

# 建信信用增强债券型证券投资基金

## 【2014】第三季度报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司  
基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人及交通银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2014年10月22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。投资人选择本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

### § 2 基金产品概况

基金简称	建信信用增强债券
场内简称	信用债
基金主代码	165311
交易代码	165311
基金合同生效日	2011年6月16日
报告期末基金份额总额	895,244,374.07份
投资目标	在保持基金资产流动性及严格控制基金资产风险的前提下,力争在保持高于银行存款利率的稳定收益的基础上,实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法进行资产配置,在各自不同的资产类别之间选择并构建投资组合,同时,在固定收益资产所构建的稳健收益基础上,适当参与新股发行申购及增发新股申购,为基金投资者获得一定的超额收益。信用评级和收益率水平平分三等,即股票二级市场投资的股票型基金。
业绩比较基准	中国债券总指数收益率。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
下一级基金的基金简称	建信信用增强债券A
下一级基金的交易代码	165311
报告期末下级基金的份额总额	536,006,533.46份
§ 3 主要财务指标	359,237,983.46份

### 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7月1日 - 2014年9月30日)	
建信信用增强债券A		建信信用增强债券C	
1.本期已实现收益	7,000,956.47	8,155,197.51	
2.本期利润	13,398,757.09	15,027,994.88	
3.报告期总回报/报告期总利润	0.0217	0.0176	
4.期末基金份额净值	573,028,603.11	383,486,708.66	
5.期末基金份额净值	1.00	1.008	

注:1.本期间已实现收益指基金本期利润收入,按应收利息、应收股息和其他收入(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小数价差变动损益总额。

2.所持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据。

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

建信信用增强债券A

阶段 净值增长① 净值增长率② 业绩比较基准收益 业绩比较基准收益率③ 比率差④

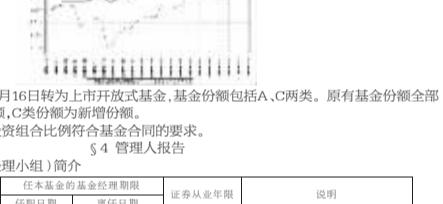
过去三个月 2.10% 0.11% 1.62% 0.10% 0.48% -0.01%

建信信用增强债券C

阶段 净值增长① 净值增长率② 业绩比较基准收益 业绩比较基准收益率③ 比率差④

过去三个月 2.08% 0.10% 1.62% 0.09% 0.39% 0.09%

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:1.本基金于2014年6月16日转为上市开放式基金,基金份额包括A,C两类。原有基金份额全部转换为建信信用增强A类份额, C类份额为新增份额。

2.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间	证券从业年限	说明
李菁	投资管理部副总监,负责基金投资管理	2011年6月16日 -	8	硕士,2002年7月进入中国建设银行,从事金融市场业务,曾任任项目经理,2005年9月进入建信基金管理有限公司,历任基金经理助理、基金经理、基金经理,现任基金经理,投资管理部总监,负责基金投资管理,投资管理部总监,负责基金投资管理,投资管理部总监,负责基金投资管理,2011年6月16日起任建信信用增强债券基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

为了保护基金份额持有人利益,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》、《证券投资基金托管协议》内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度导则》、《基金管理公司特定客户资产管理业务办法》、《法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理制度》、《异常交易管理办法》、《公平交易内控管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管理机制。公司使用的交易系统设置了公平交易预警线,一旦发现不同基金经理同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易平台进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接通过第三人的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

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》、《证券投资基金托管协议》内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度导则》、《基金管理公司特定客户资产管理业务办法》、《法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理制度》、《异常交易管理办法》、《公平交易内控管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管理机制。公司使用的交易系统设置了公平交易预警线,一旦发现不同基金经理同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易平台进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接通过第三人的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 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》、《证券投资基金托管协议》内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度导则》、《基金管理公司特定客户资产管理业务办法》、《法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理制度》、《异常交易管理办法》、《公平交易内控管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管理机制。公司使用的交易系统设置了公平交易预警线,一旦发现不同基金经理同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易平台进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接通过第三人的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.3 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》、《证券投资基金托管协议》内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度导则》、《基金管理公司特定客户资产管理业务办法》、《法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理制度》、《异常交易管理办法》、《公平交易内控管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管理机制。公司使用的交易系统设置了公平交易预警线,一旦发现不同基金经理同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易平台进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接通过第三人的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.4 报告期内本基金投资策略说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略

4.4.2 报告期内本基金投资策略

4.4.3 报告期内本基金投资策略

4.4.4 报告期内本基金投资策略

4.4.5 报告期内本基金投资策略

4.4.6 报告期内本基金投资策略

4.4.7 报告期内本基金投资策略

4.4.8 报告期内本基金投资策略

4.4.9 报告期内本基金投资策略

4.4.10 报告期内本基金投资策略

4.4.11 报告期内本基金投资策略

4.4.12 报告期内本基金投资策略

4.4.13 报告期内本基金投资策略

4.4.14 报告期内本基金投资策略

4.4.15 报告期内本基金投资策略

4.4.16 报告期内本基金投资策略

4.4.17 报告期内本基金投资策略

4.4.18 报告期内本基金投资策略

4.4.19 报告期内本基金投资策略

4.4.20 报告期内本基金投资策略

4.4.21 报告期内本基金投资策略

4.4.22 报告期内本基金投资策略

4.4.23 报告期内本基金投资策略

4.4.24 报告期内本基金投资策略

4.4.25 报告期内本基金投资策略

4.4.26 报告期内本基金投资策略

4.4.27 报告期内本基金投资策略

4.4.28 报告期内本基金投资策略

4.4.29 报告期内本基金投资策略

4.4.30 报告期内本基金投资策略

4.4.31 报告期内本基金投资策略

4.4.32 报告期内本基金投资策略

4.4.33 报告期内本基金投资策略

4.4.34 报告期内本基金投资策略

4.4.35 报告期内本基金投资策略

4.4.36 报告期内本基金投资策略

4.4.37 报告期内本基金投资策略

4.4.38 报告期内本基金投资策略

4.4.39 报告期内本基金投资策略

4.4.40 报告期内本基金投资策略

4.4.41 报告期内本基金投资策略

4.4.42 报告期内本基金投资策略

4.4.43 报告期内本基金投资策略

4.4.44 报告期内本基金投资策略

4.4.45 报告期内本基金投资策略

4.4.46 报告期内本基金投资策略

4.4.47 报告期内本基金投资策略

4.4.48 报告期内本基金投资策略

4.4.49 报告期内本基金投资策略

4.4.50 报告期内本基金投资策略

4.4.51 报告期内本基金投资策略

4.4.52 报告期内本基金投资策略

4.4.53 报告期内本基金投资策略

4.4.54 报告期内本基金投资策略

4.4.55 报告期内本基金投资策略

4.4.56 报告期内本基金投资策略

4.4.57 报告期内本基金投资策略

4.4.58 报告期内本基金投资策略

4.4.59 报告期内本基金投资策略

4.4.60 报告期内本基金投资策略

4.4.61 报告期内本基金投资策略

4.4.62 报告期内本基金投资策略

4.4.63 报告期内本基金投资策略

4.4.64 报告期内本基金投资策略

4.4.65 报告期内本基金投资策略

4.4.66 报告期内本基金投资策略

4.4.67 报告期内本基金投资策略

4.4.68 报告期内本基金投资策略

4.4.69 报告期内本基金投资策略