建信纯债债券型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014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:2014年4月22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2014年4月18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2014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
交易代码	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	660,664,216.34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	162,347,260.07份	498,316,956.27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（2014年1月1日－2014年3月31日）	
	建信纯债债券A	建信纯债债券C
1.本期已实现收益	-4,416,152.87	-16,269,971.11
2.本期利润	2,422,129.50	8,924,719.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0131	0.0139
4.期末基金资产净值	159,406,773.92	486,614,761.80
5.期末基金份额净值	0.982	0.977

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

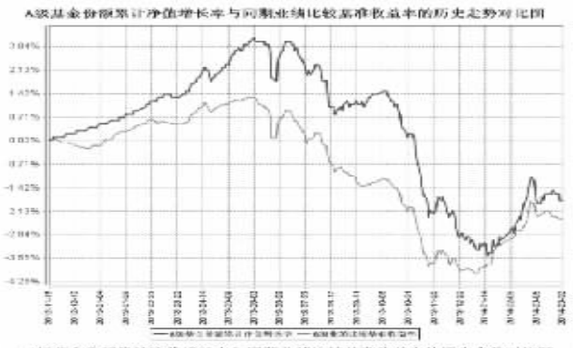
建信纯债债券A

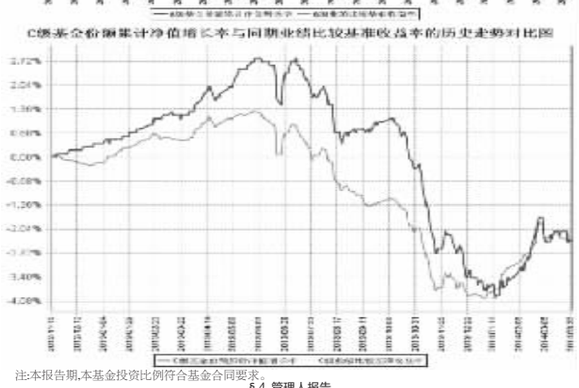
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.34%	0.15%	1.62%	0.08%	-0.28%	0.07%

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	1.35%	0.15%	1.62%	0.08%	-0.27%	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	本基金的基金经理	2012年11月15日	2014年3月6日	6	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日至2014年3月6日任建信纯债债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日至2014年3月27日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日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金经理;2013年12月10日起任建信稳定添利债券型证券投资基金基金经理。
黎颖芳	本基金的基金经理	2012年11月15日	-	13	硕士。2000年7月毕业于湖南大学金融保险学院,同年进入大成基金管理公司,在金融工程部、规划发展部任职,2005年11月加入本公司研究部,历任研究员、高级研究员、基金经理助理。2009年2月19日至2011年5月11日任建信稳定增利债券型证券投资基金基金经理;2011年01月18日至2014年1月22日任建信保本混合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。

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《建信纯债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》、《证券投资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季度中国宏观经济景气度低于预期,缘自去年下半年以来中性偏紧的货币政策和系列防控金融风险举措已在对经济增长的总需求产生了向下的压力。针对走弱的经济数据,央行在春节过后对金融环境进行了适度放松,表现为货币市场利率的下降和人民币汇率的小幅贬值。同时政府层面稳增长和微刺激的呼声也开始出现。

1季度债券市场无风险收益率曲线走势为陡峭化下行,银行间7天回购加权利率较上季度末下行近150bp,10年期国债下行5bp。信用风险的零星爆发导致低评级债券的信用利差有所加大,流动性进一步走弱。高等级兼具政府背景的低久期债券受到市场追捧。

