建信收益增强债券型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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
送出日期:2014年3月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2014年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信收益增强债券	
基金主代码	530009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年6月2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	
报告期末基金份额总额	384,396,744.40份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
下属分级基金的交易代码:	530009	531009
报告期末下属分级基金的份额总额	174,257,979.88份	210,138,764.52份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持资产流动性的基础上,发挥投研团队在固定收益、股票及金融衍生产品方面的综合研究实力,在有效控制风险的前提下追求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信用类债券投资组合,运用基本面研究择机介入上市公司股票及参与新股申购,以实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	30%×中债企业债总指数+70%×中债国债总指数
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混合型基金,但高于货币市场基金以及不涉及股票二级市场投资的债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	李芳菲
	联系电话	010-66228888	010-66060069
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	lifangfei@abcchina.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95599
传真		010-66228001	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年		2012年		2011年	
	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
本期已实现收益	37,640,452.08	12,753,465.11	12,343,589.70	8,017,189.60	14,061,336.05	16,126,848.65
本期利润	20,893,220.69	1,188,917.17	31,906,557.79	30,183,868.11	-19,621,850.62	-27,890,891.09
加权平均基金份额本期利润	0.0339	0.0045	0.0781	0.0762	-0.0436	-0.0469
本期基金份额净值增长率	-0.10%	-0.49%	5.69%	5.48%	-4.14%	-4.53%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末		2011年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0312	0.0125	0.0319	0.0178	0.0875	0.0761
期末基金资产净值	179,701,167.62	212,771,681.13	1,176,339,540.57	323,800,312.12	380,600,720.10	480,064,699.13
期末基金份额净值	1.031	1.013	1.032	1.018	1.087	1.076

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、期末可供分配利润的计算方法:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分;如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分);

3、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 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

建信收益增强债券A

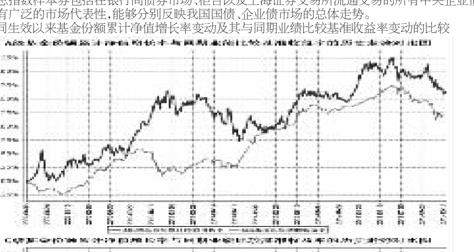
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.37%	0.34%	-2.15%	0.15%	-0.22%	0.19%
过去六个月	-2.37%	0.27%	-3.92%	0.13%	1.55%	0.14%
过去一年	-0.10%	0.28%	-1.49%	0.12%	1.39%	0.16%
过去三年	1.21%	0.27%	8.79%	0.11%	-7.58%	0.16%
自基金合同生效起至今	14.77%	0.27%	10.82%	0.11%	3.95%	0.16%

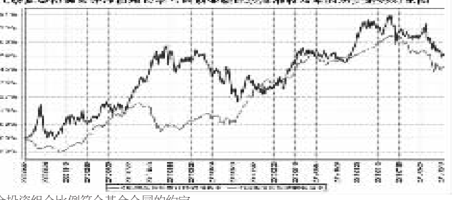
建信收益增强债券C

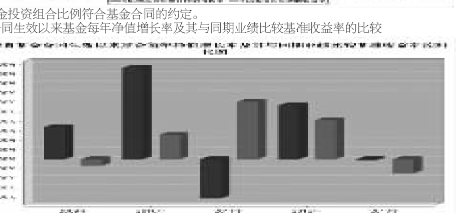
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.41%	0.33%	-2.15%	0.15%	-0.26%	0.18%
过去六个月	-2.50%	0.26%	-3.92%	0.13%	1.42%	0.13%
过去一年	-0.49%	0.27%	-1.49%	0.12%	1.00%	0.15%
过去三年	0.21%	0.27%	8.79%	0.11%	-8.58%	0.16%
自基金合同生效起至今	12.94%	0.27%	10.82%	0.11%	2.12%	0.16%

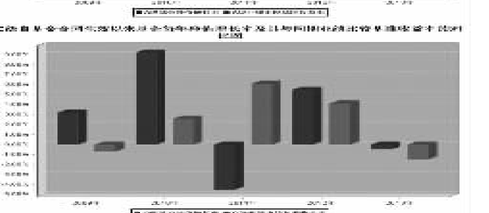
注:本基金的业绩比较基准为:30%×中债企业债总指数+70%×中债国债总指数。中债企业债总指数、中债国债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司(简称"中债公司")编制的、分别反映我国国债市场和企业债市场整体价格和投资回报情况的指数。其中,中债国债总指数样本券包括在银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有记帐式国债;中债企业债总指数样本券包括在银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有中央企业债和地方企业债。该两个指数具有广泛的市场代表性,能够分别反映我国国债、企业债市场的总体走势。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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









