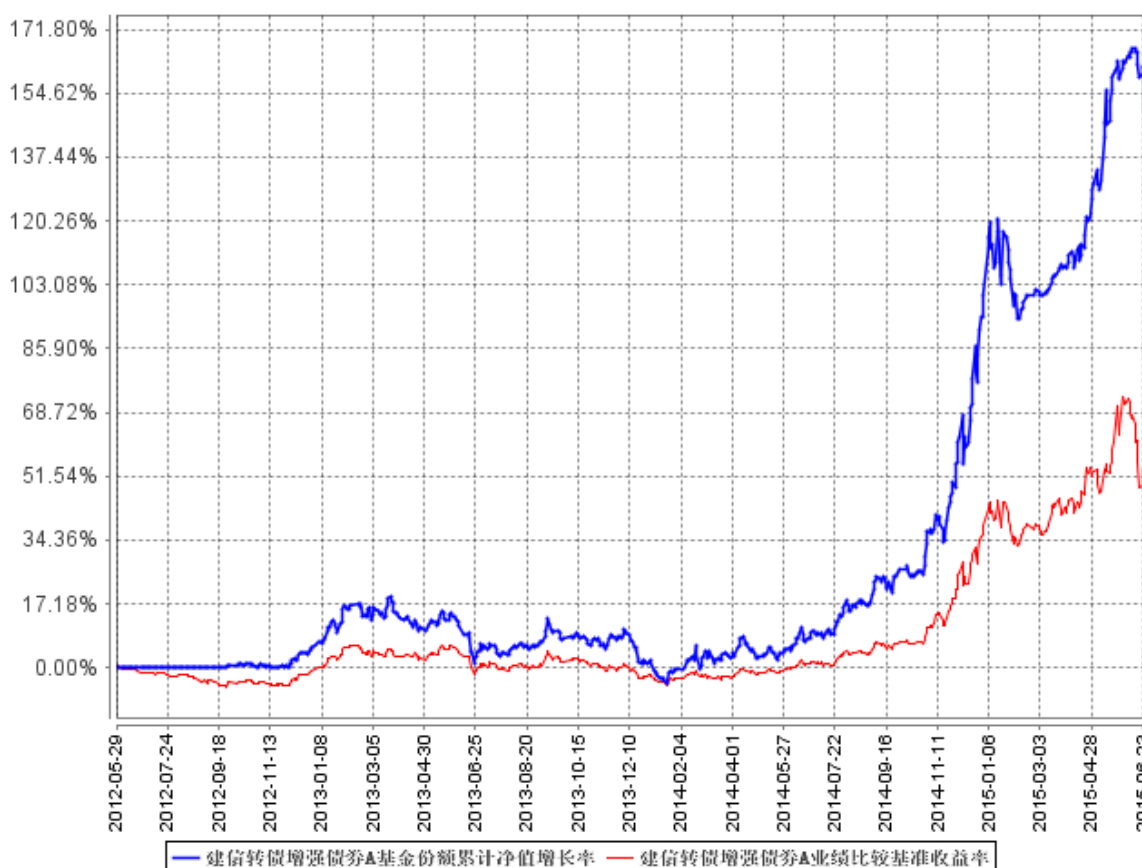
中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于 2001 年 12 月 31 日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择了该组合作为本基金的业绩比较基准。该业绩比较基准能够较好地反映本基金的风险收益特征。

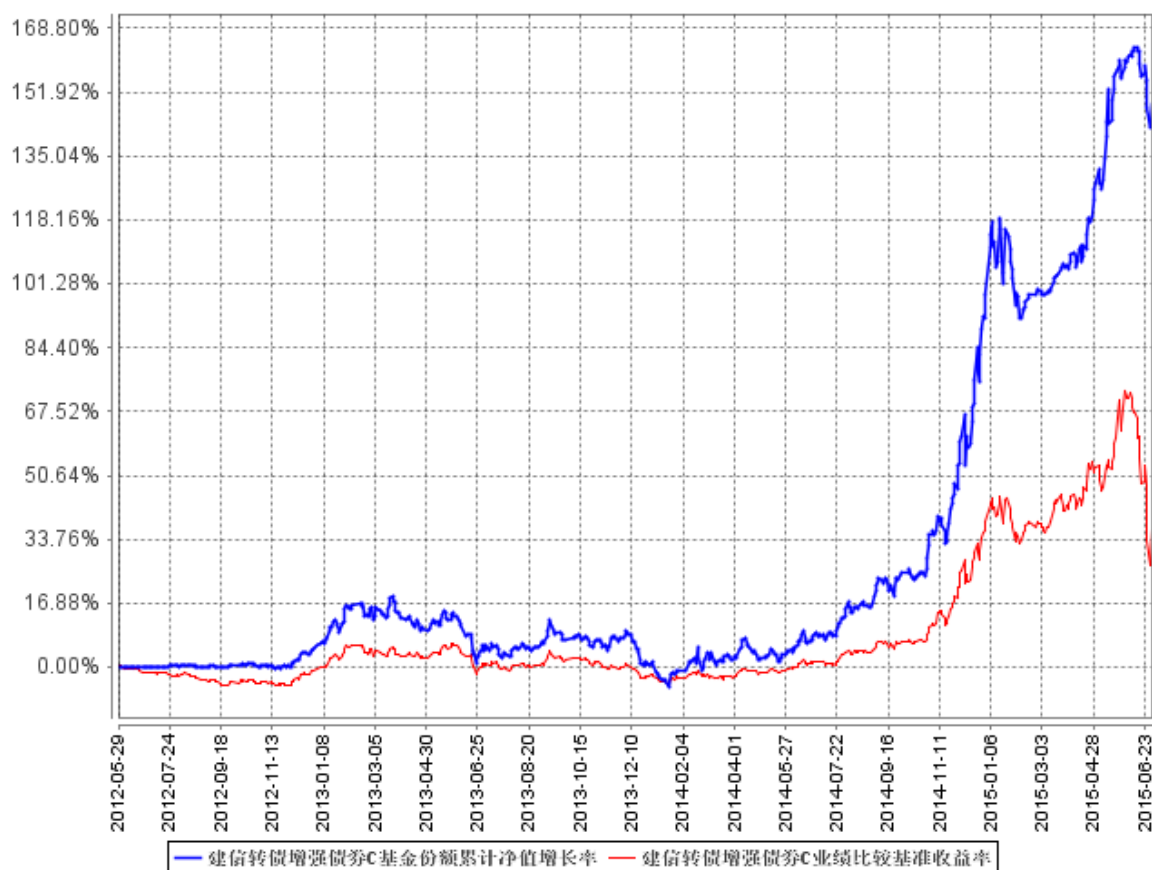
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信转债增强债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





