建信稳定增利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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信稳定增利债券
基金主代码	530008
交易代码	530008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月25日
报告期末基金份额总额	1,775,906,600.48份
投资目标	通过主动式管理债券组合,在追求基金资产稳定增长基础上获得高于投资基准的回报。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。本基金管理人力求综合发挥固定收益、股票及金融衍生产品投资研究团队的力量,通过专业分工细分研究领域,立足长期基本因素分析,从利率、信用等角度进行深入研究,形成投资策略,优化组合,获取可持续的、超出市场平均水平的稳定投资收益。并在固定收益资产所提供的稳定收益基础上,适当参与新股发行申购及增发新股申购,为基金持有人增加收益,实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中国债券总指数。
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型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
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

下属两级基金的基金简称	建信稳定增利债券A	建信稳定增利债券C
下属两级基金的交易代码	531008	530008
报告期末下属两级基金的份额总额	77.90份	1,775,906,522.58份

§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7月1日 - 2014年9月30日)	
	建信稳定增利债券A	建信稳定增利债券C
1.本期已实现收益	0.01	11,674,048.67
2.本期利润	0.07	38,366,579.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0009	0.0259
4.期末基金资产净值	99.47	2,267,210,394.20
5.期末基金份额净值	1.277	1.277

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字。

3.本基金于2014年9月29日新增A类份额。

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

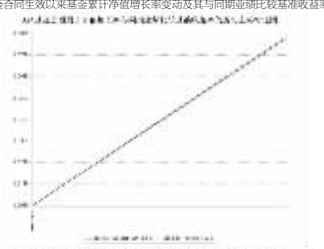
建信稳定增利债券A

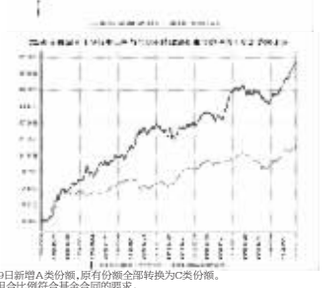
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.08%	0.06%	0.22%	0.05%	-0.14%	0.01%

建信稳定增利债券C

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	4.33%	0.12%	1.62%	0.10%	2.71%	0.02%

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9月29日新增A类份额,原有份额全部转换为C类份额。

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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钟敬咏	投资管理部副总监,本基金的基金经理	2008年8月15日	-	9	特许金融分析师(CFA),硕士,加拿大籍华人。1995年7月毕业于南开大学金融系,获经济学学士学位。2004年5月毕业于加拿大不列颠哥伦比亚大学,获工商管理硕士学位。曾先后任职于广东发展银行珠海分行、深圳发展银行珠海分行、嘉实基金管理有限公司等,从事外汇交易、信贷、债券研究及投资组合管理等工作。2008年5月加入建信基金管理公司,2009年6月2日至2011年5月11日任建信收益增强债券型证券投资基金基金经理,2008年8月15日起任建信稳定增利债券型证券投资基金基金经理,2011年12月13日起任建信双息红利债券型证券投资基金基金经理,2013年9月3日起任建信安心保本混合型证券投资基金基金经理。

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,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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信稳定增利债券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》、《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,制定并修订了《公平交易管理办法》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

宏观经济方面,三季度经济数据较差,在上半年国家陆续出台保增长的措施后,对经济的拉动效果并不明显。而社会融资规模等金融数据低于预期,部分原因可能是由于信贷风险逐步暴露,银行信贷供给变得更为谨慎所致。

投资增速在三季度放缓明显,其中房地产投资下滑较多,制造业投资持续回落,投资增速下滑是三季度经济增速回落的主要因素。三季度消费数据相对平稳,出口则表现较好。三季度物价平稳,从已经公布的数据看,七月和八月消费者物价指数均低于市场预期。

政策面总体而言是宽松的。央行支农再贷款、定向降息、公开市场止回购利率连续下调和标极使用PSL、SLF等工具都释放出了宽松信号。九月底人民银行联合银监会出台《关于进一步做好住房金融服务工作的通知》,对房地产按揭等方面给予了一定的放松政策。

债券市场方面,三季度债券收益率出现下行,其中长端利率下降较快,平均下行20BP以上,这一方面是由于市场对经济下行的确认,另一方面则是央行持续释放出宽松的信号。由于股票市场表现良好,大笔分转债品种在三季度都有不错的涨幅。

本基金在三季度部分兑现了转债和信用债的收益,总体上转债和信用债的配置有所降低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期稳定增利A净值增长率0.08%,波动率0.06%,业绩比较基准收益率0.22%,波动率0.05%;稳定增利C净值增长率4.33%,波动率0.12%,业绩比较基准收益率1.62%,波动率0.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们认为四季度经济存在一定的下行压力。首先,银行借贷的趋势值得关注。其次,央行和银监会出台了地产方面的相关政策(包括放松限购、调整房贷利率等),但效果还需要观察。此外,出口增长态势虽相对明朗,但此次全球的复苏是较为脆弱的,而且人民币可能会跟随美元对其它货币升值,这将影响我们未来对其它地区的出口,整体上我们认为出口转好对经济的拉动作用有限。

