建信货币市场基金

【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

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信货币
基金主代码	530002
交易代码	530002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月25日
报告期末基金份额总额	17,996,653,858.16份
投资目标	在力保本金安全和基金财产较高流动性的前提下,争取获得超过投资基准的收益率。
投资策略	综合运用定量分析和定性分析手段,全面评估货币市场的利率走势、类属资产和券种的风险收益水平及流动性特征,在此基础上制订本基金投资策略。具体而言,包括短期资金利率走势预测、组合剩余期限调整策略、债券期限配置策略、类属资产配置策略、品种选择策略和交易策略等方面。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为6个月银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期收益和风险均低于债券基金、混合基金、股票基金。
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

§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	263,120,513.43
2.本期利润	263,120,513.43
3.期末基金资产净值	17,996,653,858.16

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入本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

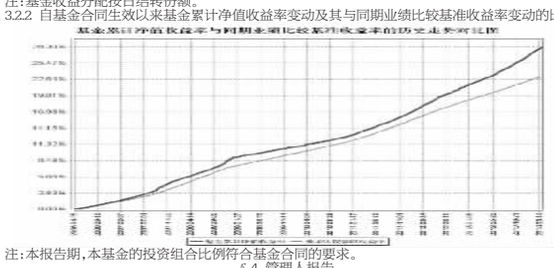
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.2504%	0.0027%	0.7024%	0.0000%	0.5480%	0.0027%

注:基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
于艳辉	本基金的基金经理	2013年8月5日	-	5	于艳辉女士,硕士。2008年6月加入国泰人寿保险公司,任固定收益研究专员;2009年9月加入金元惠理基金管理公司,联合北京基金管理公司,任债券研究员;2011年6月加入民生证券,任债券研究员,基金经理助理;2013年8月5日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月20日起任建信双利策略债券型证券基金基金经理。
彭江峰	本基金的基金经理	2012年2月17日	2014年1月20日	8	硕士,曾任中信期货有限公司期货分析师,国泰君安期货经纪有限公司研究员,国泰君安期货研究所副所长,2006年5月起就职于新华基金管理公司,历任债券研究员、投资经理、基金经理等职,2010年5月31日至2014年4月14日期间任相继担任债券型证券投资基金基金经理。彭江峰于2013年6月5日、2013年11月30日至2013年5月20日期间任建信货币基金型证券投资基金基金经理;2012年2月17日至2014年1月20日期间任建信货币市场基金基金经理;2012年5月29日起至2013年11月30日期间任建信增强债券型证券投资基金基金经理;2013年7月26日起至2014年3月20日期间任建信核心精选股票型证券投资基金基金经理。2013年11月5日起任建信安心精神债券型证券投资基金基金经理。
陈建民	本基金的基金经理	2013年12月18日	-	6年	2005年4月加入中国建设银行第门分行,任客户经理;2007年4月调入中国建设银行总行金融市场部,任债券交易员;2013年9月加入南京证券股份有限公司基金管理部,2013年12月20日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月20日起任建信月盈安心理财基金基金经理。
高翔	本基金的基金经理	2013年12月28日	-	7	硕士,2006年7月至2007年4月期间任中信证券公司工作,任交易员;2007年4月加入建信基金管理公司,历任初级交易员、交易员;2009年7月起任建信货币市场基金的基金经理助理,2012年3月20日起任债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年11月20日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年5月17日起任建信安心理财债券型证券投资基金基金经理。

§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	固定收益投资	7,409,768,307.10	38.32
	其中:债券	7,409,768,307.10	38.32
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,636,155,654.23	8.46
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	9,980,184,670.14	51.61
4	其他资产	310,524,688.19	1.61
5	合计	19,336,633,319.66	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.66	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,304,348,947.82	7.25
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	30.42	7.25
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.00	-
2	30天(含)-60天	22.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	22.39	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.22	-
4	90天(含)-180天	12.69	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	18.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	105.72	7.25

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,058,298,816.49	16.99
	其中:政策性金融债	1,757,542,777.61	9.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,151,162,443.21	23.07
6	中期票据	200,307,047.40	1.11
7	其他	-	-
8	合计	7,409,768,307.10	41.17
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	399,563,206.12	2.22

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140204	14国开04	2,800,000	280,336,334.19	1.56
2	130236	13国开36	2,600,000	259,124,521.07	1.44
3	041353034	13武钢CP002	2,000,000	200,663,682.91	1.12
4	071404001	14广发CP001	2,000,000	200,146,033.45	1.11
5	041359020	13川铁投CP001	1,800,000	180,053,479.93	1.00
6	011324003	13中冶SCP003	1,600,000	160,086,735.14	0.89
7	041361026	13津城建CP001	1,600,000	159,831,988.74	0.89
8	011482001	14太钢SCP001	1,600,000	159,823,571.15	0.89
9	071428001	14方正证券CP001	1,500,000	150,182,739.00	0.83
10	011468001	14中材集SCP001	1,500,000	150,128,002.34	0.83

