建信货币市场基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	17,859,218,693.08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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1. 本期已实现收益	260,862,996.59
2.本期利润	260,862,996.59
3.期末基金资产净值	17,859,218,693.08

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。

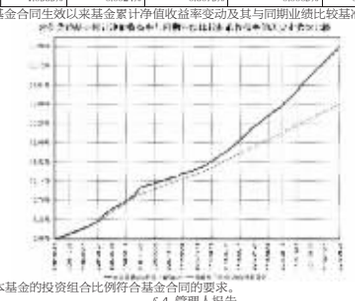
2、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

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	1.0565%	0.0024%	0.6075%	0.0003%	0.4490%	0.0021%

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、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日起任建信嘉泰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。
陈建良	本基金的基金经理	2013年12月10日	-	7	2005年6月加入中国建设银行厦门分行,任客户经理;2007年6月调入中国建设银行总行金融市场部,任债券交易员;2013年9月加入我公司投资管理部,任基金经理助理。2013年12月10日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信月盈安心理财基金基金经理;2014年6月17日起任建信嘉泰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。
高珊	本基金的基金经理	2013年12月20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,历任初级交易员、交易员。2009年7月起任建信货币市场基金的基金经理助理。2012年8月28日起任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日起任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年1月29日起任建信双月安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年9月17日起任建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年12月20日起任建信货币市场基金基金经理。

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,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2015年1季度,债券市场整体呈现小幅下跌,收益率先下后上,以净价计,金融债跌幅最大,国债跌幅最小,赚钱机会关键在于把握波段操作,核心影响因素在于政策宽松预期的演绎以及兑现;具体而言,

经济基本面仍笼罩在疲态的阴霾中;这体现在,其一,油价大幅下跌后,石油产业链上游出现的补库存活动,并未带来整体生产活动的改善,其二,去年首次降息后,房地产销售端的回暖程度差强人意,高库存仍制约开工意愿,其三,1-2月信贷数据虽然超预期,但社融增速仍然低迷,表外向表内转移的融资行为仍难提振投资,可能的证据在于投资资金来源增速的表现仍然低迷,其四,相对亮点在于基建投资,但考虑到大量地方政府债务的接续压力,市场对其持续性保持怀疑

然而政策正在行动,预期在博弈中渐似临近拐点;这体现在,其一,2月全面降准以及再度降息,向市场宣告全面政策并不在排斥中,且时点早于预期,这与基本面的形势是相契合的(贬值压力+通缩患影),其二,房地产政策再次放大招,二套房首付比例下调以及税收免征期限缩短,都意在激活房地产市场的销售端,其三,财政政策终于迈出积极的一步,不止体现在政府工作报告中赤字率的提升,更重要的是地方政府债务问题出台了实质性的置换方案,这成为降低融资成本的重要一环;政策连续重拳出台,为3月债市带来3重调整压力,其一,宽信用的剑已在路上,权益资产大好,其二,准利率品的供给大增,其三,地方置换债的投资资金来源能否奇希望于央妈?目前看央妈在这一问题上仍然按兵不动.

资金面在1季度是紧平衡的格局;尽管全面降准兑现,还有逆回购重启,以及各种形式的结构放水(SLO/SLF/PSL/地方国库现金招标),但新股、春节、缴税、贬值压力等等因素都叠加在一起,使得货币市场利率的中枢仍维持在偏高的水平,直到3月中旬后央行逐步引导逆回购利率下行后,才看到资金利率的明显回落.

本基金以管理流动性为第一要务,在保证正常季节性赎回压力的前提下,考虑到1季度短端相对突出的价值,策略上适当增加了债券的配比,积极把握资金波动的时点,参与了一级投标及二级调整的机会,同时同业存款纳入一般存款后,线下同业存款的报价优势更加突出,也适当增加了3个月内存款的配比,总体而言,本基金利用适度杠杆策略,保持债券配比和剩余期限在中等水平,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

本报告期基金净值收益率1.0565%,波动率0.0024%;业绩比较基准收益率0.6075%,波动率0.0003%。

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2015年2季度,关注宽货币能否跟进宽财政的脚步;具体来看,

基本面而言,观察3个纬度数据的走向,其一,4月份公布1季度经济数据,大概率仍难看到明显改善,而金融数据特别是信贷增量能否持续超预期?其二,3月份房地产政策再度放出大招后,2季度高频数据端能否看到相对明显的回暖?其三,开工旺季即将到来,制造业库存端能否看到相对积极的表现?