本基金组合以中高等级债券为主,在一季度保持了与基准相当的久期。但部分利率债在3月份未能获利了结加上组合有一定赎回,导致组合收益低于基准收益。

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1.34%,波动率0.15%,建信纯债C净值增长率1.35%,波动率0.15%;业绩比较基准收益率1.62%,波动率0.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从社会融资总量和PMI等先行指标看,2季度国内经济走势难以趋势性转强,偏低的货币市场利率或将持续,有利于金融机构杠杆的维系和控制系统风险。同时在财政政策微调和融资回暖的带动下,经济进一步走弱的可能性也将减缓。我们判断债券市场无风险收益率曲线或将维持稳定,一方面信用风险偏好已有所降低,影子银行的活动较去年有所收敛,对资金面的冲击将减缓,另一方面市场对稳增长已有所预期,长端利率大幅下行的空间也有限。

本基金将维持相对中高等级的债券组合,同时灵活管理久期,力争为投资者获得稳健收益。

§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	固定收益投资	1,179,253,557.62	94.86
	其中:债券	1,179,253,557.62	94.86
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	16,156,270.54	1.30
7	其他资产	47,684,202.99	3.84
8	合计	1,243,094,031.15	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

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

无。

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	18,698,000.00	2.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	131,365,000.00	20.33
	其中:政策性金融债	131,365,000.00	20.33
4	企业债券	895,558,557.62	138.63
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	133,632,000.00	20.69
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,179,253,557.62	182.54

5.5 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	124153	13国网01	800,000	80,718,200.55	12.49
2	124118	12晋兴中	700,000	71,003,527.68	10.99
3	122809	11准国资	660,090	64,820,838.00	10.03
4	122212	12京江河	569,210	54,359,555.00	8.41
5	140205	14国开05	500,000	50,985,000.00	7.89

5.6 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资产支持证券投资明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

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

无。

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	48,530.18
2	应收证券清算款	22,446,437.94
3	应收股利	-
4	应收利息	25,061,442.80
5	应收申购款	127,792.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,684,202.99

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§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
报告期期初基金份额总额	214,115,198.79	745,580,084.73
报告期期间基金总申购份额	3,773,785.18	132,623,383.87
减:报告期期间基金总赎回份额	55,541,723.90	379,886,512.33
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	162,347,260.07	498,316,956.27

注: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基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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。

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
2014年4月22日

建信社会责任股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014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:2014年4月22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2014年4月18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2014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	37,887,057.42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,本基金在长期价值投资理念的基础上,坚持社会责任投资,重点考察企业社会责任的履行,立足企业基本面,努力实现本基金的投资目标。
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,一般情况下其风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。
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

§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（2014年1月1日－2014年3月31日）
1.本期已实现收益	1,886,230.46
2.本期利润	-214,601.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0062
4.期末基金资产净值	45,953,433.92
5.期末基金份额净值	1.213

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。

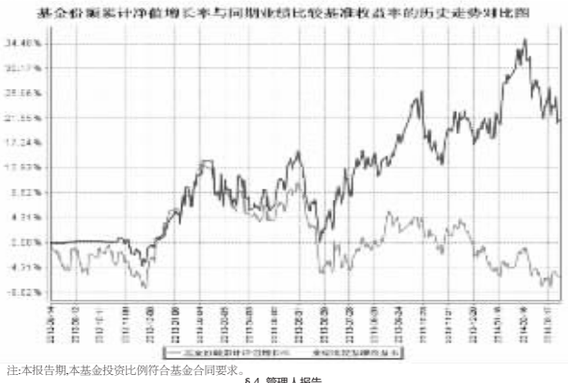
2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.41%	1.34%	-5.33%	0.89%	5.74%	0.45%

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		
姚锦	本基金的基金经理	2012年8月14日	2014年3月6日	9	博士。曾任天津通广三星电子有限公司工程师,天弘基金管理公司研究员、研究部副主管、研究部主管、投资部副总经理兼研究总监等职;2009年3月17日至2011年3月3日担任天弘永利债券型证券投资基金基金经理;2009年12月17日至2011年5月5日任天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理。现任我公司研究部首席策略分析师。2012年2月17日起任建信优选成长股票型证券投资基金基金经理,2012年8月14日至2014年3月6日任建信社会责任股票型证券投资基金基金经理;2014年1月20日起任建信保本基金的基金经理,该基金于1月23日起转型为建信积极配置混合型证券投资基金,姚锦继续担任该基金的基金经理。
许杰	本基金的基金经理	2012年8月14日	-	11	硕士,特许金融分析师（CFA）。曾任青岛市纺织品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员,2002年3月加入泰达宏利基金管理有限公司,历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职;2006年12月23日至2011年9月30日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理,2010年2月8日至2011年9月30日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理,2008年9月26日至2011年9月30日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011年10月加入我公司,2012年3月21日起任建信恒稳价值混合型证券投资基金基金经理,2012年8月14日起任建信社会责任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

