建信恒久价值股票型证券投资基金招募说明书 便新 摘要

匯要提示] 本基金经中国证券监督管理委员会 2005 年 10 月 31 日证监基金字 2005]178 号文核准募集。本基金的基金合同于 2005 年 12 月 1 日正式生效。 基金投资有风险,投资人申购基金份额时应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来

表现。
本稿要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间
权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当 事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照 征券投资基金法》、征券投资基金法的资本会运作管理办法》基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人款了解基金份额持有人的权利和义务。应详知查阅基金合同。

的从7州以方,应开到宣风基金合同。 基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监 会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书摘要所载内容截止日为2010年5月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年3

一、基金管理人 (一 基金管理人概况 各称:建信基金管理有限责任公司 住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心 16 层 办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心 16 层 设立日期:2005年9月19日 法定代表人:江先周 联系人:路彩管 电话:010-66228888

. 公司经中国证监会证监基金字 [2005]158号文批准设立。公司的股权结构如

| Ŧ | : | |
|---|--------------------------|-----------------------|
| | 股东名称 | 股权比例 |
| | 中国建设银行股份有限公司 | 65% |
| | 美国信安金融服务公司 | 25% |
| | 中国华电集团资本控股有限公司 | 10% |
| | 本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够 | 移切实维护基金投资人的利益。股东会为公司权 |

中国华电集团资本容级有限公司
本基金管理人公司治理结构完善。经营运作规范、能够切实维护基金投资人的利益。股东会为公司权力机构、由金体版东组成、决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利、不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。董事会为公司的法费机构、对股东会位表,为时东会汇报。公司董事会由《多董事组成、其中3名为独立董事、根据公司章程的规定、董事会履行《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。公司技监事会,由各国治理者,是有关于自然。公司政治专注等公司财务并监督公司董事、高管尽职情况。公司根据经营运作需要该营资率的股东会负责,主要负责检查公司财务并监督公司董事、高管尽职情况。公司根据经营运作需要该营资金合资理部、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、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、基金运营部、信息技术部、风险管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理等员会和风险管理等员会和风险管理等员会和风险管理等员会和风险管理等,所经济学硕士学位。1986年获财政部财政科学研究所经济学硕士学位。1993年获录记录行业、经验、1985年获录比较,由国建设银行产金融户金融,以及企业、1985年获录。1985年获东北财经大学经济学生产学位、2006年获得长工商学院 EMBA。历任中国建设银行者资密部证券处断处长,中国建设银行人发动等。等由处务证明的经理。1084年形成,中国建设银行人人农的原则经经理。1084年形成,中国建设银行个人保险等。1086年表述,中国建设银行个人保护、各部局经验理。1084年形成,中国建设银行令人发动。1084年产业企业,1084年形成。1084年的企业,1084年的企

85年度。 马梅琴女士,董事,现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1984年毕业于中央财政金融学院 马梅琴女土、董事、现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1984 年毕业于中央财政金融学院 財政系、获学土学位。历任中国建设银行等资储蓄部外币储蓄处处长,中国建设银行零售业务部自动服务 处处长,中国建设银行个人银行业务部正券业务处处长,中国建设银行等各重业务部自动服务 免处长,中国建设银行个人金融业务部间总经理。 俞斌先生、董事、现任中国建设银行财务会计部总经理助理。1992 年获南京大学计算数学专业硕士学 位。历任中国建设银行江苏分行参州分行行长助理。副行长,中国建设银行财务会计部处长。 欧阳伯权先生、董事、现任美国信安金融集团总裁 — 亚洲。1977 年获加拿大清铁卢大学城市设计及 环境规划系学士学位。历任加拿大安泰保险公司管理级培训员、团体核保总监、美国友邦保险公司亚洲区团 体保险部副总裁、信安国际有限公司亚洲区行政总裁 般红军先生、董事、现任中国等电集团资本控股有限公司副总经理。1998 年毕业于首都经济贸易大学 数量经济学专业,获硕士学位。历任中国电力财务有限公司债券基金部项目经理、华电集团财务有限公司投 资咨询部副经理(往村工作)、中国华电集团公司农制重组办公室副处长、体制农革处处长、政策与法律事务 都致策研究处处长。

2. 监事会成员 罗冲蒋女士, 监事会主席。1977年毕业于天津南开大学政治经济学专业。历任国家统计局干部、副处 、中国建设银行投资调查部副处长、信贷部副处长、按长、委托代理部处长、中国建设银行基金托管部副总

