建信货币市场基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31日

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:2013年1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2013年1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2012年10月1日起至12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	13,269,549,341.78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(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	56,258,050.42
2.本期利润	56,258,050.42
3.期末基金资产净值	13,269,549,341.78

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	0.9410%	0.0082%	0.7181%	0.0000%	0.2229%	0.0082%

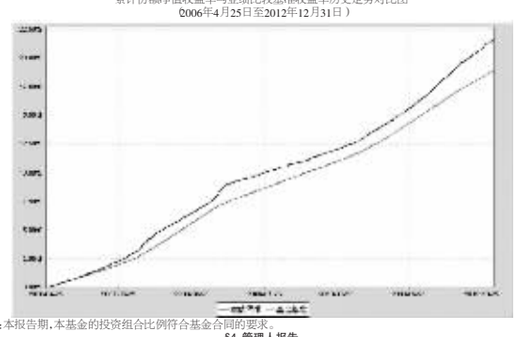
注:基金收益分配按日结转份额。

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

建信货币市场基金

累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2006年4月25日至2012年12月31日)



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	本基金基金经理	2012-2-17	-	7	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月加入我公司。2011年11月30日起任建信保本混合型证券投资基金的基金经理;2012年5月29日起任建信转债增强基金的基金经理。

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《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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》等风险控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一组投资组合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

去年四季度,我国经济温和复苏,工业增加值等经济增速指标明显反弹,通胀指标小幅回升。货币政策保持稳健,央行主要通过逆回购在公开市场调节流动性。由于央行持续投放资金,四季度资金面相对宽松,年底资金面也相对平稳,没有出现异常紧张的情况。

由于经济增速和通胀水平仍处于较低水平,资金面相对宽松,四季度债市总体上涨,信用债表现较好,年底收益率小幅上行。

四季度,本基金减持了即将到期的短期债券,少量投资相对较长期限的短期债券,主要投资对象为逆回购和定期存款。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值收益率0.9410%,波动率0.0082%,业绩比较基准收益率0.7181%,波动率0.0000%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望今年一季度,我们认为中国经济可能继续温和复苏。由于换届效应,以及城镇化建设加速,经济增速将持续回升,而通胀水平也可能随之上行。货币政策在保持稳健的情况下,可能需要根据经济形势和通胀水平进行微调,防止经济过热和通胀上升较快。一季度资金面可能相对宽松,春节前或偏紧一些,短期债券收益率可能先降后升,短融可能表现较好。

一季度本基金将审慎投资,灵活调整。具体而言,本基金将更加注重对流动性的管理,适当增加组合的平均剩余期限,适当增加短期信用债券的投资比例,适度投资短期逆回购和定期存款。我们将根据货币市场资金利率和经济形势的变化,积极主动对组合进行调整,在确保组合流动性的基础上,力争获取更多的投资收益。

§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	固定收益投资	1,720,884,379.74	12.79
	其中:债券	1,720,884,379.74	12.79
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	6,539,013,679.19	48.60
	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	4,967,733,288.23	36.92
4	其他各项资产	228,232,660.10	1.70
5	合计	13,455,864,007.26	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.19	
	其中:买断式回购融资	-	
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	-	-
	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	39
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

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	78.15	0.03
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.23	-
2	30天(含)—60天	2.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	4.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.43	-
4	90天(含)—180天	10.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	4.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.70	0.03

5.4报告期末按券种品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	29,816,616.67	0.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	860,068,650.15	6.48
	其中:政策性金融债	860,068,650.15	6.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	790,919,108.93	5.96
6	中期票据	40,080,003.99	0.30
7	其他	-	-
8	合计	1,720,884,379.74	12.97
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	219,764,506.87	1.66

5.5报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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)	占基金资产净值的比例(%)
1	120218	12国开18	3,100,000	310,645,099.39	2.34
2	120314	12进出14	1,400,000	139,921,444.50	1.05
3	110212	11国开12	1,300,000	129,789,516.49	0.98
4	120228	12国开28	1,300,000	129,721,932.61	0.98
5	041261013	12津城建CP001	1,200,000	119,984,327.44	0.90
6	041258029	12三花CP001	600,000	60,133,690.45	0.45
7	100236	10国开36	600,000	60,039,503.23	0.45
8	041260094	12湘高速CP003	600,000	60,005,600.82	0.45
9	041254009	12华侨城CP001	500,000	50,226,287.46	0.38
10	041260010	12广控CP001	500,000	50,213,618.95	0.38

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	0次
报告期内偏离度的最高值	0.13%
报告期内偏离度的最低值	-0.02%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.04%

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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基金计价方法说明

