嘉实理财宝7天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:嘉实基金管理有限公司
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4月19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4月15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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实理财宝7天债券	
交易代码	070035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年8月29日	
报告期末基金份额总额	2,822,646,090.40份	
投资目标	在有效控制风险和保持适当流动性的基础上,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	根据宏观经济指标决定组合的平均剩余期限(长/中/短)和比例分布,根据各类资产的流动性特征决定组合中各类资产的投资比例,根据各类资产的信用等级及担保状况,决定组合的风险级别;根据明细资产的剩余期限、资信等级、流动性指标以及个别债券的收益率与剩余期限的配比等指标进行投资。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,长期风险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	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B
下属两级基金的交易代码	070035	070036
报告期末下属两级基金的份额总额	1,094,621,610.74份	1,728,024,479.66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)	
	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B
1. 本期已实现收益	11,540,798.48	10,964,406.84
2.本期利润	11,540,798.48	10,964,406.84
3.期末基金资产净值	1,094,621,610.74	1,728,024,479.66

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,由于本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)嘉实理财宝7天债券A与嘉实理财宝7天债券B适用不同的销售服务费率。(3)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用;(4)本基金收益在基金份额"7天持有周期到期日"集中结转为基金份额。

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

嘉实理财宝7天债券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	0.9635%	0.0079%	0.3329%	0.0000%	0.6306%	0.0079%

嘉实理财宝7天债券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	1.0356%	0.0079%	0.3329%	0.0000%	0.7027%	0.0079%

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

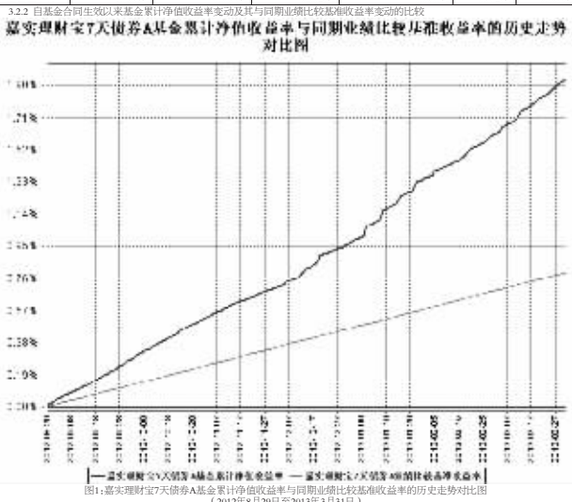


图1:嘉实理财宝7天债券A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年8月29日至2013年3月31日)

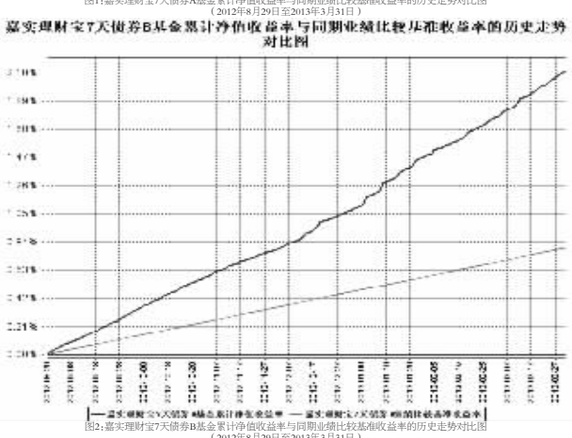


图2:嘉实理财宝7天债券B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年8月29日至2013年3月31日)

注:本基金基金合同生效日2012年8月29日至报告期末未满1年。报告期内本基金各项资产配置比例符合基金合同第十二部分(二、投资范围和四、投资限制)的规定。

§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		
桑迎	本基金基金经理、嘉实交心货币基金经理	2012年8月29日	-	8年	曾任交通银行外汇交易员,华夏银行总行交易员。2008年1月加入嘉实基金管理有限公司,历任交易部债券交易员、固定收益部基金经理助理。银行与金融专业硕士,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实理财宝7天债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生异常交易行为。

