

建信优化配置混合型证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012年 3 月 31 日

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,851,107,364.27	71.90
	其中：股票	4,851,107,364.27	71.90
2	固定收益投资	351,020,916.34	5.16
	其中：债券	351,020,916.34	5.16
3	金融衍生品投资	--	--
4	买入返售金融资产	632,801,549.20	9.30
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	--	--
5	银行存款和结算备付金合计	958,686,935.03	14.09
6	其他各项资产	10,569,085.78	0.16

代码	行业类别	公允价值(元)	公允价值占净值比例(%)	公允价值占净值比例(%)
代码	行业类别	公允价值(元)	公允价值占净值比例(%)	公允价值占净值比例(%)

序号	股票代码	股票名称	公允价值 (元)	公允价值占净值比例 (%)
1	000002	万科 A	26,448,178	220,466,913.84
2	000234	南方证券	9,351,455	59,496,221.66
3	000805	方正证券	2,497,753	15,090,181.70
4	000257	美的集团	12,416,195	162,908,470.24
5	000024	招商局 A	7,517,800	54,136,560.00
6	000568	泸州老窖	3,928,300	15,557,247.00
7	000048	保利地产	13,510,387	152,372,260.23
8	001336	新华保险	4,999,804	13,846,095.92
9	000001	平安银行	3,849,919	13,532,743.54
10	000887	伊利股份	6,329,823	53,209,298.92



9	合计	351,020,916.34	5.18
---	----	----------------	------

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	公允价值占净值比例(%)
1	110003	11国债(3)	1,183,750	120,901,904.15	1.79
2	110005	11国债(5)	1,000,000	100,000,000.00	1.43
3	275709	国债逆回购	771,283	83,324,016.34	1.23
4	110018	11国债(18)	500,000	50,095,000.00	0.74

5.6 报告期末公允价值占基金资产净值比例大于或等于 3% 的资产支持证券投资情况

本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.7 报告期末公允价值占基金资产净值比例大于或等于 3% 的前五名权证投资情况

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末受限资产情况

5.8.1 本基金投资受限资产

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。

5.8.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,540,837.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,794,074.59
5	应收申购款	234,153.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,569,085.78

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占合并资产负债表比例(%)
----	------	------	---------	---------------

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(%)	流通受限资 产情况
1	110003	宝钢转债	129,931,900.00	1.79	
2	125790	南钢转债	83,324,016.34	1.23	
5.8.5 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(%)	流通受限资 产情况
1	000895	双汇发展	172,095,181.70	2.54	无重大资产重 估
§6 开放式基金份额变动					
单位：份					
本报告期内基金份额总额			9,299,547,998.33		
本报告期内基金申购份额			40,273,666.03		
本报告期间基金赎回份额			120,933,240.00		

2012 第一季度 报告

	20.02
--	-------

9	其他				
9	合计		873,086,241.00	106.49	
5.5 报告期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	113001	中行转债	845.150	80,052,608.00	9.76
2	1182361	11风传转债 MTN1	600.000	61,224,000.00	7.47
3	019121	11国信 21	600.000	60,948,000.00	7.43
4	113002	工行转债	471.540	51,053,635.80	6.23
5	0980155	09新嘉转债	500.000	49,405,000.00	6.03
5.6 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					
本基金本报告期末未持有资产支持证券。					
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细					
本基金本报告期末未持有权证。					
5.8 投资组合报告附注					
5.8.1 本基金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。					
5.8.2 本基金投资的前十名股票未出现基金合同约定的投资范围。					
5.8.3 其他资产构成					
序号	名称	金额(人民币元)			
1	存出保证金	500,000.00			
2	应收证券清算款				

3	应收股利	-
---	------	---



项目	建信收益增强债券 A	建信收益增强债券 C
----	------------	------------

本报告期初基金份额总额	349,978,174.06	446,121,198.83
本报告期基金总申购份额	16,646,170.75	913,667,106.43
减：本报告期基金总赎回份额	40,816,905.32	927,364,297.43
本报告期基金份额变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	325,807,439.49	432,424,007.83

注：1.申购份额含转换入份额，2.赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准建信收益增强债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《建信收益增强债券型证券投资基金合同》；
3. 《建信收益增强债券型证券投资基金托管协议》；
4. 关于申请募集建信收益增强债券型证券投资基金的法律意见书；
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指定报刊上披露的各项公告；
8. 存放地点
备查文件目录第 5 至第 7 项备查文件存放在基金管理人办公场所、营业场所；第 6 项文件存放在基金托管人办公场所。
9. 查阅方式
基金投资者在营业时间内可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复制件。

建信基金管理有限责任公司
二〇一二年四月二十三日