等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下:

当时间窗为1日时,配了1984对投资组合,有496对投资组合未通过T检验,其中190对投资组合的正溢价率占优频率小于55%,其它306对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,有29对投资组合的平均溢价率超过2%,但其组合贡献率低于5%,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为3日时,配了2454对投资组合,有558对投资组合未通过T检验,其中78对投资组合的溢价率占优频率小于55%,其它480对正溢价率占优频率大于55%的投资组合,有9对投资组合的平均溢价率超过5%,但其组合贡献率低于5%,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为5日时,配了2548对投资组合,有673对投资组合未通过T检验,其中92对投资组合的溢价率占优频率小于55%,其它581对正溢价率占优频率大于55%的投资组合,有1对投资组合的平均溢价率超过10%,但其组合贡献率低于5%,同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年年初延续2012年四季度经济反弹的趋势,但二季度经济增长动能明显不足,在上半年较为宽松的货币政策条件下,三季度宏观经济增长出现强劲反弹,四季度则趋于平稳增长,物价指数全年均保持较低水平。经济政策方面,在社会融资总量和增速都较高的情况下,央行和银监会在2013年5月份开始加紧了规范影子银行的发展步伐,央行通过回购和央票等一系列收短放长的操作来引导短期市场利率,银监会则通过严格执行《中国银监会关于规范商业银行理财业务投资运作有关问题的通知》以及规范商业银行平台贷款等措施来规范商业银行行为。国际市场方面,欧美经济仍在复苏进程中,日元贬值,虽然9月份美联储决定延迟推出QE,但四季度仍然回复到正式有步骤退出量化宽松政策阶段。

在上述背景下,债券市场2013年前5月在充裕的流动性和较高的风险偏好环境下收益率曲线整体下滑,此后随着流动性预期的收紧以及商业银行在利率市场化情形下行为模式的改变,债券各品种都经历了漫长的下跌过程。股票市场在经历了1月份的短暂反弹后开始下跌,5月底后跌幅更大,全年并未突破2月初的高点。

回顾全年的基金管理工作,基金并没有在春节后及时锁定转债市场收益且一季度过早减持中低评级信用债,是全年绝对收益表现较差的主要原因。全年组合久期中性,但并未能规避利率债和高等级信用债也下跌给组合带来的负贡献,四季度组合权益资产配置比例较低,规避了转债市场大幅下跌的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期收益增强A净值增长率为-0.10%,波动率为0.28%;收益增强C净值增长率为-0.49%,波动率为0.27%。业绩比较基准收益率为-1.49%,波动率为0.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新年,我们认为政府仍然会在稳增长和调结构之间寻找平衡,但如果经济增长一定要保持底线思维,则调结构之路将更为曲折和艰难。随着市场利率化的逐步深入和稳步推进,我们认为社会融资成本易上难下,在没有出现系统性风险或者经济大幅滑坡事件之前,资金利率难以有较大幅度的回落。整体而言,我们认为债券市场方面,资金成本的抬高使得债券各期限品种收益率难以下行,收益率曲线平坦化的态势或将延续,仍然需充分警惕信用事件对信用产品整体估值的影响。权益市场方面,我们仍然认为市场难以实现系统性的估值扩张行情,但部分长期估值具备安全边际和增长比较确定且有持续性的股票仍具有一定投资价值。

本基金将在严控风险的前提下,相对控制久期风险,加强组合投资的灵活性,权益市场方面,采取相对防御与均衡的投资策略,精选个股,力求为持有人获得较好的绝对收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本管理人根据中国证监会[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定,继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策;对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督;对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成(具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定)。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件,发现估值问题;提议基金估值调整的相关方案并进行校验;根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案,报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理,并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的,由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果,基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金和理财类基金)。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内未实施利润分配,符合法律法规和基金合同中关于利润分配的相关规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管建信收益增强债券型证券投资基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》、《建信收益增强债券型证券投资基金托管协议》的约定,对建信收益增强债券型证券投资基金管理人—建信基金管理有限责任公司2013年1月1日至2013年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司在建信收益增强债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的建信收益增强债券型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配 [illegible]

