建信双月安心理财债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月十九日

§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2013年4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2013年1月29日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信双月安心理财债券	
基金主代码	530029	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2013年1月29日	
报告期末基金份额总额	5,336,580,702.13份	
投资目标	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。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天。	
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	招商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	建信双月安心理财债券A	建信双月安心理财债券B
下属两级基金的交易代码	530029	531029
报告期末下属两级基金的份额总额	4,779,973,829.92份	556,606,872.21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(2013年1月29日-2013年3月31日)	
	建信双月安心理财债券A	建信双月安心理财债券B
1.本期已实现收益	28,141,424.15	3,545,028.36
2.本期利润	28,141,424.15	3,545,028.36
3.期末基金资产净值	4,779,973,829.92	556,606,872.21

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.本金基金合同生效日为2013年1月29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. 建信双月安心理财债券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	0.5922%	0.0010%	0.2328%	0.0000%	0.3594%	0.0010%

2. 建信双月安心理财债券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	0.6410%	0.0011%	0.2328%	0.0000%	0.4082%	0.0011%

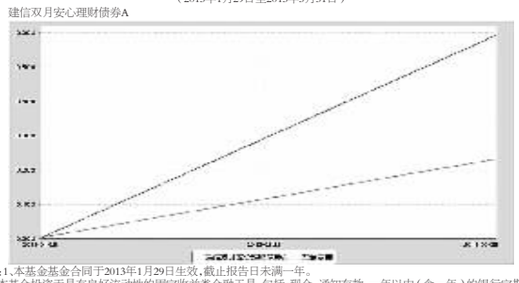
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信双月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

(2013年1月29日至2013年3月31日)

1、 建信双月安心理财债券A

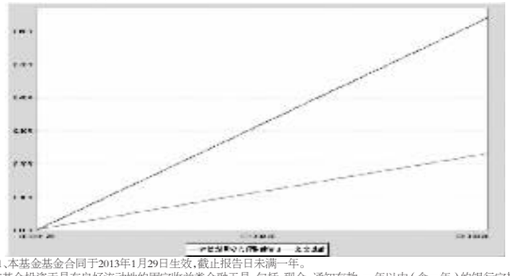


注:1.本基金基金合同于2013年1月29日生效,截止报告日未满一年。

2.本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括:现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和银行协议存款,剩余期限一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、中期票据、短期融资券,剩余期限397天以内(含397天)债券(不含可转换债券),以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。在任何一个交易日,本基金投资组合平均剩余期限不得超过180天。基金管理人应当自基金合同生效之日起6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3、本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

2、 建信双月安心理财债券B



注:1.本基金基金合同于2013年1月29日生效,截止报告日未满一年。

2.本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括:现金、通知存款,一年以内(含一年)的银行定期存款和银行协议存款,剩余期限一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、中期票据、短期融资券,剩余期限397天以内(含397天)债券(不含可转换债券),以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。在任何一个交易日,本基金投资组合平均剩余期限不得超过180天。基金管理人应当自基金合同生效之日起6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3、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		
高珊女士	本基金的基金经理	2013-1-29	-	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;2013年1月29日起任建信双月安心理财基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》和其他有关法律法规的规定和《建信双月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

一季度,全球市场流动性依然宽松。以美国为首的经济体缓慢复苏,但欧洲市场频发黑天鹅事件,表现明显弱于预期,全球经济真正回暖尚待时日。国内经济仍旧弱复苏,从数据看偏弱,加上新政府对房地产市场前所未有的调控,使高涨的股市出现大幅调整。反观债券市场,虽然通胀水平在前两个月略超市场预期,但是三月份以来食品价格的快速回落降低了市场对短期内通胀的担忧。年初以来,央行的货币政策总体以稳健为主,SLO推出后短期资金利率如预期中一样趋稳。为应付春节后巨量的到期资金,央行开展一系列正回购操作,但由于巨额的外汇占款流入以及备付金的到期,一季度银行间市场流动性总体宽松,资金成本相较去年进一步降低。债券市场收益率在宽松的资金面和配置型资金的推动下总体下行。但随着正回购逐步加量、对未来的流动性仍旧不能盲目乐观。

建信双月安心理财基金于本季度末结束了首个运作周期,平稳应对了开放导致的巨额赎回冲击,积极配置了部分收益高的信用产品并逐步拉长久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期建信双月理财A净值收益率0.5922%,波动率0.0010%,建信双月理财B净值收益率0.6410%,波动率0.0011%,业绩比较基准收益率0.2328%,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

展望二季度,随着两会闭幕,之前一些停滞的项目将进入施工阶段,二季度的经济表现将略强于一季度,但通胀并不会成为干扰市场情绪的主要因素。资金价格受财政存款以及季末因素的影响,仍会在半年末关口出现脉冲式上行。受此影响,债市将逐步进入震荡阶段,不排除在二季度后半段出现小幅调整的可能。同时,我们也将继续对政府未来可能继续出台的银行监管、清理影子银行、房地产调控等一系列政策保持关注。