政策面而言,货币政策预计还是有所作为,2季度由于缴税、新股、债务置换等多重因素,季节性的资金需求理论上是上升的,央行对冲的节奏是影响短期预期波动的关键,1季度经济数据公布前后是可能的时间窗口.

资金面而言,除了传统的季节影响因素外,关注2点变化,其一是注册制改革下新股审批的速度,4月已增加至30家,后续每月是否持续放量?其二,如果宽货币与宽信用同步,理论上线下价格的竞争力应好于线上,因为同业存款纳入一般存款口径后,配资产的同业吸存资金一定程度上能够反应实体融资需求的变化;当然如果宽货币的进程好于预期,则可能引导短端资金成本的全面回落.

债券市场经过3月份的大幅调整后,收益率水平回到了前期高点附近,如果央行能够持续引导短端资金成本回落,则一定程度上应有波段性的操作机会,空间和持续性仍然受制于宽货币与宽信用的协调性.

本基金以管理流动性为第一要务,在保证正常流动性应对能力的前提下,本基金将积极捕捉季节因素带来的资金波动机会,适当布局资金至打新时点及传统季末赎回时点,适当参与一级市场短券投标机会,保持剩余期限在中等水平,控制债券配比在合理水平,继续利用杠杆策略以期为投资者获得稳定的收益.

§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	固定收益投资	10,004,145,670.00	51.43
	其中:债券	10,004,145,670.00	51.43
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,018,404,547.60	10.38
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	6,652,052,618.06	34.20
4	其他资产	775,716,583.69	3.99
5	合计	19,450,319,419.35	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.77	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,572,898,693.55	8.81
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	31.99	8.81
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.28	-
2	30天(含)-60天	22.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	14.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.28	-
4	90天(含)-180天	20.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	15.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	105.14	8.81

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	摊余成本(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	2,109,458,629.27	11.81
	其中:政策性金融债	1,499,501,653.55	8.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	7,894,687,040.73	44.21
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	10,004,145,670.00	56.02
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	100,077,432.94	0.56

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120219	12国开19	5,200,000	519,858,880.33	2.91
2	011481006	14淮南矿SCP006	3,000,000	299,965,221.43	1.68
3	041473005	14马鞍钢铁CP001	3,000,000	299,951,083.73	1.68
4	011474003	14陕煤化SCP003	2,700,000	269,927,073.13	1.51
5	041459052	14中冶CP002	2,700,000	269,898,875.08	1.51
6	041454064	14鞍钢股CP001	2,500,000	249,935,824.15	1.40
7	011473009	14鲁高速SCP009	2,000,000	199,969,264.55	1.12
8	041456046	14青国投CP001	2,000,000	199,946,972.02	1.12
9	011437009	14中建材SCP009	2,000,000	199,942,374.44	1.12
10	011599070	15联合水泥SCP002	2,000,000	199,870,871.27	1.12

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.2068%
报告期内偏离度的最低值	0.0498%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1614%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提摊销。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.8.2

本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 基金投资的前十名债券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	102,170,841.10
3	应收利息	325,567,319.22
4	应收申购款	347,978,423.37
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	775,716,583.69

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	46,227,130,117.83
报告期期间基金总申购份额	31,918,465,198.38
减:报告期期间基金总赎回份额	60,286,376,623.13
报告期期末基金份额总额	17,859,218,693.08

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交易明细

7.1 基金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货币市场基金设立的文件;

2、《建信货币市场基金基金合同》;

3、《建信货币市场基金招募说明书》;

4、《建信货币市场基金托管协议》;

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

建信优化配置混合型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	4,219,438,284.95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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	944,856,044.97
2.本期利润	1,515,672,559.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.3125
4.期末基金资产净值	6,087,739,692.70
5.期末基金份额净值	1.4428