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

报告期内,流动性充裕资金市场偏宽松,资金利率和短期债券收益率快速下行。1季度相比去年,最大的变化在于外汇占款量再度冲高。外汇占款和配高的信贷投放,为银行间市场带来充沛的流动性。此外,央行为平滑资金市场波动推出SLO机制,央行可应机构要求随时为市场提供资金,在各个时段的刺激下,1季度资金市场呈现宽松状态,1季度银行间市场隔夜回购利率均值2.36%,远低于2011年以来均值2.98%的水平。受到资金利率水平快速下行的影响,银行间短期债券收益也大幅下滑。13年1月初银行间市场1年期AAA级别短期融资券收益在4.40%附近,1季度末该级别短期融资券收益率已经降到3.9%附近,收益下行接近50个基点。总体而言,出于维护经济稳定的考虑,1季度央行在货币政策实际操作中偏中性,没有在公开市场加大回笼力度。货币市场整体维持宽松,收益大幅下行。

报告期内,本基金一方面需要谨慎应对组合规模的波动,另一方面要应对市场收益的波动。本基金始终秉持稳健投资原则,谨慎操作,以保证组合安全性为首要任务。保持组合久期处于中性略长水平,并提高配置短期限短融等品种,一方面保持组合流动性一方面积累正偏离。通过上述操作,本基金顺利应对了市场的波动,保证了组合安全。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期嘉实理财宝7天债券A的基金份额净值收益率为0.9635%,嘉实理财宝7天债券B的基金份额净值收益率为1.0356%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%。

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2013年2季度,政策走势仍将是影响货币市场的主要因素。新一届政府在清理影子银行、规范地方政府融资等方面推出一系列经济政策。新政策可能使今年经济复苏偏弱,为了稳定经济,预计央行大概率将维持货币政策中性稳定。央行并不希望看到市场流动性过于宽松或者紧张。此外,2013年随着宏观经济走势的变化,以及政府整顿经济的政策出台,不排除爆发真正违约的可能性。尚德破产事件将给我们敲响警钟,在2013年我们需要警惕信用违约事件的爆发。针对上述复杂市场环境,本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格,强化投资风险控制,以确保组合安全性为首要任务,兼顾流动性和收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况,继续保持较高的流动性资产配置,谨慎控制组合的信用配置,以应对利率上行风险和组合规模波动,努力为投资人创造安全稳定的收益。

§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	固定收益投资	2,363,743,568.93	64.45
	其中:债券	2,363,743,568.93	64.45
	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	1,196,668,306.12	32.63
4	其他资产	107,119,736.80	2.92
	合计	3,667,531,611.85	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	19.93
	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	841,798,779.10	29.82
	其中:买断式回购融资	-	-

注:(1)报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。(2)本基金基金合同第十二部分约定:本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%。报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的40%。

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	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过127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	53.02	29.82
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	15.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	15.61	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.78	-
4	90天(含)-180天	12.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	28.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	126.14	29.82

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	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	200,700,642.43	7.11
	其中:政策性金融债	200,700,642.43	7.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,163,042,926.50	76.63
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
	合计	2,363,743,568.93	83.74
	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	50,174,914.17	1.78

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

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)	占基金资产净值比例(%)
1	110206	11国开06	1,500,000	150,525,728.26	5.33
2	011201003	12中石油SCP003	1,500,000	150,471,690.79	5.33
3	071302002	13国泰君安CP002	1,400,000	140,005,368.30	4.96
4	071303003	13中信CP003	1,300,000	129,991,863.01	4.61
5	041365003	13中城建CP001	1,000,000	100,002,988.90	3.54
6	071304002	13广发CP002	1,000,000	99,993,158.67	3.54
7	041352001	13南方水泥CP001	800,000	80,384,944.52	2.85
8	071301002	13招商CP002	700,000	69,995,935.36	2.48
9	071311001	13国信CP001	700,000	69,995,423.53	2.48
10	041262027	12云铜CP001	600,000	60,243,863.06	2.13

