建信双息红利债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9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10月24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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信双息红利债券
基金主代码	530017
交易代码	530017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月13日
报告期末基金份额总额	1,299,957,073.92份
投资目标	通过主动管理债券组合,力争在追求基金资产稳定增长基础上,为投资者取得高于投资业绩比较基准的回报。
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,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	90%×中国债券总指数收益率+10%×中证红利指数收益率。
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	建信双息红利债券A	建信双息红利债券C
下属两级基金的交易代码	530017	531017
报告期末下属两级基金的份额总额	1,299,289,435.19份	667,638.73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7月1日 - 2014年9月30日)	
	建信双息红利债券A	建信双息红利债券C
1.本期已实现收益	19,271,852.28	2,578.68
2.本期利润	38,698,115.88	4,036.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.0502	0.0098
4.期末基金资产净值	1,443,839,010.47	672,944.94
5.期末基金份额净值	1.111	1.008

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

建信双息红利债券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	4.60%	0.17%	3.15%	0.13%	1.45%	0.04%

建信双息红利债券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	0.80%	0.18%	1.94%	0.13%	-1.14%	0.05%

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.本基金于2014年9月1日新增C类份额,原有份额全部转换为A类份额。
2.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		
钟敬捷	投资管理部副总监,基金的基金经理	2011年12月13日	-	9	特许金融分析师(CFA),硕士,加拿大籍华人,1995年7月毕业于南开大学金融系,获经济学学士学位,2004年5月毕业于加拿大不列颠哥伦比亚大学,获工商管理硕士学位,曾先后任职于广东发展银行珠海分行、深圳发展银行珠海分行、嘉实基金管理有限公司等,从事外汇、交易、信贷、债券研究及投资组合管理等工作,2008年5月加入建信基金管理公司,2009年6月21日至2011年5月11日任建信收益增强债券型证券投资基金基金经理;2008年8月15日起任建信稳定增利债券型证券投资基金基金经理;2011年12月13日起任建信双息红利债券型证券投资基金基金经理;2013年9月13日起任建信安心保本混合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《建信双息红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》、《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

宏观经济方面,三季度经济数据较差。在上半年国家陆续出台保增长的措施后,对经济的拉动效果并不明显。而社会融资规模等金融数据低于预期,部分原因可能是由于信贷风险逐步暴露,银行信贷供给变得更为谨慎所致。

投资增速在三季度放缓明显,其中房地产投资下滑较多,制造业投资持续回落,投资增速下滑是三季度经济增速回落的主要因素。三季度消费数据相对平稳,出口则表现较好。三季度物价平稳,从已经公布的数据看,七月和八月消费者物价指数均低于市场预期。

政策面总体而言是宽松的。央行支表再贷款、定向降息、公开市场正回购利率连续下调和积极使用PSL、SLF等工具都释放出了宽松信号。九月底人民银行联合银监会出台《关于进一步做好住房金融服务工作的通知》,对房地产按揭等方面给了广泛的优惠政策。

债券市场方面,三季度债券收益率出现下行,其中长端利率下降较快,平均下行20BP以上,这一方面是由于市场对经济下行的确认,另一方面则是央行持续释放出宽松的信号。由于股票市场表现良好,大部分转债品种在三季度都有不错的涨幅。

本基金在三季度部分兑现了转债的收益,总体上转债的配置有所降低。三季度本基金规模增加较快,目前基金信用债的比例还没有达到配置的目标。本基金三季度增加了股票的配置,增配部分股票以低估值股票为主,但降低了地产等周期股的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期双息红利A净值增长率4.6%,波动率0.17%,业绩比较基准收益率3.15%,波动率0.13%;双息红利C净值增长率0.8%,波动率0.18%,业绩比较基准收益率1.94%,波动率0.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们认为四季度经济存在一定的下行压力。首先,银行借贷的趋势值得关注。其次,央行和银监会出台了地产方面的相关政策(包括放松限购、调整房贷利率等),但效果还需要观察。此外,出口增长态势虽相对明朗,但此次全球的复苏是较为脆弱的,而且人民币可能会跟随美元对其它货币升值,这将影响我们未来对其它地区的出口,整体上我们认为出口转好对经济的拉动作用有限。

