

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

送出日期：2014年8月25日

### § 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员对本报告书内容的真实性、准确性、完整性承担责任。本公司年度报告经三分之二以上独立董事签字确认。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月21日复核了报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、会计报告、投资组合报告等内容，保证复核后的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。

基金合同的当事人因对本基金的了解和认识不足，可能导致损失。

基金招募说明书及更新、基金产品资料概要、定期报告、基金净值公告、基金定期报告、基金半年度报告摘要、半年度报告正文、投资者关系活动记录表、应阅读半年度报告全文。

本报告期基金无财务费用。

本报告期基金无关联交易。

### § 2 基金简介

**2.1 基金基本情况**

基金简称：建信双息红利债券型证券投资基金

基金主代码：530017

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2011年12月13日

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

报告期末基金份额总额：311,443,306.79份

基金合同存续期间：不定期

**2.2 基金产品说明**

投资目标：通过主动管理债券组合，力争在追求基金资产稳定增值的基础上为投资者取得高于业绩基准回报。

投资策略：本基金将采取自下而上的方法确定投资组合比例，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。同时本基金将适当进行行业配置，精选具有较好投资价值的债券品种，适当增加股票投资，严格控制风险，规避风险。本基金认为当市场出现低估值股票时具备较高的投资价值，国企改革和债转股可能会成为驱动低估值股票行情的新催化剂，本基金将加大这方面股票的投资，力争为投资者创造价值。

业绩比较基准：90%×中证国债指数收益率+10%×中证红利指数收益率。

风险收益特征：本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合型基金，高于货币市场基金。

**2.3 基金管理人和基金托管人**

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

名称：建信基金管理有限责任公司 中信银行股份有限公司

姓名：路彩霞 朱义明

信息披露负责人：010-62288888 010-65558812

电子邮箱：xinxipub@ccb.com zhuyiming@ccitbank.com

客户服务电话：400-81-95533 010-66228000 95588

传真：010-66228001 010-65550832

**2.4 信息披露方式**

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址：<http://www.ccbfund.cn>

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。

**§ 3 主要财务指标和基金净值表现**

金额单位：人民币元

**3.1 期间数据和指标**

报告期(2014年1月1日—2014年6月30日)

本期已实现收益：8,644,822.15

本期利润：14,484,251.32

加权平均基金份额本期利润：0.0765

本期基金份额净值增长率：7.69%

**3.1.2 期间数据和指标**

报告期末(2014年6月30日)

期初可供基金份额总额：0.0901

期末可供基金份额总额：340,070,582.90

期末基金份额净值：1.092

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)和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来实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末可供分配利润的实现部分；如果期末未分配利润的未来实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为零。

3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用，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**

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 1.20% 0.16% 0.74% 0.12% 0.46% 0.04%

过去三个月 4.30% 0.14% 3.13% 0.14% 1.17% 0.00%

过去六个月 7.69% 0.17% 5.30% 0.14% 2.39% 0.03%

过去一年 6.71% 0.18% 1.86% 0.16% 4.85% 0.02%

自基金合同成立日起至今 18.96% 0.22% 5.48% 0.15% 13.48% 0.07%

注：本基金的业绩比较基准为：90%×中证国债指数收益率+10%×中证红利指数收益率。本基金为债券型证券投资基金，主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票、权证、证券投资基金、货币市场基金及其他金融工具。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，投资于股票、权证、证券投资基金、货币市场基金的比例合计不超过基金资产的20%，其中投资于股票的比例不超过10%，投资于权证的比例不超过5%，投资于权证、证券投资基金、货币市场基金的比例合计不超过基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为90%×中证国债指数收益率+10%×中证红利指数收益率。

本基金投资于债券的比例不低于80%，因此，本基金投资于债券的比例将不低于基金资产净值的80%。

本基金投资于股票的比例将不超过20%，因此，本基金投资于股票的比例将不超过基金资产净值的20%。

本基金投资于权证的比例将不超过5%，因此，本基金投资于权证的比例将不超过基金资产净值的5%。

本基金投资于货币市场基金的比例将不超过基金资产净值的20%，因此，本基金投资于货币市场基金的比例将不超过基金资产净值的20%。

本基金投资于权证投资基金、权证投资基金的比例将不超过基金资产净值的5%，因此，本基金投资于权证投资基金的比例将不超过基金资产净值的5%。

本基金投资于权证投资基金的比例将不超过基金资产净值的5%，因此，本基金投资于权证投资基金的比例将不超过基金资产净值的5%。

本基金投资于权证投资基金的比例将不超过基金资产净值的5%，因此，本基金投资于权证投资基金的比例将不超过基金资产净值的5%。