建信信用增强债券型证券投资基金

【2015】第一季度报告

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:2015年4月21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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月17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2015年1月1日起至12月31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	建信信用	
基金主代码	165311	
交易代码	165311	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月16日	
报告期末基金份额总额	330,300,646.38份	
投资目标	在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益,实现基金资产的长期稳健增值。	
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。同时,在固定收益资产所提供的稳健收益基础上,适当参与新股发行申购及增发新股申购,为基金份额持有人增加收益,实现基金资产的长期增值。	
业绩比较基准	中国债券总指数收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于中等风险基金产品。其预期风险和收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 由于主要投资于除国债、中央银行票据以外的信用类金融工具,因此本基金投资蕴含一定的信用风险,预期风险和收益水平高于一般的不涉及股票二级市场投资的债券型基金。	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信信用增强债券A	建信信用增强债券C
下属分级基金的交易代码	165311	165314
报告期末下属分级基金的份额总额	245,865,619.61份	84,435,026.77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(2015年1月1日 - 2015年3月31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	29,087,173.68	11,825,022.25
2.本期利润	12,234,724.91	4,875,387.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0437	0.0467
4.期末基金资产净值	302,103,806.27	103,301,027.62
5.期末基金份额净值	1.229	1.223

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

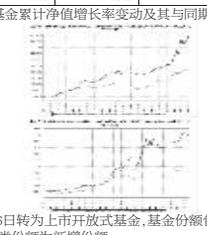
建信信用增强债券A

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	3.80%	0.58%	0.32%	0.12%	3.48%	0.46%

建信信用增强债券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	3.64%	0.60%	0.32%	0.12%	3.32%	0.48%

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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李菁	投资管理部副总监、本基金的基金经理	2011年6月16日	-	9	硕士。2002年7月进入中国建设银行,从事基金托管业务,任主任科员。2005年9月进入建信基金管理有限责任公司,历任债券研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、投资管理部副总监。2007年11月3日至2012年2月17日任建信货币市场基金基金经理,2009年6月2日起任建信收益增强基金基金经理,2011年6月16日起任建信信用增强债券基金基金经理。

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《建信信用增强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》、《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

1-2月工业增加值、投资数据以及PM1指数均表现疲软,预计1季度国内经济数据相比去年下滑趋势难改。国际方面,美国就业数据表现良好,但整体经济增长存在放缓压力,美联储加息预期推后,美元指数自3月中旬后有所调整,欧洲和日本经济仍维持疲态。政策方面,仍然延续稳增长的思路,降息、地方政府债务置换、地产政策放松以及存款保险制度等一系列制度安排陆续出台。

在此背景下,沪深300指数上涨14.6%,创业板涨幅更大,累计上涨58.7%,中小板上涨46.8%, 上证综指创下09年以来的新高。债券市场方面,春节前,收益率有所下行,春节后受股市分流、地方债供给增加以及地产政策放松稳增长预期升温的多重挤压,收益率曲线陡峭化上行,整体收益率有所上升。

回顾一季度的基金管理工作,基金适度参与了长期金融债的波段机会,由于大部分大盘转债赎回到期,基金转债投资比例下降,也相应调整了转债的持仓结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期信用增强A净值增长率3.8%,波动率0.58%,信用增强C净值增长率3.64%,波动率0.6%;业绩比较基准收益率0.32%,波动率0.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们认为二季度宏观经济仍然持续弱势,居民物价水平指数也在低位运行,经济基本面上对债市仍然较为有利,但随着前期货币财政宽松政策陆续落实执行,市场对经济复苏的预期在逐步升温,而股市财富效应的体现使得许多理财资金对债券投资有挤出效应。整体而言,我们认为债券市场方面,随着一季度数据的出台和资金面的缓解,市场前期悲观情绪有望得到缓解,市场有短期波段机会;股票市场方面,在经历了前期涨幅后,高估值的公司面临季报业绩考验,相对低估值的蓝筹板块将面临经济数据考验,市场波动性将加剧。

本基金将在严控风险的前提下,加强组合投资的灵活性,力求为持有人获得较好的绝对收益。

§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	25,766,723.56	4.00
	其中:股票	25,766,723.56	4.00
2	固定收益投资	589,898,253.84	91.64
	其中:债券	589,898,253.84	91.64
	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	10,325,688.49	1.60
7	其他资产	17,712,407.94	2.75
8	合计	643,703,073.83	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,246,000.00	0.80
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	-	-
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	22,520,723.56	5.56
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	25,766,723.56	6.36

