建信月盈安心理财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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	建信月盈安心理财
基金主代码	530028
交易代码	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	798,087,839.13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A	建信月盈安心理财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	748,969,281.80份	49,118,557.33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7月1日 - 2013年9月30日)	
	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
1. 本期已实现收益	8,722,807.73	646,359.51
2.本期利润	8,722,807.73	646,359.51
3.期末基金资产净值	748,969,281.80	49,118,557.33

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

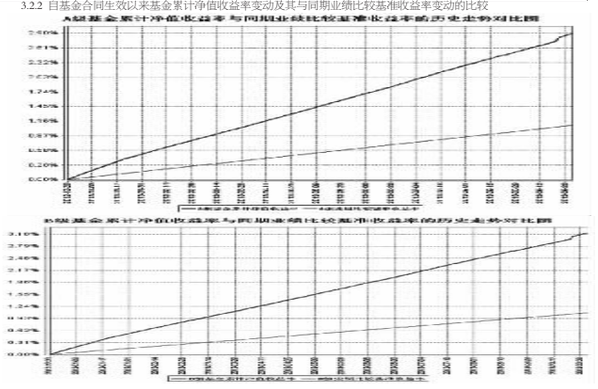
建信月盈安心理财A

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	0.9332%	0.0052%	0.3456%	0.0000%	0.5876%	0.0052%

建信月盈安心理财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	1.0073%	0.0052%	0.3456%	0.0000%	0.6617%	0.0052%

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



注:本报告期内,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	本基金的基金经理	2012年12月20日	-	7	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。
朱建华	本基金的基金经理	2012年12月20日	-	6	硕士,曾任大连博迅系统工程公司职员、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29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;2013年5月14日起任建信定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:本基金基金合同于2012年12月20日生效,截止报告期末未满一年。

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150天。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150天。

3.本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

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	本基金的基金经理	2012年12月20日	-	7	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。
朱建华	本基金的基金经理	2012年12月20日	-	6	硕士,曾任大连博迅系统工程公司职员、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29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;2013年5月14日起任建信定期开放债券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,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《建信月盈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

三季度,国内外经济总体运行平稳,黑天鹅事件对市场的冲击明显要低于上个季度。海外市场,美国经济的复苏步伐基本符合市场预期,虽然QE没有如市场预期那样在9月底开始退出步伐,但三季度,资金从美债市场的撤出非常明显。欧洲经济显示了一定的好转态势,由于财政的结构性矛盾仍将继续长期制约欧洲经济,预计欧洲大范围的宽松政策仍将持续。国内方面,通胀总体处于较低位置,实体经济在短期内出现了一定补库存的迹象,土地市场的再次火热,加上铁路、地方投资等的拉动,三季度国内经济逐步企稳,但影响国内经济发展的长期矛盾并没有化解。资金面方面,三季度央行加强了银行间市场的资金价格干预力度,一方面通过频繁的SLO等稳定短期的资金利率水平,另一方面央行为控制长期的通胀预期以及流动性风险,续发三年期央票收紧长期流动性,对市场预期造成了一定的不确定性,这也在很大程度上影响了债市。债券市场,三季度一般是债券的传统熊市,今年也不例外,债市新开户继续受到遏制,银行加强了头寸的预期管理,导致银行整体出钱意愿不强,机构继续小幅降杠杆,特别是利率债银行的配置行为变化导致利率债跌幅较大。信用债由于前期涨幅较大新增需求不足,信用债也经历了一波下跌,信用利差小幅收窄,收益率曲线持续平坦。同时债券基金在九月底也普遍出现较大规模赎回。

回顾三季度的基金管理工作,建信月盈安心理财基金主要采用了稳健的投资风格预防流动性风险,投资上主要以存款为主,并适当降低了债券比例,缩短久期,因此虽然三季度月盈理财出现较大的赎回压力,但仍然较好渡过了三季度末的流动性冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金月盈理财A净值收益率0.9332%,波动率0.0052%,月盈理财B净值收益率1.0073%,波动率0.0052%;业绩比较基准收益率0.3456%,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

