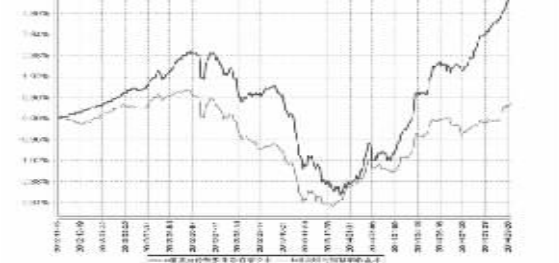


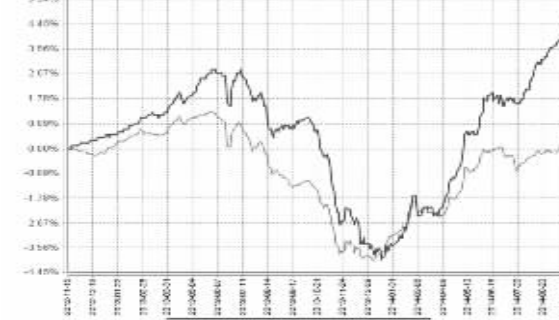
建信纯债债券型证券投资基金

【2014】第三季度报告

A.本基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C.本基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

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	说明
黎新芳	本基金基金经理	2012年11月15日 -	13

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本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《建信纯债债券型证券投资基金合同》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
为了公平对待投资者,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》、《基金管理人公平交易管理制度》等法律法规和公司内控制度,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》等风险管理制度。公司使用的交易系统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 报告期内基金投资策略和运作分析

资产配置方面,报告期内本基金保持较高比例的股票资产配置,同时配置了一定规模的可转债、股指期货和衍生品投资。二、三季度本基金继续围绕代表中国经济未来成长方向的新兴产业进行布局,包括创新的软件、电子、新能源、节能、高端装备、军工等行业,服务类的医疗、教育、环保、文化等行业,通过投资于这类行业中的龙头企业,本基金三季度取得了一定的收益。

4.5 报告期内基金业绩表现

本报告期本基金净值增长率为13.92%,波动率0.8%,业绩比较基准收益率为1.09%,波动率0.01%。

4.6 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
报告期内全球宏观经济持续保持复苏,对全球经济带来一定的推动作用,中国经济处于转型期,尽管政府稳增长政策难以立见成效,但新兴产业的发展势头良好,而且将衍生出一系列新的经济增长点,经济大幅下滑的风险不大。同时,市场资金利率水平在继续下行的趋势,股票市场的流动性比较充裕,股票市场将走向上行和扩大。本基金将于四季度保持较高的股票资产配置,本基金将继续围绕代表中国经济未来成长方向的新兴产业进行布局,符合管理人的创新和优质服务行业的方向将引领中国经济的发展,本基金将继续围绕这个大的方向进行投资,积极挖掘其中最具有竞争力的公司。

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	40,534,614.83	62.56
其中:股票	40,534,614.83	62.56	
2	固定收益投资	3,448,368.00	5.32
其中:债券	3,448,368.00	5.32	
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
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	10,955,154.83	16.35
7	其他资产	10,219,283.11	15.77
8	合计	64,797,420.77	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	-	-
B	采矿业	1,541,980.00	2.43
C	制造业	29,985,432.13	47.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,913,667.70	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,417,685.00	2.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	747,100.00	1.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,646,470.00	2.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,282,280.00	5.18
S	综合	-	-
合计		40,534,614.83	63.94

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	601098	中裕博信	157,000	2,430,360.00	3.83
2	002008	大亚股份	107,000	2,091,850.00	3.30
3	002073	杭锅股份	165,962	2,041,332.60	3.22
4	600685	广汇能源	69,960	1,767,889.20	2.79
5	002470	华正天	63,000	1,567,440.00	2.46
6	300157	恒誉环保	86,000	1,541,980.00	2.43
7	002100	天康生物	110,000	1,540,000.00	2.43
8	002465	海特高新	87,000	1,529,460.00	2.41
9	600733	中航光电	80,000	1,504,000.00	2.37
10	600689	东方明珠	151,000	1,500,942.60	2.37

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	3,448,368.00	5.44
8	其他	-	-
9	合计	3,448,368.00	5.44

5.5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	175,440,720.22	83.13
其中:股票	175,440,720.22	83.13	
2	固定收益投资	19,988,000.00	9.47
其中:债券	19,988,000.00	9.47	
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
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	8,644,137.19	4.10
7	其他资产	6,975,275.40	3.31
8	合计	211,048,132.81	100.00