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其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	176,187,198.90
3	应收利息	50,082,309.20
4	应收申购款	1,963,152.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	228,232,660.10

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	2,977,852,134.08
本报告期基金总申购份额	19,036,168,944.06
减:本报告期基金总赎回份额	8,744,471,736.36
本报告期期末基金份额总额	13,269,549,341.78

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 备查文件目录

7.1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。

7.2存放地点:

基金管理人或基金托管人处。

7.3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
二〇一三年一月二十一日

建信社会责任股票型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信社会责任股票
基金主代码	530019
交易代码	530019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月14日
报告期末基金份额总额	138,043,923.76份
投资目标	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	采用自上而下的资产配置和自下而上的股票选择相结合的投资策略,本基金在长期价值投资理念的基础上,坚持社会责任投资,重点考察企业社会责任的履行,立足企业基本面,努力实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,一般情况下其风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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(2012年10月1日-2012年12月31日)	2012年8月14日-2012年09月30日
1.本期已实现收益	-3,261,307.99	1,465,676.19
2.本期利润	4,519,525.65	1,465,676.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0225	0.0019
4.期末基金资产净值	143,495,933.07	263,162,841.35
5.期末基金份额净值	1.039	1.002

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。

2、上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、本基金2012年08月14日成立,成立当期未满2个月。

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

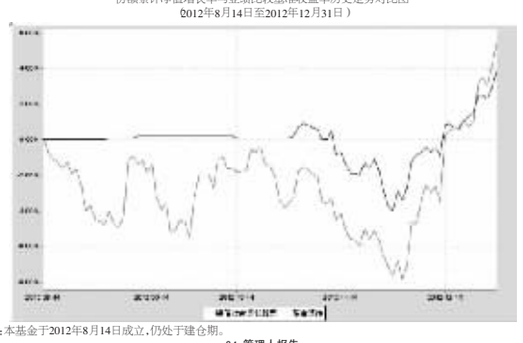
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.69%	0.54%	7.68%	0.96%	-3.99%	-0.42%

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

建信社会责任股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年8月14日至2012年12月31日)



注:本基金于2012年8月14日成立,仍处于建仓期。

§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		
许杰	本基金基金经理	2012-8-14	-	10	硕士。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员,2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司,历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职,2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合型证券投资基金基金经理,2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票型证券投资基金基金经理,2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金经理。2011年10月加入我公司,2012年3月21日起任建信恒稳价值混合基金基金经理。
姚锦	本基金基金经理	2012-8-14	-	8	博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师,2004年4月起就职于天弘基金管理公司,历任研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职,2009年3月17日至2011年3月3日任天弘永利债券基金基金经理;2009年12月17日至2011年5月5日任天弘周期策略股票基金基金经理。现任我公司研究部首席策略分析师,2012年2月17日起任建信优选成长股票基金基金经理。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《建信社会责任股票型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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

资产配置方面:股票配置的比例偏低。由于过分关注年底流动性紧张对股票市场的负面影响,而忽略了经济好转对投资者预期产生的变化。

在行业配置和股票选择方面:重点持有了基本面向好或发生了向上的拐点,而同时有估值安全边际的公司,例如汽车、家电、电力和铁路相关的龙头公司。这些公司基本上都取得了较好的收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率3.69%,波动率0.54%,业绩比较基准收益率7.68%,波动率0.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计2013年股票市场将取得一定程度的上涨。从国家政策的角度来看,积极的财政政策和稳健的货币政策(社会融资总量合理增长)有利于股市。海外经济总体上处于复苏阶段,美国将持续其复苏进程,欧洲将在底部徘徊,有可能逐渐走出底部。中国经济将在2013年实现弱复苏或温和复苏。货币供给正常增长,但预计实体经济对资金的需求将比较旺盛,因此2013年股市流动性宽松,但幅度有限。

2012年,上市公司盈利增长稀缺,但总体流动性不差(社会融资总量大幅上升,实体经济需求不足),因此成长性公司享有很高的估值溢价。2013年,上市公司盈利增长普遍,成长性溢价水平将降低。盈利上升成为推动股价上升的最大动力,原来高成长公司的估值溢价将降低。个股可能分化严重:盈利恢复高增长而原来估值低的股票有望实现盈利和估值双推动带来的股价上升(反转型股票实现的超额收益可能最大),估值高的股票如果成长不达预期将出现股价向下的回归。