展望四季度,我们认为经济的持续增长性不足,但大起大落也不太可能,实体经济的产能过剩仍将是长期的,未来企业补库存与去库存将长期反复,未来引领经济的增长引擎不会发生变化,但投资很难维持高位,通胀在四季度会达到年内高点,但很难超预期,因此也暂不会成为债市的掣肘,猪肉价格的可能回升在四季度应引起一定重视。十八届三中全会召开后将出台什么样的改革措施将引起全市场的期待,但我们也认为由于国内经济的潜在增速在下降,短期改革恐怕不足以扭转这一下降趋势,未来如何盘活存量值得关注。地方投融资平台的长期风险依然较大,因此新的金融改革措施出台后如何化解目前经济体的诸多矛盾将对市场、机构行为等产生深远影响。四季度,我们预计货币政策不会大的调整,不刺激,稳价格预期将是央行的总体思路。

债市方面,四季度债市供给仍将较快,特别是企业债供给在四季度将逐步放量。需求方面,追求绝对收益仍是影响机构的最重要操作行为,利率债的操作空间并不大。我们认为四季度实体经济体信用违约风险将低于三季度,信用息差将缩窄。短融方面,预计年内资金面不会有太大的波动,对短融市场整体偏有利,特别是现在收益率曲线相对平坦,短融在估值上有一定优势。存款价格更多受资金影响,可适当拉长存款期限。

未来建信月盈安心理财债券型证券投资基金仍将维持中性的剩余期限,将重点关注流动性的基础上适当拉长久期。在组合投资策略的制定中会依据申赎情况进行动态调整,特别是对于敏感时点做好流动性的应对。配置上主要以存款和短融相结合的策略,在保证组合流动性的同时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	469,982,297.33	58.83
	其中:债券	469,982,297.33	58.83
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	214,500,761.75	26.85
	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	102,624,341.48	12.85
4	其他资产	11,734,811.81	1.47
5	合计	798,842,212.37	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	1.40
	其中,买断式回购融资	0.00
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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	128
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

报告期内投资组合平均剩余期限超过150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150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	32.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	18.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	12.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	20.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	15.01	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.62	-

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	150,058,887.62	18.80
	其中:政策性金融债	150,058,887.62	18.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	319,923,409.71	40.09
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	469,982,297.33	58.89
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	120245	12国开45	1,000,000	99,997,595.45	12.53
2	041359003	13杉杉CP001	600,000	60,036,993.55	7.52
3	041360036	13湘高速CP002	600,000	59,915,048.03	7.51
4	110203	11国开03	500,000	50,061,292.17	6.27
5	041256037	12TCL集CP001	500,000	50,049,750.05	6.27
6	041358006	13华谊兄弟CP001	300,000	30,023,372.57	3.76
7	041366001	13海亮CP001	200,000	20,010,896.66	2.51
8	041369026	13昆交产CP001	200,000	20,000,144.84	2.51
9	011343001	13中核建SCP001	200,000	20,000,121.76	2.51
10	041360004	13苏国信CP001	200,000	20,000,042.26	2.51

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0604%
报告期内偏离度的最低值	-0.1410%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0294%

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 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	11,710,962.32
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	23,849.49
7	其他	-
8	合计	11,734,811.81

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信月盈安心理财A	建信月盈安心理财B
报告期期初基金份额总额	1,182,675,580.11	94,069,137.39
报告期期间基金总申购份额	326,884,598.23	59,111,314.11
减:报告期期间基金总赎回份额	760,590,896.54	104,061,894.17
报告期期末基金份额总额	748,969,281.80	49,118,557.33

注:上述总申购份额含红利再投份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金本报告期末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月盈安心理财债券型证券投资基金设立的文件;

2.《建信月盈安心理财债券型证券投资基金基金合同》;

3.《建信月盈安心理财债券型证券投资基金招募说明书》;

4.《建信月盈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
2013年10月24日

诺安信用债券一年定期开放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:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21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	诺安信用债一年定期开放债券
交易代码	000151
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月18日
报告期末基金份额总额	2,165,047,769.29份
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1.封闭期投资策略 在封闭期内,为合理控制本基金开放期的流动性风险,并满足每次开放期的流动性需求,原则上本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。同时,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。 2.开放期投资安排 在开放期,基金管理人将采取各种有效管理措施,保障基金运作安排,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。在开放期前根据市场情况,进行相应压力测试,制定开放期操作规范流程和应急预案,做好应付极端情况下巨额赎回的准备。
业绩比较基准	中证企业债指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于证券市场中的中低风险品种,预期收益和风险高于货币市场基金,普通债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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	22,231,838.40
2.本期利润	22,119,770.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0102
4.期末基金资产净值	2,192,511,019.97
5.期末基金份额净值	1.013