目前的债券市场收益率处于历史平均分位以下,信用债的配置价值并不突出,组合收益的来源仍以协议存款为主。建信双月安心理财基金在二季度将继续择时配置中长期协议存款,在保证组合流动性的同时努力提高投资人收益。

§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	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	5,302,323,664.32	99.30
4	其他各项资产	37,134,722.60	0.70
5	合计	5,339,458,386.92	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	-
	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	24
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	83
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

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	80.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	18.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.36	-

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	-
报告期内偏离度的最低值	-
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	-

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 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	应收利息	37,134,722.60
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	37,134,722.60

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信双月安心理财债券A	建信双月安心理财债券B
基金合同生效日(2013年1月29日)基金份额总额	4,751,832,405.77	553,061,843.85
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	28,141,424.15	3,545,028.36
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,779,973,829.92	556,606,872.21

注:上述总申购份额含红利再投资份额。

§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月安心理财债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信双月安心理财债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信双月安心理财债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信双月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。

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
二〇一三年四月十九日

建信纯债债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月十九日

§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规定,于2013年4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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信纯债债券	
基金主代码	530021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月15日	
报告期末基金份额总额	4,357,231,330.50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人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,通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析,比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、不同信用特征的券种及债券与现金之间进行动态调整。	
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	
下属两级基金的基金简称	建信纯债债券A	建信纯债债券C
下属两级基金的交易代码	530021	531021
报告期末下属两级基金的份额总额	1,191,078,582.22份	3,166,152,748.28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(2013年1月1日-2013年3月31日)		2012年11月15日-2012年12月31日	
	建信纯债债券A	建信纯债债券C	建信纯债债券A	建信纯债债券C
1.本期已实现收益	11,690,436.27	40,560,135.18	8,503,709.48	59,955,439.41
2.本期利润	15,079,045.68	53,293,164.81	8,384,217.21	59,020,297.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0105	0.0093	0.0044	0.0039
4.期末基金资产净值	1,208,900,206.99	3,207,942,711.32	1,919,335,782.31	15,016,876,284.84
5.期末基金份额净值	1.015	1.013	1.004	1.004

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

1、建信纯债债券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	1.10%	0.04%	0.70%	0.03%	0.40%	0.01%

2、建信纯债债券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	0.90%	0.05%	0.70%	0.03%	0.20%	0.02%

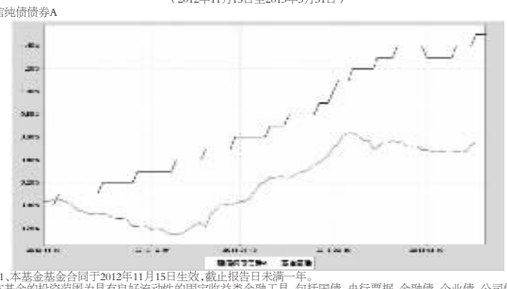
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信纯债债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年11月15日至2013年3月31日)

建信纯债债券A



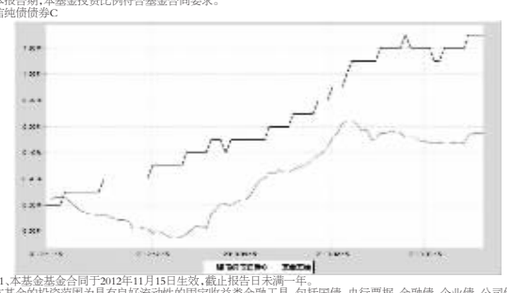
注:1、本基金基金合同于2012年11月15日生效,截止报告日未满一年。

2、本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、分离交易可转债、次级债、地方政府债、政府机构债、债券回购、资产支持证券、银行存款等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。如法律法规和监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发;同时本基金亦不参与可转债投资(分离交易可转债除外)。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3、本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

建信纯债债券C



注:1、本基金基金合同于2012年11月15日生效,截止报告日未满一年。

2、本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、分离交易可转债、次级债、地方政府债、政府机构债、债券回购、资产支持证券、银行存款等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。如法律法规和监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发;同时本基金亦不参与可转债投资(分离交易可转债除外)。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3、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		
黎颖芳女士	本基金基金经理	2012-11-15	-	12	黎颖芳女士,硕士。2000年毕业于湖南大学金融保险学院,毕业后就职于大成基金管理公司,先后在金融工程部和规划发展部担任研究员和产品设计师等职。黎颖芳于2005年11月加入建信基金管理公司研究部,先后担任债券研究员、高级债券研究员和基金经理助理等职,2009年2月19日至2011年5月11日任建信稳定增利债券基金的基金经理;2011年1月18日起任建信保本基金基金经理。
朱建华先生	本基金基金经理	2012-11-15	-	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型证券投资基金基金经理。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》和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 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