理有限责任公司(任督察长)。 张延明先生,副总经理。1993年获中国人民大学投资经济系学士学位,1997年获中国人民大学投资经

济系硕士学位、先后供职于梁川市建设集团,中国建设银行。历中中国建设银行信贷管理部主任科员,中国建设银行行长办公室主任科员、副处长、处长。2006年11月加入本公司,任总经理助理;2008年6月起任副

4. 督察长 路彩管女士, 督察长。1979 年毕业于河北大学经济系计划统计专业。历任中国建设银行公司业务部副 处长、处长、华夏证券股份有限公司部门副总经理, 宝盈基金管理公司首席顾问 公司副总经理级), 建信基 金管理有限责任公司监事长。 5.基金经理 王新艳女士,副总经理,2009年12月17日至2011年2月1日任本基金基金经理简历请参见高管人

员》。 卓利伟先生,投资管理部副总监。1994年毕业于浙江工业大学,获学士学位;2005年毕业于浙江大学工 商管理专业,获硕士学位。1994年9月起在杭州经济建设集团工商公司投资部任职;1997年11月起在北京 恒逸实业有限公司投资部任职;2003年1月起任上海石油交易所筹备组成员;2005年1月加入百荣投资按 股集团有限公司,任任投资部制经理;2005年8月加入建信基金管理公司,历任研究员,高级研究员,基金经 理助理,基金经理、资深基金经理,2009年3月25日至今任本基金的基金经理;2009年6月27日至今任

建信收益增强债券型证券投资基金的基金经理;2010年11月16日起任建信内生动力股票型证券投资基金 历任基金经理: 吴剑飞先生:2005年12月1日至2009年11月23日。 天到《元生:2009年12月1日至2009年11月25日。 卓利伟先生:2009年3月25日至今。 王新艳女士:2009年12月17日起至2011年2月1日。

平利17九三十2009 年 9 万 月 17 日起至 2011 年 2 月 1日 。
6. 投资决策委员会成员
为志晨先生,总经理 简历请参见董事会成员)。
王新艳女士,副总经理 简历请参见董事会成员)。
王新艳女士,副总经理 简历请参见董事会成员)。
万志勇先生,总经理 简历请参见公司高管人员)。
万志勇先生,研究部执行总监,硕士。 曾就职于西安创新互联网孵化器有限公司,北方证券有限责任公司、大成基金管理有限公司,建模士丹科华鑫基金管理有限公司 6 原巨田基金管理有限公司),银华基金管理有限公司。 2008 年 10 月 23 日至 2009 年 11 月 11 日任银华领先策略基金基金经理,2009 年 6 月 1 日至 2010 年 6 月 1 9 日任银华阳谐主题基金金经理,2010 年 7 月加入建信基金管理有限员任公司,2010 年 1 月 月 日在民任研究部执行总监。 2010 年 11 月 17 日起任建信内生动力股票型证券投资基金基金经理;2011 年 5 月 日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理。
聚准即先生,投资管理部副总监。 CFA、证券从业经历 8 年。 2003 年 1 月茶青华大学经济学博士学位,2003 年 1 月至 2005 年 8 月,款职于大成基金管理有限保全记司,历任研究部研究员,规划发展部产品投资市场,机构理增储高级经理。 2005 年 8 月加入建信基金管理有限责任之司,历任研究部研究员,海划发展部产品发行,机构建和流级经理。 2005 年 8 月加入建信基金管理有限责任之司,历任研究部研究员,海划发展部产品发行,从未被取得成分量,经过,18 日起任建信沙保。 300 指数证券投资基金(10 产的基金经理;2010 年 5 月 28 日起任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金(17)及其联接基金的基金经理。

金 (CTF)及其联接基金的基金经理。 卓利伟先生,投资管理部副总监 简历请参见基金经理)。

司均不存在近亲属关系。

→ 遊本情况 名称:中信银行股份有限公司 住所:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 办公地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人,孔丹 联系人;朱义明 联系人;吉、010-65556899 注册资本;八民币 390,33 亿元 基金托管资格批文及文号;中国证监会证监基金字 [2004]125 号 仁、注要人员情况 张向东、江南管理硕士。曾任职于中信银行总行资金都;汇兑部、会计部和清算中心,全面负责全行本、 的消算工作。曾任中信银行总行清算中心总经理。现任中信银行总行托管部总经理。 云、相关服务机构 一、译本伦娜带生相均

