建信双周安心理财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:中国工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。

基金托管人中国工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	建信双周理财
基金主代码	530014
交易代码	530014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月28日
报告期末基金份额总额	2,539,182,435.31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。
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	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	建信双周理财A / 建信双周理财B
下属分级基金的交易代码	530014 / 531014
报告期末下属分级基金的份额总额	814,474,276.44份 / 1,724,708,158.87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)	
	建信双周理财A	建信双周理财B
1. 本期已实现收益	6,841,077.35	13,806,239.87
2. 本期利润	6,841,077.35	13,806,239.87
3. 期末基金资产净值	814,474,276.44	1,724,708,158.87

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.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

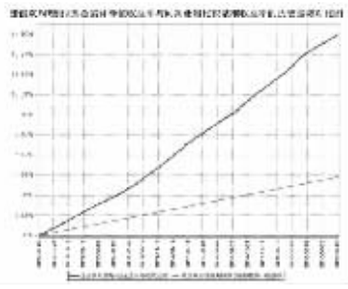
建信双周理财A

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	0.8894%	0.0036%	0.3403%	0.0000%	0.5491%	0.0036%

建信双周理财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	0.9631%	0.0036%	0.3403%	0.0000%	0.6228%	0.0036%

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	本基金的基金经理	2014年1月21日	-	7	于倩女士,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;2011年6月加入我公司,历任债券研究员、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4月17日起任建信嘉新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。
朱建华	本基金的基金经理	2012年8月28日	2015年8月11日	7	硕士。曾任大连博达系统工程公司职员、中诚信国际信用评级公司项目组长,2007年10月起任中诚信证券评估有限公司公司评级部总经理助理,2008年8月起任国泰基金管理公司高级研究员。朱建华于2011年6月加入本公司,历任高级债券研究员、货币市场基金的基金经理助理,2012年8月28日至2015年8月11日任建信双周安心理财债券型证券投资基金基金经理;2012年11月15日至2014年3月6日任建信纯债债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日至2014年3月27日任建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金经理;2013年5月14日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金经理;2013年12月10日起任建信稳定添利债券型证券投资基金基金经理。
高珊	本基金的基金经理	2012年8月28日	-	9	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;2015年8月25日起任建信现金添利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,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》、《证券投资基金公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司内部控制制度,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。

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

三季度,A股市场大幅下跌,上证综指下跌28.6%、沪深300指数下跌28.4%、中证500指数下跌31.2%,创业板综指下跌28.1%。

三季度经济增速继续放缓、企业盈利仍旧面临很大压力,虽然货币政策持续宽松,但股市由于进一步去杠杆、股市的流动性大幅下降,同时人民币汇率贬值,投资者信心受到重创。

本基金一贯采取自下而上精选个股的投资策略,重点配置企业盈利增长较快、估值安全边际相对较高的个股配置,TMT、医药、农林牧渔、轻工、公用事业等业绩较为确定的板块,但由于系统性风险,组合净值也有较大回撤。

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-25.55%,波动率3.2%,业绩比较基准收益率-21.2%,波动率2.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,本基金认为经济增长压力非常大,政府将出台一系列有利措施稳增长,改革、转型、调整经济结构将是主要政策方向,股市杠杆大幅下降,系统性风险已大部分释放,但投资者信心的恢复需要很长一段时间。上证综指已经快接近价值区域,中小板和创业板综指大部分风险已经释放,但仍然高估;投资者都比较谨慎,但机构投资者仓位都比较轻,少部分股票已经进入价值区域的左侧,市场还在寻底过程中。

需要关注几个重大因素:企业盈利会存在大幅下调的可能;创业板综指和中小板综指整体估值仍然较高,估值下降的风险依旧存在;债券市场信用风险在累积,若连续出现违约,将打击对投资者信心;市场已经对人民币汇率形成贬值预期,若汇率再大幅波动,对股市将是较大风险。

本基金将延续一贯的风格,追求价值与高质量的成长,努力寻找投资机会,尽力为持有人获得良好的回报。

§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	706,412,447.77	64.93
	其中:股票	706,412,447.77	64.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	380,489,648.25	34.97
8	其他资产	1,115,232.97	0.10
9	合计	1,088,017,328.99	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	38,832,062.56	3.69
B	采矿业	-	-
C	制造业	420,512,295.70	39.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,685,743.00	1.96
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	25,517,650.05	2.42
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	21,221,803.86	2.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	22,372,198.47	2.13
L	租赁和商务服务业	20,424,332.16	1.94
M	科学研究和技术服务业	50,470,184.80	4.79
N	水利、环境和公共设施管理业	86,376,177.17	8.21
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	706,412,447.77	67.10

