建信优化配置混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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10月24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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信优化配置混合
基金主代码	530005
交易代码	530005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月1日
报告期末基金份额总额	7,868,624,786.95份
投资目标	通过合理的资产配置和积极的证券选择,在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。
投资策略	基金管理人对宏观经济、行业及上市公司、债券、货币市场工具等进行定性与定量相结合的研究,运用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在大类资产配置这一宏观层面与个股个券选择这一微观层面优化投资组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:60%×富时中国A600指数+40%×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,一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	169,100,562.47
2.本期利润	687,629,109.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0849
4.期末基金资产净值	6,976,652,861.31
5.期末基金份额净值	0.8866

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;

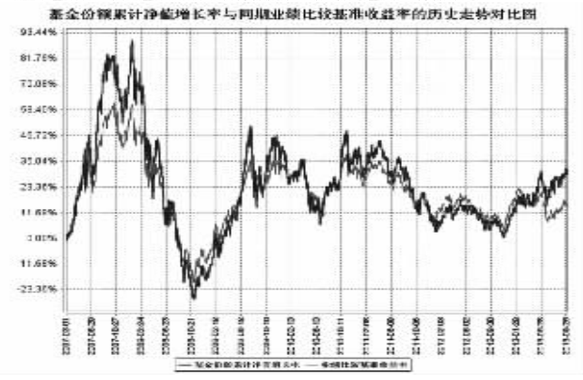
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	10.56%	1.15%	6.16%	0.81%	4.40%	0.34%

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		
陶灿	本基金的基金经理	2011年7月11日	-	6	硕士,2007年7月加入本公司,从事行业研究,历任研究员、基金经理助理,2011年7月11日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理。
乔林建	本基金的基金经理	2013年1月5日	-	11	硕士,2002年6月起就职于新华人寿保险公司,历任研究员、投资经理;2006年6月起就职于新华资产管理公司,任高级投资经理,2008年2月加入我公司,历任高级投资经理、资深投资经理、基金经理助理;2013年1月5日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理;2013年9月24日起任建信创新中国股票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《建信优化配置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

2013年三季度期间经济增长周期从下滑转变为增速见底回升,各项经济指标好于市场预期,市场流动性经历6月冲击后保持适度宽松,固此整体上市场表现较好,但分化继续延续,风格渐渐依旧鲜明。

本基金紧密跟踪宏观经济和政策变化,积极进行组合管理,在周期与成长、价值与主题间做出相对均衡的选择。

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10.56%,波动率1.15%,业绩比较基准收益率6.16%,波动率0.81%。

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,宏观经济数据经历三季度一定程度恢复后,政策稳增长的预期在降低,特别是三中全会后,政策托底功能在下降,经济内生增长动能还处于较弱态势。在流动性、盈利增长、风格年度切换、政策的交织影响下,证券市场波动预期加大,本基金将在控制下行风险的同时,追求个股和行业的超额收益,为持有人创造回报。

§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	5,628,787,526.02	80.17
	其中:股票	5,628,787,526.02	80.17
2	固定收益投资	28,166,143.50	0.40
	其中:债券	28,166,143.50	0.40
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	300,000,690.00	4.27
	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	1,038,734,162.38	14.79
6	其他资产	25,424,244.27	0.36
7	合计	7,021,112,766.17	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	189,465,714.70	2.72
B	采矿业	70,058,040.48	1.00
C	制造业	3,365,461,274.82	48.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,030,085.16	0.40
E	建筑业	36,150,549.00	0.52
F	批发和零售业	107,263,452.86	1.54
G	交通运输、仓储和邮政业	7,166,432.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	484,611,087.84	6.95
J	金融业	221,191,042.08	3.17
K	房地产业	450,715,391.55	6.46
L	租赁和商务服务业	370,093,602.80	5.30
M	科学研究和技术服务业	13,363,621.44	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	193,988,384.50	2.78
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	91,228,846.79	1.31
S	综合	-	-
	合计	5,628,787,526.02	80.68

注:以上行业分类以2013年9月30日的中国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	600887	伊利股份	4,969,680	222,045,302.40	3.18
2	002344	海宁皮城	9,039,371	196,154,350.70	2.81
3	300202	聚龙股份	6,422,876	184,529,227.48	2.64
4	601888	中国国旅	3,813,867	158,046,648.48	2.27
5	600016	民生银行	15,231,831	145,616,304.36	2.09
6	000625	长安汽车	13,078,074	134,704,162.20	1.93
7	300070	碧水源	3,166,760	128,887,132.00	1.85
8	600570	恒生电子	5,482,308	118,198,560.48	1.69
9	002241	歌尔声学	2,616,314	110,617,755.92	1.59
10	000671	阳光城	8,946,482	100,647,922.50	1.44

