# 建信双债增强债券型证券投资基金

## 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:中信银行股份有限公司**
**报告送出日期:2014年7月19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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,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。

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4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 建信双债增强债券 | |
| 基金主代码 | 000207 | |
| 交易代码 | 000207 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013年7月25日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 459,966,725.87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较高的当期收入和总回报。 | |
| 投资策略 | 本基金主要通过采取债券类属配置策略、信用债投资策略、可转债投资策略等投资策略以实现投资目标。 | |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为: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 | 中信银行股份有限公司 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 建信双债增强债券A | 建信双债增强债券C |
| 下属两级基金的交易代码 | 000207 | 000208 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 278,854,609.20份 | 181,112,116.67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4月1日 - 2014年6月30日) | |
|---|---|---|
| | 建信双债增强债券A | 建信双债增强债券C |
| 1.本期已实现收益 | 6,472,005.63 | 4,219,412.40 |
| 2.本期利润 | 10,031,129.58 | 6,452,932.10 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0313 | 0.0300 |
| 4.期末基金资产净值 | 294,795,094.15 | 190,737,152.55 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.057 | 1.053 |

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

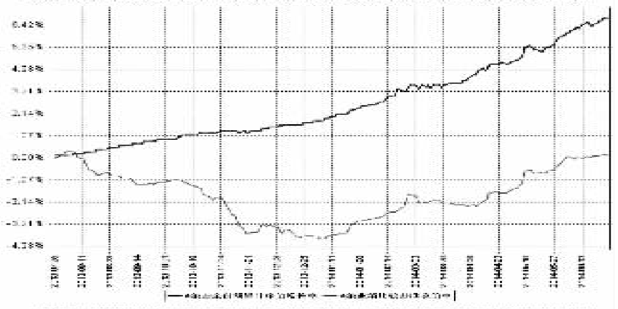
建信双债增强债券A

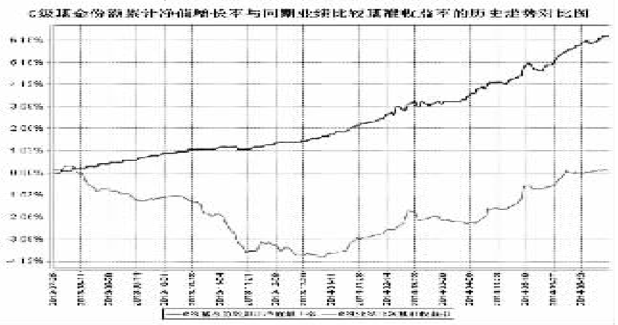
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 3.02% | 0.08% | 2.42% | 0.09% | 0.60% | -0.01% |

建信双债增强债券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 | 2.93% | 0.08% | 2.42% | 0.09% | 0.51% | -0.01% |

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7月25日生效,截至报告期末未满一年。

2、本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债和公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可转债(含分离交易可转债)、债券回购、银行存款以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可参与一级市场新股申购或增发,持有因可转债转股所形成的股票或分离交易可转债分离交易的权证等资产。因上述原因持有的股票和权证等资产,基金将在其可交易之日起的10个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种(如国债期货),基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中投资于信用债和可转债的比例合计不低于非现金基金资产的80%;基金持有的现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

3、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 | | |
| 彭云峰 | 本基金的基金经理 | 2013年7月25日 | - | 8 | 硕士。曾任中经网数据有限公司财经分析师、国都证券有限责任公司债券研究员兼宏观研究员,2006年5月起就职于鹏华基金管理公司,历任债券研究员、社保组合投资经理、债券基金经理等职,2010年5月31日至2011年6月14日任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理。彭云峰于2011年6月加入本公司,2011年11月30日至2013年5月3日任建信保本混合型证券投资基金基金经理;2012年2月17日至2014年1月21日任建信货币市场基金基金经理;2012年5月29日起任建信转债增强债券型证券投资基金基金经理;2013年7月25日起任建信双债增强债券型证券投资基金基金经理;2013年11月5日起任建信安心回报两年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

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《建信双债增强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