注:以上行业分类以2015年9月30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	300332	天壕环境	2,486,216	50,470,184.80	4.79
2	600651	飞乐音响	4,953,643	49,338,284.28	4.69
3	002250	联化科技	2,391,704	42,811,501.60	4.07
4	002236	大华股份	1,108,623	37,482,543.63	3.56
5	000826	桑德环境	960,234	32,359,885.80	3.07
6	300070	碧水源	729,679	31,879,675.51	3.03
7	002104	恒宝股份	1,999,600	31,213,756.00	2.97
8	002475	立讯精密	972,846	28,767,056.22	2.73
9	002689	博林特	3,576,884	27,863,926.36	2.65
10	002100	天康生物	3,263,711	27,545,720.84	2.62

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	939,347.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	71,701.43
5	应收申购款	104,184.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,115,232.97

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	300070	碧水源	31,879,675.51	3.03	重大事项临时停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	902,332,050.58
报告期期间基金总申购份额	59,707,494.66
减:报告期期间基金总赎回份额	223,093,016.82
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	738,946,528.42

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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	18,147,912.89
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	18,147,912.89
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.46

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核心精选混合型证券投资基金设立的文件;
2、《建信核心精选混合型证券投资基金基金合同》;
3、《建信核心精选混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信核心精选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10月27日

建信核心精选混合型证券投资基金

【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:中国工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。

基金托管人中国工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	建信核心精选混合
基金主代码	530006
交易代码	530006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月25日
报告期末基金份额总额	738,946,528.42份
投资目标	本基金通过对宏观经济环境、市场环境、行业特征和公司基本面的深入研究,精选具有良好成长性和价值性的上市公司股票,在有效控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳定增值。
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	本基金投资业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×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,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。
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

注:本基金自2015年8月8日起由股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金。

§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	-190,160,024.66
2.本期利润	-432,018,270.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5580
4.期末基金资产净值	1,052,722,598.98
5.期末基金份额净值	1.425

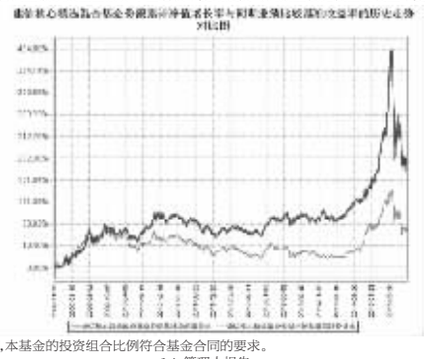
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-25.55%	3.20%	-21.20%	2.51%	-4.35%	0.69%

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		
顾中汉	权益投资部副总经理、本基金的基金经理	2015年5月22日	-	11	硕士。曾任北京市房管局科员,2004年4月起就职于易方达基金管理公司,历任交易员、研究员、基金经理助理、投资经理,2010年1月至2011年5月任社保109组合的投资经理。顾中汉于2011年6月加入本公司,历任基金经理、研究部副总监、权益投资部副总监,2011年10月11日起任建信恒久价值混合型证券投资基金基金经理;2011年12月13日至2013年5月3日任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理;2014年8月20日起任建信中小盘先锋股票基金的基金经理;2015年5月22日起任建信核心精选混合基金经理。

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《建信核心精选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

三季度,A股市场大幅下跌,上证综指下跌28.6%、沪深300指数下跌28.4%、中证500指数下跌31.2%,创业板综指下跌28.1%。

三季度经济增速继续放缓、企业盈利仍旧面临很大压力,虽然货币政策持续宽松,但股市由于进一步去杠杆、股市的流动性大幅下降,同时人民币汇率贬值,投资者信心受到重创。

本基金一贯采取自下而上精选个股的投资策略,重点配置企业盈利增长较快、估值安全边际相对较高的个股配置,TMT、医药、农林牧渔、轻工、公用事业等业绩较为确定的板块,但由于系统性风险,组合净值也有较大回撤。