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	28,166,143.50	0.40
8	其他	-	-
9	合计	28,166,143.50	0.40

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	110015	石化转债	250,410	24,512,634.90	0.35
2	128002	东华转债	29,400	3,653,508.60	0.05

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

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 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。

5.10.2 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	3,073,169.92
2	应收证券清算款	19,568,042.62
3	应收股利	621,531.04
4	应收利息	619,041.92
5	应收申购款	1,542,458.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,424,244.27

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	24,512,634.90	0.35

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情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	8,245,845,018.57
报告期期间基金总申购份额	38,278,422.99
减:报告期期间基金总赎回份额	415,498,654.61
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	7,868,624,786.95

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 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金本报告期未发生管理人运用固有资产投资本基金的情况。

§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优化配置混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信优化配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信优化配置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
2013年10月24日

建信稳定增利债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30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10月24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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信稳定增利债券
基金主代码	530008
交易代码	530008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月25日
报告期末基金份额总额	1,799,773,182.23份
投资目标	通过主动式管理债券组合,在追求基金资产稳定增长基础上获得高于投资基准的回报。
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。本基金管理人力求综合发挥固定收益、股票及金融衍生产品投资研究团队的力量,通过专业分工细分研究领域,立足长期基本因素分析,从利率、信用等角度进行深入研究,形成投资策略,优化组合,获取可持续的、超出市场平均水平的稳定投资收益。并在固定收益资产所提供的稳定收益基础上,适当参与新股发行申购及增发新股申购,为基金持有人增加收益,实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中国债券总指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	21,062,629.16
2.本期利润	7,670,547.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0043
4.期末基金资产净值	2,156,140,158.54
5.期末基金份额净值	1.198

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	0.34%	0.17%	-1.83%	0.10%	2.17%	0.07%

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		
钟敬棣	投资管理部副总监、本基金的基金经理	2008年8月15日	-	8	特许金融分析师(CFA),硕士,加拿大籍华人。1995年7月毕业于南开大学金融系,获经济学学士学位,2004年5月毕业于加拿大不列颠哥伦比亚大学,获工商管理硕士学位。曾先后任职于广东发展银行珠海分行、深圳发展银行珠海分行、嘉实基金管理有限公司等,从事外汇交易、信贷、债券研究及投资组合管理等工作,2008年5月加入建信基金管理公司,2009年6月2日至2011年5月11日任建信收益增强债券型证券投资基金基金经理;2008年8月15日起任建信稳定增利债券型证券投资基金基金经理;2011年12月13日起任建信双息红利债券型证券投资基金基金经理;2013年9月3日起任建信安心保本混合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

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《建信稳定增利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

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率0.34%,波动率0.17%,业绩比较基准收益率-1.83%,波动率0.10%。

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,预期经济增长动能可能重新走弱。正常情况下,经济的短周期补库存只会维持1—2个季度,生产端能否延续三季度的扩张取决于需求端能否兑现。从外需而言,美国下调自己的经济增长预测,同时又再度迎来债务上限的争论问题,这使得外部需求令人担忧。从内需而言,预期央行仍将维持资金的紧平衡,较高的资金利率对投资的负面影响可能会逐步显现出来,而监管部门对银行同业业务的规范也将进一步影响投资增速。当然值得我们关注的是三中全会释放的改革信号,它可能成为影响预期走向的关键变量。物价方面,预计四季度消费者物价指数同比水平进一步温和回升。

四季度本基金将择机加大债券的配置力度,重点关注包括国债和金融债在内的高等级债券,同时在严格的信用研究基础上,适当配置性价比高的信用债,力争为投资者取得好的收益。

§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	101,843,362.90	3.71
	其中:股票	101,843,362.90	3.71
2	固定收益投资	2,522,348,710.45	91.90
	其中:债券	2,522,348,710.45	91.90
	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	27,491,435.31	1.00
6	其他资产	92,990,511.78	3.39
7	合计	2,744,674,020.44	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	采矿业	35,652,081.12	1.65
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,240,000.00	0.75
E	建筑业	6,026,775.70	0.28
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	43,924,506.08	2.04
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	-	-
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	101,843,362.90	4.72