1、且帮助(A) 名称,建信基金管理有限责任公司 住所;北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心 16层 办公地址;北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心 16层 法定代表人;江先周

电话:010-66228800

(1)中国建设银行股份有限公司 注所:北京市西城区金融大街25号

住所:北京市西域区金融大街 25 号 办公地址:北京市西域区同市口大街 1 号院 1 号楼 低安兴融中心) 法定代表人:郭树清 客服电话:95533 网址:www.cch.com 0 冲信银行股份有限公司 住所:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 办公地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 法定代表人:孔丹 客服电话:9558 网址:bank.ecitic.com

存版之前。2005年 6)交通银行股份有限公司 住 F:上海市浦东新区银城中路 188 号 邮政编码:200120) 办公地址:上海市浦东新区银城中路 188 号 邮政编码:200120) 法定代表人:胡怀邦

客服电话:95559

答服电击。95559 例此。http://www.95559.com.cn 4)中国民生银行股份有限公司 注册地址:北京市西城区复兴门内大街 2 号 法定代表人,董文标 客户服务电话。95568

在广服办电话:95526 公司网站:www.bankobeijing.com.cn 6 招商银行股份有限公司 注册地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 法定代表人:傅育宁

2011年第2号

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

图制投资风险,追求基金资产长期稳定增值。

基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、国债、金融 业债。回购,央行票据、可转换债券、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

6) 预期的宏观经济政策。该项指标的研究主要由宏观研究团队借助相关分析研究系统,并结合实地调

_ 12-429-%/ 02-5

本来E独立企業 名称七代別

4

4 E.52

光性对人

-j.

5

·守有的的发化同匹守。 本基金管理人将根据对上述指标的研究结果,对市场状况进行综合评价,确定资产配置比例。 资产配置流程

Pinter Color

2.行业配置策略 进行行业配置时,本基金管理人将主要进行以下几方面的分析研究: (1) 行业竞争结构分析,行业内部的竞争结构对于行业长期发展趋势有关键影响,对行业内部各公司的盈利比为和盈利水平起到重要作用。 (2) 行业发展阶段分析,本基金管理人将以行业生命周期理论为基础。根据行业整体的增长率、销售额、竞为计学投资。产品线分布,和简率水平、定价方式、进入壁垒等多种指标、对各行业处于何种发展阶段进行判断,并揭此确定行业的中长期发展前最和盈利状况。 (3) 各行业特定指标的分析。各个不同的行业均有一些特定的指标,可以表征行业的总体状况,本基金管理人将过途控制标则业直之考察。 (4) 行业层气程度分析,行业层气程度变化亦是影响行业发展趋势和盈利能力的重要因素。而行业层气程度工生变受到宏观经济发展变化的影响。本基金管理人将以对实现经济的研究判断为基础,根据国家所处经济周期的不同阶段给不同产业或行业的发展造成的差景,并综合考虑行业技术进步、行业政策、行业组织创新、社会习惯的改变和经济的研究的企业化等因素。对行业的景气度作出分辨系。

本基金强调对具有良好流动性、价值被低估和重视股东价值的上市公司股票的发掘。在选股过程中,吸

THER

3.公公种

72.43

i"it

0 流动性筛选 在进行个股选择时,本基金将首先对市场中的各只股票进行流动性筛选,原则上规避流动性欠佳的股

© 沈代 ISAR 模型的定量选股分析 在流动性筛选的基础上, 本基金将利用 ISAR 模型对股票进行排序及评分,评分结果作为选择股票的参

的风险收益。 九.基金的投资业绩比较基准 本基金投资业绩比较基准为:75%×MSCI中国A股指数+20%×中信全债指数+5%×I年定期存款利率。 十.基金的风险收益特征 本基金属干股票和证券投资基金,一般情况下其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混 基金:在股票型基金中,本基金属于中等风险、中等收益的证券投资基金。

