

## 建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

### 2014 第二季度 报告

2014年6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:招商银行股份有限公司**  
**报告送出日期:2014年7月19日**

#### 1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金服务机构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。  
基金管理人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年7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,也不保证基金资产不受损失。  
基金的过往业绩并不预示其未来业绩,投资有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告自2014年4月1日起至6月30日止。

#### 5.2 基金产品概况

基金名称	建信双利策略主题分级股票型证券投资基金		
基金代码	65310	基金简称	建信双利
交易代码	65310	基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月16日	基金合同期限	不定期
报告期末基金份额总额	567,803,543.00份	报告期末基金份额持有人户数	20,111户
投资目标	本基金采用定期定额投资与个股精选相结合的投资方法,力争在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,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	本基金通过自上而下的方式,通过对经济发展过程中周期性、结构性或阶段性特征的分析和判断,深入挖掘具有中长期增长潜力的行业及个股,并在此基础上进行资产配置,力求在有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值,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。		
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:90%×沪深300指数收益率+10%×中证500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,风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金、混合型基金和货币型基金,本基金的风险收益特征属于股票型基金中的中高风险品种,其风险和预期收益要高于普通股票型基金。		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
下属一级基金的基金简称	建信双利	建信转债	建信红利
下属一级基金的基金代码	65310	150006	150007
报告期末下属一级基金的基金份额总额	559,967,981.89份	3,134,224.00份	4,301,338.00份

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	475,661,147.12	92.60
2	其中:股票	475,661,147.12	92.60
3	其中:债券	-	-
4	其中:资产支持证券	-	-
5	其中:贵金属投资	-	-
6	其中:买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入回购的质押式股票质押资产	-	-
8	其中:银行存款和拆出资金	3,232,392.50	0.63
9	其中:应收股利	1,316,664.37	0.26
10	其中:其他资产	1,316,664.37	0.26
11	负债	-	-
12	其中:应付账款	-	-
13	其中:应付利息	-	-
14	其中:应付股利	-	-
15	其中:其他负债	-	-
16	所有者权益	478,897,541.49	93.37
17	其中:实收资本	478,897,541.49	93.37
18	其中:未分配利润	-	-
19	其中:其他所有者权益	-	-
20	其中:其他综合收益	-	-
21	其中:其他	-	-
22	合计	478,897,541.49	93.37

注:以上行业分类以2014年6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	601318	中国平安	415,069	16,328,814.66	3.32
2	600571	华谊兄弟	569,571	15,020,866.78	3.14
3	000998	中信证券	564,583	15,514,792.80	3.18
4	601166	兴业银行	1,514,382	15,180,251.46	3.09
5	002714	双环新材	334,528	14,735,958.60	3.01
6	000022	万科A	1,127,460	14,236,094.20	2.89
7	000011	平安银行	1,434,236	14,114,436.42	2.86
8	001111	威远生化	786,720	11,997,466.00	2.38
9	600511	国药股份	514,614	11,681,737.80	2.30
10	600051	浦发银行	1,219,924	11,380,900.00	2.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.12 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.13 其他资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.22 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.23 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.24 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.25 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.26 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.28 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.29 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.30 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.31 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.32 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.33 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.34 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.35 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.36 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.37 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.38 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.39 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.40 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.41 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.42 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.43 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.44 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.45 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.46 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.47 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.48 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.49 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.50 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.51 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.52 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.53 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.54 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.55 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.56 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.57 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.58 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.59 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.60 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.61 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.62 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.63 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.64 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.65 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.66 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.67 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.68 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.69 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.70 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.71 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.72 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.73 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.74 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.75 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.76 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.77 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.78 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.79 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.80 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.81 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.82 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.83 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.84 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.85 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.86 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.87 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.88 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.89 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.90 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.91 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.92 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.93 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.94 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.95 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.96 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.97 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.98 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.99 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.100 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.101 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.102 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.103 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.104 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.105 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.106 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.107 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.108 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.109 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.110 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.111 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.112 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.113 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.114 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.115 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.116 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.117 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.118 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.119 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.120 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.121 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.122 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.123 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.124 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.125 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.126 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.127 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.128 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.129 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.130 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.131 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.132 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.133 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.134 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.135 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.136 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.137 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.138 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.139 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.140 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.141 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.142 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.143 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.144 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.145 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.146 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.147 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.148 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.149 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.150 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.151 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.152 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.153 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.154 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.155 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.156 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.157 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.158 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.159 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.160 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.161 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.162 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.163 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.164 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.165 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.166 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.167 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.168 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.169 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.170 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.171 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.172 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.173 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明