我们预期四季度通货膨胀压力不大,猪肉价格依然是我们关注的一个因素。

在经济下行压力较大、政府努力降低企业融资成本的背景下,预期四季度央行依然会维持相对宽松的资金面。

总体上,四季度经济基本面没有特别不利于债券市场的因素,但需关注股票市场进一步走好对债券市场资金的分流作用。四季度本基金将保持适当的组合久期,并增加信用债的配置。本基金认为随着无风险利率的下降,股票市场的吸引力在增加,基金将择机选择好的股票品种,并加大配置,力争在下一季度为投资者获得良好回报。

§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	204,113,929.18	11.98
	其中:股票	204,113,929.18	11.98
2	固定收益投资	1,382,749,704.48	81.13
	其中:债券	1,382,749,704.48	81.13
	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	28,388,884.94	1.67
7	其他资产	89,174,250.84	5.23
8	合计	1,704,426,769.44	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	3,917,416.36	0.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	166,564,893.39	11.53
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	4,680.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	18,987,671.43	1.31
L	租赁和商务服务业	14,639,268.00	1.01
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	204,113,929.18	14.13

注:以上行业分类以2014年09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	600067	冠城大通	2,916,693	18,987,671.43	1.31
2	600887	伊利股份	719,648	18,638,883.20	1.29
3	000858	五粮液	898,960	16,603,791.20	1.15
4	002273	水晶光电	731,931	15,926,818.56	1.10
5	002344	海宁皮城	999,950	14,639,268.00	1.01
6	002008	大族激光	730,019	14,271,871.45	0.99
7	000625	长安汽车	999,906	13,698,712.20	0.95
8	601299	中国北车	2,394,583	12,619,452.41	0.87
9	300032	金龙机电	533,087	11,440,047.02	0.79
10	600519	贵州茅台	69,932	11,338,075.16	0.78

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	102,834,852.00	7.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	147,543,500.00	10.21
	其中:政策性金融债	147,543,500.00	10.21
4	企业债券	355,805,186.76	24.63
5	企业短期融资券	120,212,000.00	8.32
6	中期票据	554,973,000.00	38.42
7	可转债	101,381,165.72	7.02
8	其他	-	-
9	合计	1,382,749,704.48	95.72

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	140203	14国开03	900,000	95,634,000.00	6.62
2	101461017	14神华MTN002	800,000	80,696,000.00	5.59
3	1480443	14广州地铁债03	500,000	50,950,000.00	3.53
4	122316	14融资01	500,000	50,610,000.00	3.50
5	101459044	14龙源进MTN001	500,000	50,185,000.00	3.47

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	159,691.85
2	应收证券清算款	44,483,305.47
3	应收股利	-
4	应收利息	20,844,512.38
5	应收申购款	23,686,741.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	89,174,250.84

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	110015	石化转债	18,946,143.10	1.31
2	127002	徐工转债	18,380,475.13	1.27
3	110023	民生转债	9,356,000.00	0.65
4	110018	国电转债	8,540,586.00	0.59

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	建信双息红利债券A	建信双息红利债券C
报告期期初基金份额总额	311,443,306.79	-
报告期期间基金总申购份额	1,516,571,768.03	785,060.63
减:报告期期间基金总赎回份额	528,725,639.63	117,421.90
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	1,299,289,435.19	667,638.73

注:总申购份额含红利再投资和转换入份额,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息红利债券型证券投资基金设立的文件;
2、《建信双息红利债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信双息红利债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信双息红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10月24日

