建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金

【2015】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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信安心回报两年定期开放债券
基金主代码	000346
交易代码	000346
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月5日
报告期末基金份额总额	276,492,878.50份
投资目标	在严格控制风险并保持较高流动性的基础上,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。本基金在债券资产所提供的稳定收益的基础上,适当参与一级市场新股申购或增发新股,为基金份额持有人增加收益,实现基金资产的长期稳定增值。 本基金在综合分析宏观经济、货币政策等因素的基础上,采用久期管理、期限管理、类属管理和风险管理相结合的投资策略。在个券选择上,本基金将综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险分析、流动性分析等方法来评估个券的投资价值。
业绩比较基准	两年期银行定期存款收益率(税前)。
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、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	招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	建信安心回报两年定期开放债券A	建信安心回报两年定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	000346	000347
报告期末下属分级基金的份额总额	137,692,107.39份	138,800,771.11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7月1日 - 2015年9月30日)		
		建信安心回报两年定期开放债券A	建信安心回报两年定期开放债券C
1. 本期已实现收益		2,770,725.54	2,660,244.29
2. 本期利润		2,056,543.57	1,941,958.05
3. 加权平均基金份额本期利润		0.0149	0.0140
4. 期末基金资产净值		144,401,113.69	145,225,687.69
5. 期末基金份额净值		1.049	1.046

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、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

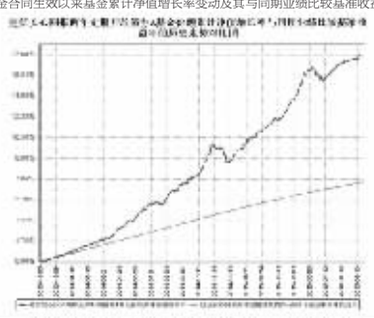
建信安心回报两年定期开放债券A

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	1.45%	0.08%	0.64%	0.01%	0.81%	0.07%

建信安心回报两年定期开放债券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	1.36%	0.07%	0.64%	0.01%	0.72%	0.06%

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		
彭云峰	本基金的基金经理	2013年11月5日	-	10	硕士。曾任中经网数据有限公司财经分析师、国都证券有限责任公司债券研究员兼宏观研究员,2006年5月起就职于鹏华基金管理公司,历任债券研究员、社保组合投资经理、债券基金经理等职,2010年5月31日至2011年6月14日任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理。彭云峰于2011年6月加入本公司,2011年11月30日至2013年5月3日任建信保本混合型证券投资基金基金经理;2012年2月17日至2014年1月21日任建信货币市场基金基金经理;2012年5月29日起任建信转债增强债券型证券投资基金基金经理;2013年7月25日起任建信双债增强债券型证券投资基金基金经理;2013年11月5日起任建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金经理;2015年5月26日起任建信新经济灵活配置混合型证券投资基金。

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《建信安心回报两年定期开放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》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年三季度,中国经济增速小幅下滑。与二季度相比,7-8月投资、出口、工业增加值增速明显下降,消费增速小幅提高,CPI增速有所回升,但仍处于较低水平。三季度资金面宽松,银行间短期回购利率总体保持在较低水平。8月26日,央行宣布下调存贷款基准利率并降低存款准备金率。

由于经济数据偏弱,通胀水平较低,货币政策宽松,同时股票市场大幅调整导致更多资金投资债券市场,因而三季度债券市场持续上涨,各期限、各品种债券收益率均不同程度下行。分类别看,中长期债券表现好于短期债券,信用债好于利率债,城投债好于产业债。

三季度股票市场大幅下跌,高估值的中小市值股票跌幅相对较大。可转债跟随对应股票,也出现了明显下跌。由于可转债市场规模较小,有一定稀缺性,总体而言可转债比对应股票的跌幅稍小。

2015年三季度,本基金主要投资较短期限的信用债。由于股票市场波动较大,可转债有一定投资风险,本基金三季度基本没有投资可转债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期安心回报两年A净值增长率1.45%,波动率0.08%,安心回报两年C净值增长率1.36%,波动率0.07%;业绩比较基准收益率0.64%,波动率0.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于货币政策持续宽松,稳增长政策不断推出,房地产等行业出现企稳迹象,预计四季度中国经济形势可能有所好转,经济增速有望小幅回升,通胀水平仍然较低。我们预计四季度货币政策将继续相对宽松,准备金率和基准利率可能进一步下调,前者下调的概率更大。

