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
送出日期:2014年8月25日

建信纯债债券型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30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。本半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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月21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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。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6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信纯债债券	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	651,717,016.93份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	建信纯债债券A	建信纯债债券C
下属分级基金的交易代码:	530021	531021
报告期末下属分级基金的份额总额	117,036,435.92份	534,680,581.01份

2.2 基金产品说明

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。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	张建春
	联系电话	010-66228888	010-63639180
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95595
传真		010-66228001	010-63639132

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	建信纯债债券A	建信纯债债券C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日-2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日-2014年6月30日)
本期已实现收益	-1,877,242.37	-5,167,851.50
本期利润	8,418,269.53	30,833,491.99
加权平均基金份额本期利润	0.0520	0.0516
本期基金份额净值增长率	5.57%	5.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0064	-0.0127
期末基金资产净值	119,730,795.46	543,483,442.36
期末基金份额净值	1.023	1.016

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

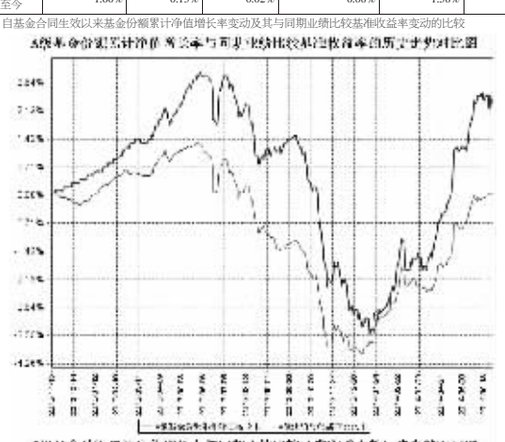
建信纯债债券A

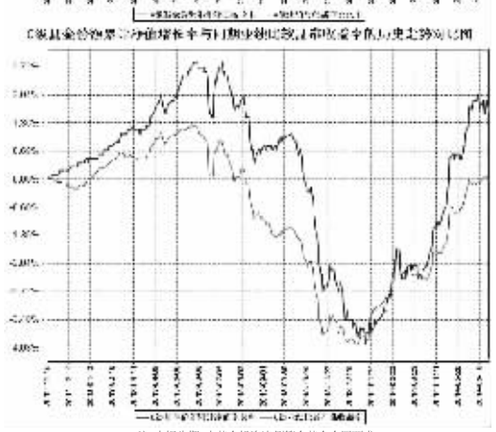
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.59%	0.16%	0.42%	0.07%	0.17%	0.09%
过去三个月	4.18%	0.13%	2.42%	0.09%	1.76%	0.04%
过去六个月	5.57%	0.14%	4.07%	0.08%	1.50%	0.06%
过去一年	-0.39%	0.14%	-0.65%	0.09%	0.26%	0.05%
自基金合同生效起至今	2.30%	0.13%	0.02%	0.08%	2.28%	0.05%

建信纯债债券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
过去一个月	0.49%	0.17%	0.42%	0.07%	0.07%	0.10%
过去三个月	3.99%	0.14%	2.42%	0.09%	1.57%	0.05%
过去六个月	5.39%	0.15%	4.07%	0.08%	1.32%	0.07%
过去一年	-0.78%	0.15%	-0.65%	0.09%	-0.13%	0.06%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.13%	0.02%	0.08%	1.58%	0.05%

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





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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准,建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日,注册资本2亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司,其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的65%,信安金融服务公司出资额占注册资本的25%,中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的10%。

公司下设综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部,以及深圳、成都、上海、北京四家分公司,设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持"诚信、专业、规范、创新"的核心价值观,恪守"持有人利益重于泰山"的原则,以"建设财富生活"为崇高使命,坚持规范运作,致力成为"最可信赖、持续领先的综合性、专业化资产管理公司"。

截至2014年6月30日,公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)、建信创新中国股票型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信中证500指数增强型证券投资基金、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金和建信货币市场基金,共计42只开放式基金,管理的基金净资产规模共计为551.21亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 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

