

## 建信恒久价值股票型证券投资基金

[2014] 第一季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2014年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2014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2014年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称		
S30001		建信恒久价值股票
基金代码		S30001
基金运作方式		契约型开放式
基金合同生效日		2005年12月1日
报告期末基金份额总额		3,540,711,580.729

有效报告期的基金资产净值增长率长期稳定增长。

采用上证综合指数的资产配置和在当下的资产配置比例相符合的投资者策略,主要投资于具有持续

回报率的股票,价值投资且具有持续回报的上市公司的股票,从而为基金持有人提供稳定的股息回报。

基金经理对基金的评价:建信恒久价值股票型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2014年1月1日起至3月31日止。

§ 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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)

1.本期已实现收益

-11,825,110.02

2.本期利润

-78,903,967.07

3.加权平均基金份额本期利润

-0.0199

4.期末基金资产净值

1,867,176,738.53

5.期末基金份额净值

0.5273

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.所列财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价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 本期报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 基金业績比较基准收益率③ 基金业績比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -3.99% 1.35% -4.80% 0.89% 0.81% 0.46%

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

3.3 主要财务指标

3.3.1 本期报告期前十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600887 伊利股份 3,205,299 114,853,863.17 6.15

2 300020 丽珠集团 2,353,562 80,079,363.96 4.29

3 300166 东方国信 2,214,331 79,273,049.80 4.25

4 600261 阳光照明 3,621,605 78,101,135.00 3.10

5 000625 长安汽车 5,711,466 64,586,833.92 2.93

6 300054 丽珠集团 4,677,473 51,723,813.38 2.77

7 600351 亚宝药业 6,945,875 51,330,016.25 2.75

8 009566 海南药 4,908,402 50,725,267.68 2.72

9 002063 远光软件 2,064,857 43,981,454.10 2.36

10 000653 丽珠集团 1,443,330 40,413,240.00 2.16

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9 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股指期货投资明细

无。

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资组合持有的股指期货

本基金报告期末未持有股指期货。

5.10 本报告期末未持有股票投资组合的公允价值。

5.11 本报告期末按报告期前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日

前一年内受到行政处罚、处罚。

5.12 基金管理人对报告期内本基金投资运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内,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

金份额持有人谋取利益,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《建信恒久价值股票型证券投资基金合同》的规定。

5.13 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人,保护投资者利益,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》、《证券投资基金托管人内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易

制度指导意见》、《基金管理人特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规及公司内部制度,制

定和修订了《公平交易管理制度》、《公平交易管理办法》、《公平交易操作流程》、《利益冲突防范

办法》、《风险管理办法》。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实

行交易时,系统会自动剔除公平交易模块执行操作,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。

5.14 管理人对交易行为的专项说明

本基金报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超

过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的经营业绩和运作分析说明

4.4.1 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.2 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.3 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.4 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.5 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.6 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.7 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.8 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.9 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.10 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.11 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.12 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.13 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.14 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.15 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.16 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.17 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.18 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.19 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.20 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.21 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.22 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.23 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.24 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.25 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.26 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.27 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.28 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.29 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.30 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.31 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.32 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.33 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.34 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.35 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.36 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.37 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.38 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.39 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.40 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.41 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.42 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.43 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.44 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.45 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.46 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.47 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.48 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.49 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.50 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.51 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.52 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.53 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.54 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.55 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.56 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.57 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.58 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.59 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.60 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.61 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.62 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.63 报告期内基金的经营业绩和运作分析

4.4.64 报告期内基金的经营业绩和运作分析