基于以上判断,我们对四季度债券市场相对乐观。四季度中长期债券收益率可能仍有一定下降空间,短期债券收益率或小幅波动。9月美国就业数据不佳,投资者对美联储加息时间预期延后,人民币汇率有望保持相对稳定,有利于国内投资者提高风险偏好。同时,经过短期大幅调整,股票市场估值总体相对合理,部分行业和品种明显低估。因而我们对四季度权益市场的表现相对乐观。虽然目前可转债整体转股溢价率偏高,但如果对应股票大幅上涨,可转债或有较好表现。

11月上旬本基金将结束第一个投资周期,开始第二个为期两年的投资周期。四季度本基金将坚持谨慎投资,稳中求进,追求绝对收益。本基金将把债券组合久期保持在相对较低水平,适度提高杠杆比例。本基金将主要投资剩余期限2年以内的信用债,以交易所上市品种为主。在下一投资周期建仓初期,本基金对可转债的投资将非常谨慎。我们将密切关注债券市场、宏观经济形势,以及政策动态,积极调整投资组合。在控制风险的基础上,力争获取更多投资收益。

§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	713,245.50	0.22
	其中:股票	713,245.50	0.22
2	固定收益投资	296,750,383.40	91.85
	其中:债券	296,750,383.40	91.85
	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	16,476,252.77	5.10
7	其他资产	9,150,402.04	2.83
8	合计	323,090,283.71	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	713,245.50	0.25
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	-	-
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	713,245.50	0.25

注:以上行业分类以2015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	000887	中鼎股份	28,818	713,245.50	0.25

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	5,418,965.50	1.87
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	170,026,417.90	58.71
5	企业短期融资券	101,069,000.00	34.90
6	中期票据	20,236,000.00	6.99
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	296,750,383.40	102.46

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	122212	12京江河	394,650	39,630,753.00	13.68
2	041561011	15津城建CP001	300,000	30,405,000.00	10.50
3	122290	13包钢01	240,870	24,335,096.10	8.40
4	122204	12双良节	209,000	21,290,830.00	7.35
5	1282432	12北部湾MTN1	200,000	20,236,000.00	6.99

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

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	24,435.32
2	应收证券清算款	691,102.96
3	应收股利	-
4	应收利息	8,434,863.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,150,402.04

5.10.4 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。

5.10.5 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	000887	中鼎股份	713,245.50	0.25	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信安心回报两年定期开放债券A	建信安心回报两年定期开放债券C
报告期期初基金份额总额	137,692,107.39	138,800,771.11
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	137,692,107.39	138,800,771.11

§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安心回报两年定期开放债券型证券投资基金设立的文件;
2、《建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信安心回报两年定期开放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10月27日

建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

【2015】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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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	建信双利分级股票
场内简称	建信双利
基金主代码	165310
交易代码	165310
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月6日
报告期末基金份额总额	174,174,587.38份
投资目标	本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值,力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过自上而下的方式,通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析,深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题,在前述主题筛选和主题配置的基础上,本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具,采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。 从本基金所分离的两类基金份额来看,建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额;建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	建信双利	建信稳健	建信进取
下属分级基金的场内简称	建信双利	建信稳健	建信进取
下属分级基金的交易代码	165310	150036	150037
报告期末下属分级基金的份额总额	167,271,975.38份	2,761,044.00份	4,141,568.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。	建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额。	建信进取份额将表现出高风险、高预期收益的显著特征,其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。

§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7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-29,940,535.05
2.本期利润	-85,538,656.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4696
4.期末基金资产净值	195,537,459.54
5.期末基金份额净值	1.123

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	-29.01%	3.65%	-27.06%	3.18%	-1.95%	0.47%

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		
梁洪昀	金融工程及指数投资部总经理、本基金的基金经理	2015年3月25日	-	12	特许金融分析师(CFA),2003年1月获清华大学经济学博士学位,2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司,历任金融工程部研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监、投资管理部总监、金融工程及指数投资部总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理;2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2011年9月8日起任深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金基金经理;2015年3月25日起任建信双利分级股票基金的基金经理;2015年7月31日起任建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金基金经理;2015年8月6日起任建信中证申万有色金属指数分级发起式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《建信双利策略主题分级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

本基金属于高仓位股票型基金,在仓位选择上余地很小,更多地是通过精选个股方式力争取得超越基准的业绩表现。在报告期内,本基金采取较为均衡的配置策略,力求基金业绩表现相对平稳。

报告期内,A股市场经历了剧烈的波动,波动之大、波动之急均为历史所罕见。其间,还曾伴随上市公司股票的大面积停牌。在大面积停牌发生时,股票交易首先要考虑基金的流动性需求,收益性要求退居次席,这在一定程度上影响了基金的表现。此外,在市场波动加大、组合中停牌股票比重增大时,停牌股票净值调整对于组合净值表现的影响也会加大。