2 910 117 810 15

135,629,370.7

390,490,823,28

65,044,285.38

公允价值 忨

23,033,112,20

140,419,304.5

981,500,435.0

324,566,771.40

34,530,000.00

10,320,000.0

197,254,588.43

2,151,000.00

100,082,826.10

189,861,685.94

122,733,563.20

25,100,000.0

44,879,868.18

484,151,698.00

493,088,562.3

202,029,263.2

137,617,951.3

127,632,000.0

2,910,117,810.15

83.12

3.87

3.87

11.15

1.86

100.00

0.67

4.10

9.47

1.01

0.06

3.58

1.31

14.13

14.39

5.89

本基金爾丁取完實生地分子。 在型金:在股票型基金中,本基金属于中等风险、中等收益的业券投資歷歷。 十一、基金的投资组合报告 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。 容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。 本基金托管人中信報行报份有限公司根据本基金基金合同规定,于2011年4月20日复核了本报告中的财务指标,净值表现和投资组合根告等内容、保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 本投资组合报告所载数据期间为2011年1月1日至2011年3月31日,本报告所列财务数据未经审 计

收与借鉴是国信安Principal)金融集团的ISAI 模型"人;指令 Kara 模型"人;结合中国证券市场实际情况作进一步优化、以此为基础、构建初选股票池、投资与研究团队对所选择的股票进行研究和确认、形成核心股票地

股票选择流程

本基金管理人在上述分析研究的基础上,对各行业进行综合评级,并确定行业配置比例。 行业配置流程

1.0多格拉拉克拉

1. 发展标识统

当一次无期有益点

(1)少男个指想方针

SYALIS

-440--35

事件不必

F 17.11

FX.

扩张上升分

旦べて提

指···卢丁M

- 34, 71

\$23 E

七甲模块

34

ISAR 模型包含以下几个方面:

会融衍生品投资

A 农、林、牧、渔业

CO 其中:食品、饮料

C1 纺织、服装、皮毛 C2 木材、家具

C7 机械、设备、仪表

C8 医药、生物制品

F 交通运输、仓储业

H 批发和零售贸 I 金融、保险业

L 传播与文化产

M 综合类

C99 其他制造业

C4 石油、化学、塑胶、塑料

D 电力、煤气及水的生产和供应业

B 采掘业

C5 电子

限行存款和结算备付金合证

报告期末按行业分类的股票投资

13

1、资产配置策略 本基金管理人将综合运用定量分析和定性分析手段。全面评估证券市场当期的系统性风险,并对可以 预见的未来时期内预期收益率进行分析与预测。在此基础上,制订本基金资产在股票,债券和现金等大类资 产的战场配置比例,调整原则和调整范围,并定期或不定期地进行调整。 所参考的主要指标包括: ① 废观经济总体走势。主要包括 GDP 增长率等指标; ② 货币与金融指标。主要包括对 M2 等货币供应指标以及长期国债的到期收益率指标进行研究与预

客户服务电话:95555 (或拨打各城市营业网点咨询电话) 网址:www.embchina.com 7)中国工商银行股份有限公司 住所:北京市西城区复兴门内大街 55 号

客服电店: 95366 例此: www.ciche.com.en 6) 光大银行股份有限公司 注册地址: 北京市西城区复兴门外大街 6号光大大厦 法定代表人, 唐双宁 客户客服电话: 95595 阿村·www.cebbank.com

网址:www.cebbank.com 9 屆泰君安证券股份有限公司 注册地址:上海市浦东新区商城路 618 号 办公地址:上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

客服电话:400-8888-666 地址:北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 法定代表人:王东明

客服电话:95558 网址:www.citics.com (1)光大证券股份有限公司 住所:上海市静安区新闸路 1508 号 法定代表人:徐浩明

各版七点:1010954 何比:www.ebsen.com (2)招商证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层 法定代表人: 宫少林 客户服务热线:95565.4008888111

网址:www.newone.com.cn (13)中信金通证券有限责任公司 住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯商务楼A座

网址:www.bigsun.com.cn 04)长城证券有限责任公司 住所:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

客服电话:0755-82288968 划址:www.cc168.com.cn (15) 海通证券股份有限公司 住所:上海市广东路 689 号 法定代表人:王开国 中服务电话:400-8888-001, 021)962503

窓户服免电话:400-8888-001, 021 962503 例址:www.hsec.com (6) 长江证券股份市限公司 住所:武汉市新华路特 8 号长江证券大厦 法定代表人:胡运钊 客户服务电话:4008-888-999 公司附址:www.95579.com (7) 坪泰联合证券市限责任公司 住所:溪圳市福田区深南大道 4011 号香港中旅大厦 25、24 楼 法定代表人:马昭明 客户服务电话:95513 公司附址:www.lbag.com

公司网址:www.lhzq.com (18)中信建投证券有限责任公司 住所:北京市朝阳区安立路 66号 4号楼 办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号 法定代表人:张佑君 客户服务电话:400-8888-108

