

建信纯债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:中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同的规定，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。

本报告期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	建信纯债债券
基金代码	630021
交易代码	630021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年1月16日
报告期末基金份额总额	1,674,513,320.83份
报告期末基金份额净值	1.000
报告期末基金资产净值	1,674,513,320.83元
报告期末基金份额总额	1,674,513,320.83份
报告期末基金份额净值	1.000
报告期末基金资产净值	1,674,513,320.83元

§ 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)	
	建信纯债债券A	建信纯债债券C
1. 本期已实现收益	4,695,681.97	10,875,002.79
2. 本期利润	10,436,077.24	24,490,320.62
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0269	0.0276
4. 期末基金资产净值	751,479,782.34	1,170,314,610.72
5. 期末基金份额净值	1.156	1.143

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。

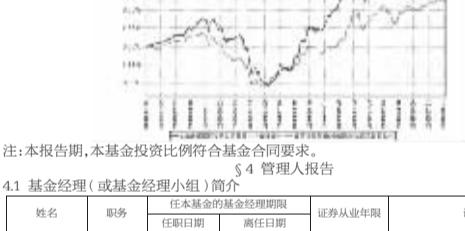
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用实际收益水平要低于所列数字。

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

建信纯债债券				
阶段	净值增长率为	净值增长率为	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率
过去三个月	3.12%	0.12%	1.12%	0.06%
			2.00%	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,本基金投资比例符合基金合同要求。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		说明
		任职日期	离任日期	
黎黎芳	本基金的基金经理	2012年11月15日	-	14

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

在报告期内,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取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 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引》、《证券投资基金公司内

部制度、制定和修订了《公平交易管理制度》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易和外

部制度》、《利益冲突管理制度》等风险控制制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦发

现不同基金同时买卖同一证券时自动提示,在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。证券买卖价格以集中竞价交易价格为准。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易交易较少的单边交易量

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。

4.4.1 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.2 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.3 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.4 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.5 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.6 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.7 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.8 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.9 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.10 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.11 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.12 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.13 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.14 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.15 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.16 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。

4.4.17 报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内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

份额持有人谋取利益,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《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定。