建信优选成长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	建信优选成长股票
基金主代码	530003
交易代码	530003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月8日
报告期末基金份额总额	2,032,612,412.47份
投资目标	通过投资于具有良好业绩成长性和投资价值的上市公司,实现基金资产长期增值。
投资策略	本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数+20%×中国债券总指数+5%×1年定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,一般情况下其预期风险和预期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	41,987,197.06
2.本期利润	230,849,044.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.1091
4.期末基金资产净值	1,980,795,230.33
5.期末基金份额净值	0.9745

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。

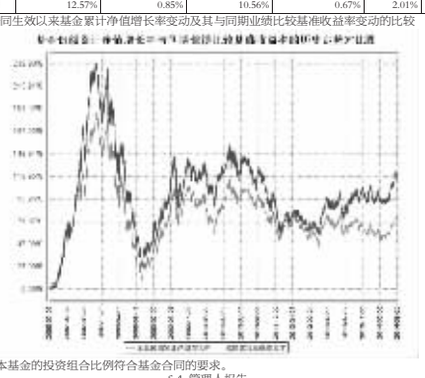
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	12.57%	0.85%	10.56%	0.67%	2.01%	0.18%

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
姚锦	研究部首席策略分析师、本基金的基金经理	2012年2月17日	-	10	博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师、天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职,2009年3月17日至2011年3月3日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理;2009年12月17日至2011年5月5日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理,现任我公司研究部首席策略分析师,2012年2月17日起任建信优选成长股票型证券投资基金基金经理,2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任股票型证券投资基金基金经理;2014年1月20日起任建信保本基金的基金经理,该基金于1月23日起转型为建信积极配置混合型证券投资基金基金,姚锦继续担任该基金的基金经理。

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,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《建信优选成长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

三季度全球市场对于美国经济复苏,就业好转的预期进一步增强,伴随全球资本回流美国,美元上涨,美国国债收益率波动下行,股票指数高位波动。预计在美国经济温和复苏过程中,QE退出的确定性和长期维持较低利率的目标在不同时期对市场仍旧会有不同的影响。与此对应的是欧洲和日本较弱的经济数据,和具有不确定性的宽松的政策。国内稳增长和改革措施相继出台,央行定向放松,放松房贷政策,地方债务管理和预算法等政策相继出台,流动性仍旧维持较为宽松,以银行理财为代表的利率水平平稳降低。

三季度市场的主要影响因素从稳增长带来的数据好转,转变为乐观的改革预期,从而带动估值水平显著上升,指数出现年内最大的上涨。结构分化仍旧是市场主基调,受益改革的板块表现突出,如军工,上改等行业,转型和重组相关的品种表现突出,基本面出现利好的行业如新能源,环保表现较好,部分周期品种在成本降低,供给受限以及出口带动等影响下表现较好,如钢铁、化工等。以银行,家电,汽车,医药等为代表的大盘蓝筹表现平稳。本基金在三季度维持较高仓位,重点配置的军工,新能源,化工,环保等行业表现较好。

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12.57%,波动率0.85%,业绩比较基准收益率10.56%,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

本基金判断改革预期将是未来影响市场的主要因素,改革的进程和落实将对市场形成较大影响,低于预期的情况可能会导致市场调整。未来稳增长防风险的大基调下,整体的经济增长和业绩出现显著超预期的可能性较低,影响市场的主要是资金和预期带动的估值变动。从结构上来看,同时出现基本面好转和估值提升的板块集中在改革受益的品种上,这些板块的表现可能出现持续的超额收益。关注注册制的推出,有可能带来结构转换,以及存在泡沫的部分成长股估值回归。持续关注信用风险的暴露。

四季度本基金仍将坚持精选个股,选择具有长期趋势性的行业和个股进行投资,根据市场情绪影响针对估值水平进行操作。

§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	1,715,870,099.35	84.98
	其中:股票	1,715,870,099.35	84.98
2	固定收益投资	140,154,000.00	6.94
	其中:债券	140,154,000.00	6.94
	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	158,070,557.15	7.83
7	其他资产	5,157,827.89	0.26
8	合计	2,019,252,484.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	51,231,911.72	2.59
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,186,754,937.25	59.91
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	178,480,573.46	9.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,190,058.60	3.09
J	金融业	78,968,580.00	3.99
K	房地产业	55,725,593.84	2.81
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	103,518,444.48	5.23
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	1,715,870,099.35	86.63

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	600887	伊利股份	6,925,086	179,359,727.40	9.05
2	601766	中国南车	18,753,900	98,645,514.00	4.98
3	601299	中国北车	18,670,007	98,390,936.89	4.97
4	300070	碧水源	2,052,687	62,114,308.62	3.14
5	601311	骆驼股份	4,013,698	61,208,894.50	3.09
6	300059	东方财富	3,899,940	61,190,058.60	3.09
7	601866	中海集运	19,134,341	60,847,204.38	3.07
8	600026	中海发展	10,599,740	58,934,554.40	2.98
9	600428	中远航运	14,822,933	58,698,814.68	2.96
10	600409	三友化工	8,999,901	57,329,369.37	2.89