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《建信社会责任股票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》、《证券投资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

行业配置和个股选择方面:主要持有了空间大、进入壁垒高且景气度处于快速上升阶段的行业中具有护城河的企业。本季度重点持有的LED、软件、医药等行业的股票对组合贡献较大。但是组合中部分带有周期性质的个股出现一定的下跌,对组合带来了负贡献。

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0.41%,波动率1.34%,业绩比较基准收益率-5.33%,波动率0.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年是经济转型年。中国上一个趋势性上升周期是从2001年到2010 年以重化工业为代表的阶段,以房地产行业为主导产业,以汽车大宗消费、基础设施建设等为重要推动力,实现了经济的高速增长。但是,正如李克强总理在今年的政府工作报告中所说,我国支撑发展的要素条件在发生深刻变化,深层次矛盾凸显,正处于结构调整阵痛期、增长速度换挡期。回顾1998到2001年期间,我国经济也经历了几年的低谷期,期间通过强力改革和结构调整,终于使经济重新走上一轮高速增长期。同样,我国政府目前也正在推行强力改革,也正在努力推进经济结构的转型。我国经济维持相对高速增长的潜力仍然存在,在经历一段时期的调整后,中国经济会重新走上快速发展之路。

从日本等国的发展经验来看,后工业化时代引领经济发展的是创新和服务。从这些国家的股市表现来看,创新和服务类的股票也战胜了市场。同样可以预期,在经济调整期及之后,创新和服务也会成为推动中国经济发展的最重要的动力。中国经济上一个十年最大的驱动力来自于人民住(房地产)和行(汽车)的需求,而未来经济发展的驱动力则来自于效率改善的创新和生活质量改善的服务。正如在2001年以后十年的重化工业时代,船舶制造、有色、煤炭、钢铁等行业是股市表现最好的行业,预期创新和服务类的行业未来从长期来看也会成为股市上涨的领头羊。社会责任基金将重点关注这些行业,例如创新类的新能源、节能环保、软件、电子、工业自动化等行业,服务类的医药、医疗、教育、文化等行业。社会责任基金也会关注周期类公司估值修复的行情。在经济下滑比较严重的背景下,政府出台稳增长措施,可能会带来的低估值的周期股阶段性的机会。

经历了2013年一年的大幅上涨后,大部分成长类公司的估值处于较高的位置,而IPO重新开闸后股票的供给也大幅上升,因此今年挑选股票更具有挑战性。社会责任基金将精挑细选,重点持有那些能够持续超预期的公司。

§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	34,785,106.23	74.13
	其中:股票	34,785,106.23	74.13
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	12,016,656.95	25.61
7	其他资产	121,974.18	0.26
8	合计	46,923,737.36	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	1,147,440.00	2.50
C	制造业	25,893,831.05	56.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	557,700.00	1.21
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,132,200.00	2.46
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,009,984.18	8.73
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	1,410,381.00	3.07
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	633,570.00	1.38
S	综合	-	-
	合计	34,785,106.23	75.70

注:以上行业分类以2014年3月31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	000541	佛山照明	229,000	2,367,860.00	5.15
2	002437	誉衡药业	40,500	2,157,030.00	4.69
3	002065	东华软件	45,053	1,818,339.08	3.96
4	600089	特变电工	181,763	1,637,684.63	3.56
5	600690	青岛海尔	88,674	1,440,065.76	3.13
6	300070	碧水源	42,700	1,410,381.00	3.07
7	000581	威孚高科	59,338	1,358,840.20	2.96
8	300296	利亚德	53,000	1,325,000.00	2.88
9	600580	卧龙电气	175,000	1,270,500.00	2.76
10	603000	人民网	17,500	1,225,000.00	2.67