2014年二季度,中国经济形势相对平稳。与一季度相比,4-5月投资增速下滑,工业增加值增速变化不大,消费和出口增速提高。CPI增速4月大幅下行,5月回升,总体处于较低水平。尽管二季度外汇占款规模有所下降,但央行在公开市场持续投放资金,同时实施了定向降准和再贷款等政策,因而二季度资金面比较宽松,6月中下旬也相对平稳,资金利率没有大幅波动。

由于经济增速相对平稳,通胀水平较低,货币政策相对宽松,4月和5月各期限、各品种债券收益率均大幅下行,6月收益率小幅波动。总体而言,二季度债券市场表现较好。从不同类别来看,中长期债券表现好于短期债券,信用债好于利率债,城投债好于产业债。二季度可转债市场表现较好。

2014年二季度,本基金适当增加了债券投资比例,积极投资信用债,以交易所品种为主。4-5月本基金可转债投资比例相对较高,6月适当减持了部分股性较强的可转债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期双债增强A净值增长率3.02%,波动率0.08%,双债增强C净值增长率2.93%,波动率0.08%;业绩比较基准收益率2.42%,波动率0.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于稳增长的微刺激政策密集推出,货币政策和财政政策都适当放松,美国等发达经济体经济形势好转,我们对三季度中国经济增长形势比较乐观,三季度经济增速可能相对平稳,通胀水平保持在较低水平。我们预计三季度货币政策可能相对中性,大幅宽松的概率不大。原因是过于宽松的货币政策不利于中国经济转型升级,而且三季度货币供应量增速可能较高。

基于以上判断,我们对三季度债券市场谨慎乐观,预计收益率进一步下行的空间不大。我们认为三季度中短期债券的表现可能较好,中高等级信用债的表现可能好于利率债。由于经济形势可能好转,股票市场估值相对合理,我们对三季度股票市场相对乐观。目前可转债整体股性较强,如果股市向好,可转债市场也会表现良好。

2014年三季度,本基金将谨慎投资,稳中求进。本基金将在保持流动性的基础上,适度提高债券组合久期。主要投资中短期信用债,继续提高交易所信用债的投资比例。在确定性较强的情况下,积极投资可转债,精选品种,灵活操作。我们将密切关注债券市场、宏观经济形势,以及政策动态,积极调整投资组合。在控制风险的基础上,力争获取更多投资收益。

### §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 | 716,041,129.20 | 85.91 |
| | 其中:债券 | 716,041,129.20 | 85.91 |
| | 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 | 20,000,150.00 | 2.40 |
| | 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 | 70,510,697.85 | 8.46 |
| 7 | 其他资产 | 26,973,388.93 | 3.24 |
| 8 | 合计 | 833,525,365.98 | 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 80,003,000.00 | 16.48 |
| | 其中:政策性金融债 | 80,003,000.00 | 16.48 |
| 4 | 企业债券 | 326,235,711.60 | 67.19 |
| 5 | 企业短期融资券 | 232,102,000.00 | 47.80 |
| 6 | 中期票据 | 50,466,000.00 | 10.39 |
| 7 | 可转债 | 27,234,417.60 | 5.61 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 716,041,129.20 | 147.48 |

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 | 126018 | 08江铜债 | 740,490 | 67,828,884.00 | 13.97 |
| 2 | 041361053 | 13首发CP001 | 500,000 | 50,525,000.00 | 10.41 |
| 3 | 122290 | 13包钢01 | 415,000 | 41,666,000.00 | 8.58 |
| 4 | 100236 | 10国开36 | 400,000 | 40,088,000.00 | 8.26 |
| 5 | 122186 | 12力帆02 | 327,840 | 32,816,784.00 | 6.76 |

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 | 83,206.95 |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,831,285.73 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 15,045,134.35 |
| 5 | 应收申购款 | 1,013,761.90 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 26,973,388.93 |

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 | 110020 | 南山转债 | 16,198,617.60 | 3.34 |
| 2 | 113002 | 工行转债 | 7,905,000.00 | 1.63 |
| 3 | 110018 | 国电转债 | 3,130,800.00 | 0.64 |