注:以上行业分类以2015年3月31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	600109	国金证券	495,922	12,665,847.88	3.12
2	601318	中国平安	125,957	9,854,875.68	2.43
3	600219	南山铝业	300,000	3,246,000.00	0.80

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	49,287,000.00	12.16
	其中:政策性金融债	49,287,000.00	12.16
4	企业债券	374,046,230.00	92.26
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	72,387,000.00	17.86
7	可转债	94,178,023.84	23.23
8	其他	-	-
9	合计	589,898,253.84	145.51

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	1480386	14冀渤海债	700,000	72,184,000.00	17.81
2	101474009	14沪世茂MTN002	600,000	62,088,000.00	15.32
3	0980104	09垂城投债	450,000	45,675,000.00	11.27
4	122591	12常交债	400,000	41,736,000.00	10.29
5	1280089	12联泰债	300,000	30,876,000.00	7.62

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	61,947.37
2	应收证券清算款	990,995.76
3	应收股利	-
4	应收利息	16,539,267.13
5	应收申购款	120,197.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,712,407.94

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	110023	民生转债	16,086,671.30	3.97
2	110028	冠城转债	15,409,950.00	3.80
3	113007	吉视转债	15,140,768.70	3.73
4	128008	齐峰转债	11,253,199.76	2.78
5	128005	齐翔转债	8,687,626.06	2.14
6	128006	长青转债	8,108,761.44	2.00
7	128007	通鼎转债	1,824,916.08	0.45

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信信用增强债券A	建信信用增强债券C
报告期期初基金份额总额	279,432,257.18	131,877,297.12
报告期期间基金总申购份额	49,927,370.73	49,713,262.80
减:报告期期间基金总赎回份额	83,494,008.30	97,155,533.15
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	245,865,619.61	84,435,026.77

注:上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§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

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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信用增强债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信信用增强债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信信用增强债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信信用增强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
2015年4月21日

建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)

【2015】第一季度报告

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:2015年4月21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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2015年4月17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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信优势动力股票(LOF)
场内简称	建信优势
基金主代码	165313
交易代码	165313
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年3月19日
报告期末基金份额总额	831,591,541.96份
投资目标	采取定量和定性相结合的方法,寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力,但是价值被低估的优势上市公司,通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险,在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产来获取超额收益。
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	75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,一般情况下其风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。属于较高风险收益特征的证券投资基金品种。
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

§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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	198,652,128.40
2.本期利润	184,349,374.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.1816
4.期末基金资产净值	1,217,476,078.82
5.期末基金份额净值	1.464

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。

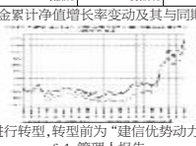
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	15.37%	1.58%	11.09%	1.37%	4.28%	0.21%

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:本基金于2013年3月19日进行转型,转型前为"建信优势动力股票型证券投资基金"。

§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		
姜锋	本基金的基金经理	2013年3月19日	-	7	硕士。2007年7月加入本公司,从事行业研究,任研究员。2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理,该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力股票型证券投资基金(LOF),姜锋继续担任该基金基金经理;2014年3月21日起任建信健康民生混合型证券投资基金基金经理。
万志勇	投资管理部副总监、本基金的基金经理	2013年3月19日	-	13	硕士。曾就职于西安创新互联网孵化器有限公司、北方证券有限责任公司、大成基金管理有限公司、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司(原巨田基金管理有限公司)、银华基金管理有限公司。2008年10月23日至2009年11月11日任银华领先策略基金基金经理,2009年6月1日至2010年6月19日任银华和谐主题基金基金经理。2010年7月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究部执行总监、研究部执行总监兼投资管理部副总监、投资管理部副总监。2010年11月17日起任建信内生动力股票型证券投资基金基金经理;2011年5月6日至2012年5月18日任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理;2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理,该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力股票型证券投资基金(LOF),万志勇继续担任该基金基金经理。

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《建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)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

2015年1季度国内宏观经济继续下行,政府通过释放准备金存款的政策来维持流动性,同时对地产信贷政策进行了调整,稳经济的措施继续推行。市场继续憧憬经济的转型,受益于移动互联网的相关板块领涨市场。