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	140,154,000.00	7.08
	其中:政策性金融债	140,154,000.00	7.08
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	140,154,000.00	7.08

注:无。

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	140212	14国开12	1,400,000	140,154,000.00	7.08

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	933,061.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,518,915.92
5	应收申购款	1,705,850.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,157,827.89

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

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,178,212,175.01
报告期期间基金总申购份额	30,376,455.51
减:报告期期间基金总赎回份额	175,976,218.05
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	2,032,612,412.47

注:上述总申购份额含转换入份额,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

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优选成长股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信优选成长股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信优选成长股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信优选成长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

建信优化配置混合型证券投资基金

【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	建信优化配置混合
基金主代码	530005
交易代码	530005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月1日
报告期末基金份额总额	6,314,443,734.96份
投资目标	通过合理的资产配置和积极的证券选择,在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。
投资策略	基金管理人对宏观经济、行业及上市公司、债券、货币市场工具等进行定性与定量相结合的研究,运用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在大类资产配置这一宏观层面与个股个券选择这一微观层面优化投资组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:60%×富时中国A600指数+40%×中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
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	78,502,612.76
2.本期利润	662,161,526.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.0996
4.期末基金资产净值	6,100,608,584.44
5.期末基金份额净值	0.9661

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;

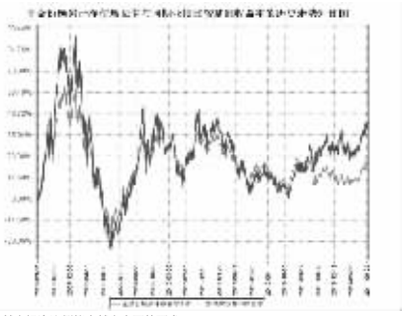
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	11.51%	0.77%	9.11%	0.53%	2.40%	0.24%

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,本基金投资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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陶灿	本基金的基金经理	2011年7月11日	-	7	硕士。2007年7月加入本公司,从事行业研究,历任研究员、基金经理助理,2011年7月11日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理;2014年5月14日起任建信改革红利股票型证券投资基金基金经理。
马志强	本基金的基金经理	2013年11月13日	-	10	博士,曾就职于东北证券公司、北京高汇投资管理有限公司、北京蓝巢投资有限公司,2004年11月起就职于天弘基金管理公司,2008年12月2日至2011年3月23日任天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理。2011年3月加入本公司,2011年8月2日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理;2013年11月13日起任建信优化配置基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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《建信优化配置混合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年三季度市场稳步上扬,个股表现非常活跃,市场各路资金进场,成交量稳步放大。本组合保持了较高的股票仓位,适当参与了各类主题投资,行业上增持了券商、环保、医药行业,减持了地产行业。

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11.51%,波动率0.77%,业绩比较基准收益率9.11%,波动率0.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于宏观而言,增速下一个台阶和调整增长模式早已达成共识。近期政府采取了宽货币、紧财政的政策,缓冲下滑的经济的同时,避免了地方政府债务的蔓延。应该说股票市场对于这次的政策指向给予了积极的回应。我们对四季度的股票市场仍然抱有积极的态度,市场的波动在所难免,但结构性的机会仍然会此起彼伏。大部分机会来自个股,而行业上重点关注低估值的消费板块等。

本基金将会通过吸收投研团队的研究成果,优化组合配置并精选个股,力争给持有人带来超额收益。

§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	5,177,182,789.88	84.17
	其中:股票	5,177,182,789.88	84.17
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	971,272,235.98	15.79
7	其他资产	2,543,496.79	0.04
8	合计	6,150,998,522.65	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	703,100,750.09	11.53
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,554,753,581.88	41.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,701,575.96	0.90
E	建筑业	39,623,221.77	0.65
F	批发和零售业	12,931,152.10	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	170,817,135.18	2.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	384,784,074.28	6.31
J	金融业	417,181,987.80	6.84
K	房地产业	271,432,320.27	4.45
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	195,839,694.00	3.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	74,143,058.30	1.22
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	297,874,238.25	4.88
S	综合	-	-
	合计	5,177,182,789.88	84.86

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	600570	恒生电子	6,081,046	256,498,520.28	4.20
2	300202	聚龙股份	7,425,886	210,598,126.96	3.45
3	000998	隆平高科	13,548,574	204,177,010.18	3.35
4	300070	碧水源	6,471,900	195,839,694.00	3.21
5	601555	东吴证券	17,311,128	178,304,618.40	2.92
6	601633	长城汽车	5,135,891	156,182,445.31	2.56
7	002714	牧原股份	2,835,609	155,873,426.73	2.56
8	600887	伊利股份	5,840,439	151,267,370.10	2.48
9	600372	中航电子	5,594,114	149,698,490.64	2.45
10	600109	国金证券	6,356,988	148,499,239.68	2.43