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 | 建信双债增强债券A | 建信双债增强债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 369,592,041.09 | 242,096,869.96 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 38,496,101.45 | 28,791,188.15 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 129,233,533.34 | 89,775,941.44 |
| 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 | 278,854,609.20 | 181,112,116.67 |

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双债增强债券型证券投资基金设立的文件;
2、《建信双债增强债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信双债增强债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信双债增强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7月19日**

---

# 建信稳定添利债券型证券投资基金

## 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:中国农业银行股份有限公司**
**报告送出日期:2014年7月19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。

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4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 建信稳定添利债券 |
| 基金主代码 | 000435 |
| 交易代码 | 000435 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年12月10日 |
| 报告期末基金份额总额 | 81,650,007.94份 |
| 投资目标 | 通过积极主动的投资组合管理为投资人创造较高的当期收入和总回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金主要通过采取自上而下的定性分析和定量分析确定大类属配置策略,结合久期管理和信用风险管理的投资策略构建债券投资组合。同时在固定收益资产所提供的稳健收益基础上,适当进行股票投资,本基金的股票投资作为债券投资的辅助和补充,以本金安全为最重要因素。 |
| 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4月1日 - 2014年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 210,010.22 |
| 2.本期利润 | 4,211,281.68 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0421 |
| 4.期末基金资产净值 | 85,979,063.38 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.053 |

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。

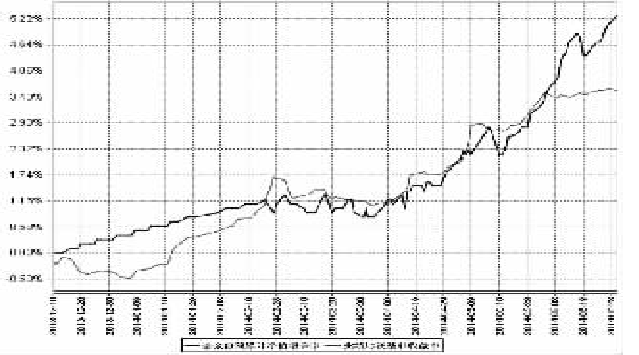
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 4.46% | 0.17% | 2.42% | 0.09% | 2.04% | 0.08% |

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、本基金合同于2013年12月10日生效,截止报告期末未满一年。

2、本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的80%;投资于权益类资产的比例不高于基金资产的20%;基金持有的现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

3、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 | | |
| 朱建华 | 本基金的基金经理 | 2013年12月10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。 |

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《建信稳定添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

二季度,国内宏观形式严峻,主要经济数据增幅低于预期,保增长压力加大。为配合增长目标,央行的货币政策也从年初的中性开始转向偏宽松,定向降准、再贷款等一些列数量型政策的出台为银行间市场注入资金,资金面整体宽松,去年的"钱荒"未再现,加上127号文对同业非标的控制,债券市场做多热情较高,不仅短端收益率受资金面的影响出现下行,长端的吸引力明显增加,收益率也出现较大下行,信用息差出现缩窄。全市场呈现加杠杆与加久期的趋势。但目前银行整体资金成本仍明显高于历史平均水平,随着收益率的下行,利率债的短期风险也相应上升。

本季度,建信稳定添利债券型基金完成产品建仓,债券方面顺应市场增加了相应杠杆率与久期,由于规模赎回较多,为应付流动性风险增加了交易所债券比例并配以部分银行间信用债。同时也适当增加了转债的比例。虽然部分权益资产的波动对净值造成一定损失,但债券的上涨总体上带动基金净值的上升。

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4.46%,波动率0.17%,业绩比较基准收益率2.42%,波动率0.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们认为国内经济仍面临较大压力,保增长的措施仍将持续,后续刺激政策的出台仍可期。货币政策方面,由于通胀还不到抬头之时,因此在目前的经济形式下央行的货币政策不会转向,仍将维持中性偏宽松的手段。但由于三季度面临财政存款上缴等诸多不利因素,除非央行公开市场明显大幅投放,否则资金面难言二季度的宽松,不排除资金面季度中出现波段性的紧张。信用风险方面,虽然风险事件的暴露市场上已经有相应预期,但风险事件的冲击仍有可能出现,对个券的甄别显得尤为重要。权益方面,市场的仍处于震荡期,缺乏明显的趋势性机会,仓位不易过重。