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

孙志晨 何斌 秦绪华

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信收益增强债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2009]第281号《关于核准建信收益增强债券型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集7,962,663,348.06元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第107号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》于2009年6月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为7,964,474,021.08份基金份额,其中认购资金利息折合1,810,673.02份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》和《建信收益增强债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购、申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用的,称为A类基金份额;不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为公司债、国债、金融债、企业债、可转换债券(含可分离式)、中央银行票据、资产支持证券、债券回购、股票、权证以及中国证监会批准的允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%,其中,本基金持有公司债、金融债、企业债、资产支持证券等除国债、中央银行票据以外的固定收益类资产的比例不低于债券资产的30%,本基金投资于股票(含一级市场新股申购)等权益类品种的比例为基金资产的0%-20%,现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为中债企业债总指数X30%+中债国债总指数X70%。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于2014年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期内所采用的会计政策、会计估计和最近一年年度报告一致。

7.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金管理人的股东、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,542,918.06	6,224,639.15
其中:支付销售机构的客户维护费	641,381.96	1,010,785.85

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002065	东华软件	220,000	7,436,000.00	1.89
2	002437	誉衡药业	101,250	4,262,625.00	1.09
3	000860	顺鑫农业	249,983	3,839,738.88	0.98

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于公司网站www.ccbfund.cn的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600886	国投电力	26,180,280.92	1.75
2	600329	中新药业	26,017,360.76	1.73
3	600863	内蒙华电	25,675,954.10	1.71
4	000540	中天城投	22,635,354.45	1.51
5	600795	国电电力	22,312,122.21	1.49
6	600161	天坛生物	20,116,331.11	1.34
7	601989	中国重工	19,270,000.00	1.28
8	600261	阳光照明	16,974,168.18	1.13
9	002255	海陆重工	16,350,001.69	1.09
10	002410	广联达	16,162,129.60	1.08
11	002065	东华软件	16,063,500.68	1.07
12	600585	海螺水泥	15,065,021.57	1.00
13	600383	金地集团	14,702,382.92	0.98
14	002550	千红制药	14,605,065.50	0.97
15	600030	中信证券	14,342,011.25	0.96
16	600855	航天长峰	13,660,205.73	0.91
17	600801	华新水泥	13,260,165.23	0.88
18	600521	华海药业	12,838,955.34	0.86
19	601318	中国平安	12,480,996.49	0.83
20	002296	辉煌科技	12,337,710.81	0.82

注:上述买入金额为买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300006	莱美药业	32,402,087.32	2.16
2	601628	中国人寿	31,267,430.52	2.08
3	600329	中新药业	26,380,564.88	1.76
4	600886	国投电力	25,817,352.04	1.72
5	000540	中天城投	22,365,921.49	1.49
6	600863	内蒙华电	21,283,485.53	1.42
7	601989	中国重工	20,357,042.87	1.36
8	600161	天坛生物	19,521,801.29	1.30
9	600795	国电电力	18,396,495.34	1.23
10	600521	华海药业	18,036,895.61	1.20
11	002255	海陆重工	17,939,976.01	1.20
12	300074	华平股份	17,819,657.22	1.19
13	002550	千红制药	17,738,486.05	1.18
14	002410	广联达	17,060,025.69	1.14
15	600261	阳光照明	15,466,156.79	1.03
16	600108	亚盛集团	14,125,742.76	0.94
17	600855	航天长峰	14,032,464.44	0.94
18	600030	中信证券	13,468,043.88	0.90
19	600585	海螺水泥	12,730,783.12	0.85
20	600383	金地集团	12,438,916.13	0.83

注:上述卖出金额为卖出成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	696,500,690.16
卖出股票收入(成交)总额	799,659,548.41

注:上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	47,892,000.00	12.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	38,196,000.00	9.73
	其中:政策性金融债	38,196,000.00	9.73
4	企业债券	214,846,258.80	54.74
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	76,553,000.00	19.51
7	可转债	3,620,028.80	0.92
8	其他	-	-
9	合计	381,107,287.60	97.10

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1280418	12张公资债	300,000	28,881,000.00	7.36
2	1280386	12绍城投债	300,000	28,791,000.00	7.34
3	1282505	12凯得MTN1	300,000	28,527,000.00	7.27
4	1180177	11国网债01	300,000	28,272,000.00	7.20
5	1280017	12中石油03	300,000	28,227,000.00	7.19

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期末未投资于国债期货。

建信基金管理有限责任公司
2014年3月27日