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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债券投资明细

无。

5.6 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资产支持证券投资明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	65,712.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,706.94
5	应收申购款	53,554.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,974.18

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	39,383,545.09
报告期期间基金总申购份额	16,835,645.56
减:报告期期间基金总赎回份额	18,332,133.23
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	37,887,057.42

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基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§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社会责任股票型证券投资基金设立的文件;

2、《建信社会责任股票型证券投资基金基金合同》;

3、《建信社会责任股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信社会责任股票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
2014年4月22日

建信双周安心理财债券型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014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:2014年4月22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2014年4月18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2014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
基金主代码	530014
交易代码	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	1,448,559,928.95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A	建信双周理财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	1,246,022,703.93份	202,537,225.02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（2014年1月1日－2014年3月31日）	
	建信双周理财A	建信双周理财B
1. 本期已实现收益	19,408,972.54	5,091,384.60
2.本期利润	19,408,972.54	5,091,384.60
3.期末基金资产净值	1,246,022,703.93	202,537,225.02

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损益,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

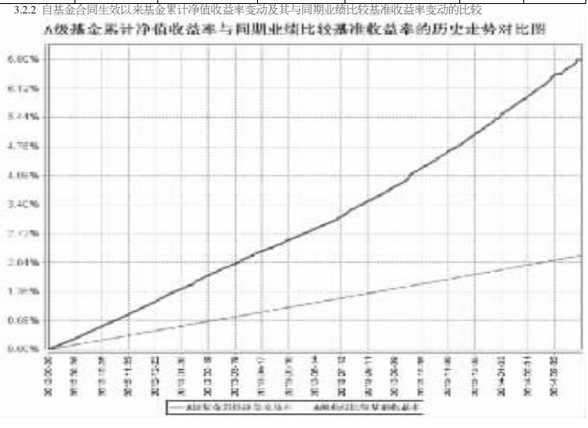
建信双周理财A

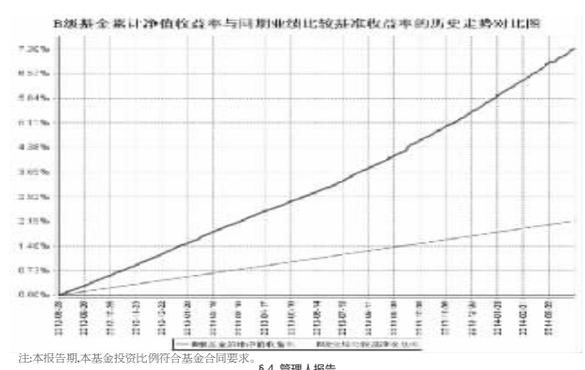
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.3113%	0.0079%	0.3381%	0.0000%	0.9732%	0.0079%

建信双周理财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	1.3839%	0.0079%	0.3381%	0.0000%	1.0458%	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





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		
于倩倩	本基金的基金经理	2014年1月21日	-	5	于倩倩女士,硕士。2008年6月加入国泰人寿保险公司,任固定收益研究专员;2009年9月加入金元惠理基金管理公司（原金元比联基金管理公司）,任债券研究员;2011年6月加入我公司,历任债券研究员、基金经理助理,2013年8月5日起任建信货币市场基金基金经理;2014年1月21日起任建信双周安心理财债券基金的基金经理。
高珊	本基金的基金经理	2012年8月28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;2013年12月20日起任建信货币市场基金基金经理。
朱建华	本基金的基金经理	2012年8月28日	-	6	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日至2014年3月6日任建信纯债债券型证券投资基金基金经理;2012年12月20日至2014年3月27日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日起任建信安心回报定期开放债券型证券投资基金基金经理;2013年12月10