建信稳定添利债券型基金将保持稳健的投资风格,债券方面追求绝对收益,并适当降低久期,做好防御。权益方面我们将结合市场实际情况,争取把握波段操作的机会,轻大盘重个股。

### §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 | 3,899,330.00 | 2.45 |
| | 其中:股票 | 3,899,330.00 | 2.45 |
| 2 | 固定收益投资 | 148,014,591.00 | 93.09 |
| | 其中:债券 | 148,014,591.00 | 93.09 |
| | 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 | 2,001,545.82 | 1.26 |
| 7 | 其他资产 | 5,084,228.06 | 3.20 |
| 8 | 合计 | 158,999,694.88 | 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 | 1,374,000.00 | 1.60 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,519,230.00 | 2.93 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 6,100.00 | 0.01 |
| 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 | - | - |
| 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 | 3,899,330.00 | 4.54 |

注:以上行业分类以2014年6月30日的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 | 600352 | 浙江龙盛 | 90,000 | 1,453,500.00 | 1.69 |
| 2 | 000998 | 隆平高科 | 50,000 | 1,374,000.00 | 1.60 |
| 3 | 002117 | 东港股份 | 40,000 | 692,000.00 | 0.80 |
| 4 | 600499 | 科达洁能 | 20,000 | 356,800.00 | 0.41 |
| 5 | 603369 | 今世缘 | 1,000 | 16,930.00 | 0.02 |
| 6 | 002727 | 一心堂 | 500 | 6,100.00 | 0.01 |

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 | 10,000,000.00 | 11.63 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 91,927,119.00 | 106.92 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,330,000.00 | 35.28 |
| 6 | 中期票据 | 10,358,000.00 | 12.05 |
| 7 | 可转债 | 5,399,472.00 | 6.28 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 148,014,591.00 | 172.15 |

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 | 041359065 | 13富春江CP001 | 300,000 | 30,330,000.00 | 35.28 |
| 2 | 112198 | 14欧菲债 | 199,990 | 20,398,980.00 | 23.73 |
| 3 | 122290 | 13包钢01 | 150,060 | 15,066,024.00 | 17.52 |
| 4 | 122186 | 12力帆02 | 140,150 | 14,029,015.00 | 16.32 |
| 5 | 122276 | 13魏桥01 | 117,000 | 11,700,000.00 | 13.61 |

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 | 12,130.76 |
| 2 | 应收证券清算款 | 999,518.19 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,072,579.11 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,084,228.06 |

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 | 110020 | 南山转债 | 4,752,000.00 | 5.53 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 603369 | 今世缘 | 16,930.00 | 0.02 | 新股锁定 |
| 2 | 002727 | 一心堂 | 6,100.00 | 0.01 | 新股锁定 |

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 130,272,282.39 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 10,577,354.35 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 59,199,628.80 |
| 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 | 81,650,007.94 |

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

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 19,820,614.47 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 19,820,614.47 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 24.28 |

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稳定添利债券型证券投资基金设立的文件;
2、《建信稳定添利债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信稳定添利债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信稳定添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**
**2014年7月19日**

---

# 建信双周安心理财债券型证券投资基金

## 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:中国工商银行股份有限公司**
**报告送出日期:2014年7月19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。

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4月1日起至6月30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 | 1,783,639,869.39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 | 1,096,438,306.57份 | 687,201,562.82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4月1日 - 2014年6月30日) | |
|---|---|---|
| | 建信双周理财A | 建信双周理财B |
| 1. 本期已实现收益 | 13,578,221.18 | 7,271,797.03 |
| 2.本期利润 | 13,578,221.18 | 7,271,797.03 |
| 3.期末基金资产净值 | 1,096,438,306.57 | 687,201,562.82 |

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入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