本基金基于对政策、经济基本面和企业盈利的判断,结合市场的估值水平,以低估值地产、汽车和家电为主要配置对象,均衡配置了TMT板块。

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15.37%,波动率1.58%,业绩比较基准收益率11.09%,波动率1.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,美国经济保持回升态势,美联储加息时点临近,需要关注国际资金流向变动;欧洲经济逐步步入复苏通道;国内经济有望在一系列政策托底作用下逐步企稳,重点关注地产销售变化对总投资的影响。

本基金在2015年2季度将继续采取相对均衡的配置策略,积极寻找业绩可预见性强的消费股、成长性与估值匹配的成长股和基本面持续改善的周期股,尽力为基金持有人创造回报。

§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	943,191,973.45	76.11
	其中:股票	943,191,973.45	76.11
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	253,601,306.28	20.46
7	其他资产	42,462,506.63	3.43
8	合计	1,239,255,786.36	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	537,011,426.52	44.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,266,721.89	1.09
F	批发和零售业	57,556,512.85	4.73
G	交通运输、仓储和邮政业	7,941,600.00	0.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,007,043.14	2.22
J	金融业	62,852,690.56	5.16
K	房地产业	129,722,001.57	10.65
L	租赁和商务服务业	57,552,261.94	4.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	39,081,714.98	3.21
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	11,200,000.00	0.92
S	综合	-	-
	合计	943,191,973.45	77.47

注:以上行业分类以2015年03月31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	000024	招商地产	1,996,005	65,748,404.70	5.40
2	000550	江铃汽车	1,522,926	65,455,359.48	5.38
3	600048	保利地产	5,567,763	63,973,596.87	5.25
4	000625	长安汽车	2,543,465	58,728,606.85	4.82
5	002344	海宁皮城	2,415,118	57,552,261.94	4.73
6	601318	中国平安	712,744	55,765,090.56	4.58
7	300070	碧水源	901,747	39,081,714.98	3.21
8	300124	汇川技术	898,290	37,521,573.30	3.08
9	600104	上汽集团	1,494,731	37,159,012.66	3.05
10	000333	美的集团	1,075,454	35,436,209.30	2.91

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	378,045.78
2	应收证券清算款	41,764,855.95
3	应收股利	-
4	应收利息	132,742.12
5	应收申购款	186,862.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,462,506.63

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	000625	长安汽车	58,728,606.85	4.82	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,132,851,685.51
报告期期间基金总申购份额	43,499,453.37
减:报告期期间基金总赎回份额	344,759,596.92
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	831,591,541.96

注:上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§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	5,018,905.13
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	5,018,905.13
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2015年3月10日	-5,018,905.13	-6,609,898.06	0.00%
合计			-5,018,905.13	-6,609,898.06	

§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势动力股票型证券投资基金(LOF)设立的文件;

2、《建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)基金合同》;

3、《建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》;

4、《建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)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
2015年4月21日

建信周盈安心理财债券型证券投资基金

【2015】第一季度报告

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:2015年4月21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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2015年4月17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2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信周盈安心理财	
基金主代码	530030	
交易代码	530030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年9月17日	
报告期末基金份额总额	2,307,641,175.68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。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过127天。	
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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	建信周盈安心理财A	建信周盈安心理财B
下属分级基金的交易代码	530030	531030
报告期末下属分级基金的份额总额	1,665,712,558.96份	641,928,616.72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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)	
	建信周盈安心理财A	建信周盈安心理财B
1. 本期已实现收益	22,512,556.96	7,890,998.03
2.本期利润	22,512,556.96	7,890,998.03
3.期末基金资产净值	1,665,712,558.96	641,928,616.72

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入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

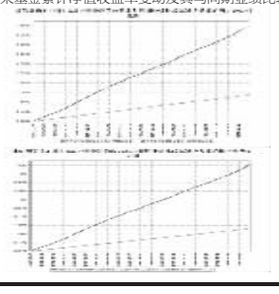
建信周盈安心理财A

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	1.2280%	0.0072%	0.3329%	0.0000%	0.8951%	0.0072%

建信周盈安心理财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	1.3005%	0.0072%	0.3329%	0.0000%	0.9676%	0.0072%

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,本基金投资比例符合基金合同要求。

§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		
高珊	本基金的基金经理	2013年9月17日	-	8	硕士。2006年7月至2007年6月期间在中信建投证券公司工作,任交易员。2007年6月加入建信基金管理公司,