建信健康民生混合型证券投资基金

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:中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人光大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	建信健康民生混合
基金主代码	000547
交易代码	000547
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月21日
报告期末基金份额总额	235,063,085.68份
投资目标	本基金主要投资于有利于提升居民健康水平和促进国计民生的行业及公司,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的股票投资包含健康和民生这两大主题,本基金将精选有利于提升居民健康水平和促进国计民生的公司进行投资。 在债券组合的构造和调整上,本基金综合运用久期管理、期限配置策略、类属配置管理、套利策略等组合管理手段进行日常管理,获取稳健增值的机会。
业绩比较基准	70%×沪深300指数收益率+30%×中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,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	中国光大银行股份有限公司

§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7月1日—2014年9月30日)
1.本期已实现收益	21,177,559.69
2.本期利润	44,391,199.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.0843
4.期末基金资产净值	261,127,654.13
5.期末基金份额净值	1.111

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	9.89%	0.67%	9.36%	0.63%	0.53%	0.04%

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2014年3月21日生效,截止报告期末未满一年。

2.本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括A股股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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的相关规定。

基金的投资组合比例为:股票资产占计市值占基金资产净值的50%~95%,债券等固定收益类资产合计市值占基金资产净值的0~50%,权证投资合计市值占基金资产净值的0~3%,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%。本基金将不低于80%的非现金基金资产投资于有利于提升居民健康水平和促进国计民生的公司发行的证券资产。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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		
娄锋	本基金的基金经理	2014年3月21日	-	7	硕士。2007年7月加入本公司,从事行业研究,任研究员。2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理。该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)。娄锋继续担任该基金基金经理;2014年3月21日起任建信健康民生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

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《建信健康民生混合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3季度市场上涨。7月份在中报和沪港通政策的主导下,低估值监等大幅上涨,业绩平淡的成长股大幅调整。

8月和9月宏观经济持续下滑,经济数据低迷,市场重新回归转型和改革主基调,军工、TMT和转型的传统行业领涨市场。

本基金3季度基于对政策、经济基本面和企业盈利的判断,结合市场的估值水平,以业绩增长稳定的医药和消费股作为主要配置对象,适度参与了周期股、成长股和转型主题投资机会。

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9.89%,波动率0.67%,业绩比较基准收益率9.36%,波动率0.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,美国经济保持回升态势,QE持续退出,美联储开始讨论加息时点,美元持续升值,需要关注国际资金流向变动;欧洲经济在量化宽松的背景下步入复苏通道;国内经济预计将缓慢回落,改革仍是主基调,微刺激政策将稳住经济的底线,关注四中全会对顶层制度的设计和地产销售变化情况。

本基金在2014年4季度将采取相对均衡的配置策略,积极寻找符合经济转型大方向的有利于大众健康的行业和公司;本基金将在医药、环保、TMT和消费四大行业中自下而上寻找业绩增速与估值相匹配的优质成长股投资,灵活参与市场的主题投资机会。

§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	221,004,681.21	81.88
	其中:股票	221,004,681.21	81.88
2	固定收益投资	401,095.60	0.15
	其中:债券	401,095.60	0.15
	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	41,201,009.40	15.26
7	其他资产	7,316,913.61	2.71
8	合计	269,923,699.82	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	17,997,546.92	6.89
B	采矿业	3,647,341.00	1.40
C	制造业	143,523,252.87	54.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,077,125.60	0.80
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,731,447.60	7.56
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	29,950,405.62	11.47
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,077,561.60	1.56
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	221,004,681.21	84.63

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	600571	信雅达	546,171	12,572,856.42	4.81
2	600557	康缘药业	449,646	12,324,796.86	4.72
3	600887	伊利股份	433,167	11,219,025.30	4.30
4	002104	恒宝股份	643,110	9,325,095.00	3.57
5	600572	康恩贝	502,299	8,513,968.05	3.26
6	000998	隆平高科	543,432	8,189,520.24	3.14
7	000963	华东医药	136,319	8,165,508.10	3.13
8	002614	蒙发利	429,580	7,831,243.40	3.00
9	002063	远光软件	346,438	7,244,018.58	2.77
10	000997	新大陆	256,800	6,815,472.00	2.61

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	401,095.60	0.15
8	其他	-	-
9	合计	401,095.60	0.15

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	128008	齐峰转债	4,011	401,095.60	0.15

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	187,844.51
2	应收证券清算款	6,874,183.72
3	应收股利	-
4	应收利息	6,887.40
5	应收申购款	247,997.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,316,913.61