建信转债增强债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、量化衍生品及海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司，设立了子公司—建信资本管理有限责任公司。自成立以来，

公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“最可信赖、持续领先的综合性、专业化资产管理公司”。

截至 2015 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）、建信创新中国股票型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、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、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金，共计 55 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 1654.99 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-----------------|------|--------|----|
|    |    | 任职日期            | 离任日期 |        |    |
|    |    |                 |      |        |    |

|     |              |                    |   |    |   |
|-----|--------------|--------------------|---|----|---|
| 彭云峰 | 本基金的<br>基金经理 | 2012 年 5 月<br>29 日 | - | 10 | <p>硕士。曾任中经网数据有限公司财经分析师、国都证券有限责任公司债券研究员兼宏观研究员，</p> <p>2006 年 5 月起就职于鹏华基金管理有限公司，历任债券研究员、社保组合投资经理、债券基金经理等职，</p> <p>2010 年 5 月 31 日至 2011 年 6 月 14 日任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理。</p> <p>彭云峰于 2011 年 6 月加入本公司，</p> <p>2011 年 11 月 30 日至 2013 年 5 月 3 日任建信保本混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|-----|--------------|--------------------|---|----|---|

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>经理；<br/>2012 年<br/>2 月 17 日<br/>至<br/>2014 年<br/>1 月 21 日<br/>任建信货<br/>币市场基<br/>金基金经<br/>理；<br/>2012 年<br/>5 月 29 日<br/>起任建信<br/>转债增强<br/>债券型证<br/>券投资基<br/>金基金经<br/>理；<br/>2013 年<br/>7 月 25 日<br/>起任建信<br/>双债增强<br/>债券型证<br/>券投资基<br/>金基金经<br/>理；<br/>2013 年<br/>11 月 5 日<br/>起任建信<br/>安心回报<br/>两年定期<br/>开放债券<br/>型证券投<br/>资基金基<br/>金经理；<br/>2015 年<br/>5 月 26 日<br/>起任建信<br/>新经济灵<br/>活配置混<br/>合型证券<br/>投资基金<br/>基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

与 2014 年下半年相比，2015 年上半年中国经济增速小幅回落，二季度 GDP 增速与一季度持平，均为 7%；同期通胀处于较低水平，波动不大。2015 年上半年货币政策相对宽松，央行多次下调存贷款基准利率和存款准备金率，并通过公开市场操作、抵押补充贷款等方式投放流动性。

由于经济增速回落，通胀水平较低，货币政策相对宽松，上半年债券市场总体上涨，各期限、各品种债券收益率均明显下行，资金利率也大幅下降。具体来看，除 2 月底至 4 月中旬，以及 5 月中旬至 6 月底债市出现调整之外，其余时间债市均上涨。从不同类别来看，中长期债券表现好于短期债券，信用债好于利率债，城投债好于产业债。

上半年股票市场持续上涨，只是在 6 月中旬之后出现了较大幅度的调整。总体来看，上半年成长股的表现好于价值股，创业板的表现尤其突出。相对而言，上半年可转债市场表现不佳。虽

然前五个月可转债总体持续上涨，但 6 月下跌较多。由于存续品种越来越少，估值相对偏高，部分可转债品种波动较大。

上半年本基金可转债投资比例相对较低，主要投资分离交易可转债，以及部分估值相对合理的可转债，同时注意灵活操作。上半年本基金股票投资比例相对较高，主要投资部分可转债对应的正股，以及受益于政策利好且估值相对较低的股票。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期转债增强 A 净值增长率 25.7%，波动率 1.63%，转债增强 C 净值增长率 25.38%，波动率 1.62%；业绩比较基准收益率-1.35%，波动率 2.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于货币政策适当放松，财政政策相对积极，房地产行业有企稳迹象，政府投资有所加快，美国等发达经济体经济形势好转，我们对下半年中国经济增长形势相对乐观。预计下半年经济增速可能比上半年略有回升，通胀水平仍保持在较低水平。我们预计下半年货币政策可能仍相对宽松，存款准备金率和存贷款基准利率均可能进一步下调，前者下调空间可能更大一些。

基于以上判断，我们对下半年债券市场相对乐观，预计收益率可能进一步下行。我们认为下半年中长期债券的表现可能较好，中高等级信用债的表现可能好于利率债。由于经济形势可能逐步好转，股票市场估值相对合理，政府致力于稳定股票市场，我们对下半年股票市场相对乐观。目前可转债品种较少，部分品种估值偏高，总体而言不具有特别好的投资价值。如果正股上涨较多，相应可转债可能会有较好表现。

下半年本基金将根据市场情况调整可转债的投资比例，择机增持估值相对合理的可转债，尤其是新发可转债品种。对权益类资产的投资将更加积极主动，注重精选个股，灵活投资。本基金将坚持审慎灵活、稳中求进的投资风格，在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产稳健增值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。

