

# 建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金 2016 年第 1 季度报告

2016 年 3 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银河证券股份有限公司

报告送出日期：2016 年 4 月 20 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。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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 2016 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	建信网金融分级		
场内简称	网金融		
基金主代码	165315		
交易代码	165315		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 7 月 31 日		
报告期末基金份额总额	906,211,286.59 份		
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。		
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。		
业绩比较基准	中证互联网金融指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	中国银河证券股份有限公司		
下属分级基金简称	建信网金融分级	建信网金融分级 A	建信网金融分级 B
下属分级场内简称	网金融	网金融 A	网金融 B

下属分级基金交易代码	165315	150331	150332
下属分级基金报告期末基金份额总额	372, 181, 732. 59 份	267, 014, 777. 00 份	267, 014, 777. 00 份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	建信网金 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征。	建信网金 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

### §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（2016年1月1日—2016年3月31日）
1. 本期已实现收益	-3, 803, 998. 93
2. 本期利润	-9, 517, 173. 12
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0866
4. 期末基金资产净值	784, 509, 500. 17
5. 期末基金份额净值	0. 8657

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。

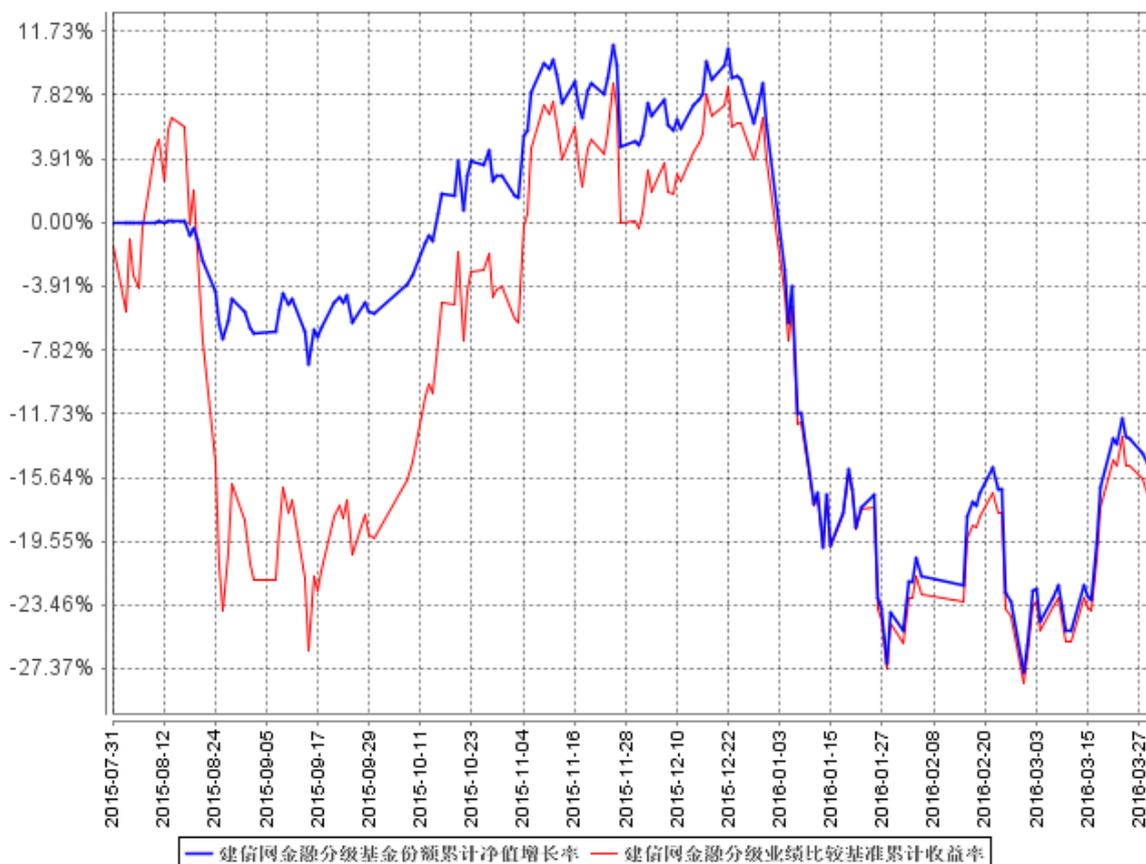
#### 3.2 基金净值表现

##### 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 偏差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	-17. 47%	3. 33%	-17. 10%	3. 17%	-0. 37%	0. 16%

### 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

建信网金融分级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：1、本基金基金合同于 2015 年 7 月 31 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相关规定。