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

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	600571	信雅达	12,572,856.42	4.81	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	780,836,202.73
报告期期间基金总申购份额	4,042,022.00
减:报告期期间基金总赎回份额	549,815,139.05
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	235,063,085.68

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健康民生混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信健康民生混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信健康民生混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信健康民生混合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

建信周盈安心理财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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	建信周盈安心理财
基金主代码	530030
交易代码	530030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月17日
报告期末基金份额总额	3,164,827,835.60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。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过127天。
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	交通银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	建信周盈安心理财A / 建信周盈安心理财B
下属两级基金的交易代码	530030 / 531030
报告期末下属两级基金的份额总额	2,483,200,711.61份 / 681,627,123.99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)	
	建信周盈安心理财A	建信周盈安心理财B
1. 本期已实现收益	31,144,804.65	11,965,750.09
2. 本期利润	31,144,804.65	11,965,750.09
3. 期末基金资产净值	2,483,200,711.61	681,627,123.99

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

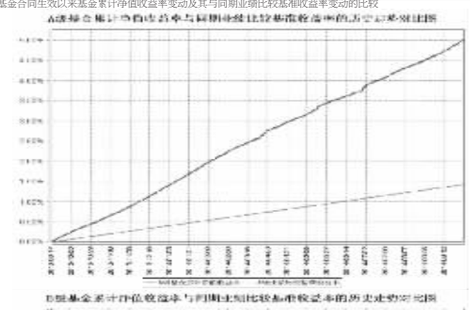
建信周盈安心理财A

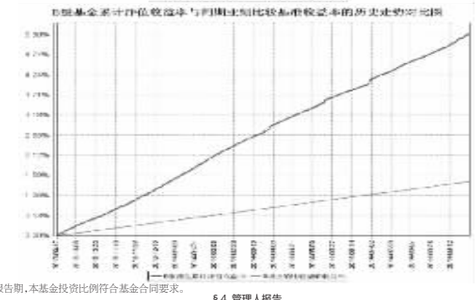
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1531%	0.0067%	0.3456%	0.0000%	0.8075%	0.0067%

建信周盈安心理财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	1.2270%	0.0067%	0.3456%	0.0000%	0.8814%	0.0067%

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		
高珊	本基金的基金经理	2013年9月17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日起任建信双债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。

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《建信周盈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

三季度以来,国内需求的走弱和工业品价格的快速下跌给企业盈利带来了显著的负面影响。房地产市场投资不振、企业去库存压力导致减产,再加上外需回落;多重不利因素叠加导致整个季度的经济数据都不尽人意。随着中国经济下滑,全球工业活动也在走弱,近期公布的全球PMI和主要经济体工业指数均不及预期。9月中下旬以来,全球股市明显下跌,债券市场上涨,美元升值,这些都充分反映了全球市场风险偏好的下降。

资金方面,央行在三季度加强了银行间市场的资金价格干预力度。虽然目前货币政策定向宽松的大格局没有变,但在存款新政的考核下,有关存款的竞争从关键时点"冲存款"转向偏向日均考核,这将使资金成本面临上行压力。叠加上IPO打新资金的扰动,也让三季度资金价格跌冲上行波动不断,给货币理财类基金的日常操作增加了难度。

债券市场,三季度一般是债券的传统熊市,今年却是例外。由于经济的持续失速倒逼货币政策放松,央行"量价齐松"如期而至,在这样的宏观背景下,相对宽松的资金面使得上半年的债券牛市得以进一步持续。尤其在9月下旬,5000亿SLF推出后,收益率应声大跌,创下年内收益率新低。

回顾三季度的基金管理工作,建信周盈安心理财基金主要采用了稳健的投资风格预防流动性风险,投资上主要以高收益信用债券为主,存款逆回购为辅,加大杠杆拖高组合收益,即时适当控制信用债券风险,平稳渡过了三季度末的流动性冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期周盈理财A基金净值收益率1.1531%,波动率0.0067%,周盈理财B基金净值收益率1.2270%,波动率0.0067%;业绩比较基准收益率0.3456%,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

展望四季度,我们认为经济环比回升应该是大概率事件。猪肉价格在9月份保持稳定,蔬菜价格在9月中下旬略有上涨,两者合并对食品价格同比增长的拉动力量有限,同时考虑到燃料价格下降以及去年较高的基数,全月CPI同比增速可能进一步回落到1.6%左右,来自通胀的压力仍可控。另外,央行在9月30日发布了《关于进一步做好住房金融服务工作的通知》,大幅放款购房贷款申请条件。尽管在目前银行资金成本较高的背景下,银行落实首套房利率折扣的积极性可能不高,但放市政策对房地产市场改善带来的积极作用不容小觑。房地产市场调整时间接近一年,流动性逐步宽松和政府救市政策的推出使30多个一线大中城市商品房销售面积出现恢复。在当前内需乏力的情景下,房地产市场的变化对中期经济走势有很大影响。