自 2015 年 3 月 26 日起，公司按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值价格，对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）进行估值。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于分红条款的相关规定。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

中国民生银行根据《建信转债增强债券型证券投资基金基金合同》和《建信转债增强债券型证券投资基金托管协议》，托管建信转债增强债券型证券投资基金（以下简称“建信转债增强债券基金”）。

本报告期，中国民生银行在建信转债增强债券基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，按照国家相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人——建信基金管理有限责任公司在建信转债增强债券基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期，基金管理人——建信基金管理有限责任公司严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由建信转债增强债券基金管理人——建信基金管理有限责任公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信转债增强债券型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|-----|------|
|----|-----|-----|------|



|                 |            | 2015 年 6 月 30 日                | 2014 年 12 月 31 日                 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产:</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 4,804,398.20                   | 110,412,577.84                   |
| 结算备付金           |            | 16,890,627.14                  | 37,012,484.07                    |
| 存出保证金           |            | 1,606,142.68                   | 424,418.66                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 524,336,247.82                 | 2,332,922,438.16                 |
| 其中: 股票投资        |            | 75,422,827.75                  | 293,202,750.13                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 448,913,420.07                 | 2,039,719,688.03                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 27,774,117.50                  | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 3,988,901.64                   | 9,043,759.33                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | 94,235,710.41                    |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 579,400,434.98                 | 2,584,051,388.47                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2014 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 134,000,000.00                 | 733,461,980.10                   |
| 应付证券清算款         |            | 7,600,304.00                   | 39,376,900.79                    |
| 应付赎回款           |            | 28,684,297.50                  | 86,701,238.67                    |
| 应付管理人报酬         |            | 293,012.78                     | 794,660.07                       |
| 应付托管费           |            | 78,136.77                      | 211,909.38                       |
| 应付销售服务费         |            | 80,980.33                      | 222,103.16                       |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 1,881,333.45                   | 754,653.90                       |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |
| 应付利息            |            | -                              | 65,537.76                        |
| 应付利润            |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                              | -                                |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 423,840.13                     | 504,784.50                       |
| 负债合计            |            | 173,041,904.96                 | 862,093,768.33                   |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 162,424,164.68                 | 864,030,098.17                   |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 243,934,365.34                 | 857,927,521.97                   |
| 所有者权益合计         |            | 406,358,530.02                 | 1,721,957,620.14                 |

|            |  |                |                  |
|------------|--|----------------|------------------|
| 负债和所有者权益总计 |  | 579,400,434.98 | 2,584,051,388.47 |
|------------|--|----------------|------------------|

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额总额 162,424,164.68 份。其中建信转债增强基金 A 类基金份额净值 2.519 元，基金份额总额 66,646,786.93 份；建信转债增强基金 C 类基金份额净值 2.490 元，基金份额总额 95,777,377.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：建信转债增强债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 163,712,750.66                           | 21,358,490.83                                 |
| 1.利息收入                |            | 4,916,828.70                             | 2,487,894.60                                  |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 348,972.79                               | 101,440.24                                    |
| 债券利息收入                |            | 4,548,915.61                             | 2,374,358.94                                  |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |            | 18,940.30                                | 12,095.42                                     |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 557,736,779.41                           | 5,789,768.95                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 85,756,643.02                            | 202,846.78                                    |
| 基金投资收益                |            | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 471,221,498.28                           | 5,109,868.42                                  |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.1 | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 758,638.11                               | 477,053.75                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -399,210,133.36                          | 13,064,981.53                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 269,275.91                               | 15,845.75                                     |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 11,450,807.44                            | 4,969,145.31                                  |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 3,194,090.46                             | 800,449.60                                    |
| 2. 托管费                | 6.4.10.2.2 | 851,757.54                               | 213,453.25                                    |
| 3. 销售服务费              | 6.4.10.2.3 | 892,321.78                               | 242,418.06                                    |
| 4. 交易费用               | 6.4.7.19   | 2,829,202.44                             | 88,873.45                                     |
| 5. 利息支出               |            | 3,450,026.79                             | 3,423,360.22                                  |
| 其中：卖出回购金融资产支出         |            | 3,450,026.79                             | 3,423,360.22                                  |
| 6. 其他费用               | 6.4.7.20   | 233,408.43                               | 200,590.73                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以</b>   |            | 152,261,943.22                           | 16,389,345.52                                 |

|                   |  |                |               |
|-------------------|--|----------------|---------------|
| “-”号填列)           |  |                |               |
| 减：所得税费用           |  | -              | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 152,261,943.22 | 16,389,345.52 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信转债增强债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日      |                 |                   |
|--|--|-----------------|-------------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 864,030,098.17                             | 857,927,521.97  | 1,721,957,620.14  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 152,261,943.22  | 152,261,943.22    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -701,605,933.49                            | -766,255,099.85 | -1,467,861,033.34 |
| 其中：1.基金申购款                             | 51,597,685.18                              | 51,180,334.61   | 102,778,019.79    |
| 2.基金赎回款                                | -753,203,618.67                            | -817,435,434.46 | -1,570,639,053.13 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -               | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 162,424,164.68                             | 243,934,365.34  | 406,358,530.02    |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |                 |                   |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 251,117,189.14                             | 2,968,409.45    | 254,085,598.59    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数                     | -  | 16,389,345.52   | 16,389,345.52     |

|  |                 |               |                 |
|--|-----------------|---------------|-----------------|
| (本期利润)                                 |                 |               |                 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | -72,550,360.26  | -2,446,428.12 | -74,996,788.38  |
| 其中：1.基金申购款                             | 67,472,902.49   | 3,109,261.86  | 70,582,164.35   |
| 2.基金赎回款                                | -140,023,262.75 | -5,555,689.98 | -145,578,952.73 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -               | -             | -               |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 178,566,828.88  | 16,911,326.85 | 195,478,155.73  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|            |           |            |
|------------|-----------|------------|
| <u>孙志晨</u> | <u>何斌</u> | <u>秦绪华</u> |
| 基金管理人负责人   | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人    |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信转债增强债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第 504 号《关于核准建信转债增强债券型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信转债增强债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 5,279,275,175.83 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 178 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信转债增强债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,279,859,790.73 份基金份额,其中认购资金利息折合 584,614.90 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《建信转债增强债券型证券投资基金基金合同》和《建信转债增强债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购、申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,赎回时根据持有期限收