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
报告期内偏离度的最高值	0.2259%
报告期内偏离度的最低值	0.0763%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1363%

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

报告期末,本基金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

本基金采用固定份额净值,基金份额账面净值始终保持为1.00人民币元。

本基金估值采用摊余成本法,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,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益或损失。

5.8.2 若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,应声明本报告期内是否存在该类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

报告期内,本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,其摊余成本总计在每个交易日均未超过当日基金资产净值的20%。

5.8.3 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

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	27,608,812.23
4	应收申购款	79,510,924.57
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合计	107,119,736.80

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实理财宝7天债券A	嘉实理财宝7天债券B
本报告期期初基金份额总额	969,964,071.01	795,114,270.48
本报告期基金总申购份额	4,984,938,095.62	4,786,149,764.92
减:本报告期基金总赎回份额	4,860,280,555.89	3,853,239,555.74
本报告期期末基金份额总额	1,094,621,610.74	1,728,024,479.66

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投及基金份额目动升降级调增份额;总赎回份额含目动升降级调减份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(1)中国证监会批准嘉实理财宝7天债券型证券投资基金募集的文件;

(2)《嘉实理财宝7天债券型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实理财宝7天债券型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实理财宝7天债券型证券投资基金基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实理财宝7天债券型证券投资基金公告的各项原稿。

7.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

7.3 查阅方式

(1)书面查询:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查询:基金管理人网址:http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8800,或发电子邮件,E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2013年4月19日

建信双周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:中国工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。

基金托管人中国工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1日起至3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	2,010,757,586.73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	1,629,896,236.70份	380,861,350.03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)	
	建信双周理财债券A	建信双周理财债券B
1.本期已实现收益	19,967,392.09	13,998,863.63
2.本期利润	19,967,392.09	13,998,863.63
3.期末基金资产净值	1,629,896,236.70	380,861,350.03

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

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	0.9116%	0.0042%	0.3381%	0.0000%	0.5735%	0.0042%

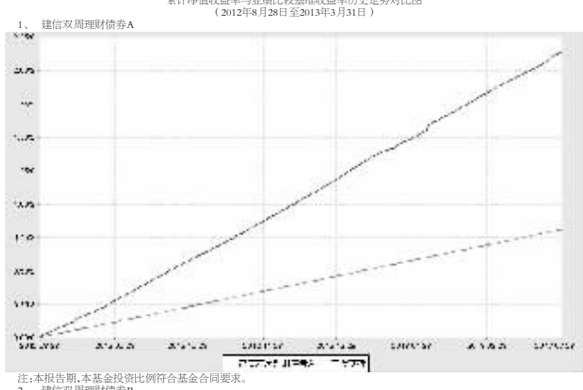
2. 建信双周理财债券B

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	0.9841%	0.0042%	0.3381%	0.0000%	0.6460%	0.0042%

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

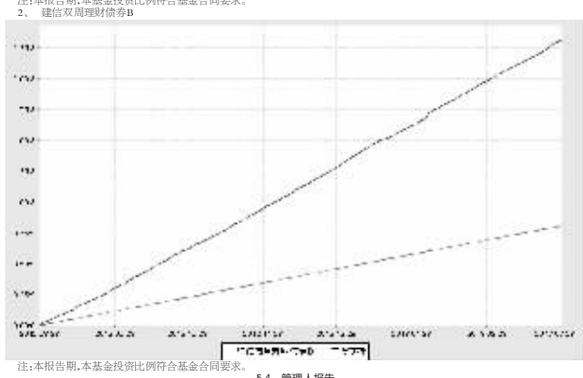
建信双周安心理财债券型证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年8月28日至2013年3月31日)

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		
朱建华先生	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。
高珊女士	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;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