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-25.55%,波动率3.2%,业绩比较基准收益率-21.2%,波动率2.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,本基金认为经济增长压力非常大,政府将出台一系列有利措施稳增长,改革、转型、调整经济结构将是主要政策方向,股市杠杆大幅下降,系统性风险已大部分释放,但投资者信心的恢复需要很长一段时间。上证综指已经快接近价值区域,中小板和创业板综指大部分风险已经释放,但仍然高估;投资者都比较谨慎,但机构投资者仓位都比较轻,少部分股票已经进入价值区域的左侧,市场还在寻底过程中。

需要关注几个重大因素:企业盈利会存在大幅下调的可能;创业板综指和中小板综指整体估值仍然较高,估值下降的风险依旧存在;债券市场信用风险在累积,若连续出现违约,将打击对投资者信心;市场已经对人民币汇率形成贬值预期,若汇率再大幅波动,对股市将是较大风险。

本基金将延续一贯的风格,追求价值与高质量的成长,努力寻找投资机会,尽力为持有人获得良好的回报。

§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	429,099,639.07	93.43
	其中:股票	429,099,639.07	93.43
2	固定收益投资	114,867.00	0.03
	其中:债券	114,867.00	0.03
	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	29,229,367.36	6.36
7	其他资产	852,041.67	0.19
8	合计	459,295,915.10	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按申万一级行业分类的股票投资组合

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	230,579,895.45	9.08
	其中:政策性金融债	150,589,079.47	5.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	714,830,149.03	28.15
6	中期票据	-	-
7	同业存单	441,590,853.00	17.39
8	其他	-	-
9	合计	1,387,000,897.48	54.62
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	111510307	15兴业CD307	1,000,000	98,411,725.63	3.88
2	111511238	15平安CD238	1,000,000	98,353,387.60	3.87
3	111510312	15兴业CD312	1,000,000	98,341,413.94	3.87
4	111591942	15宁波银行CD111	1,000,000	97,349,677.87	3.83
5	071521006	15渤海证券CP006	800,000	79,990,815.98	3.15
6	150301	15进出01	700,000	70,241,158.45	2.77
7	011574002	15陕煤化SCP002	500,000	50,135,469.43	1.97
8	011599305	15河钢SCP001	500,000	49,992,841.91	1.97
9	011599118	15苏沙钢SCP001	500,000	49,973,696.09	1.97
10	011599124	15包钢集SCP002	500,000	49,972,315.49	1.97

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	44
报告期内偏离度的最高值	0.3774%
报告期内偏离度的最低值	0.1720%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2795%

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损益。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 本基金投资的前十名债券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	-
3	应收利息	23,732,683.11
4	应收申购款	30,655,222.61
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	54,387,905.72

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信双周理财A	建信双周理财B
报告期期初基金份额总额	785,025,411.87	828,072,929.87
报告期期间基金总申购份额	525,787,755.12	1,996,771,723.88
减:报告期期间基金总赎回份额	496,338,890.55	1,100,136,494.88
报告期期末基金份额总额	814,474,276.44	1,724,708,158.87

注:上述总申购份额含红利再投资份额。

§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双周安心理财债券型证券投资基金设立的文件;
2.《建信双周安心理财债券型证券投资基金基金合同》;
3.《建信双周安心理财债券型证券投资基金招募说明书》;
4.《建信双周安心理财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

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

【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:中国工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。

基金托管人中国工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	建信沪深300指数(LOF)
场内简称	建信300
基金主代码	165309
交易代码	165309
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2009年11月5日
报告期末基金份额总额	486,525,986.04份
投资目标	本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
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×商业银行税后活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
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7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	20,186,319.79
2.本期利润	-187,688,603.98
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3677
4.期末基金资产净值	455,371,680.67
5.期末基金份额净值	0.9360

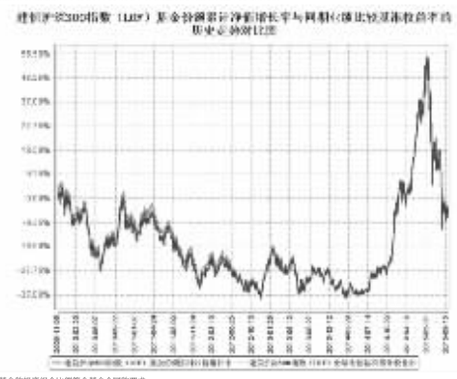
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-27.37%	3.32%	-27.06%	3.18%	-0.31%	0.14%

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	2009年11月5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9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26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《建信沪深300指数型证券投资基金(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

在报告期内,本基金根据基金合同规定,采取了对指数的被动复制策略,将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。

在