## §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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理、本基金的基金经理	2015 年 7 月 31 日	-	12	特许金融分析师（CFA），2003 年 1 月获清华大学经济学博士学位。2003 年 1 月至 2005 年 8 月就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。

				<p>2005 年 8 月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部总监、金融工程及指数投资部总监。2009 年 11 月 5 日起任建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理；2010 年 5 月 28 日至 2012 年 5 月 28 日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；2011 年 9 月 8 日起任深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2012 年 3 月 16 日起任建信深证 100 指数增强型证券投资基金基金经理；2015 年 3 月 25 日起任建信双利分级股票基金的基金经理；2015 年 7 月 31 日起任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金基金经理；2015 年 8 月 6 日起任建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金基金经理。</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，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《建信中证互联网金融指数分级发起式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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金成立于 2015 年 3 季度，管理人根据基金合同规定，在本报告期初完成了建仓，开始跟踪指数的运作。

在报告期末段，基金所跟踪的标的指数出现明显反弹，吸引资金流入。连续多个交易日，每日均有超过 10% 的净申购，基金规模在短时间内扩大数倍。由于申购款在 T+2 日才可到帐使用，在此期间基金仓位被明显稀释，跟踪误差有所放大。基金管理人已在法律法规和基金合同规定的范围内，尽可能提升仓位以减小跟踪误差。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-17.47%，波动率 3.33%，业绩比较基准收益率-17.10%，波动率 3.17%。

## §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	450,828,254.06	52.83
	其中：股票	450,828,254.06	52.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	108,749,650.34	12.74
8	其他资产	293,843,643.79	34.43
9	合计	853,421,548.19	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境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	101,533,320.14	12.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,005,694.13	2.42
G	交通运输、仓储和邮政业	3,079,104.00	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	170,964,215.36	21.79
J	金融业	105,854,803.43	13.49
K	房地产业	26,871,788.12	3.43
L	租赁和商务服务业	23,470,877.00	2.99
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	450,779,802.18	57.46

注：以上行业分类以 2016 年 3 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境内股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	48,451.88	0.01
D	电力、热力、燃气及水生	-	-

	产和供应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	48,451.88	0.01

注：以上行业分类以 2016 年 3 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

## 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	601166	兴业银行	1,123,925	17,454,555.25	2.22
2	600177	雅戈尔	1,150,251	17,391,795.12	2.22
3	600109	国金证券	1,195,100	17,245,293.00	2.20
4	601318	中国平安	529,700	16,849,757.00	2.15
5	600570	恒生电子	282,600	16,486,884.00	2.10
6	002385	大北农	1,374,156	16,215,040.80	2.07
7	000001	平安银行	1,514,600	16,115,344.00	2.05
8	601555	东吴证券	1,186,585	15,912,104.85	2.03
9	002024	苏宁云商	1,298,689	14,869,989.05	1.90
10	600446	金证股份	389,700	14,422,797.00	1.84

### 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	300474	景嘉微	2,467	48,451.88	0.01

### 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

本报告期本基金未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，恒生电子股份有限公司（600570）于 2015 年 8 月 19 日发布公告：收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》。因恒生网络涉嫌违反证券、期货法律法规，中国证券监督管理委员会决定对恒生网络进行立案调查。2015 年 9 月 2 日，案件调查审理完毕，因向不具有经营证券业务资质的客户销售系统、提供相关服务，并获取非法收益，严重扰乱证券市场秩序，恒生网络被处没收违法所得 132,852,384.06 元，并处以 398,557,152.18 元罚款。

### 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	34,503.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,356.98
5	应收申购款	293,796,783.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	293,843,643.79

### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

**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中未存在流通受限情况。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	建信网金融分级	建信网金融分级	建信网金融分级
		A	B
报告期期初基金份额总额	44,514,200.61	17,764,994.00	17,764,994.00
报告期期间基金总申购份额	853,415,934.91	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	27,248,836.93	-	-
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-498,499, 566.00	249,249,783.00	249,249,783.00
报告期期末基金份额总额	372,181,732.59	267,014,777.00	267,014,777.00

注：1、上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额；

2、拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

**§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**

单位：份

报告期初管理人持有的本基金份额	10,106,851.58
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,106,851.58
报告期期末持有的本基金份额占基金总份 额比例 (%)	1.12

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

本基金本报告期末发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况**

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份 额比例 (%)	发起份 额总 数	发起份 额占 基金总份 额比例 (%)	发起份 额承 诺持有期限
基金管理人固有资 金	10,106,851.58	1.12	10,001,250.00	1.10	不低于三年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,106,851.58	1.12	10,001,250.00	1.10	-

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证互联网金融指数分级发起式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。

### 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 9.3 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  
2016年4月20日