

## 建信核心精选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:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:2014年4月22日

§ 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、完整性和及时性承担个别及连带责任。  
基金托管人中国工商银行股份有限公司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。  
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。

本报告期未发生巨额赎回。

§ 2 基金产品概况

| 基金简称       | 建信核心精选股票   |
|------------|--|
| 基金代码       | 530004   |
| 运作方式       | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2008年11月25日  |
| 报告期末基金份额总额 | 1,192,055,951.03份  |
| 投资目标       | 本基金通过精选具有良好的环境、市场环境、行业特征和公司基本面的人研究，精选具有良好成长性和价值性的上市股票投资，在有效控制风险的前提下实现基金资产的长期稳定增值。                              |
| 投资策略       | 本基金主要投资于具有良好成长性和价值性的股票，具体情况如下：1、本基金将根据宏观经济环境、市场环境、行业特征和公司基本面的研究，精选具有良好成长性和价值性的上市股票投资，在有效控制风险的前提下实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 业绩比较基准     | 深证成份指数收益率×75%+沪深300指数收益率×25%   |
| 风险收益特征     | 本基金是一只股票型证券投资基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金等其他类型的基金。  |
| 基金经理       | 建信基金管理有限责任公司   |
| 基金总资产      | 1,192,055,951.03元  |
| 基金总负债      | 1,192,055,951.03元  |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

| 单位:人民币元      | 报告期(2014年1月1日 - 2014年3月31日) |
|--------------|-----------------------------|
| 本期初所有者权益     | 55,961,660.05               |
| 本期利润         | -14,620,612.47              |
| 加权平均基金份额本期利润 | 1.202,330.00                |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.0499                      |

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，计算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

■ 表现最好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  | 600887 | 伊利股份 | 1,309,438 | 46,917,635.54 | 3.90         |
| 2  | 600109 | 国电电力 | 2,283,671 | 42,521,954.02 | 3.54         |
| 3  | 300058 | 蓝思科技 | 539,076   | 26,938,000.00 | 2.24         |
| 4  | 300007 | 智飞生物 | 778,993   | 25,730,187.99 | 2.14         |
| 5  | 002437 | 瑞凌股份 | 459,100   | 24,451,666.00 | 2.03         |
| 6  | 002353 | 杰瑞股份 | 387,206   | 23,309,801.20 | 1.94         |
| 7  | 000024 | 深南电A | 1,080,062 | 20,369,932.3  | 1.69         |
| 8  | 000625 | 长安汽车 | 2,121,250 | 20,303,625.00 | 1.69         |
| 9  | 600376 | 开能设备 | 3,929,719 | 19,255,623.10 | 1.60         |
| 10 | 600557 | 康得新  | 584,923   | 17,834,302.27 | 1.48         |

§ 5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

■ 表现最好的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券品种  | 债券名称 | 数量(张)         | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------|------|---------------|----------------|--------------|
| 1  | 国债    | 国债   | 70,350,000.00 | 5.85           |              |
| 2  | 企业债   | -    | -             | -              | -            |
| 3  | 金融债   | -    | -             | -              | -            |
| 4  | 企业债券  | -    | -             | -              | -            |
| 5  | 短期融资券 | -    | -             | -              | -            |
| 6  | 中期票据  | -    | -             | -              | -            |
| 7  | 可转债   | -    | -             | -              | -            |
| 8  | 其他    | -    | -             | -              | -            |
| 9  | 合计    | -    | -             | 119,215,000.00 | 9.92         |

§ 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贵金属投资明细

■ 表现最好的前十名贵金属投资明细

| 序号 | 债券代码    | 债券名称     | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019322  | 13国债22   | 700,000 | 70,350,000.00 | 5.85         |
| 2  | 1382166 | 13国债MTN1 | 500,000 | 48,865,000.00 | 4.06         |

§ 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五名权证投资明细

■ 表现最好的前十名权证投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019322 | 13国债22 | 700,000 | 70,350,000.00 | 5.85         |

§ 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股指期货投资明细

■ 表现最好的前十名股指期货投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019322 | 13国债22 | 700,000 | 70,350,000.00 | 5.85         |

§ 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

■ 表现最好的前十名权证投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019322 | 13国债22 | 700,000 | 70,350,000.00 | 5.85         |

§ 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

■ 表现最好的前十名股指期货投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019322 | 13国债22 | 700,000 | 70,350,000.00 | 5.85         |

§ 5.10 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国债期货投资明细

■ 表现最好的前十名国债期货投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019322 | 13国债22 | 700,000 | 70,350,000.00 | 5.85         |

§ 5.11 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票期权投资明细

■ 表现最好的前十名股票期权投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019322 | 13国债22 | 700,000 | 70,350,000.00 | 5.85         |

§ 5.12 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商品期货投资明细

■ 表现最好的前十名商品期货投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019322 | 13国债22 | 700,000 | 70,350,000.00 | 5.85         |

§ 5.13 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黄金白银投资明细

■ 表现最好的前十名黄金白银投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量(张)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019322 | 13国债22 | 700,000 | 70,350,000.00 | 5.85         |

§ 5.14 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证券投资基金投资明细

■ 表现最好的前十名证券投资基金投资明细