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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	1,814,246.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	199,903.12
5	应收申购款	529,347.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,543,496.79

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

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	6,922,228,901.78
报告期期间基金总申购份额	20,283,458.42
减:报告期期间基金总赎回份额	628,068,625.24
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	6,314,443,734.96

注:上述总申购份额含转换入份额,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

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优化配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信优化配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信优化配置混合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

建信货币市场基金

【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	建信货币
基金主代码	530002
交易代码	530002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月25日
报告期末基金份额总额	21,230,605,617.26份
投资目标	在力保本金安全和基金财产较高流动性的前提下,争取获得超过投资基准的收益率。
投资策略	综合运用定量分析和定性分析手段,全面评估货币市场的利率走势、类属资产和券种的风险收益水平及流动性特征,在此基础上制订本基金投资策略。具体而言,包括短期资金利率走势预测、组合剩余期限调整策略、债券期限配置策略、类属资产配置策略、品种选择策略和交易策略等方面。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为6个月银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种;预期收益和风险均低于债券基金、混合基金、股票基金。
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	255,126,862.09
2.本期利润	255,126,862.09
3.期末基金资产净值	21,230,605,617.26

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,由于货币市场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。

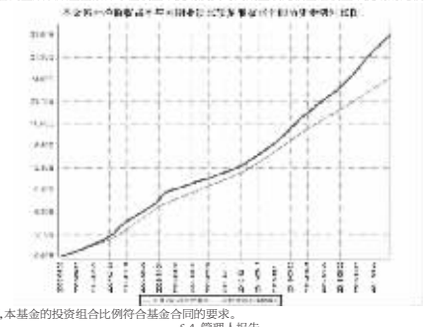
3.2 基金净值表现

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

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	1.0435%	0.0018%	0.7181%	0.0000%	0.3254%	0.0018%

注:基金收益分配按日结转份额。

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



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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
于倩倩	本基金的基金经理	2013年8月5日	-	6	于倩倩女士,硕士。2008年6月加入国泰人寿保险公司,任固定收益研究专员;2009年9月加入金元惠理基金管理公司(原金元比联基金管理公司),任债券研究员;2011年6月加入我公司,历任债券研究员、基金经理助理,2013年8月5日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财债券基金的基金经理;2014年6月17日起任建信盈新宝货币市场基金基金经理;2014年9月17日起任建信现金添利货币基金的基金经理。

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,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《建信货币市场基金基金合同》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

回顾3季度,债券市场在多空僵持的氛围中重回上涨通道,并突破上半年高点,这主要得益于经济基本面数据的意外断崖式下跌,使得市场对于经济预期以及政策预期的走向重新作出修正;具体来看,5-6月份相对偏强的经济金融数据并没有在3季度得到延续,7-8月份社融数据接连走弱,超出高基数所带来的影响,显示表内表外融资需求皆不旺,与此相对应,实体经济的供需两端我们看到的是,制造业再度累积库存去化的压力,基建投资缺乏财政余粮的支撑,房地产销量重新探底,整体投资数据全面下滑,尽管出口阶段回暖,但仍未阻挡工业生产增速破位下跌。

弱于预期的基本面数据使得政策态度也在悄然纠偏中,一方面,在国务院号召全面降低社会融资成本的大旗下,央行重启了公开市场操作利率的下调通道,另一方面,尽管央行官员曾表示"池子里的水已经很多了",但9月下旬5000亿SLF的定向放水仍显露出政策层的托底意图;此外,对于房地产信贷政策的放松传言不绝于耳,也已经于近期获得验证。

资金面而言,在政策层的呵护下整体波澜不惊,每逢IPO扰动公开市场会有相应对冲,9月存款偏离度纳入考核机制下,季末冲存款效应明显消退。

经济重新走弱以及政策实际纠偏,为本已胶着的债券市场提供了进一步上涨的空间和动能,3季度中债银行间债券总净价指数上涨0.48%,其中金融债净价指数上涨1%,明显好于国债,企业债涨幅次之,净价上涨0.78%,总回报以全价计,仍是企业债占优;收益率曲线的变化来看,利率债曲线再度平坦化下行,反应市场对经济预期悲观,信用债曲线也继续平坦化,同时3年以内中高等级信用息差被继续压缩。

本基金以管理流动性为第一要务,为预防9月赎回压力,本基金卖出了部分短券以释放部分浮盈,同时积极把握IPO扰动时点,重点布局资金至4季度及明年1季度,并适度参与了一级市场短券投标,保持整体剩余期限在中等偏高的水平,整体而言,通过合理利用杠杆策略,为投资者获得了相对较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值收益率1.0435%,波动率0.0018%,业绩比较基准收益率0.7181%,波动率0.0000%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望