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1013%
报告期内偏离度的最低值	-0.0265%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0487%

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十名资产支持证券投资明细

无。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.2 基金投资的前十名债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。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	197,878,261.57
4	应收申购款	112,646,426.62
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	310,524,688.19

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	29,554,108,555.58
报告期期间基金总申购份额	42,720,425,634.42
减:报告期期间基金总赎回份额	54,277,880,331.84
报告期期末基金份额总额	17,996,653,858.16

注:上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2014年2月21日	120,000,000.00	120,000,000.00	-
2	转换转出	2014年3月28日	-20,000,000.00	-19,999,000.00	-
3	红利再投资	2014年2月28日	52,518.18	52,518.18	-
4	红利再投资	2014年3月28日	391,608.33	391,608.33	-
合计			100,444,126.51	100,445,126.51	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信货币市场基金设立的文件;

2、《建信货币市场基金基金合同》;

3、《建信货币市场基金招募说明书》;

4、《建信货币市场基金托管协议》;

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。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 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

2014年4月22日

建信优化配置混合型证券投资基金

【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

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信优化配置混合
基金主代码	530005
交易代码	530005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月1日
报告期末基金份额总额	7,194,757,626.79份
投资目标	通过合理的资产配置和积极的证券选择,在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。
投资策略	基金管理人对宏观经济、行业及上市公司、债券、货币市场工具等进行定性与定量相结合的研究,运用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在大类资产配置这一宏观层面与个股个券选择这一微观层面优化投资组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:60%×富时中国A600指数+40%×中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
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

§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	268,859,852.34
2.本期利润	-233,941,577.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0318
4.期末基金资产净值	6,038,342,710.93
5.期末基金份额净值	0.8393

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、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	-3.81%	1.31%	-3.22%	0.71%	-0.59%	0.60%

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

注:本报告期,本基金投资比例符合基金合同的要求。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陶灿	本基金的基金经理	2011年7月11日	-	6	硕士。2007年7月加入本公司,从事行业研究,历任研究员、基金经理助理。2011年7月11日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理。
乔林建	本基金的基金经理	2013年1月5日	-	11	硕士。2002年6月起就职于新华人寿保险公司,历任研究员、投资经理;2006年6月起就职于新华资产管理公司,任高级投资经理。2008年2月加入我公司,历任高级投资经理、资深投资经理、基金经理助理。2013年1月5日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理;2013年9月24日起任建信创新中国股票型证券投资基金基金经理;2013年11月13日起任建信核心精选基金经理。
马志强	本基金的基金经理	2013年11月13日	-	10	博士。曾就职于东北证券公司、北京高汇投资管理有限公司、北京监巢投资有限公司,2004年11月起就职于天弘基金管理公司,2008年12月2日至2011年3月23日任天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理。2011年3月加入本公司,2011年8月2日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理;2013年11月13日起任建信优化配置基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《建信优化配置混合型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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年一季度,中国经济继续在"调结构、促改革"基调中运行,"三驾马车"似乎都处于乏力状态,受中央持续反腐的影响,社会消费品零售总额的持续放缓,在政策和资金约束下房地产投资增速下滑,去产能化的推进又让制造业固定资产投资减速,受成本高企、资金短缺、竞争加剧等因素的影响,再加上季节性因素和去年同期基数比较大的原因,外贸形势十分严峻复杂。

在经济增速下滑背景下,央行在2014年1季度执行稳健的货币政策时选择"中性"中更偏"松"一些,银行间资金面总体较为宽裕。1月份市场面临银行缴准、春节提现及新股因素,资金面仍然偏紧,但央行通过常规公开市场操作、SLO、SLF等向市场投放了大量资金,确保了短期资金利率的稳定;春节过后,由于春节提现回流,加上外汇占款的快速流入,资金面处于持续宽松状态,1天资金利率长时间长时间低于2.0%,一度到达1.6%。

受资金面充裕因素的驱动以及经济下行对债市的支撑,信用债在一季度迎来新的春天,市场暖意融融,收益率大幅下行。不过随着央行的持续回笼以及信用风险的冲击,市场对未来资金面的预期再次谨慎,3月份信用债开始企稳回调,小牛行情渐收尾。

在这种资金面环境下,建信货币市场基金在做好流动性管理的同时,适时在一季度逐步放大组合期限,增加了一个月以上定存的比例,增加了短期融资券的配置比例,平稳渡过了年初和季度末的大额赎回期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值收益率1.2504%,波动率0.0027%,业绩比较基准收益率0.7024%,波动率0.0000%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望4月份以及二季度,我们认为,资金面最宽松局面已经过去,二季度资金面很可能将偏向紧平衡,这主要是因为一方面央行公开市场操作仍然稳健,并没有放松或明显收紧的信号,在稳健的货币政策的总基调下,央行公开市场操作有望继续保持当前的节奏,市场流动性将稳中趋紧。另一方面,从2月下旬开始,人民币双向波动扩大,再考虑到国外加息预期升温等多种因素,未来热钱流入国内速度将明显放缓,中国外汇占款数据将继续面临下降压力,加上企业缴税财政存款增加等因素,银行间流动性将受到压制。总而言之,我们判断,未来资金面将偏向紧平衡,一季度宽裕的流动性或暂告一段落。