注:以上行业分类以2013年9月30日的中国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	601006	大秦铁路	6,033,586	43,924,506.08	2.04
2	600028	中国石化	8,029,748	35,652,081.12	1.65
3	600795	国电电力	7,000,000	16,240,000.00	0.75
4	601669	中国水电	1,937,870	6,026,775.70	0.28

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	320,851,648.00	14.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	463,706,000.00	21.51
	其中:政策性金融债	463,706,000.00	21.51
4	企业债券	1,428,541,044.30	66.25
5	企业短期融资券	19,890,000.00	0.92
6	中期票据	87,013,000.00	4.04
7	可转债	202,347,018.15	9.38
8	其他	-	-
9	合计	2,522,348,710.45	116.98

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	019219	12国债19	1,700,000	169,915,000.00	7.88
2	126019	09长虹债	1,438,700	132,288,465.00	6.14
3	122964	09龙湖债	1,115,170	115,531,612.00	5.36
4	110411	11农发11	1,100,000	109,318,000.00	5.07
5	110015	石化转债	1,048,400	102,627,876.00	4.76

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国债期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 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。

5.9 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(元)
1	存出保证金	218,830.67
2	应收证券清算款	41,254,918.30
3	应收股利	-
4	应收利息	49,895,862.81
5	应收申购款	1,620,900.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	92,990,511.78

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	102,627,876.00	4.76
2	110018	国电转债	98,529,186.00	4.57
3	125089	深机转债	772,412.31	0.04

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不在在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,840,516,022.48
报告期期间基金总申购份额	292,021,077.97
减:报告期期间基金总赎回份额	332,763,918.22
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,799,773,182.23

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 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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稳定增利债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信稳定增利债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信稳定增利债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信稳定增利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
2013年10月24日

建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月24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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信优势动力股票(LOF)(场内简称:建信优势)
基金主代码	165313
交易代码	165313
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年3月19日
报告期末基金份额总额	2,777,412,691.51份
投资目标	采取定量和定性相结合的方法,寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力,但是价值被低估的优势上市公司,通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险,在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产来获取超额收益。
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	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,一般情况下其风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。属于较高风险收益特征的证券投资基金品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-7,753,139.98
2.本期利润	144,271,002.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0439
4.期末基金资产净值	2,633,594,076.71
5.期末基金份额净值	0.948

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。

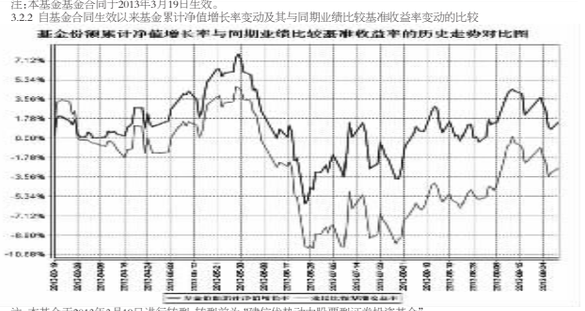
3.2 基金净值表现

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	4.75%	1.04%	6.66%	1.07%	-1.91%	-0.03%

注:本基金基金合同于2013年3月19日生效。

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:本基金于2013年3月19日进行转型,转型前为"建信优势动力股票型证券投资基金"。

§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		
万志勇	投资管理部副总监、本基金的基金经理	2013年3月19日	-	12	硕士。曾就职于西安创新互联网孵化器有限公司、北方证券有限责任公司、大成基金管理有限公司、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司(原巨田基金管理有限公司)。银华基金管理有限公司,2008年10月23日至2009年11月11日任银华领先策略基金基金经理,2009年6月1日至2010年6月19日任银华和谐主题基金基金经理。2010年7月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究部执行总监、研究部执行总监兼投资管理部副总监、投资管理部副总监,2010年11月17日起任建信内生动力股票型证券投资基金基金经理;2011年5月6日至2012年5月18日任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理;2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理,该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力股票型证券投资基金(LOF),万志勇继续担任该基金基金经理。
姜锋	本基金的基金经理	2013年3月19日	-	6	硕士,2007年7月加入本公司,从事行业研究,任研究员,2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理,该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力股票型证券投资基金(LOF),姜锋继续担任该基金基金经理。

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《建信优势动力股票型证券投资基金(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