我们预期四季度通货膨胀压力不大,猪肉价格依然是我们关注的一个因素。

在经济下行压力较大、政府努力降低企业融资成本的背景下,预期四季度央行依然会维持相对宽松的资金面。

总体上,四季度经济基本面没有特别不利于债券市场的因素,但需关注股票市场进一步走好对债券市场资金的分流作用。四季度本基金将保持适当的组合久期,继续利用一定的杠杆配置信用债获取投资收益,并且下而上选择转债品种,争取在下一季度为投资者获得良好的回报。

§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	43,633,288.96	1.51
	其中:股票	43,633,288.96	1.51
2	固定收益投资	2,432,938,691.65	84.37
	其中:债券	2,432,938,691.65	84.37
	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	-	-
	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	74,369,953.84	2.58
7	其他资产	332,733,189.93	11.54
8	合计	2,883,675,124.38	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	-	-
C	制造业	21,050.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,832,238.96	1.58
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,780,000.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	43,633,288.96	1.92

注:以上行业分类以2014年9月30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	600795	国电电力	7,000,000	18,060,000.00	0.80
2	600674	川投能源	1,000,496	17,768,808.96	0.78
3	601006	大秦铁路	1,000,000	7,780,000.00	0.34
4	603306	华懋科技	1,000	21,050.00	0.00
5	601016	节能风电	1,000	3,430.00	0.00

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	49,518,000.00	2.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	423,849,000.00	18.69
	其中:政策性金融债	423,849,000.00	18.69
4	企业债券	1,201,083,622.80	52.98
5	企业短期融资券	90,232,000.00	3.98
6	中期票据	436,043,000.00	19.23
7	可转债	232,213,068.85	10.24
8	其他	-	-
9	合计	2,432,938,691.65	107.31

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	140203	14国开03	1,700,000	180,642,000.00	7.97
2	122276	13魏桥01	1,008,490	102,371,819.90	4.52
3	122964	09龙湖债	978,030	100,052,469.00	4.41
4	1280089	12联泰债	900,000	93,411,000.00	4.12
5	110028	冠域转债	709,650	83,738,700.00	3.69

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	80,859.65
2	应收证券清算款	255,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	57,230,932.88
5	应收申购款	20,421,397.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	332,733,189.93

5.10.4 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	110018	国电转债	47,321,085.60	2.09
2	127002	徐工转债	39,082,242.24	1.72
3	110023	民生转债	23,836,281.20	1.05
4	110015	石化转债	19,432,416.90	0.86
5	125089	深机转债	815,337.90	0.04

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信稳定增利债券A	建信稳定增利债券C
报告期期初基金份额总额	-	1,450,535,538.10
报告期期间基金总申购份额	77.90	948,476,572.59
减:报告期期间基金总赎回份额	-	623,105,588.11
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	77.90	1,775,906,522.58

注:1.上述总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额;

2.本基金于2014年9月29日新增A类份额。

§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稳定增利债券型证券投资基金设立的文件;

2.《建信稳定增利债券型证券投资基金基金合同》;

3.《建信稳定增利债券型证券投资基金招募说明书》;

4.《建信稳定增利债券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10月24日

建信核心精选股票型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信核心精选股票
基金主代码	530006
交易代码	530006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月25日
报告期末基金份额总额	1,610,908,579.09份
投资目标	本基金通过对宏观经济环境、市场环境、行业特征和公司基本面的深入研究,精选具有良好成长性和价值性的上市公司股票,在有效控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人对经济环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析,作出投资决策。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,一般情况下其风险和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7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	86,756,396.05
2.本期利润	210,496,748.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.1494
4.期末基金资产净值	1,751,099,025.91
5.期末基金份额净值	1.087

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。

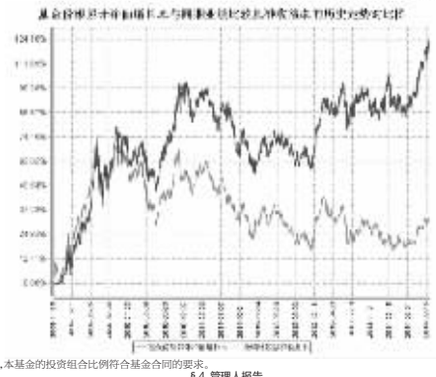
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	14.37%	0.75%	10.24%	0.67%	4.13%	0.08%

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔林建	本基金的基金经理	2013年11月13日	-	12	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、基金经理助理;2013年1月5日至2014年3月6日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。

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,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《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信核心精选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,制定并修订了《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年三季度,中国经济增速有所下滑。与二季度相比,7-8月投资、消费、工业增加值增速明显下降,出口增速回升,CPI增速小幅下降,仍处于较低水平。三季度资金面比较宽松,9月中下旬也相对平稳,资金利率没有大幅波动。

三季度股票市场在四中全会的改革预期和沪港通等政策利好驱动下,出现持续强劲的上涨。各种主题内投资成为市场追捧的主线,如军工、新能源汽车等,小市值公司的重组转型也表现突出。股市的表现与基本面关联度不大。