取赎回费用的，称为 A 类基金份额；不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信转债增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转债的比例不低于基金固定收益类证券资产的 80%；投资于现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；投资于股票和权证等权益类证券的比例不高于基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为  $60\% \times \text{天相可转债指数收益率} + 30\% \times \text{中国债券总指数收益率} + 10\% \times \text{沪深 300 指数收益率}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信转债增强债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的

通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 4,804,398.20           |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 4,804,398.20           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |               |              |
|----|------------------------|---------------|--------------|
|    | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票 | 68,422,239.79          | 75,422,827.75 | 7,000,587.96 |

|               |       |                |                |               |
|---------------|-------|----------------|----------------|---------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -              | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 400,851,520.33 | 408,116,420.07 | 7,264,899.74  |
|               | 银行间市场 | 40,818,120.00  | 40,797,000.00  | -21,120.00    |
|               | 合计    | 441,669,640.33 | 448,913,420.07 | 7,243,779.74  |
| 资产支持证券        |       | -              | -              | -             |
| 基金            |       | -              | -              | -             |
| 其他            |       | -              | -              | -             |
| 合计            |       | 510,091,880.12 | 524,336,247.82 | 14,244,367.70 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,689.05          |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 7,600.80          |
| 应收债券利息     | 3,978,889.09      |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 722.70            |
| 合计         | 3,988,901.64      |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015年6月30日 |
|----|-------------------|
|    |                   |



|             |              |
|-------------|--------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,880,551.70 |
| 银行间市场应付交易费用 | 781.75       |
| 合计          | 1,881,333.45 |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 6,630.47          |
| 预提费用        | 417,209.66        |
| 合计          | 423,840.13        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 建信转债增强债券 A    |                            |                 |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                 |
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额            |
| 上年度末          | 338,094,013.89             | 338,094,013.89  |
| 本期申购          | 16,944,171.96              | 16,944,171.96   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -288,391,398.92            | -288,391,398.92 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                          | -               |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                          | -               |
| 本期申购          | -                          | -               |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                          | -               |
| 本期末           | 66,646,786.93              | 66,646,786.93   |

金额单位：人民币元

| 建信转债增强债券 C    |                            |                 |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                 |
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额            |
| 上年度末          | 525,936,084.28             | 525,936,084.28  |
| 本期申购          | 34,653,513.22              | 34,653,513.22   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -464,812,219.75            | -464,812,219.75 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                          | -               |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                          | -               |
| 本期申购          | -                          | -               |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                          | -               |
| 本期末           | 95,777,377.75              | 95,777,377.75   |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 建信转债增强债券 A     |                 |                 |                 |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
| 上年度末           | 142,729,599.50  | 196,852,700.97  | 339,582,300.47  |
| 本期利润           | 220,504,709.44  | -158,540,997.32 | 61,963,712.12   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -250,805,590.90 | -49,518,505.38  | -300,324,096.28 |
| 其中：基金申购款       | 7,148,314.99    | 9,863,640.22    | 17,011,955.21   |
| 基金赎回款          | -257,953,905.89 | -59,382,145.60  | -317,336,051.49 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |
| 本期末            | 112,428,718.04  | -11,206,801.73  | 101,221,916.31  |

单位：人民币元

| 建信转债增强债券 C     |                 |                 |                 |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
| 上年度末           | 215,169,013.89  | 303,176,207.61  | 518,345,221.50  |
| 本期利润           | 330,967,367.14  | -240,669,136.04 | 90,298,231.10   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -387,487,210.33 | -78,443,793.24  | -465,931,003.57 |
| 其中：基金申购款       | 14,187,977.29   | 19,980,402.11   | 34,168,379.40   |
| 基金赎回款          | -401,675,187.62 | -98,424,195.35  | -500,099,382.97 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |
| 本期末            | 158,649,170.70  | -15,936,721.67  | 142,712,449.03  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入  | 84,780.90                       |
| 定期存款利息收入  | -                               |
| 其他存款利息收入  | -                               |
| 结算备付金利息收入 | 246,361.01                      |
| 其他        | 17,830.88                       |
| 合计        | 348,972.79                      |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 1,385,615,108.76     |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,299,858,465.74     |
| 买卖股票差价收入   | 85,756,643.02        |

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期                   |
|-------------------------------|----------------------|
|                               | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 471,221,498.28       |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                    |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                    |
| 合计                            | 471,221,498.28       |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 2,540,897,726.28     |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,055,471,391.24     |
| 减：应收利息总额               | 14,204,836.76        |
| 买卖债券差价收入               | 471,221,498.28       |

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 758,638.11                            |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                     |
| 合计          | 758,638.11                            |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -399,210,133.36                       |
| ——股票投资     | -50,197,897.19                        |
| ——债券投资     | -349,012,236.17                       |
| ——资产支持证券投资 | -                                     |
| ——贵金属投资    | -                                     |
| ——其他       | -                                     |
| 2. 衍生工具    | -                                     |
| ——权证投资     | -                                     |
| 3. 其他      | -                                     |
| 合计         | -399,210,133.36                       |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目           | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|--------------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入      | 242,460.31                            |
| 转换费收入 530020 | 14,684.85                             |
| 转换费收入 531020 | 12,130.75                             |
| 合计           | 269,275.91                            |