高层在上个月的北戴河会议形成共识,将接受GDP增速低于7.5%。我们预计货币政策不会大的调整,不刺激,稳价格预期将是央行的总体思路。债市方面,我们预计信用债能保持平衡。由于实体经济在四季度的信用违约风险将高于三季度,信用息差将进一步放大,所以应重点关注年末个券估值调整风险。由于3季末流动性平稳度过,年末万亿财政巨额存款投放在即,预计4季度流动性仍将保持宽松。存款价格更多受资金影响,可适当拉长存款期限。

未来建信周盈安心理财债券型证券投资基金仍将维持中性的剩余期限,在重点关注流动性的基础上适当拉长久期。在组合投资策略的制定中会依据中期情况进行动态调整,特别是对于敏感时点做好流动性的应对,并抓住打新导致交易所回购利率冲高带来的投资机会。配置上主要以存款和短融相结合的策略,在保证组合流动性的同时跟随市场的发展变化,获得合理的收益。

§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	1,610,525,764.69	50.70
	其中:债券	1,610,525,764.69	50.70
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	628,500,744.25	19.79
	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	893,645,723.22	28.13
4	其他资产	43,840,195.09	1.38
5	合计	3,176,512,427.25	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	16.90
	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	8,999,866.50 / 0.28
	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	95
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	75

报告期内投资组合平均剩余期限超过127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127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	39.41	0.28
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	15.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	6.32	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	15.81	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	21.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.98	0.28

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	349,926,686.75	11.06
	其中:政策性金融债	199,945,807.79	6.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,260,599,077.94	39.83
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,610,525,764.69	50.89
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	041453047	14武钢CP001	800,000	80,058,498.12	2.53
2	041366015	13包钢CP001	600,000	60,030,632.71	1.90
3	140204	14国开04	600,000	60,022,290.42	1.90
4	041459052	14中冶CP002	600,000	59,947,878.51	1.89
5	041460004	14梅花CP001	500,000	50,068,262.05	1.58
6	041460027	14湘高速CP001	500,000	50,001,348.90	1.58
7	041454012	14红豆CP001	500,000	50,000,853.36	1.58
8	041456026	14渝文资CP001	500,000	50,000,098.31	1.58
9	041460050	14湘高速CP002	500,000	50,000,096.34	1.58
10	041461005	14西基投CP001	500,000	50,000,067.85	1.58

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	50
报告期内偏离度的最高值	0.3120%
报告期内偏离度的最低值	0.2074%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2671%

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摊益。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	43,840,195.09
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	43,840,195.09

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	建信周盈安心理财A	建信周盈安心理财B
报告期期初基金份额总额	2,329,220,558.74	867,407,891.00
报告期期间基金总申购份额	3,423,828,377.27	1,616,351,474.22
减:报告期期间基金总赎回份额	3,269,848,224.40	1,802,132,241.23
报告期期末基金份额总额	2,483,200,711.61	681,627,123.99

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周盈安心理财债券型证券投资基金设立的文件;

2、《建信周盈安心理财债券型证券投资基金基金合同》;

3、《建信周盈安心理财债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信周盈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10月24日

建信安心回报两年定期开放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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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	建信安心回报两年定期开放债券
基金主代码	000346
交易代码	000346
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月5日
报告期末基金份额总额	321,289,296.02份
投资目标	在严格控制风险并保持较高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资收益,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。本基金在债券资产所提供的稳定收益的基础上,适当参与一级市场新股申购或增发新股,为基金份额持有人增加收益,实现基金资产的长期稳定增值。 本基金在综合分析宏观经济、货币政策等因素的基础上,采用久期管理、期限管理、类属管理和风险管理相结合的投资策略。在个券选择上,本基金将综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险分析、流动性分析等方法来评估个券的投资价值。
业绩比较基准	两年期银行定期存款收益率(税前)。
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	招商银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	建信安心回报两年定期开放债券A / 建信安心回报两年定期开放债券C
下属两级基金的交易代码	000346 / 000347
报告期末下属两级基金的份额总额	159,907,927.79份 / 161,381,368.23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)	
	建信安心回报两年定期开放债券A	建信安心回报两年定期开放债券C
1. 本期已实现收益	2,138,412.53	1,989,831.61
2. 本期利润	3,775,624.67	3,637,097.37
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0226	0.0216
4. 期末基金资产净值	166,489,489.44	167,438,506.59
5. 期末基金份额净值	1.041	1.038

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