建信转债增强债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信转债增强债券
基金主代码	530020
交易代码	530020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月29日
报告期末基金份额总额	375,698,525.90份
投资目标	通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置,并充分利用可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,实现对大类资产的配置,在控制风险并保持良好流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的超额收益。
投资策略	本基金在合同约定的范围内主要构建的整体资产配置,根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势,判断当前所处的经济周期,进而对未来做出科学预测,在此基础上,结合对流动性及资金流向的分析,综合股市估值水平和债券收益率情况及风险分析,进行资产类别大类资产配置进行固定收益类资产、权益类资产以及货币类资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。
业绩比较基准	60%×天相可转债指数收益率+30%×中国债券总指数收益率+10%×沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,债券型基金的风险高于货币市场基金,低于混合型和股票型基金,属于中低风险收益的品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	建信转债增强债券A	建信转债增强债券C
下属两级基金的交易代码	530020	531020
报告期末下属两级基金的份额总额	99,374,872.79份	276,323,653.11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7月1日 - 2014年9月30日)	
	建信转债增强债券A	建信转债增强债券C
1.本期已实现收益	876,073.14	1,588,442.16
2.本期利润	13,477,706.50	28,815,176.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.1683	0.1678
4.期末基金资产净值	125,557,128.60	346,001,347.07
5.期末基金份额净值	1.263	1.252

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

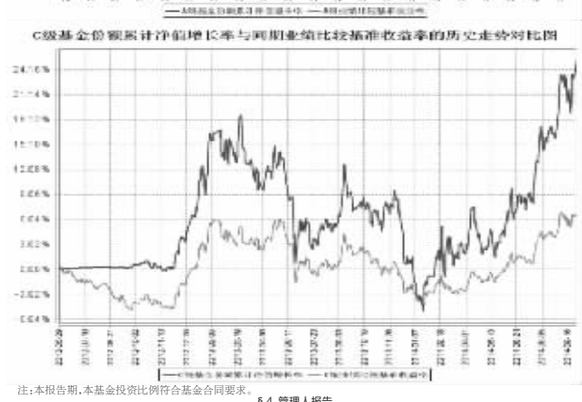
建信转债增强债券A

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	14.82%	0.90%	4.97%	0.40%	9.85%	0.50%

建信转债增强债券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	14.76%	0.90%	4.97%	0.40%	9.79%	0.50%

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		
彭云峰	本基金的基金经理	2012年5月29日	-	8	硕士,曾任中经网数据有限公司研究分析师,国都证券有限责任公司债券研究及量化研究,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3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31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

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《建信转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年三季度,中国经济增速有所下滑,与二季度相比,7-8月投资、消费、工业增加值增速明显下降,出口增速回升,CPI增速小幅下降,仍处于较低水平。三季度资金面比较宽松,9月中旬也相对平稳,资金利率没有大幅波动。

由于6月经济数据较好,7月中上旬债市有所调整。之后几个月经济增速回落,货币政策较为宽松,7月下旬之后债市持续上涨,各期限、各品种债券收益率均大幅下行。总体而言,三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。

三季度股票市场大幅上涨。可转债整体涨幅不如股票,部分中小盘转债涨幅较大。

本基金三季度可转债投资比例相对较高,根据市场情况动态调整。主要投资银行、石化、电力等大盘转债,也投资了一些投资价值较好的中小盘转债。股票方面,本基金适当增加了投资比例,精选个股,灵活投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期转债增强A净值增长率14.82%,波动率0.9%,转债增强C净值增长率14.76%,波动率0.9%;业绩比较基准收益率4.97%,波动率0.4%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于三季度微刺激经济政策不断推出,房地产政策调整,美国经济形势向好,预计四季度中国经济增长情况将有所好转,通胀或仍保持在较低水平。四季度货币政策可能相对宽松,适时提供流动性,确保货币信贷合理增长。目前判断,四季度全面降息降准的概率不大。

基于以上分析,我们对四季度债券市场谨慎乐观,预计债券收益率先升后降,波动幅度不大。我们认为四季度中短期债券的表现可能较好,信用债的表现可能好于利率债,中高评级信用债优于低评级信用债。由于经济形势可能好转,改革推进利好相关行业,沪港通有利于价值重估,而且股票市场估值相对合理,预计四季度股票市场仍会有较好表现。目前可转债整体股性较强,有望跟随股市上涨。