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产；

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 2,828,802.44                          |
| 银行间市场交易费用 | 400.00                                |
| 合计        | 2,829,202.44                          |

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------------------------|
| 审计费用   | 49,588.57                             |
| 信息披露费  | 148,718.11                            |
| 银行汇划费用 | 12,201.75                             |
| 其他费用   | 22,900.00                             |
| 合计     | 233,408.43                            |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 建信基金管理有限责任公司(“建信基金”)   | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国民生银行股份有限公司(“中国民生银行”) | 基金托管人、基金销售机构        |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金管理人的股东、基金销售机构     |
| 美国信安金融服务公司             | 基金管理人的股东            |
| 中国华电集团资本控股有限公司         | 基金管理人的股东            |

|              |           |
|--------------|-----------|
| 建信资本管理有限责任公司 | 基金管理人的子公司 |
|--------------|-----------|

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2015年1月1日至2015年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,194,090.46                   | 800,449.60                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 788,317.91                     | 298,510.09                          |

注：1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.75% / 当年天数；

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产里列支的费用项目。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015年1月1日至2015年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月<br>30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 851,757.54                     | 213,453.25                          |

注：支付基金托管人中国民生银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费           |

|                    | 建信转债增强债券<br>A                   | 建信转债增强债券<br>C | 合计         |
|--------------------|---------------------------------|---------------|------------|
| 中国建设银行             | -                               | 226,656.35    | 226,656.35 |
| 中国民生银行             | -                               | 37,692.52     | 37,692.52  |
| 建信基金管理有限责任公司       | -                               | 97,926.33     | 97,926.33  |
| 合计                 | -                               | 362,275.20    | 362,275.20 |
| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |               |            |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |               |            |
|                    | 建信转债增强债券<br>A                   | 建信转债增强债券<br>C | 合计         |
| 中国建设银行             | -                               | 173,567.54    | 173,567.54 |
| 中国民生银行             | -                               | 41,978.64     | 41,978.64  |
| 建信基金管理有限责任公司       | -                               | 10,703.26     | 10,703.26  |
| 合计                 | -                               | 226,249.44    | 226,249.44 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.35% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金管理有限责任公司，再由建信基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.35% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用自有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方<br>名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |          |
|-----------|----------------------------|-----------|---------------------------------|----------|
|           | 期末余额                       | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入   |
| 中国民生银行    | 4,804,398.20               | 84,780.90 | 497,608.86                      | 9,115.24 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况****6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期内未实施利润分配。

**6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |          |                 |                |        |       |        |              |            |            |    |
|----------------------|----------|-----------------|----------------|--------|-------|--------|--------------|------------|------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称     | 成功认购日           | 可流通日           | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：张) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 132002               | 15 天集 EB | 2015 年 6 月 11 日 | 2015 年 7 月 2 日 | 新债流通受限 | 99.99 | 99.99  | 6,870        | 686,939.77 | 686,939.77 | -  |

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

至本报告期末，本基金银行间市场无债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 134,000,000.00 元，于 2015 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管



理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程  
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督  
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和  
控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、  
监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的  
督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### 6.4.14 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人  
出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基  
金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，  
违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券  
交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发  
行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计  
及汇总。

##### 6.4.14.1.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.14.1.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2015年6月30日 | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 349,960,091.50    | 1,366,838,027.45    |
| AAA 以下 | 57,196,464.07     | 622,880,660.58      |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 407,156,555.57    | 1,989,718,688.03    |

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.14.2 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除 6.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.14.2.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.14.3 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.14.3.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资和买入返售金融资产等，本基金的基金管理人每日通过影子价格对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

## 6.4.14.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2015 年 6 月<br>30 日 | 1 年以内          | 1-5 年          | 5 年以上         | 不计息            | 合计             |
|---------------------------|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 资产                        |                |                |               |                |                |
| 银行存款                      | 4,804,398.20   | -              | -             | -              | 4,804,398.20   |
| 结算备付金                     | 16,890,627.14  | -              | -             | -              | 16,890,627.14  |
| 存出保证金                     | 1,606,142.68   | -              | -             | -              | 1,606,142.68   |
| 交易性金融资产                   | 17,976,625.20  | 384,774,708.17 | 46,162,086.70 | 75,422,827.75  | 524,336,247.82 |
| 衍生金融资产                    | -              | -              | -             | -              | -              |
| 买入返售金融资产                  | -              | -              | -             | -              | -              |
| 应收证券清算款                   | -              | -              | -             | 27,774,117.50  | 27,774,117.50  |
| 应收利息                      | -              | -              | -             | 3,988,901.64   | 3,988,901.64   |
| 应收股利                      | -              | -              | -             | -              | -              |
| 应收申购款                     | -              | -              | -             | -              | -              |
| 其他资产                      | -              | -              | -             | -              | -              |
| 资产总计                      | 41,277,793.22  | 384,774,708.17 | 46,162,086.70 | 107,185,846.89 | 579,400,434.98 |
| 负债                        |                |                |               |                |                |
| 卖出回购金融资产款                 | 134,000,000.00 | -              | -             | -              | 134,000,000.00 |
| 短期借款                      | -              | -              | -             | -              | -              |
| 交易性金融负债                   | -              | -              | -             | -              | -              |
| 衍生金融负债                    | -              | -              | -             | -              | -              |
| 应付证券清算款                   | -              | -              | -             | 7,600,304.00   | 7,600,304.00   |
| 应付赎回款                     | -              | -              | -             | 28,684,297.50  | 28,684,297.50  |
| 应付管理人报酬                   | -              | -              | -             | 293,012.78     | 293,012.78     |
| 应付托管费                     | -              | -              | -             | 78,136.77      | 78,136.77      |
| 应付销售服务费                   | -              | -              | -             | 80,980.33      | 80,980.33      |
| 应付交易费用                    | -              | -              | -             | 1,881,333.45   | 1,881,333.45   |
| 应交税费                      | -              | -              | -             | 0.00           | -              |
| 应付利息                      | -              | -              | -             | 0.00           | -              |

