

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24日
基金管理人的董事会及董事保证本报告不存在虚假记载、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。
基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等数据,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(2014年7月1日起至30日止)

§ 1 基金产品概况

基金简称 建信纯债债券
基金主代码 530021
交易代码 530021
基金运作方式 灵活型开放式
基金合同生效日 2012年11月15日
报告期末基金份额总额 616,609,293.92份

投资目标 在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的资产配置及投资组合的动态调整,力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金采取自上而下的方法确定投资组合比例,通过对宏观经济形势、行业周期所处阶段、利率变化和信用利差变化趋势的重新分析,力求在未来一定时期内不断调整品种和资产的配置,相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用级别的券种及券种与现金之间进行动态调整。

业绩比较基准 中证综合债指数

风险收益特征 本基金为债券型基金,其风险和预期收益水平低于股票型基金,高于货币型基金。

基金管理人 建信基金管理有限责任公司

基金托管人 中国光大银行股份有限公司

下属两只基金的基金简称 建信纯债债券A 建信纯债债券C

下属两只基金的基金代码 530021 531021

报告期末下属两只基金的份额总额 158,388,963.85份 457,680,330.07份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

基金简称 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
建信纯债债券A 建信纯债债券C

1.本期已实现收益 2,066,707.42 6,908,918.29

2.本期利润 4,364,178.10 13,134,675.81

3.期初平均基金份额本期利润 0.0344 0.0306

4.期末基金份额净值 167,300,165.65 479,938,643.30

5.期末可供分配基金份额净值 1.056 1.049

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据。

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

建信纯债债券A

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 3.25% 0.08% 0.76% 0.07% 2.53% 0.01%

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:在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的资产配置及投资组合的动态调整,力求在未来一定时期内不断调整品种和资产的配置,相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用级别的券种及券种与现金之间进行动态调整。

本基金在投资运作过程中,严格控制投资风险以实现投资目标的长期稳健增值。

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(2014年7月1日起至30日止)

§ 2 基金产品概况

基金简称 建信稳健债混型

基金主代码 530016

交易代码 530016

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2011年1月22日

报告期末基金份额总额 47,823,929.02份

投资目标 在严格控制风险的基础上,通过主动的资产配置及投资组合的动态调整,力求在未来一定时期内不断调整品种和资产的配置,相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用级别的券种及券种与现金之间进行动态调整。

本基金在投资运作过程中,严格控制投资风险以实现投资目标的长期稳健增值。

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(2014年7月1日起至30日止)

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

基金简称 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
建信稳健债混型

1.本期已实现收益 3,980,510.63

2.本期利润 7,129,640.82

3.期初平均基金份额本期利润 0.14690

4.期末可供分配基金份额净值 63,391,366.85

5.期末可供分配利润 1.326

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据。

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

建信稳健债混型

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 13.02% 0.80% 1.09% 0.01% 12.83% 0.79%

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:在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的资产配置及投资组合的动态调整,力求在未来一定时期内不断调整品种和资产的配置,相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用级别的券种及券种与现金之间进行动态调整。

本基金在投资运作过程中,严格控制投资风险以实现投资目标的长期稳健增值。

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(2014年7月1日起至30日止)

§ 2 基金产品概况

基金简称 建信恒稳价值混型

基金主代码 530016

交易代码 530016

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2011年8月4日

报告期末基金份额总额 184,288,374.09份

投资目标 在严格控制风险的基础上,通过主动的资产配置及投资组合的动态调整,力求在未来一定时期内不断调整品种和资产的配置,相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用级别的券种及券种与现金之间进行动态调整。

本基金在投资运作过程中,严格控制投资风险以实现投资目标的长期稳健增值。

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(2014年7月1日起至30日止)

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

基金简称 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
建信恒稳价值混型

1.本期已实现收益 12,984,804.35

2.本期利润 44,006,509.99

3.期初平均基金份额本期利润 0.1481

4.期末可供分配基金份额净值 201,357,213.00

5.期末可供分配利润 1.093

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据。

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

建信恒稳价值混型

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 15.10% 0.76% 10.24% 0.67% 5.67% 0.99%

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:在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的资产配置及投资组合的动态调整,力求在未来一定时期内不断调整品种和资产的配置,相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用级别的券种及券种与现金之间进行动态调整。

本基金在投资运作过程中,严格控制投资风险以实现投资目标的长期稳健增值。

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(2014年7月1日起至30日止)

§ 2 基金产品概况

基金简称 建信消费升级混型

基金主代码 530016

交易代码 530016

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2011年4月14日

报告期末基金份额总额 211,048,132.81份

投资目标 在严格控制风险的基础上,通过主动的资产配置及投资组合的动态调整,力求在未来一定时期内不断调整品种和资产的配置,相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用级别的券种及券种与现金之间进行动态调整。

本基金在投资运作过程中,严格控制投资风险以实现投资目标的长期稳健增值。

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(2014年7月1日起至30日止)

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

基金简称 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
建信消费升级混型

1.本期已实现收益 12,994,804.35

2.本期利润 44,006,509.99

3.期初平均基金份额本期利润 0.1481

4.期末可供分配基金份额净值 201,357,213.00

5.期末可供分配利润 1.093

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据。

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

建信消费升级混型

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 15.10% 0.76% 10.24% 0.67% 5.67% 0.99%

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:在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的资产配置及投资组合的动态调整,力求在未来一定时期内不断调整品种和资产的配置,相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用级别的券种及券种与现金之间进行动态调整。

本基金在投资运作过程中,严格控制投资风险以实现投资目标的长期稳健增值。

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(2014年7月1日起至30日止)

§ 2 基金产品概况

基金简称 建信消费升级混型