四季度,我们将把可转债的投资比例保持在相对较高水平,根据市场情况动态调整,精选投资品种,灵活操作。同时积极投资权益类资产,稳中求进。在严格控制风险的基础上,力争实现基金资产稳健增值。

§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	82,837,933.52	11.26
	其中:股票	82,837,933.52	11.26
2	固定收益投资	618,200,565.65	84.03
	其中:债券	618,200,565.65	84.03
	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	20,816,710.95	2.83
7	其他资产	13,857,924.07	1.88
8	合计	735,713,134.19	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	-	-
C	制造业	28,307,771.18	6.00
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	7,422,110.00	1.57
E	建筑业	14,206,849.24	3.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输,仓储和邮政业	13,674,136.14	2.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	4,923,566.96	1.04
J	金融业	5,165,500.00	1.10
K	房地产业	6,942,000.00	1.47
L	租赁和商务服务业	2,196,000.00	0.47
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	82,837,933.52	17.57

注:以上行业分类以2014年9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	601299	中国北车	1,599,912	8,431,536.24	1.79
2	601006	大秦铁路	1,038,278	8,077,802.84	1.71
3	601668	中国建筑	2,300,000	7,797,000.00	1.65
4	000099	中信海直	464,426	5,596,333.30	1.19
5	600585	海螺水泥	269,913	4,637,105.34	0.98
6	600795	国电电力	1,700,000	4,386,000.00	0.93
7	601929	吉视传媒	319,944	4,188,066.96	0.89
8	601989	中国重工	632,910	4,151,889.60	0.88
9	600999	招商证券	350,000	4,070,500.00	0.86
10	000024	招商地产	300,000	3,687,000.00	0.78

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	20,010,000.00	4.24
	其中:政策性金融债	20,010,000.00	4.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	598,190,565.65	126.85
8	其他	-	-
9	合计	618,200,565.65	131.10

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	110015	石化转债	1,004,390	109,508,641.70	23.22
2	110018	国电转债	885,210	104,206,921.20	22.10
3	113001	中行转债	715,120	74,057,827.20	15.70
4	110020	南山转债	524,630	59,026,121.30	12.52
5	113002	工行转债	498,860	54,310,888.20	11.52

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 本基金本报告末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资中,中国石油化工股份有限公司(石化转债代码:110015)于2013年11月25日公告,由于原油管道破裂致使排水暗渠爆炸,从而引发人员伤亡事故,中国政府已派出事故调查组进行全面调查。2014年1月,国务院事故调查组对中国石油化工股份有限公司及相关责任人分别给予纪律处分,中国石油化工股份有限公司于1月13日披露相关处罚结果。目前该公司生产经营稳定,成品油市场供应稳定,该处罚不影响持有该债券。

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	74,247.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,419,735.99
5	应收申购款	10,363,940.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,857,924.07

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	110015	石化转债	109,508,641.70	23.22
2	110018	国电转债	104,206,921.20	22.10
3	113001	中行转债	74,057,827.20	15.70
4	110020	南山转债	59,026,121.30	12.52
5	113002	工行转债	54,310,888.20	11.52
6	113003	重工转债	47,859,790.00	10.15
7	110024	隧道转债	38,241,523.20	8.11
8	113005	平安转债	24,297,900.00	5.15
9	110019	恒丰转债	11,612,515.20	2.46
10	128004	久立转债	8,261,902.35	1.75
11	127002	徐工转债	1,709,430.00	0.36
12	128003	华天转债	477,690.50	0.10
13	113006	深燃转债	337,761.10	0.07

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	建信转债增强债券A	建信转债增强债券C
报告期期初基金份额总额	66,703,027.49	111,863,801.39
报告期期间基金总申购份额	116,094,243.54	332,436,717.75
减:报告期期间基金总赎回份额	83,422,398.24	167,976,866.03
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	99,374,872.79	276,323,653.11

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转债增强债券型证券投资基金设立的文件;
2、《建信转债增强债券型证券投资基金基金合同》;
3、《建信转债增强债券型证券投资基金招募说明书》;
4、《建信转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