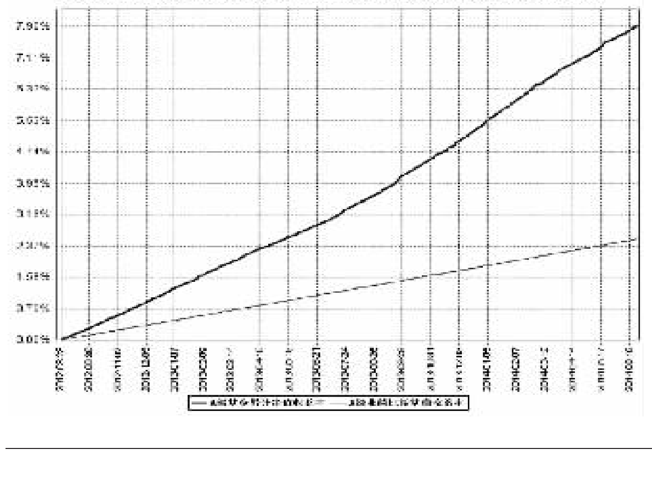
建信双周理财A

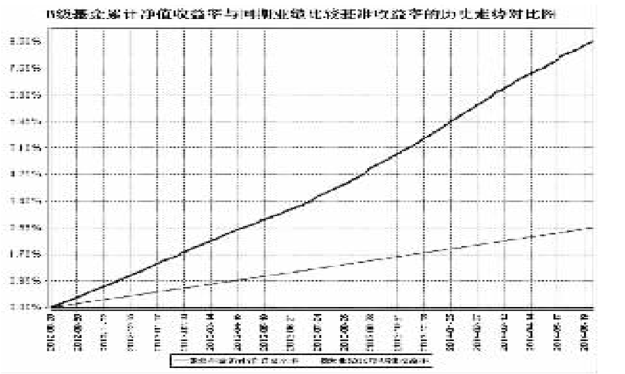
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.0555% | 0.0055% | 0.3418% | 0.0000% | 0.7137% | 0.0055% |

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 | 1.1287% | 0.0055% | 0.3418% | 0.0000% | 0.7869% | 0.0055% |

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 | - | 6 | 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;2014年6月17日起任建信嘉薪宝货币市场基金基金经理。 |
| 高珊 | 本基金的基金经理 | 2012年8月28日 | - | 8 | 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。 |

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《建信双周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

回顾2季度,应该说衰退式宽松的预期得到了充分的演绎;

从基本面而言,制造业和房地产双杀,新开工投资明显回落,稳增长口号下资金输送实体的进度却不达预期,基建投资显得枯木难支,在整体需求端下滑的预期下,生产端发电量增速、制造业景气度的低位改善仍未带来足够的企稳信心;

从政策面而言,有疏有堵,主动放松的意愿明显加强,以期进一步降低实体融资成本,堵的一面在于127号文对于非标投资的精细监控,这直接导致表外融资的快速萎缩,疏的一面在于央行更积极地"定向"资金出去,再贷款、定向降准等各种工具应声而出,基础货币的投放方式全面转向更为主动的时代,此外在央行常规的公开市场操作中,也能看到正回购缩量的迹象,整体政策层面传递的信号是比较积极的;

资金层面,降息降准预期发酵下,月末的季节效应明显消退,即使临近半年末,资金价格也主要反应在1个月左右的期限,幅度大约在100-200bp,中长期资金仍偏于宽松;

债券市场在以上多重因素的支撑下呈现出比较明显的牛市行情,金融债净价指数上涨2.62%,企业债净价指数上涨2.45%,6月后长端出现调整,行情从牛平过渡到牛陡,主要是降息降准预期已被反应,随着政策宽松预期被逐步兑现机构获利了结的心态居上;

本基金作为流动性管理产品,在保证应对2季末赎回压力的前提下,积极捕捉资金波动的时机,重点布局资金到下半年,在类属资产上,考虑到非标被打压后,同业存款利率吸引力下滑,债券收益优势凸显,我们重点增加了对债券资产的配置,同时进一步拉长了剩余期限的分布。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期双周理财A基金净值收益率1.0555%,波动率0.0055%,双周理财B基金净值收益率1.1287%,波动率0.0055%;业绩比较基准收益率0.3418%,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3季度,一些新的变化值得我们关注;