各户服务电话:400-8888-108 公司网址:www.csc108.com (9)济鲁证券有限公司 注册地址:山东省济南市经十路128号 法定代表人:李玮 客户服务热线:95538

主册地址:长春市人民大街 138-1 号 去定代表人:矫正中

网址:www.nesc.em C1 謝海证券股份有限公司 注册地址:天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室 法定代表人:杜庆平 客户服务电话: 4006515988

生所:广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼 法定代表人:王志伟 客户服务电话:020-95575 网址:www.gf.com.cn 23)广发华福证券有限责任公司

注册地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

Frikmer, 0091-9020 网班:www.gifitay.com.en 04 /信达证券股份有限公司 注册地址:北京市西城区阔市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心 法定代表人,张志刚

网址:www.xyzq.com.cn 26 财富证券股份有限公司 注册地址:长沙市芙蓉中路 2 段 80 号顺天国际财富中心 26 层 法定代表人:周晖

客户服务电话:0731-4403340 注册地址:深圳市金田路大中华国际交易广场 8 楼 法定代表人:杨宇翔

客服热线:4008866338 网址:stock.pingan.com 28)东海证券有限责任公司

注册地址:江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼 各版: xxx: 1900000300 例址: xxxx: longone.com.cn 09 中国建银投资证券有限责任公司 注册地址: 深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层 法定代表人: 扬小阳

60 安信证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元 办公地址:深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 20 层 法定代表人: 牛冠兴 客户服务电话: 0755-8282555

网址:www.axzq.com.cn 61)国元证券股份有限公司 注册地址:合肥市寿春路 179 号 法定代表人:凤良志 客户服务热线:400-8888-777

住所:北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C座 户服条由话-4008-888-8888

网址:www.chinastock.com.cn 63)中信万通证券有限责任公司 主所:青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

山东路 90 号华泰证券大厦

客服电话:4008-000-562

网址:www.hysec.com 66)上海证券有限责任公司 注册地址:上海市西藏中路 336 号 法定代表人:郁忠民 客服电话:021-962518 各版电记1021-90216 例址:www.962518.com 67 民生证券有限责任公司 注册地址:北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座

研加:www.guosen.com.cn 仁 注册登记机构 名称:建信基金管理有限责任公司 住所:北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层 办公地址:北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层 沙公地址:北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

○ 出具法律意见书的律师事务所名称:北京市德恒律师事务所 主所:北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

电话:010-66575888 传真:010-65232181 经办律师:徐建军 李聪明 (四) 审计基金资产的会计师事务所 名称: 普华永道中天会计师事务所有限公司 住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼 办公地址:上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 世末1 被空 法定代表人: 物紹信 联系人: 陈宇 联系电话: 021-61238888 传真: 021-61238800 经办注册会计师: 薛竞 陈宇 四. 基金的名称

本基金名称:建信恒久价值股票型证券投资基金 五.基金的类型 本基本来型: """

[型基金。

六、基金的投资目标

序号 股票代码 数量(股) 600036 3,999,967 197,259,535.03 2 600016 7,999,826 156,519,027.34 3 600887 4,299,784 148,557,537.20

- 行业分类以 2011 年 3 月 31 日的中国证

5,000,000 6 000061 96,859,699.40 7 000848 4,008,565 92,517,680.20 8 000527 4,700,000 88,078,000,00 9 000063 2,700,000 81,000,000.00

| 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 | 130,208,000.00 | 3.80 | | | |
| 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 | 可转债 | 5,421,370.70 | 0.16 | | | |
| 7 | 其他 | _ | - | | | |
| | 合 计 | 135,629,370.70 | 3.96 | | | |
| 伍)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 | | | | | | |
| | | | | | | |

08央行票据 47 130,208,000.00 0801047 1,300,000 110013 110015 。 (六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

数量(张)

公允价值 (元)