上半年国内宏观经济和通胀低位运行,尤其1季度受去年下半年高融资利率、低融资增速影响经济下滑明显。2季度开始政府采取了系列稳增长的"微刺激"措施。包括定向降准支持中小企业、国开行再贷款安排、加快财政投放支持基础设施建设等,央行维持了货币市场资金宽松的局面,特别是在市场担忧钱荒的时段通过公开市场操作向市场注入了流动性。

上半年债券市场无风险收益率曲线走势为陡峭化下行,10年期国债下行近50bp,1年国债下行80bp,10年金融债下行近90bp,1年金融债下行120bp,信用债方面高等级、长久期具政府背景的城投债受市场追捧,但中低等级产业债因经济表现低迷,信用利差有所拉大。总体来看上半年中债全价指数上涨约4.25%。

本基金上半年保持了比指数略高的久期,并波段操作了长期利率债,兼顾了资本利得和票息收入。

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5.57%,波动率0.14%,建信纯债C净值增长率5.39%,波动率0.15%;业绩比较基准收益率4.07%,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

从货币信贷、社会融资总量和PMI等先行指标看,下半年国内经济相对上半年企稳有所恢复的可能性较大,虽然房地产市场存在较大的不确定性,但我们判断国内基建活动加快和美国经济持续走强对出口的带动或能短期对抗地产的下行。在此经济环境下我们判断未来一季度债券市场无风险收益率曲线或将维持区间震荡,至于经济是强复苏或弱复苏可能要到四季度才能进一步明确,票息收入或许是短期债券市场最重要的收益来源。

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。

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

本报告期内本基金未达到利润分配条件,未实施利润分配,符合基金合同中关于分红条款的相关规定。

§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

2014年上半年,中国光大银行股份有限公司在建信纯债债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,依法安全托管了基金的全部资产,对建信纯债债券型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2014年上半年,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人——建信基金管理有限责任公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求;各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——建信基金管理有限责任公司编制的《建信纯债债券型证券投资基金2014年半年度报告》进行了复核,报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确的。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:建信纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		10,359,964.69	34,022,773.28
结算备付金		15,957,983.74	40,142,727.50
存出保证金		54,228.21	79,292.56
交易性金融资产		1,188,251,373.32	1,434,406,342.31
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,188,251,373.32	1,434,406,342.31
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		30,000,135.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		22,365,901.02	30,461,293.84
应收股利		-	-
应收申购款		142,685.82	154,630.67
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,267,132,271.80	1,539,267,060.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		595,209,314.68	582,599,153.80
应付证券清算款		5,039,629.72	23,439,585.60
应付赎回款		2,494,509.06	5,670,949.08
应付管理人报酬		366,207.27	510,977.34
应付托管费		122,069.10	170,325.77
应付销售服务费		177,036.50	231,198.25
应付交易费用		14,052.62	27,147.51
应交税费		-	-
应付利息		190,543.87	43,971.28
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		304,671.16	281,927.39
负债合计		603,918,033.98	612,975,236.02
所有者权益:			
实收基金		651,717,016.93	959,695,283.52
未分配利润		11,497,220.89	-33,403,459.38
所有者权益合计		663,214,237.82	926,291,824.14
负债和所有者权益总计		1,267,132,271.80	1,539,267,060.16

注:1、报告截止日2014年6月30日,基金份额总额651,717,016.93份。其中建信纯债债券基金A类基金份额净值1.023元,基金份额总额117,036,435.92份;建信纯债债券基金C类基金份额净值1.016元,基金份额总额534,680,581.01份。

6.2 利润表

会计主体:建信纯债债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		54,486,194.67	158,528,624.46
1.利息收入		36,688,531.28	132,101,941.23
其中:存款利息收入		233,671.30	18,218,676.26
债券利息收入		36,452,584.13	102,029,206.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,275.85	11,854,058.48
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-28,574,954.55	14,369,870.52
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-28,574,954.55	14,369,870.52
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		46,296,855.39	11,422,850.49
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		75,762.55	633,962.22
减:二、费用		15,234,433.15	46,768,089.45
1.管理人报酬		2,235,805.15	17,082,630.93
2.托管费		745,268.36	5,694,210.28
3.销售服务费		1,025,448.33	7,743,540.76
4.交易费用		25,539.56	67,239.39
5.利息支出		10,928,869.50	15,886,978.58
其中:卖出回购金融资产支出		10,928,869.50	15,886,978.58
6.其他费用		273,502.25	293,489.51
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		39,251,761.52	111,760,535.01
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		39,251,761.52	111,760,535.01