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债券投资明细

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	002153	盛信信息	108,154	7,589,166.18	3.77
2	000918	南山铝业	502,842	7,577,828.94	3.76
3	002111	威海广泰	311,344	5,467,200.64	2.72
4	600648	保利地产	766,034	4,251,488.70	2.11
5	000061	平安银行	404,338	4,099,996.20	2.04
6	000920	南京汇通	255,539	3,664,429.26	1.82
7	002207	瀚蓝环保	195,581	3,567,397.44	1.77
8	002653	鼎昌科技	161,616	3,549,087.36	1.76
9	600674	川恒股份	187,734	3,334,155.84	1.66
10	601377	兴业证券	59,316	3,328,615.84	1.65

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	002153	盛信信息	108,154	7,589,166.18	3.77
2	000918	南山铝业	502,842	7,577,828.94	3.76
3	002111	威海广泰	311,344	5,467,200.64	2.72
4	600648	保利地产	766,034	4,251,488.70	2.11
5	000061	平安银行	404,338	4,099,996.20	2.04
6	000920	南京汇通	255,539	3,664,429.26	1.82
7	002207	瀚蓝环保	195,581	3,567,397.44	1.77
8	002653	鼎昌科技	161,616	3,549,087.36	1.76
9	600674	川恒股份	187,734	3,334,155.84	1.66
10	601377	兴业证券	59,316	3,328,615.84	1.65

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债券投资明细

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	19,988,000.00	9.93
其中:政策性金融债	19,988,000.00	9.93	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	19,988,000.00	9.93

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	002153	盛信信息	108,154	7,589,166.18	3.77
2	000918	南山铝业	502,842	7,577,828.94	3.76
3	002111	威海广泰	311,344	5,467,200.64	2.72
4	600648	保利地产	766,034	4,251,488.70	2.11
5	000061	平安银行	404,338	4,099,996.20	2.04
6	000920	南京汇通	255,539	3,664,429.26	1.82
7	002207	瀚蓝环保	195,581	3,567,397.44	1.77
8	002653	鼎昌科技	161,616	3,549,087.36	1.76
9	600674	川恒股份	187,734	3,334,155.84	1.66
10	601377	兴业证券	59,316	3,328,615.84	1.65

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股票投资明细

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	19,988,000.00	9.93
其中:政策性金融债	19,988,000.00	9.93	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	19,988,000.00	9.93

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	002153	盛信信息	108,154	7,589,166.18	3.77
2	000918	南山铝业	502,842	7,577,828.94	3.76
3	002111	威海广泰	311,344	5,467,200.64	2.72
4	600648	保利地产	766,034	4,251,488.70	2.11
5	000061	平安银行	404,338	4,099,996.20	2.04
6	000920	南京汇通	255,539	3,664,429.26	1.82
7	002207	瀚蓝环保	195,581	3,567,397.44	1.77
8	002653	鼎昌科技	161,616	3,549,087.36	1.76
9	600674	川恒股份	187,734	3,334,155.84	1.66
10	601377	兴业证券	59,316	3,328,615.84	1.65

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股票投资明细

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	19,988,000.00	9.93
其中:政策性金融债	19,988,000.00	9.93	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	19,988,000.00	9.93

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	002153	盛信信息	108,154	7,589,166.18	3.77
2	000918	南山铝业	502,842	7,577,828.94	3.76
3	002111	威海广泰	311,344	5,467,200.64	2.72
4	600648	保利地产	766,034	4,251,488.70	2.11
5	000061	平安银行	404,338	4,099,996.20	2.04
6	000920	南京汇通	255,539	3,664,429.26	1.82
7	002207	瀚蓝环保	195,581	3,567,397.44	1.77
8	002653	鼎昌科技	161,616	3,549,087.36	1.76
9	600674	川恒股份	187,734	3,334,155.84	1.66
10	601377	兴业证券	59,316	3,328,615.84	1.65

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股票投资明细

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	19,988,000.00	9.93
其中:政策性金融债	19,988,000.00	9.93	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	19,988,000.00	9.93

5.15 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	002153	盛信信息	108,154	7,589,166.18	3.77
2	000918	南山铝业	502,842	7,577,828.94	3.76
3	002111	威海广泰	311,344	5,467,200.64	2.72
4	600648	保利地产	766,034	4,251,488.70	2.11
5	000061	平安银行	404,338	4,099,996.20	2.04
6	000920	南京汇通	255,539	3,664,429.26	1.82
7	002207	瀚蓝环保	195,581	3,567,397.44	1.77
8	002653	鼎昌科技	161,616	3,549,087.36	1.76
9	600674	川恒股份	187,734	3,334,155.84	1.66
10	601377	兴业证券	59,316	3,328,615.84	1.65

5.16 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投资明细

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	19,988,000.00	9.93
其中:政策性金融债	19,988,000.00	9.93	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	19,988,000.0	