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

一季度,全球市场流动性依然宽松,以美国为首的经济体处于缓慢的复苏中,但欧洲经济表现明显弱于预期,全球经济的真正回暖还需向待时日。国内方面,宏观经济依然处于震荡筑底阶段,实体经济的表现要弱于宏观经济,从发电量工业增加值等数据看明显弱于预期,加上对政府房地产市场调控预期的增强,这也使高涨的股市出现一定降温。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,同时为保持下阶段经济的发展,央行的货币政策总体以稳健为主。其中,为应付春节后巨量的到期资金,央行开展一系列的正回购操作,但鉴于之前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较为宽松,资金成本相比上个季度进一步降低。债券市场收益率在宽松的资金面和配置资金的推动下总体呈现下行,其中尤其以短端下行更为明显。

本季度,建信双周安心理财基金采用了稳健的投资风格,存款为主并调整了部分短融的配置,整体组合平均剩余期限以偏长的久期为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期双周理财A净值收益率0.9116%,波动率0.0042%,双周理财B净值收益率0.9841%,波动率0.0042%,业绩比较基准收益率0.3381%,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

展望今年二季度,我们认为随着十八大的闭幕,之前一些停滞的项目将进入施工阶段,项目的上马会使二季度的经济表现强于一季度,但通胀的预期并不会立刻成为市场主流,市场流动性受财政存款以及季末因素的影响,总体可能会前松后紧,若资金成本不能进一步降低,预计债市将可能逐步进入震荡阶段,并不排除债市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包括银行监管、清理影子银行、房地产调控等一系列政策保持关注。

从目前时点看,由于绝对资金成本较低,短融以及存款的配置价值并不很高,继续拉长久期的意义不是太大。建信双周安心理财基金将继续以存款为主短融为辅,在保证组合流动性的同时力争保证组合能够跟随市场的发展变化,获得合理的收益。

§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	固定收益投资	859,895,006.23	37.45
	其中:债券	859,895,006.23	37.45
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	220,000,530.00	9.58
	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	1,179,414,597.99	51.37
4	其他各项资产	36,739,065.50	1.60
5	合计	2,296,049,199.72	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	6.13
	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	283,469,322.04	14.10
	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	122
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	125
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

报告期内投资组合平均剩余期限超过134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134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	20.86	14.10
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	29.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	4.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	31.82	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	25.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	112.36	14.10

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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	149,933,679.66	7.46
3	金融债券	149,844,818.99	7.45
	其中:政策性金融债	149,844,818.99	7.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	560,116,507.58	27.86
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	859,895,006.23	42.76
9	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)	占基金资产净值比例(%)
1	120228	12国开28	1,500,000	149,844,818.99	7.45
2	1001032	10央行票据32	1,000,000	99,984,108.24	4.97
3	041354007	13亿利集CP001	800,000	80,011,743.59	3.98
4	041254054	12红狮CP002	700,000	70,001,474.09	3.48
5	041360002	13广汇集团CP001	500,000	50,001,318.91	2.49
6	1001060	10央行票据60	500,000	49,949,571.42	2.48
7	041358009	13巨化CP001	400,000	40,053,874.46	1.99
8	041258054	12美邦CP001	400,000	40,010,078.53	1.99
9	041258060	12魏桥CP002B	400,000	40,000,679.59	1.99
10	041262050	12金鸿CP001	300,000	30,000,861.84	1.49

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	0.16%
报告期内偏离度的最低值	0.01%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.10%

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	27,187,092.44
4	应收申购款	9,551,973.06
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	36,739,065.50

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信双周理财债券A	建信双周理财债券B
本报告期期初基金份额总额	2,955,356,242.84	6,592,309,783.02
本报告期基金总申购份额	3,116,523,211.53	2,654,082,831.36
减:本报告期基金总赎回份额	4,441,983,217.67	8,865,531,264.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,629,896,236.70	380,861,350.03

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。

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

建信社会责任股票型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	47,276,657.26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