|                             |                |                  |                |                |                  |
|-----------------------------|----------------|------------------|----------------|----------------|------------------|
| 应付利润                        | -              | -                | -              | 0.00           | -                |
| 其他负债                        | -              | -                | -              | 423,840.13     | 423,840.13       |
| 负债总计                        | 134,000,000.00 | -                | -              | 39,041,904.96  | 173,041,904.96   |
| 利率敏感度缺口                     | -92,722,206.78 | 384,774,708.17   | 46,162,086.70  | 68,143,941.93  | 406,358,530.02   |
| 上年度末<br>2014 年<br>12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年            | 5 年以上          | 不计息            | 合计               |
| 资产                          |                |                  |                |                |                  |
| 银行存款                        | 110,412,577.84 | -                | -              | -              | 110,412,577.84   |
| 结算备付金                       | 37,012,484.07  | -                | -              | -              | 37,012,484.07    |
| 存出保证金                       | 424,418.66     | -                | -              | -              | 424,418.66       |
| 交易性金融资产                     | 295,934,524.50 | 1,501,648,882.96 | 242,136,280.57 | 293,202,750.13 | 2,332,922,438.16 |
| 衍生金融资产                      | -              | -                | -              | -              | -                |
| 买入返售金融资产                    | -              | -                | -              | -              | -                |
| 应收证券清算款                     | -              | -                | -              | -              | -                |
| 应收利息                        | -              | -                | -              | 9,043,759.33   | 9,043,759.33     |
| 应收股利                        | -              | -                | -              | -              | -                |
| 应收申购款                       | 18,234,795.16  | -                | -              | 76,000,915.25  | 94,235,710.41    |
| 其他资产                        | -              | -                | -              | -              | -                |
| 资产总计                        | 462,018,800.23 | 1,501,648,882.96 | 242,136,280.57 | 378,247,424.71 | 2,584,051,388.47 |
| 负债                          |                |                  |                |                |                  |
| 卖出回购金融资产款                   | 733,461,980.10 | -                | -              | -              | 733,461,980.10   |
| 短期借款                        | -              | -                | -              | -              | -                |
| 交易性金融负债                     | -              | -                | -              | -              | -                |
| 衍生金融负债                      | -              | -                | -              | -              | -                |
| 应付证券清算款                     | -              | -                | -              | 39,376,900.79  | 39,376,900.79    |
| 应付赎回款                       | -              | -                | -              | 86,701,238.67  | 86,701,238.67    |
| 应付管理人报酬                     | -              | -                | -              | 794,660.07     | 794,660.07       |
| 应付托管费                       | -              | -                | -              | 211,909.38     | 211,909.38       |
| 应付销售服务费                     | -              | -                | -              | 222,103.16     | 222,103.16       |
| 应付交易费用                      | -              | -                | -              | 754,653.90     | 754,653.90       |
| 应交税费                        | -              | -                | -              | -              | -                |

|         |                 |                  |                |                |                  |
|---------|-----------------|------------------|----------------|----------------|------------------|
| 应付利息    | -               | -                | -              | 65,537.76      | 65,537.76        |
| 应付利润    | -               | -                | -              | -              | -                |
| 其他负债    | -               | -                | -              | 504,784.50     | 504,784.50       |
| 负债总计    | 733,461,980.10  | -                | -              | 128,631,788.23 | 862,093,768.33   |
| 利率敏感度缺口 | -271,443,179.87 | 1,501,648,882.96 | 242,136,280.57 | 249,615,636.48 | 1,721,957,620.14 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.14.3.1.2 利率风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|----|-------------|-----------------------------|-------------------|
|    |             | 本期末（2015年6月30日）             | 上年度末（2014年12月31日） |
|    | 市场利率上升25个基点 | -2,854,765.69               | -2,557,116.54     |
|    | 市场利率下降25个基点 | 2,857,836.71                | 2,559,621.60      |

#### 6.4.14.3.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

#### 6.4.14.3.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%，其中投资于可转债的比例不低于基金固定收益类证券资产的80%；投资于现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；投资于股票和权证等权益类证券的比例不高于基金资产的20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施

监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.14.3.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2015年6月30日 |                          | 上年度末<br>2014年12月31日 |                       |
|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
|               | 公允价值              | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 75,422,827.75     | 18.56                    | 293,202,750.13      | 17.03                 |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                 | -                        | -                   | -                     |
| 交易性金融资产-债券投资  | 448,913,420.07    | 110.47                   | 2,039,719,688.03    | 118.45                |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                 | -                        | -                   | -                     |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                 | -                        | -                   | -                     |
| 其他            | -                 | -                        | -                   | -                     |
| 合计            | 524,336,247.82    | 129.03                   | 2,332,922,438.16    | 135.48                |

#### 6.4.14.3.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例如附注 6.4.13.4.3.1 所示，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年末：同)。

#### 6.4.14.3.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 121,311,989.72 元，属于第二层次的余额为 403,024,258.10 元，无属于第三层次的余额(2014 年 6 月 30 日：第一层次 296,475,628.52 元，第二层次 30,271,000.00 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 26 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资   | 75,422,827.75  | 13.02         |
|    | 其中：股票  | 75,422,827.75  | 13.02         |
| 2  | 固定收益投资 | 448,913,420.07 | 77.48         |
|    | 其中：债券  | 448,913,420.07 | 77.48         |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 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      | 21,695,025.34  | 3.74   |
| 7 | 其他各项资产            | 33,369,161.82  | 5.76   |
| 8 | 合计                | 579,400,434.98 | 100.00 |