注:①上述基金业绩指标不包括持有人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。

②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。

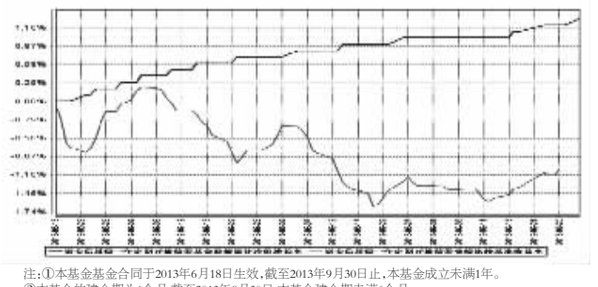
3.2 基金净值表现

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	1.10%	0.04%	-0.89%	0.10%	1.99%	-0.06%

注:本基金的业绩比较标准为:中证企业债指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%。

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:①本基金基金合同于2013年6月18日生效,截至2013年9月30日止,本基金成立未满1年。

②本基金的建仓期为6个月,截至2013年9月30日,本基金建仓期未满6个月。

§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		
谢志华	诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理、诺安鸿鹏保本混合型证券投资基金基金经理、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、诺安基金固收益一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理	2013年6月18日	-	7	理学硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于华泰证券有限责任公司、招商基金管理有限公司,从事固定收益类品种的研究、投资工作。曾于2010年8月至2012年8月任招商安心收益债券型证券投资基金基金经理,2011年3月至2012年8月任招商安瑞进取债券型证券投资基金基金经理,2012年8月加入诺安基金管理有限公司,任投资经理,2013年5月起任诺安鸿鹏保本混合型证券投资基金及诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年6月起任诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年8月起任诺安稳固收益一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日;

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》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的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不存在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

13年三季度,资金面仍处于紧平衡状态,银行纷纷提高备付金水平,放缓债券配置节奏,资金利率中枢仍处于高位。三季度利率债供给较大,一级中标利率屡屡超出市场预期,带动二级市场收益率持续上行。在基准利率抬升的推动下,信用债收益率被动上行。诺安信用债基金在三季度利用债市调整的机会,保持了较快的建仓节奏。展望四季度,一方面,资金面或逐渐有所改观,另一方面,供给仍处于高位,供需两旺背景下债市机遇增多,我们将密切跟踪市场动态,积极把握投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.013元。本报告期基金份额净值增长率为1.10%,同期业绩比较基准收益率为-0.89%。

§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	固定收益投资	1,610,174,000.00	72.67
	其中:债券	1,610,174,000.00	72.67
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	528,800,000.00	23.87
	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	63,693,496.74	2.87
6	其他资产	12,941,035.21	0.58
7	合计	2,215,608,531.95	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	307,524,000.00	14.03
	其中:政策性金融债	307,524,000.00	14.03
4	企业债券	333,511,000.00	15.21
5	企业短期融资券	719,213,000.00	32.80
6	中期票据	249,926,000.00	11.40
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,610,174,000.00	73.44

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	130238	13国开38	1,500,000	148,680,000.00	6.78
2	130240	13国开40	1,000,000	98,990,000.00	4.51
3	041360065	13闽漳龙CP001	700,000	70,063,000.00	3.20
4	1180016	11皋交投债	500,000	53,340,000.00	2.43
5	101360012	13马钢资MTN001	500,000	50,570,000.00	2.31

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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持有国债期货。

5.8.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.2 本基金本报告期末未持有股票。

5.9.3 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	应收股利	-
4	应收利息	12,941,035.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,941,035.21

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处于转股期的可转换债券。

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。

5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,165,047,769.29
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,165,047,769.29

注:总申购份额含红利再投、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基金情况

本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于2013年7月6日发布了《诺安基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告》的公告,自2013年7月6日起,负责审计本基金基金财产的会计师事务所为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金募集的文件。

②《诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》。

③《诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》。

④基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金2013年三季度报告正文。

⑥报告期内诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人全国统一客户服务电话:400-888-8998,亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2013年10月24日

建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金

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: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	建信央视50(场内简称:建信50)
基金主代码	165312
交易代码	165312
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月28日
报告期末基金份额总额	745,435,000.56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