债券名称

於、脫告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 本基金本报告期末未持有资产支持证券。 住、脫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 本基金本报告期末未持有权证。 (1) 投资组合报告附注。 8.1 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 到公开谴责、处罚。 8.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。 8.3 基础资产物的

| 8.3 其他资产构成 | | | | | | | |
|------------|--------------------|---------------|--|--|--|--|--|
| 序号 | 名 称 | 金 额 単位:人民币元) | | | | | |
| 1 | 存出保证金 | 5,144,550.08 | | | | | |
| 2 | 应收证券清算款 | 53,482,970.65 | | | | | |
| 3 | 应收股利 | - | | | | | |
| 4 | 应收利息 | 5,657,216.48 | | | | | |
| 5 | 应收申购款 | 759,548.17 | | | | | |
| 6 | 其他应收款 | - | | | | | |
| 7 | 待摊费用 | = | | | | | |
| 8 | 其他 | - | | | | | |
| | 合 计 | 65,044,285.38 | | | | | |
| 8.4 报告 | 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 | | | | | | |

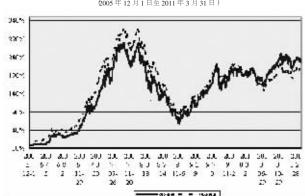
8.4 报台州水村市的发1.7 张观别的引导投票原外坍卸 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

债券代码

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。 十二、基金的业绩 基金业绩截止日为2011年3月31日。 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 生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。 1、本报告期基金份额争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 | |
|--|------------|-------------------|----------------|---------------------------|---------|--------|--|
| 2005年12月1日— 2005年12月 31日 | 0.56% | 0.09% | 5.01% | 0.54% | -4.45% | -0.45% | |
| 2006年1月1日— 2006年12月31日 | 74.23% | 1.11% | 84.33% | 1.05% | -10.10% | 0.06% | |
| 2007年1月1日— 2007年12月31日 | 102.72% | 1.95% | 104.97% | 1.72% | -2.25% | 0.23% | |
| 2008年1月1日-2008 年12月31日 | -49.94% | 2.28% | -52.23% | 2.24% | 2.29% | 0.04% | |
| 2009年1月1日— 2009年12月31日 | 73.26% | 1.74% | 66.86% | 1.51% | 6.40% | 0.23% | |
| 2010年1月1日— 2010年12月31日 | 8.39% | 1.34% | -5.55% | 1.18% | 13.94% | 0.16% | |
| 2011年1月1日— 2011年3月31日 | -1.90% | 1.18% | 1.90% | 1.03% | -3.80% | 0.15% | |
| 2005年 12 月 1 日— 2011年 3 月 31 日 | 227.56% | 1.71% | 204.35% | 1.58% | 23.21% | 0.13% | |
| 2、自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较 | | | | | | | |

建信恒久价值股票型证券投资基金 累计份额单值增长率与同期业绩比较基准收益率的 历史走势对比图 2005年12月1日至2011年3月31日)



的投资组合比例符合基金合同的要求。 十三、基金的费用概览

H=kx1,3%+3=+大xx H 为每日D时/提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值 基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费切付指令,基金托管人复 核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日,支付日

处。 6)基金杆管人的杆管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下: H=Ex0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复 核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日,支付日

核后于次月首日起3个工作日内从基金资产甲一次性又内安塞或让自八。在6月2、15月2、15月3年,期顺延。 6 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理 费率和基金托管费率,无项召升基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作 日在至少一种指定媒体上刊登公告。 本条第1款第6还第8项费用由基金管理人和基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按 费用实际支出金额支付,列人或牌人当期基金费用。 3、不列人基金费用的项目 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与 基金管作天的事项发生的费用等不列人基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师 费口及其他费用不从基金财产中支付。

费以及其他费用不从基金财产中支付。 (二)与基金销售有关的费用

1、中购员 本基金对申购设置级差费率,申购费率随申购金额的增加而递减,最高申购费率不超过1.5%:

年 ≤ 持有期<2年

赎回费用由赎回人承担,赎回费中25%归人基金资产,其余部分作为本基金用于支付注册登记费和其 少至的于沙坝。 3.基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实 3.4工作日内在至少一种指定媒体公告。

不同基金间转换的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定方式、锗如网上交易、电话交易)等定期或不定期

基金转换费用的具体计算公式如下: ① 转出金额=转出基金份额x转出基金当日基金份额净值

① 教任证金额=转任选金以可购47日至至二日至亚口40年18 ② 教人金额。 ①如果转人基金的申购费率-转出基金的申购费率, 转人金额—转出金额2 (1-时比基金赎回费率) (1-4转人基金申购费率—转出基金申购费率) ②如果转出基金的申购费率≥转人基金的申购费率, 转人金额+转出金额2 (1-转出基金赎回费率) ② 斧柱费费用-转出金额等人金额 (4-转人份额-转人金额转人基金当日基金份额争值。