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信纯债债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	959,695,283.52	-33,403,459.38	926,291,824.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	39,251,761.52	39,251,761.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-307,978,266.59	5,648,918.75	-302,329,347.84
其中:1.基金申购款	366,839,340.36	-3,069,673.99	363,769,666.37
2.基金赎回款	-674,817,606.95	8,718,592.74	-666,099,014.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	651,717,016.93	11,497,220.89	663,214,237.82
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	16,868,807,552.25	67,404,514.90	16,936,212,067.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	111,760,535.01	111,760,535.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-14,093,132,903.65	-111,292,572.36	-14,204,425,476.01
其中:1.基金申购款	1,631,822,697.58	28,088,813.31	1,659,911,510.89
2.基金赎回款	-15,724,955,601.23	-139,381,385.67	-15,864,336,986.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,775,674,648.60	67,872,477.55	2,843,547,126.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信纯债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[2012]1176号《关于核准建信纯债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《建信纯债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16,860,580,066.57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(2012)第444号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》于2012年11月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为16,868,807,552.25份基金份额,其中认购资金利息折合8,227,485.68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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》和《建信纯债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、赎回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,赎回时根据持有期限收取赎回费用的,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,赎回时根据持有期限收取赎回费用的,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。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《建信纯债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具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、分离交易可转债、次级债、地方政府债、政府机构债、债券回购、资产支持证券、银行存款等,以及法律法规或中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。本基金投资组合中投资于债券类资产占基金资产的比例不低于80%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发;同时除分离交易可转债,本基金亦不参与可转债投资。本基金的业绩比较基准为中债综合全价(总值)指数。

根据《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资组合应在基金成立6个月内达到基金合同规定的比例限制。

6.4.2 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》、《建信纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年半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2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

6.4.6 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》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,包括买卖债券的差价收入、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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期,存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国光大银行股份有限公司(中国光大银行")	基金托管人、基金代销机构
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、基金代销机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无

6.4.8.1.2 权证交易

无

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,235,805.15	17,082,630.93
其中:支付销售机构的客户维护费	704,834.18	9,301,329.31

注:1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值X 0.60% / 当年天数;

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	745,268.36	5,694,210.28

注:支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值X0.20%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信纯债债券A	建信纯债债券C	合计
中国建设银行	-	720,282.91	720,282.91
中国光大银行	-	39,700.05	39,700.05
建信基金管理有限责任公司	-	243,625.39	243,625.39
合计	-	1,003,608.35	1,003,608.35
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信纯债债券A	建信纯债债券C	合计
中国建设银行	-	6,611,820.19	6,611,820.19
中国光大银行	-	205,019.58	205,019.58
建信基金管理有限责任公司	-	537,481.59	537,481.59
合计	-	7,354,321.36	7,354,321.36

注:支付基金销售机构的销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.35%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给建信基金管理有限责任公司,再由建信基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日C类基金份额销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值X0.35% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国光大银行	30,006,953.01	-	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	10,359,964.69	49,377.55	140,658,894.33	776,210.75

注:本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为110,209,314.68元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
140203	14国开03	2014年7月1日	104.62	10,000	1,046,200.00
140208	14国开08	2014年7月1日	101.70	300,000	30,510,000.00
140213	14国开13	2014年7月1日	99.82	300,000	29,946,000.00
140410	14农发10	2014年7月2日	100.30	300,000	30,090,000.00
140203	14国开03	2014年7月2日	104.62	20,000	2,092,400.00
140208	14国开08	2014年7月3日	101.70	200,000	20,340,000.00
合计				1,130,000	114,024,