1季度国内经济继续复苏,但动能较去年12月已有所减缓,支持经济复苏的力量主要来自于地产投资和出口。同时春节因素和外汇占款的流入也给市场带来相对宽松的资金面,基础利率和融资利率都稳中有降。价格方面居民消费价格在经历季节性反弹后3月份有所回落,工业品价格回升一直乏力,总体通胀水平相对温和。但房地产价格自去年4季度以来上涨迅速,导致政府在3月份再次出手调控,央行亦着手回升流动性。在此环境下10年期国债波动较小,仍处于3.6%左右水平,隐含市场对此较经济复苏相对较弱的预期。信用债涨幅明显,大部分信用等级的信用利差已低于历史均值,城投债尤其受到市场追捧,反映投资者对政府背景的高收益债有明显偏好。总体来看中债财富总指数上涨1.22%。

本基金处于建仓期,配置品种主要是信用债,持仓结构中短融、中票和城投债的分布相对均衡,兼顾流动性和收益性。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期建信纯债A净值增长率1.10%,波动率0.04%,建信纯债C净值增长率0.90%,波动率0.05%,业绩比较基准收益率0.70%,波动率0.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为支持本轮经济复苏的动能来自于地方融资平台债务的扩张带来的投资特别是房地产市场的繁荣,本质上是在经济增长中枢下移过程中一次再杠杆带来的复苏。3月末,银监会下发规范理财业务文件,我们判断该文件将对社会融资总量增速和地方政府融资的可得性产生一定负面影响,同时也是政府防范长期系统性风险的措施之一,它可能带动经济加杠杆过程的结束,虽然这一速度并不会很快,在此环境下我们对市场资金面保持谨慎乐观,因为通胀的压力并不大,基础利率大幅上升的概率较小,但市场融资利率可能会对信用风险加大甄别力度,信用利差或重归合理水平。

二季度本基金将以持有相对中高等级的信用债为主,同时关注中长期利率债的投资机会,在遵守基金合同基础上力争继续为投资者创造稳健的收益。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,217,533,739.04	96.27
	其中:债券	5,217,533,739.04	96.27
	资产支持证券	-	-
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	112,078,492.42	2.07
7	其他各项资产	89,923,764.44	1.66
8	合计	5,419,535,995.90	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	国家债券	109,271,064.00	2.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	201,668,000.00	4.57
	其中:政策性金融债	120,092,000.00	2.72
4	企业债券	1,574,743,675.04	35.65
5	企业短期融资券	2,663,734,000.00	60.31
6	中期票据	668,117,000.00	15.13
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,217,533,739.04	118.13

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

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	041261041	12国电集CP004	2,700,000	271,836,000.00	6.15
2	071302002	13国泰君安CP002	2,000,000	200,200,000.00	4.53
3	041254022	12港中旅CP001	1,700,000	171,309,000.00	3.88
4	1382012	13铁高速MTN1	1,500,000	153,225,000.00	3.47
5	041358003	13广汇汽车CP001	1,500,000	150,960,000.00	3.42

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9投资组合报告附注

5.9.1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。

5.9.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.9.3其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	11,001.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	88,639,731.21
5	应收申购款	1,273,031.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	89,923,764.44

5.9.4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可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信纯债债券A	建信纯债债券C
本报告期期初基金份额总额	1,910,951,565.10	14,957,855,987.15
本报告期基金总申购份额	288,435,338.85	238,339,944.42
减:本报告期基金总赎回份额	1,008,308,321.73	12,030,043,183.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,191,078,582.22	3,166,152,748.28

注: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
二〇一三年四月十九日

建信月盈安心理财债券型证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月十九日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信月盈安心理财债券	
基金主代码	530028	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月20日	
报告期末基金份额总额	3,541,564,685.07份	
投资目标	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。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过150天。	
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	中国民生银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	建信月盈安心理财债券A	建信月盈安心理财债券B
下属两级基金的交易代码	530028	531028
报告期末下属两级基金的份额总额	2,769,473,134.87份	772,091,550.2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(2013年1月1日-2013年3月31日)		2012年12月20日-2012年12月31日	
	建信月盈安心理财债券 建信月盈安心理财债券A	建信月盈安心理财债券 建信月盈安心理财债券B	建信月盈安心理财债券 建信月盈安心理财债券A	建信月盈安心理财债券 建信月盈安心理财债券B
1.本期已实现收益	61,124,612.73	25,363,098.11	18,173,338.66	7,362,031.11
2.本期利润	61,124,612.73	25,363,098.11	18,173,338.66	7,362,031.11
3.期末基金资产净值	2,769,473,134.87	772,091,550.20	12,544,376,958.95	4,793,797,496.61

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

1. 建信月盈安心理财债券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	0.9135%	0.0015%	0.3381%	0.0000%	0.5754%	0.0015%

2. 建信月盈安心理财债券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