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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              | 1,407,742.20  | 0.35         |
| C  | 制造业              | 32,669,992.43 | 8.04         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | 13,309,410.00 | 3.28         |
| F  | 批发和零售业           | 9,554,000.00  | 2.35         |
| 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  | 7,959,183.12  | 1.96         |
| J  | 金融业              | 10,522,500.00 | 2.59         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| 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    | -             | -            |
| 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               | 75,422,827.75 | 18.56        |

注：以上行业分类以 2015 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。



## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 601668 | 中国建筑 | 1,600,000 | 13,296,000.00 | 3.27         |
| 2  | 002241 | 歌尔声学 | 330,000   | 11,847,000.00 | 2.92         |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 610,000   | 10,522,500.00 | 2.59         |
| 4  | 002408 | 齐翔腾达 | 571,702   | 9,798,972.28  | 2.41         |
| 5  | 600755 | 厦门国贸 | 850,000   | 9,554,000.00  | 2.35         |
| 6  | 601929 | 吉视传媒 | 526,401   | 7,959,183.12  | 1.96         |
| 7  | 000999 | 华润三九 | 229,961   | 6,988,514.79  | 1.72         |
| 8  | 002521 | 齐峰新材 | 281,083   | 3,912,675.36  | 0.96         |
| 9  | 603993 | 洛阳钼业 | 113,895   | 1,407,742.20  | 0.35         |
| 10 | 603355 | 莱克电气 | 1,000     | 49,060.00     | 0.01         |
| 11 | 300485 | 赛升药业 | 500       | 33,505.00     | 0.01         |
| 12 | 603198 | 迎驾贡酒 | 1,000     | 28,360.00     | 0.01         |
| 13 | 002775 | 文科园林 | 500       | 13,410.00     | 0.00         |
| 14 | 002765 | 蓝黛传动 | 500       | 11,905.00     | 0.00         |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 601988 | 中国银行 | 313,129,199.92 | 18.18          |
| 2  | 600219 | 南山铝业 | 267,409,791.03 | 15.53          |
| 3  | 600795 | 国电电力 | 195,905,891.87 | 11.38          |
| 4  | 600023 | 浙能电力 | 176,147,710.03 | 10.23          |
| 5  | 002408 | 齐翔腾达 | 41,917,881.03  | 2.43           |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 27,899,464.32  | 1.62           |
| 7  | 002491 | 通鼎互联 | 25,522,117.83  | 1.48           |
| 8  | 002521 | 齐峰新材 | 22,021,882.20  | 1.28           |
| 9  | 601929 | 吉视传媒 | 12,364,466.04  | 0.72           |
| 10 | 600755 | 厦门国贸 | 11,685,020.88  | 0.68           |
| 11 | 601166 | 兴业银行 | 11,053,732.27  | 0.64           |
| 12 | 002241 | 歌尔声学 | 10,804,090.61  | 0.63           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 13 | 600028 | 中国石化 | 9,353,116.70 | 0.54 |
| 14 | 600356 | 恒丰纸业 | 5,131,663.62 | 0.30 |
| 15 | 603993 | 洛阳钼业 | 1,407,742.20 | 0.08 |
| 16 | 601211 | 国泰君安 | 137,970.00   | 0.01 |
| 17 | 601985 | 中国核电 | 64,410.00    | 0.00 |
| 18 | 600958 | 东方证券 | 50,150.00    | 0.00 |
| 19 | 601198 | 东兴证券 | 27,540.00    | 0.00 |
| 20 | 603118 | 共进股份 | 23,900.00    | 0.00 |

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额       | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 601988 | 中国银行 | 323,803,587.77 | 18.80          |
| 2  | 600219 | 南山铝业 | 267,748,612.49 | 15.55          |
| 3  | 600795 | 国电电力 | 199,229,166.92 | 11.57          |
| 4  | 600023 | 浙能电力 | 176,589,258.40 | 10.26          |
| 5  | 601318 | 中国平安 | 52,308,163.08  | 3.04           |
| 6  | 002408 | 齐翔腾达 | 46,000,369.46  | 2.67           |
| 7  | 600067 | 冠城大通 | 37,454,736.56  | 2.18           |
| 8  | 002521 | 齐峰新材 | 33,444,995.21  | 1.94           |
| 9  | 600999 | 招商证券 | 28,828,374.10  | 1.67           |
| 10 | 002241 | 歌尔声学 | 26,789,512.25  | 1.56           |
| 11 | 002491 | 通鼎互联 | 24,870,721.80  | 1.44           |
| 12 | 601006 | 大秦铁路 | 24,695,844.76  | 1.43           |
| 13 | 000024 | 招商地产 | 21,047,939.78  | 1.22           |
| 14 | 601299 | 中国北车 | 18,302,993.28  | 1.06           |
| 15 | 600026 | 中海发展 | 14,657,659.55  | 0.85           |
| 16 | 601668 | 中国建筑 | 13,758,000.00  | 0.80           |
| 17 | 601929 | 吉视传媒 | 12,217,946.66  | 0.71           |
| 18 | 600585 | 海螺水泥 | 11,997,858.00  | 0.70           |
| 19 | 600037 | 歌华有线 | 11,628,051.00  | 0.68           |
| 20 | 600028 | 中国石化 | 9,190,838.65   | 0.53           |

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,132,276,440.55 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,385,615,108.76 |

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 959,864.50     | 0.24         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 40,797,000.00  | 10.04        |
|    | 其中：政策性金融债 | 40,797,000.00  | 10.04        |
| 4  | 企业债券      | 361,267,393.60 | 88.90        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债       | 45,889,161.97  | 11.29        |
| 8  | 其他        | -              | -            |
| 9  | 合计        | 448,913,420.07 | 110.47       |

