

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法律责任。

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,基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。

本报告期内基金未发生未实现收益。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信纯债债券
基金代码	530021
交易代码	530021
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	1,674,613,320.09份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过主动的资产配置和精选个券,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用自上而下的方法确定投资久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。通过对宏观经济形势、货币政策、利率走势、信用风险等因素进行综合分析和比较,在合理范围内选择债券品种和期限,以期获得长期稳定的投资回报。本基金在固定收益类资产中,主要投资于信用评级较高的债券品种,并适当参与信用债、可转债等品种的投资。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数
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	中国光大银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信纯债债券A
下属分级基金的基金代码	530021
报告期末下属分级基金的份额总额	650,201,646.88份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	4,685,581.97	10.87%
2.本期利润	10,436,077.34	24.60%
3.加权平均基金份额本期利润	0.0289	0.0276%
4.期末基金份额净值	751.678/24.34	1.170/31.610/2
5.期末基金资产净值	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②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	3.12%	0.12%	1.12%	0.00%	2.00%

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	307%	0.12%	1.12%	0.00%	1.96%

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约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
黎芳芳	本基金的基金经理	2015年1月16日	-	14	硕士,2000年7月毕业于湖南大学金融保险专业,后进入光大证券资产管理部,从事基金管理工作。2006年11月加入本公司资产管理部,历任研究员、基金经理助理、基金经理助理,2009年2月19日至2011年11月11日担任建信纯债债券型证券投资基金基金经理,2011年11月11日至2015年1月16日担任建信纯债债券型证券投资基金基金经理,2015年1月16日至2015年10月27日担任建信纯债债券型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

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《建信纯债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

为了公平对待投资者,保护投资者利益,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《公平交易管理制度》、《异常交易管理制度》、《公司防范内幕交易管理制度》、《利益冲突管理制度》等风险管理制度。公司使用的交易系统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,严禁直接或间接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。

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法律责任。

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,基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。

本报告期内基金未发生未实现收益。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信信息产业股票
基金代码	001070
交易代码	001070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月24日
报告期末基金份额总额	1,111,515,906.03份
投资目标	本基金主要投资于国内产业相关的行业上市公司股票,在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,力争创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势等因素对各个行业及上市公司进行深入研究,在充分研究的基础上,结合对上市公司基本面、估值水平、市场情绪等因素进行综合分析和比较,在合理范围内选择股票品种和期限,以期获得长期稳定的投资回报。本基金在股票资产中,主要投资于具有良好成长性的个股,并适当参与可转债、权证等品种的投资。
业绩比较基准	85%×沪深300指数收益率+15%×中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险,预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	-246,946,716.32	-21.60%
2.本期利润	-289,893,912.62	-25.21%
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2591	-0.2591%
4.期末基金份额净值	1,091.76/27.88	1.091/27.88
5.期末基金资产净值	0.082	0.082

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②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	-16.05%	3.41%	-24.12%	2.94%	0.75%

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	-16.05%	3.41%	-24.12%	2.94%	0.75%

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.本基金基金合同于2015年3月24日生效,截止本报告期末未满一年。

2.本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定相关规定。

4.1 报告期末基金的投资策略和业绩表现说明

4.1.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度宏观经济形势如我们预期继续走弱,股票市场的大幅调整加重了这一趋势。央行除了采取降准降息政策保持对内流动性宽松、降低社会融资成本以外,还意外将人民币兑美元小幅贬值。此举被认为修正人民币在美元加息压力下的低估和应对出口不振的稳增长措施之一。

3季度在人民币意外大幅贬值预期下外,占出现较大幅度流出,但央行通过降准和各种货币信贷工具及时进行了对冲,市场资金面总体宽松,推动债市继续走强。特别是长期债券下行显著,10年期国债收益率较前期下行50bp左右。总体来看,3季度中债财富指数上涨1.13%。

本基金以持有较高信用等级债券为主,中长期利率债持仓比例较高,该部分持仓在3季度组合带来不错收益,但3季度由于机构投资者申购资金大幅流入,导致基金杠杆比例和信用债持仓大幅下降,摊薄了基金利息收入所得。

4.1.2 报告期末基金的投资表现

本报告期建信纯债A净值增长率为3.12%,波动率0.12%,建信纯债C净值增长率为3.07%,波动率0.12%,业绩比较基准收益率为1.12%,波动率0.06%。

4.1.3 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4季度,我们判断全社会信用扩张增速可能在3季度已阶段性探底,经济增速在3季度基础上大幅走弱的概率很低,可能正在走微弱复苏的道路上。在此阶段,央行对全市场流动性仍将维持宽松态度。债券市场4季度整体系统性风险仍然不大,但应警惕收益率曲线在年末的波动性风险,4季度末将维持组合中高信用等级资产配置,力争为投资者获得稳健收益。

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	-	-
2	固定收益投资	1,868,490,344.60	96.00
3	金融衍生品投资	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,749,813.37	1.21
8	其他资产	72,389,065.67	3.79
9	合计	1,963,229,217.54	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	国债	324,724,000.00	16.76
2	央行票据	-	-
3	固定收益投资	790,767,000.00	41.14
4	其中:政策性金融债	790,748,000.00	38.46
5	企业债和中期票据	404,365,344.60	21.04
6	公司债和短期融资券	260,460,000.00	13.03
7	可转债	110,194,000.00	5.73
8	银行存款	-	-
9	其他资产	-	-
10	合计	1,868,490,344.60	96.70

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	150210	15国开10	4,200,000	436,968,000.00	22.74
2	150014	15国债附息14	1,800,000	189,414,000.00	9.99
3	150207	15国债附息7	1,500,000	153,270,000.00	7.97
4	011510009	15沪国债附息009	1,000,000	100,080,000.00	5.21
5	071511008	15国债附息008	900,000	90,000,000.00	4.68

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于国债期货。

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 本基金本报告期,报告期内投资前十名证券的发行主体均未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	26,203.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,081,943.49
5	应收申购款	41,881,912.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,389,065.67

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.6 开放式基金资产组合

单位:份

项目	建信纯债债券A	建信纯债债券C
报告期初基金份额总额	76,066,474.44	311,028,831.79
报告期间基金份额总额	672,388,534.22	1,156,590,143.50
减:报告期间基金份额赎回总额	98,292,361.78	444,216,307.34
报告期间基金份额变动额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期末基金份额总额	650,201,646.88	1,024,311,673.96

注: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

本基金本报告期未发生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纯债债券型证券投资基金设立的文件》;

2.《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》;

3.《建信纯债债券型证券投资基金招募说明书》;

4.《建信纯债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及基金托管人披露的各项公告。

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内免费查阅,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

建信信息产业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: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法律责任。

基金托管人光大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,基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。

本报告期内基金未发生未实现收益。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信健康民生混合
基金代码	000647
交易代码	000647
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月11日
报告期末基金份额总额	67,403,016.09份
投资目标	本基金主要投资于有利于提升国民健康水平和促进医疗卫生服务的行业及公司,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的投资策略包括:1.行业选择:本基金将精选有利于提升国民健康水平和促进医疗卫生服务的公司进行投资。2.个股选择:本基金将精选具有良好成长性的公司进行投资。3.资产配置:本基金将根据市场环境,动态调整股票、债券、现金等资产的比例。
业绩比较基准	70%×沪深300指数收益率+30%×中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券基金,低于股票基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

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	2,794,410.00	2.86
B	采矿业	-	-
C	制造业	49,774,092.26	50.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,440,224.00	2.50
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,727,008.00	4.85
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	7,348,750.22	7.52
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	67,098,061.67	68.66