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。

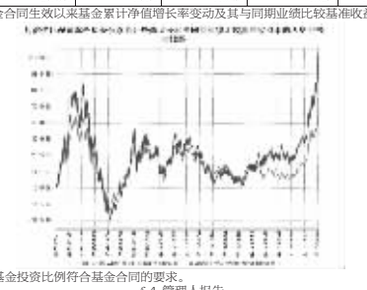
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	28.43%	1.51%	11.04%	1.02%	17.39%	0.49%

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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日至2015年3月25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;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 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率28.43%,波动率1.51%,业绩比较基准收益率11.04%,波动率1.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一季度是个政策频发的季节——地方债务置换、一带一路、自贸区、地产刺激和公募投资港股等等政策相继公布,从市场表现看,解读是相当正面的。但对于市场的认识,我更愿意去基于长周期因素的变化来考量,即流动性变动趋势和居民资产的再配置趋势。目前看,这些还没发生动摇,市场就仍然可以保持一定的乐观。至于市场内部的分化,可以肯定的是互联网对实体经济的改造和创新是一轮大的潮流,但创业板企业只有个别企业能成长为阿里和腾讯,大部分都是泡沫。二季度本基金将继续致力于挖掘周期反转和政策受益的行业品种。

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	5,487,153,760.70	88.49
	其中:股票	5,487,153,760.70	88.49
2	固定收益投资	256,634,062.72	4.14
	其中:债券	256,634,062.72	4.14
	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	451,701,403.59	7.28
7	其他资产	5,250,923.87	0.08
8	合计	6,200,740,150.88	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	67,825,947.00	1.11
B	采矿业	62,325,824.00	1.02
C	制造业	2,540,216,093.58	41.73
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	183,055,684.07	3.01
G	交通运输、仓储和邮政业	111,499,450.84	1.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,393,142,430.30	22.88
J	金融业	395,181,818.80	6.49
K	房地产业	438,552,230.34	7.20
L	租赁和商务服务业	42,197,156.85	0.69
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	104,136,398.52	1.71
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	149,020,726.40	2.45
S	综合	-	-
	合计	5,487,153,760.70	90.13

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	600570	恒生电子	2,798,336	304,682,823.68	5.00
2	300059	东方财富	5,751,893	239,278,748.80	3.93
3	300202	聚龙股份	5,873,816	228,608,918.72	3.76
4	600271	航天信息	4,142,743	215,256,926.28	3.54
5	300017	网宿科技	2,165,371	193,562,513.69	3.18
6	600109	国金证券	7,456,974	190,451,115.96	3.13
7	600340	华夏幸福	3,094,012	171,346,384.56	2.81
8	601633	长城汽车	3,275,996	170,384,551.96	2.80
9	600594	益佰制药	3,819,825	168,034,101.75	2.76
10	601098	中南传媒	6,652,711	149,020,726.40	2.45

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	256,634,062.72	4.22
8	其他	-	-
9	合计	256,634,062.72	4.22

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	110023	民生转债	1,323,420	181,665,863.40	2.98
2	113501	洛钼转债	360,990	63,212,958.90	1.04
3	128009	歌尔转债	71,339	11,755,240.42	0.19

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	2,421,275.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	192,102.87
5	应收申购款	2,637,545.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,250,923.87

5.11.4 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	181,665,863.40	2.98

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	600271	航天信息	215,256,926.28	3.54	重大事项停牌
2	300059	东方财富	239,278,748.80	3.93	重大资产重组停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	5,338,371,778.71
报告期期间基金总申购份额	93,634,453.85
减:报告期期间基金总赎回份额	1,212,567,947.61
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	4,219,438,284.95

注:上述总申购份额含转换转入份额,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

本基金本报告期末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
2015年4月21日

建信优选成长股票型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	1,889,772,463.37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,调整限制和调整范围,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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	574,754,502.78
2.本期利润	866,256,734.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.4392
4.期末基金资产净值	3,066,772,406.76
5.期末基金份额净值	1.6228

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 |