从报告期整体来看,在市场出现大幅波动时,投资组合较好地控制了风险,尤其是流动性风险。

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-29.01%,波动率3.65%,业绩比较基准收益率-27.06%,波动率3.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场在3季度大部分时间内都呈现出很高的波动性,直至季度末才有所缓解——这可能预示着在今年余下的时间内,市场的波动会渐趋平缓。投资者和监管层都将吸取之前的教训,采取比之前更为谨慎的策略。

本基金属于高仓位、主动投资的股票型基金,将会通过吸收投研团队的研究成果,优化组合配置,力争给持有人带来超越基准的收益。

§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	权益投资	181,826,472.80	91.26
	其中:股票	181,826,472.80	91.26
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	17,256,138.61	8.66
7	其他资产	148,361.70	0.07
8	合计	199,230,973.11	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	11,163,556.64	5.71
C	制造业	48,585,881.90	24.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,308,452.64	5.27
E	建筑业	10,910,766.00	5.58
F	批发和零售业	3,140,897.00	1.61
G	交通运输、仓储和邮政业	4,929,359.58	2.52
H	住宿和餐饮业	728,028.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,124,956.28	3.13
J	金融业	70,214,032.90	35.91
K	房地产业	12,339,003.94	6.31
L	租赁和商务服务业	800,432.00	0.41
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	678,294.00	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	422,669.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	642,740.92	0.33
S	综合	837,402.00	0.43
	合计	181,826,472.80	92.99

注:以上行业分类以2015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	601318	中国平安	330,556	9,870,402.16	5.05
2	600030	中信证券	486,589	6,607,878.62	3.38
3	600837	海通证券	506,900	6,462,975.00	3.31
4	600900	长江电力	634,336	5,226,928.64	2.67
5	000776	广发证券	380,797	4,988,440.70	2.55
6	600999	招商证券	306,900	4,919,607.00	2.52
7	601377	兴业证券	612,422	4,795,264.26	2.45
8	600028	中国石化	1,007,500	4,775,550.00	2.44
9	601688	华泰证券	326,373	4,543,112.16	2.32
10	601788	光大证券	288,684	4,474,602.00	2.29

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持有股指期货。

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持有股指期货。

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中,中信证券股份有限公司(600030)于2015年1月19日发布公告:2015年1月16日收市后,中国证监会在例行的新闻发布会上,通报证券公司融资融券业务检查情况,提及本公司等3家证券公司由于存在为到期融资融券合约展期的问题,对本公司等3家证券公司采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。2015年1月16日约17时,本公司通过网络报道知悉上述处罚。海通证券股份有限公司(600837)于2015年1月19日发布公告:2015年1月16日,中国证监会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司因存在违规为到期融资融券合约展期问题,受到暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。2015年9月10日,公司收到中国证监会行政处罚事先告知书。对外部接入的第三方交易终端软件未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解,违反相关规定,对华泰证券责令改正,给予警告,没收违法所得28,653,000元,并处以85,959,000元罚款。广发证券股份有限公司(000776)于2015年1月19日发布公告:2015年1月16日,中国证监会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司因存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题,且涉及客户数量较多,受到责令限期改正的行政监管措施。招商证券股份有限公司(600999)于2015年1月16日发布公告:2015年1月16日,中国证监会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司因存在存在向不符合条件的客户融资融券问题,并且受过处理仍未改正,被采取责令限期改正的行政监管措施。华泰证券股份有限公司(601688)于2015年9月12日发布公告:2015年9月10日,公司收到中国证监会行政处罚事先告知书。对外部接入的第三方交易终端软件未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解,违反相关规定,对华泰证券责令改正,给予警告,没收违法所得18,235,275.00元,并处以54,705,825.00元罚款。

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	124,046.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,997.19
5	应收申购款	20,318.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,361.70

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	600900	长江电力	5,226,928.64	2.67	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信双利	建信稳健	建信进取
报告期期初基金份额总额	184,898,570.98	6,580,928.00	9,871,394.00
报告期期间基金总申购份额	2,645,559.25	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	29,821,864.85	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	9,549,710.00	-3,819,884.00	-5,729,826.00
报告期期末基金份额总额	167,271,975.38	2,761,044.00	4,141,568.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换变动份额。

§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、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金设立的文件;
2、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》;
3、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信双利策略主题分级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
2015年10月27日

建信现金添利货币市场基金

【2015】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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信现金添利货币
基金主代码	000693
交易代码	000693
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月17日
报告期末基金份额总额	102,337,631,750.71份
投资目标	在保持基金资产的低风