基金操作上根据市场的变化略做了组合的调整,提高了股票仓位。但对主题内投资采取比较谨慎的态度,更多的坚持从公司业绩成长角度选择股票。9月本基金进行了比较大比例的分红,对组合管理带来一定的干扰。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率14.37%,波动率0.75%,业绩比较基准收益率10.24%,波动率0.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于三季度微刺激经济政策不断推出,房地产政策调整,美国经济形势向好,预计四季度中国经济增长情况将有所好转,通胀或仍保持在较低水平。四季度货币政策可能中性偏宽松,适时提供流动性,确保货币信贷合理增长。目前判断,四季度全面降息降准的概率不大。

改革的良好预期是驱动短期市场的核心要素,四季度将观察其进一步落实和兑现情况,而改革效果的体现是一个比较长的过程。短期的经济形势和企业盈利能力难以乐观。市场可能会在这两大因素的影响下,呈现震荡格局。基金管理上紧跟市场变化,适度降低风险偏好度,同时根据明年的预期进行组合优化调整。

§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	1,625,968,619.47	90.95
	其中:股票	1,625,968,619.47	90.95
2	固定收益投资	72,741,541.50	4.07
	其中:债券	72,741,541.50	4.07
	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	-	-
	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	82,578,522.52	4.62
7	其他资产	6,407,016.95	0.36
8	合计	1,787,695,700.44	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	4,203,127.36	0.24
C	制造业	995,450,139.65	56.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,591,684.72	1.40
E	建筑业	25,527,467.50	1.46
F	批发和零售业	119,066,932.39	6.80
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	156,992,277.78	8.97
J	金融业	77,104,397.42	4.40
K	房地产业	99,529,778.78	5.68
L	租赁和商务服务业	36,190,206.74	2.07
M	科学研究和技术服务业	6,979,014.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	34,884,672.18	1.99
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	40,638,525.00	2.32
S	综合	4,810,395.95	0.27
	合计	1,625,968,619.47	92.85

注:以上行业分类以2014年9月30日的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	600887	伊利股份	1,675,942	43,406,897.80	2.48
2	300020	银江股份	1,113,615	34,132,299.75	1.95
3	600703	三安光电	2,191,431	33,835,694.64	1.93
4	601328	交通银行	7,638,185	32,767,813.65	1.87
5	300017	网宿科技	532,631	29,784,725.52	1.70
6	600201	金宇集团	832,272	29,187,779.04	1.67
7	002450	康得新	909,420	28,301,150.40	1.62
8	600109	国金证券	1,166,829	27,257,125.44	1.56
9	600571	信雅达	1,151,370	26,504,537.40	1.51
10	002273	水晶光电	1,217,246	26,487,272.96	1.51

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	70,203,000.00	4.01
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	2,538,541.50	0.14
8	其他	-	-
9	合计	72,741,541.50	4.15

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	019322	13国债22	700,000	70,203,000.00	4.01
2	110025	国金转债	20,550	2,538,541.50	0.14

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	935,738.71
2	应收证券清算款	1,717,420.28
3	应收股利	-
4	应收利息	2,598,746.44
5	应收申购款	1,155,111.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,407,016.95

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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	600201	金宇集团	29,187,779.04	1.67	筹划重大事项
2	600571	信雅达	26,504,537.40	1.51	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,054,601,773.21
报告期期间基金总申购份额	784,320,287.75
减:报告期期间基金总赎回份额	228,013,481.87
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	1,610,908,579.09

注:总申购份额含红利再投资和转换入份额,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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	25,909,903.42
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	25,909,903.42
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.61

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核心精选股票型证券投资基金设立的文件;

2.《建信核心精选股票型证券投资基金基金合同》;

3.《建信核心精选股票型证券投资基金招募说明书》;

4.《建信核心精选股票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10月24日

建信双周安心理财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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信双周理财
基金主代码	530014
交易代码	530014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月28日
报告期末基金份额总额	1,651,807,538.84份
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,通过主动的组合管理为投资者创造稳定的当期回报,并力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过积极主动的组合管理,充分运用各种短期投资工具,力争为持有人创造低风险基础上的投资收益。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税前)
风险收益特征	本基金属于债券基金,长期风险收益水平低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。
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

下属两级基金的基金简称	建信双周理财A	建信双周理财B
下属两级基金的交易代码	530014	531014
报告期末下属两级基金的份额总额	1,214,421,519.55份	437,386,019.29份

§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7月1日 - 2014年9月30日)	
	建信双周理财A	建信双周理财B
1. 本期已实现收益	13,829,650.55	8,085,788.88
2.本期利润	13,829,650.55	8,085,788.88
3.期末基金资产净值	1,214,421,519.55	437,386,019.29

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,由于该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

建信双周理财A

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	1.1771%	0.0111%	0.3456%	0.0000%	0.8315%	0.0111%

建信双周理财B

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	1.2509%	0.0111%	0.3456%	0.0000%	0.9053%	0.0111%

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