## 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 126018 | 08 江铜债   | 3,555,300 | 349,734,861.00 | 86.07        |
| 2  | 140440 | 14 农发 40 | 300,000   | 30,792,000.00  | 7.58         |
| 3  | 113007 | 吉视转债     | 247,530   | 30,666,491.70  | 7.55         |
| 4  | 100306 | 10 进出 06 | 100,000   | 10,005,000.00  | 2.46         |
| 5  | 128009 | 歌尔转债     | 55,000    | 8,732,900.00   | 2.15         |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.10.2 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。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

本基金投资的前十名证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。

### 7.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,606,142.68  |
| 2  | 应收证券清算款 | 27,774,117.50 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 3,988,901.64  |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 33,369,161.82 |

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值 |
|----|------|------|------|---------|
|----|------|------|------|---------|

|   |        |      |               | 比例 (%) |
|---|--------|------|---------------|--------|
| 1 | 113007 | 吉视转债 | 30,666,491.70 | 7.55   |
| 2 | 128009 | 歌尔转债 | 8,732,900.00  | 2.15   |
| 3 | 113501 | 洛钼转债 | 5,577,600.00  | 1.37   |

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别       | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构        |        |                |        |
|------------|----------|-----------|--------------|--------|----------------|--------|
|            |          |           | 机构投资者        |        | 个人投资者          |        |
|            |          |           | 持有份额         | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 建信转债增强债券 A | 12,116   | 5,500.73  | 10,000.00    | 0.02%  | 66,636,786.93  | 99.98% |
| 建信转债增强债券 C | 13,818   | 6,931.35  | 4,182,458.43 | 4.37%  | 91,594,919.32  | 95.63% |
| 合计         | 25,934   | 6,262.98  | 4,192,458.43 | 2.58%  | 158,231,706.25 | 97.42% |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别       | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 建信转债增强债券 A | 6.89      | 0.00%    |
|                  | 建信转债增强债券 C | 19,204.56 | 0.02%    |

|  |    |           |       |
|--|----|-----------|-------|
|  | 合计 | 19,211.45 | 0.01% |
|--|----|-----------|-------|

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 建信转债增强债券 A     | 建信转债增强债券 C       |
|--------------------------------|----------------|------------------|
| 基金合同生效日（2012 年 5 月 29 日）基金份额总额 | 634,015,836.67 | 4,645,843,954.06 |
| 本报告期初基金份额总额                    | 338,094,013.89 | 525,936,084.28   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 16,944,171.96  | 34,653,513.22    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 288,391,398.92 | 464,812,219.75   |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -              | -                |
| 本报告期末基金份额总额                    | 66,646,786.93  | 95,777,377.75    |

注：上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

我公司于 2015 年 3 月 26 日召开 2015 年度第一次临时股东会会议，决定解聘杨文升先生、欧阳伯权先生公司董事职务，并解聘顾建国先生独立董事职务，批准聘任许会斌先生、张维义先生为公司董事，以及李全先生为公司独立董事。2015 年 3 月 26 日公司召开第四届董事会第一次会议，会议选举许会斌先生为公司董事长。2015 年 5 月 28 日，公司依法完成了法定代表人变更手续，许会斌先生为法定代表人。公司已根据相关法律法规要求，在指定媒体公开披露了公司前述人员的变更信息，并已在监管机构备案。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 应支付该券商的佣金    |            | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
|      |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东兴证券 | 1      | 1,246,504,431.86 | 87.37%       | 1,075,499.86 | 86.76%     | -  |
| 光大证券 | 1      | 180,259,897.66   | 12.63%       | 164,108.65   | 13.24%     | -  |
| 天源证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

- （1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- （3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个股、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人。能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；

(4) 佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人；

3、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易             |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------|------------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额             | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东兴证券 | 1,917,890,058.09 | 88.58%       | 23,545,700,000.00 | 99.50%         | -    | -            |
| 光大证券 | 247,336,035.84   | 11.42%       | 119,500,000.00    | 0.50%          | -    | -            |
| 天源证券 | -                | -            | -                 | -              | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式      | 法定披露日期     |
|----|--|-------------|------------|
| 1  | 关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行及手机银行基金申购费率优惠活动的公告            | 指定报刊和/或公司网站 | 2015年6月27日 |
| 2  | 建信基金管理有限责任公司关于新增上海汇付金融服务有限公司为旗下代销机构并参加申购费率优惠活动的公告    | 指定报刊和/或公司网站 | 2015年6月2日  |
| 3  | 关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告                             | 指定报刊和/或公司网站 | 2015年5月28日 |
| 4  | 关于公司旗下部分开放式基金开通基金转换业务的公告                             | 指定报刊和/或公司网站 | 2015年5月27日 |
| 5  | 关于继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告                      | 指定报刊和/或公司网站 | 2015年3月28日 |
| 6  | 关于新增北京晟视天下投资管理有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2015年3月21日 |
| 7  | 关于公司旗下部分开放式基金参加和讯科技申购费率优惠活动的公告                       | 指定报刊和/或公司网站 | 2015年3月11日 |



|    |   |             |                 |
|----|---|-------------|-----------------|
| 8  | 关于新增广州证券为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告                                 | 指定报刊和/或公司网站 | 2015 年 3 月 7 日  |
| 9  | 建信基金管理有限责任公司关于《关于新增华夏银行为旗下部分开放式基金代销机构并参加华夏银行费率优惠活动的公告》的更正公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2015 年 1 月 30 日 |
| 10 | 关于新增华夏银行为旗下部分开放式基金代销机构并参加华夏银行费率优惠活动的公告                      | 指定报刊和/或公司网站 | 2015 年 1 月 28 日 |
| 11 | 建信基金管理有限责任公司关于开展直销网上交易基金转换费率优惠活动的更新公告                       | 指定报刊和/或公司网站 | 2015 年 1 月 6 日  |

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信转债增强债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信转债增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信转债增强债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信转债增强债券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。

### 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 11.3 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 8 月 29 日