本基金2013年将保持偏积极的股票仓位,重点配置估值偏低,而有技术或渠道等壁垒,竞争结构良好的细分行业中的优势企业。

§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	108,468,127.40	57.83
	其中:股票	108,468,127.40	57.83
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	79,060,346.77	42.15
6	其他各项资产	28,751.87	0.02
7	合计	187,557,226.04	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	采掘业	-	-
C	制造业	57,583,510.13	40.13
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,441,444.26	9.37
C5	电子	8,556,800.00	5.96
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	35,585,265.87	24.80
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,564,125.57	8.06
E	建筑业	6,627,200.00	4.62
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,046,486.00	1.43
H	批发和零售贸易	5,026,817.10	3.50
I	金融、保险业	15,824,148.60	11.03
J	房地产业	7,845,840.00	5.47
K	社会服务业	1,950,000.00	1.36
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	108,468,127.40	75.59

注:以上行业分类以2012年12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	601299	中国北车	1,469,951	6,629,479.01	4.62
2	601390	中国中铁	2,180,000	6,627,200.00	4.62
3	600104	上汽集团	366,988	6,473,668.32	4.51
4	002055	得润电子	1,010,000	5,797,400.00	4.04
5	600143	金发科技	1,069,934	5,766,944.26	4.02
6	002595	豪迈科技	248,000	5,577,520.00	3.89
7	601318	中国平安	116,000	5,253,640.00	3.66
8	601628	中国人寿	233,949	5,006,508.60	3.49
9	002073	软控股份	640,000	4,838,400.00	3.37
10	000543	皖能电力	629,905	4,818,773.25	3.36

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8投资组合报告附注

5.8.1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。

5.8.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.8.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,604.09
5	应收申购款	10,147.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,751.87

5.8.4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。

5.8.5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情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	262,670,242.44
本报告期基金总申购份额	11,503,358.15
减:本报告期基金总赎回份额	136,129,676.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	138,043,923.76

注:上述总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1备查文件目录

1、中国证监会批准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、《建信社会责任股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信社会责任股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信社会责任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。

7.2存放地点:

基金管理人或基金托管人处。

7.3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
二〇一三年一月二十一日

建信双周安心理财债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31日

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:2013年1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2013年1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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信双周理财债券
基金主代码	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	9,547,666,025.86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
下属两级基金的基金简称	建信双周理财债券A / 建信双周理财债券B
下属两级基金的交易代码	530014 / 531014
报告期末下属两级基金的份额总额	2,955,356,242.84份 / 6,592,309,783.02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(2012年10月1日-2012年12月31日)		2012年8月28日-2012年09月30日	
	建信双周理财债券建信双周理财债券A	建信双周理财债券建信双周理财债券B	建信双周理财债券建信双周理财债券A	建信双周理财债券建信双周理财债券B
1.本期已实现收益	25,067,508.03	12,200,083.63	24,345,416.73	8,153,797.90
2.本期利润	25,067,508.03	12,200,083.63	24,345,416.73	8,153,797.90
3.期末基金资产净值	2,955,356,242.84	6,592,309,783.02	3,011,472,127.80	1,011,869,406.38

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、本基金基金合同生效日为2012年8月28日。

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

1.建信双周理财债券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	0.9193%	0.0007%	0.3456%	0.0000%	0.5737%	0.0007%

2.建信双周理财债券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	0.9929%	0.0007%	0.3456%	0.0000%	0.6473%	0.0007%

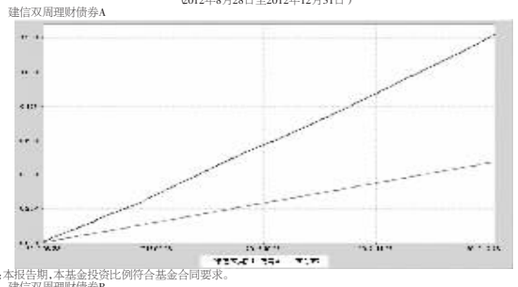
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信双周安心理财债券型证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

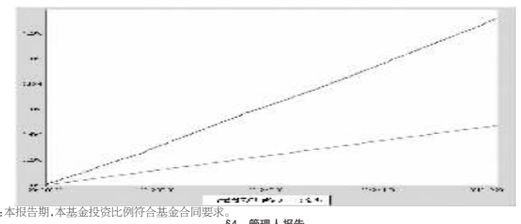
(2012年8月28日至2012年12月31日)

1、 建信双周理财债券A



注:本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

2、 建信双周理财债券B



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

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		
朱建华	本基金的基金经理	2012-8-28	-	5	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月加入建信基金管理公司研究部任高级债券研究员,2011年10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11月15日起任建信纯债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基金的基金经理。
高珊	本基金的基金经理	2012-8-28	-	6	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基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《建信双周安心理财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》、《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

四季度,全球经济虽然处于金融危机后的震荡期,但似乎已经熬过了最艰难时刻,市场对未来全球经济回暖的信心有所增强。同时中国经济也出现企稳,各主要