基本面经济而言,地产仍未见底基本是市场的共识,去年同期的增长基数相对较高也在预期中,但制造业库存调整可能呈现略微积极的变化,出口进一步改善的可能性在增加,此外,定向宽松的资金逐步落实下基建投资仍有拉升空间,因此,整体经济低位企稳的预期可能有所上升;

政策面而言,5-6月表内信贷开始超预期,在低基数的基础上7月可能迎来亮眼的M2,我们怀疑这在一定层面上是否会影响央行进一步宽松的意图,此外,7月初市场传言央票再度续发,虽然还没有看到正式的公告,但仍可能给市场带来相对混乱的信号;大的方向而言,显然目前的基本面环境仍难以支持政策方向的转向,但可能宽松的程度有不达预期的可能性;

资金层面关注2个纬度的变化,一是央行在公开市场操作上的风吹草动,二是资金流向实体的进度,前者主要是影响市场参与者的心理预期,后者可能带来的是挤出效应,一般而言,为保证后者进展流畅,前者要保持宽松的持续性,如果是这样,资金利率的反应应该会滞后1-2个季度,基于这样的判断,我们并不过分担心3季度的资金起伏;

债券市场在以上多重因素的影响下,可能继续上演陡峭化行情,长端可能面临一定的调整压力,短端暂时无忧;

本基金以流动性管理为第一要务,半年末时点过后,预计重新迎来资金回流,我们将坚持我们的判断,继续增加对半年内到期短券的配置,同时保持组合剩余期限在中等偏高的水平,争取为投资者继续实现稳定的收益。

### §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 | 1,384,310,961.98 | 67.44 |
| | 其中:债券 | 1,384,310,961.98 | 67.44 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 100,000,350.00 | 4.87 |
| | 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 | 521,051,887.67 | 25.38 |
| 4 | 其他资产 | 47,337,022.63 | 2.31 |
| 5 | 合计 | 2,052,700,222.28 | 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 | 7.91 | |
| | 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 | 226,129,566.93 | 12.68 |
| | 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

本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

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 | 109 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 111 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 73 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过134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134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 | 28.66 | 15.01 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | 6.18 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 34.24 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 22.00 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 21.36 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 112.43 | 15.01 |

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 | 330,228,043.31 | 18.51 |
| | 其中:政策性金融债 | 170,219,569.40 | 9.54 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,054,082,918.67 | 59.10 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 1,384,310,961.98 | 77.61 |
| 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序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 | 011424002 | 14中冶SCP002 | 800,000 | 79,987,027.99 | 4.48 |
| 2 | 041366015 | 13包钢CP001 | 600,000 | 60,068,452.56 | 3.37 |
| 3 | 041362029 | 13鲁宏桥CP001 | 600,000 | 60,061,853.20 | 3.37 |
| 4 | 071402005 | 14国泰君安CP005 | 600,000 | 60,013,470.06 | 3.36 |
| 5 | 041456003 | 14包钢集CP001 | 500,000 | 50,566,590.33 | 2.84 |
| 6 | 041361041 | 13希望六和CP001 | 500,000 | 50,365,860.23 | 2.82 |
| 7 | 041360055 | 13鲁晨鸣CP001 | 500,000 | 50,180,452.35 | 2.81 |
| 8 | 140204 | 14国开04 | 500,000 | 50,131,919.24 | 2.81 |
| 9 | 071409002 | 14中金CP002 | 500,000 | 50,004,395.21 | 2.80 |
| 10 | 041358093 | 13魏桥CP003 | 400,000 | 40,505,303.40 | 2.27 |

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 | 18 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.3066% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.1064% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.2125% |

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十名资产支持证券投资明细

无。

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 本基金投资的前十名债券发行主体本期未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 | 36,453,941.39 |
| 4 | 应收申购款 | 10,883,081.24 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 47,337,022.63 |

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 建信双周理财A | 建信双周理财B |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,246,022,703.93 | 202,537,225.02 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,840,749,334.86 | 1,917,081,902.66 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 1,990,333,732.22 | 1,432,417,564.86 |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,096,438,306.57 | 687,201,562.82 |

注:上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

### §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双周安心理财债券型证券投资基金设立的文件;
2、《建信双周安心理财债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信双周安心理财债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信双周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**
**2014年7月19日**