基本面方面,经济下滑及国务院领导调研提升了政策稳增长预期。我们认为,对于经济增长不必过于悲观,就业压力不大,而服务业也逐步成为主要动力。因此,二季度的基本面难以对利率下行形成有效支持,而且二季度将直接面临一级市场供给增大的压力,利率缺乏下行的动能。短端小幅上行、长端高位维持的概率较大。

根据以上分析,二季度建信货币市场基金仍将保持稳健的投资风格,降低组合平均剩余期限,增强组合的流动性,力争保证组合能够跟随市场的发展变化获得合理收益。

§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	4,748,425,983.72	78.13
	其中:股票	4,748,425,983.72	78.13
2	固定收益投资	5,019,373.80	0.08
	其中:债券	5,019,373.80	0.08
	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	625,496,939.05	10.29
	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	661,375,167.75	10.88
7	其他资产	37,187,318.49	0.61
8	合计	6,077,504,782.81	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	156,138,965.90	2.59
B	采矿业	112,847,801.54	1.87
C	制造业	2,954,233,696.39	48.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,574,438.92	0.22
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	115,191,262.04	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	82,226,587.23	1.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	283,287,717.04	4.69
J	金融业	261,497,677.40	4.33
K	房地产业	481,125,519.21	7.97
L	租赁和商务服务业	84,733,648.00	1.40
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	135,084,478.95	2.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	68,484,191.10	1.13
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,748,425,983.72	78.64

注:以上行业分类以2014年3月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600570	恒生电子	9,312,112	199,931,044.64	3.31
2	600340	华夏幸福	6,587,481	183,395,471.04	3.04
3	000002	万 科A	22,453,091	181,645,506.19	3.01
4	600887	伊利股份	4,949,696	177,347,607.68	2.94
5	300202	聚龙股份	4,298,633	172,805,046.60	2.86
6	600109	国金证券	8,214,955	152,962,462.10	2.53
7	002456	欧菲光	3,061,644	128,895,212.40	2.13
8	603008	喜临门	12,056,809	124,426,268.88	2.06
9	002437	誉衡药业	2,319,562	123,539,872.12	2.05
10	000998	隆平高科	4,820,344	110,385,877.60	1.83

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,019,373.80	0.08
8	其他	-	-
9	合计	5,019,373.80	0.08

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

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	128002	东华转债	29,400	5,019,373.80	0.08

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

无。

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

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金该报告期内投资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公开谴责、处罚。

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	2,610,239.56
2	应收证券清算款	33,850,929.67
3	应收股利	-
4	应收利息	348,419.58
5	应收申购款	377,729.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,187,318.49

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128002	东华转债	5,019,373.80	0.08

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600570	恒生电子	199,931,044.64	3.31	筹划重大战略事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

序号	7,522,589,554.93
报告期间基金总申购份额	33,517,022.66
减:报告期期间基金总赎回份额	361,348,950.80
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	7,194,757,626.79

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。

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信优化配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信优化配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信优化配置混合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。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 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

2014年4月22日

建信优选成长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

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信优选成长股票
基金主代码	530003
交易代码	530003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月8日
报告期末基金份额总额	2,251,755,411.13份
投资目标	通过投资于具有良好业绩成长性和投资价值的上市公司,实现基金资产长期增值。
投资策略	本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数+20%×中国债券总指数+5%×1年定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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

§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	49,383,177.64
2.本期利润	-82,695,503.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0360
4.期末基金资产净值	1,912,679,469.21
5.期末基金份额净值	0.8494

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入本期公允价值变动收益。

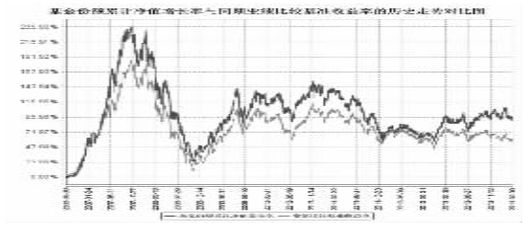
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-4.14%	1.13%	-5.04%	0.97%	0.90%	0.16%

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



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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
姚锦	研究部首席策略分析师、本基金的基金经理	2012年2月17日	-	9	博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师、天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职,2009年3月17日至2011年3月3日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理;2009年12月17日至2011年5月5日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理。现任我公司研究部首席策略分析师,2012年2月17日起任建信优选成长股票型证券投资基金基金经理,2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任股票型证券投资基金基金经理;2014年1月20日起任建信保本基金的基金经理。该基金于1月23日起转型为建信积极配置混合型证券投资基金基金,姚锦继续担任该基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《建信优选成长股票型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,