

建信保本混合型证券投资基金

2012 第二季度 报告

國號年6月癸日

	其中按断式回购的买入返售金融资产	原	原
续	银行存款和结算备付金合计	续	续
远	其他各项资产	远	远
苑	合计	苑	苑

代码	行业类别	公允价值占比	占基金资产净值比例
粤	农林牧渔业	原	原
月	采掘业	原	原
月	房地产业	原	原

纺织	食品/饮料	医药	医药
纺织	纺织/服装/皮毛	化学原料及化学制品	化学原料及化学制品
纺织	木材/家具	医药	医药
纺织	造纸/印刷	医药	医药
纺织	石油/化学/橡胶/塑料	医药原料及化学制品	医药原料及化学制品
纺织	电子	医药	医药
纺织	金属/非金属	医药	医药
纺织	机械/设备/仪表	医药原料及化学制品	医药原料及化学制品
纺织	医药/塑料制品	医药	医药
纺织	其他制造业	医药	医药
医	电力/燃气及水的生产和供应业	医药	医药
医	建筑业	医药	医药
云	交通运输/仓储业	医药	医药
邮	信息技术业	医药	医药
勾	批发和零售业	医药	医药
淘	金融/服务业	医药	医药
允	房地产业	医药	医药
福	社会服务业	医药原料及化学制品	医药原料及化学制品
道	农、林、牧、渔业	医药	医药

配	组合类	是	是
合计		是	是

注：以上行业分类以《深圳证券交易所上市公司行业分类指引》为依据。

根据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	股票名称	股票代码	数量/股	公允价值/元	占基金资产净值比例/%
1	宁德时代	宁德时代	1,000,000	1,000,000.00	1.00%
2	比亚迪	比亚迪	1,000,000	1,000,000.00	1.00%
3	隆基股份	隆基股份	1,000,000	1,000,000.00	1.00%
4	阳光电源	阳光电源	1,000,000	1,000,000.00	1.00%
5	汇川技术	汇川技术	1,000,000	1,000,000.00	1.00%
6	格力电器	格力电器	1,000,000	1,000,000.00	1.00%
7	美的集团	美的集团	1,000,000	1,000,000.00	1.00%
8	海尔智家	海尔智家	1,000,000	1,000,000.00	1.00%
9	海信视像	海信视像	1,000,000	1,000,000.00	1.00%
10	海信家电	海信家电	1,000,000	1,000,000.00	1.00%

根据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	国债	1,000,000.00	1.00%
2	央行票据	1,000,000.00	1.00%
3	金融债	1,000,000.00	1.00%
4	企业债	1,000,000.00	1.00%
5	可转债	1,000,000.00	1.00%
6	其他	1,000,000.00	1.00%

其中：政策性金融债	1,434,400,000.00	2.00%
企业债	1,434,400,000.00	2.00%
企业短期融资券	1,434,400,000.00	2.00%
中期票据	1,434,400,000.00	2.00%
其他	1,434,400,000.00	2.00%
合计	5,737,600,000.00	7.92%

报告期内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	持仓名称	持仓名称	数量/持仓量	公允价值/持仓量	公允价值/持仓量
1	中国工商银行	中国工商银行	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	中国工商银行
2	中国建设银行	中国建设银行	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	中国建设银行
3	交通银行	交通银行	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	交通银行
4	招商银行	招商银行	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	招商银行
5	浦发银行	浦发银行	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	浦发银行
6	中信银行	中信银行	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	中信银行
7	民生银行	民生银行	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	民生银行
8	兴业银行	兴业银行	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	兴业银行
9	光大银行	光大银行	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	光大银行
10	华夏银行	华夏银行	1,000,000,000.00	1,000,000,000.00	华夏银行

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。

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。

④基金本报告期内投资前十名证券的发行主体均无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基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的投资范围。

⑥报告期末各项资产构成

序号	名称	金额/单位
1	货币资金	1,000,000.00
2	应收证券清算款	1,000,000.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	0.00
5	应收申购款	1,000,000.00
6	其他应收款	0.00
7	预付费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	3,000,000.00

报告期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/账面	占基金资产净值比例(%)	
员	128006(SH)	中银行转债	1,070,000.00元(人民币)	1.00%	
圆	128006(SH)	宝钢转债	1,070,000.00元(人民币)	1.00%	
员	128006(SH)	石化转债	1,070,000.00元(人民币)	1.00%	
源	128006(SH)	莱钢转债	1,070,000.00元(人民币)	1.00%	
缘	128006(SH)	国电转债	1,070,000.00元(人民币)	1.00%	
远	128006(SH)	节能环保	1,070,000.00元(人民币)	1.00%	

报告期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/账面	占基金资产净值	流通受限情
员	600560(SH)	津滨科技	1,070,000.00元(人民币)	1.00%	网上发行申 购中,暂未上 市

开放式基金份额变动

		单位:份
本报告期初基金份额总额		1,070,000.00元(人民币)
本报告期基金申购份额		1,070,000.00元(人民币)
减:本报告期基金赎回份额		1,070,000.00元(人民币)
本报告期基金拆分变动份额		无
本报告期末基金份额总额		1,070,000.00元(人民币)

注:总申购份额转换成转入份额,总赎回份额转换成转出份额。

四、报告文件目录

- 1、中国证监会批准建信保本混合型证券投资基金设立的文件;
- 2、建信保本混合型证券投资基金合同;
- 3、建信保本混合型证券投资基金招募说明书;
- 4、建信保本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指定报刊上披露的各项公告。

(五) 指定地点:

基金管理人或基金托管人处。

(六) 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。

五、其他事项

建信基金管理有限责任公司

民國2年6月癸日

报告期末基金资产组合情况			
基金资产组合	基金资产组合	基金资产组合	基金资产组合

注：以上行业分类以《国民经济行业分类》和《上市公司行业分类指引》为依据。

续：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(万股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------	---------	--------------

吴	上海浦东发展银行	贵州茅台	贵州茅台酒股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司	控股股东
同	上海浦东发展银行	新华保险	新华保险(集团)股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司	控股股东
源	上海浦东发展银行	民生银行	中国民生银行	上海浦东发展银行股份有限公司	控股股东
源	上海浦东发展银行	金地集团	金地(集团)股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司	控股股东
源	上海浦东发展银行	洋河股份	江苏洋河酒厂股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司	控股股东
远	上海浦东发展银行	威宁高科	威宁高科集团有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司	控股股东
先	上海浦东发展银行	万科物业	万科企业股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司	控股股东
先	上海浦东发展银行	保利地产	保利地产股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司	控股股东

[illegible]

前	存出保证金多	
期	应收证券清算款	(应收证券清算款)
项	应收账款	(应收账款)
目	应收利息	(应收利息)
续	应收申购款	(应收申购款)
远	其他应收款	
准	待摊费用	(待摊费用)
照	其他	
部	合计	(资产总计)

续后报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
 本基金本报告期末未持有可转换债券。
 续后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。

§ 开放式基金份额变动

	单位：份
本报告期初基金份额总额	(本报告期初基金份额总额)
本报告期基金总申购份额	(本报告期基金总申购份额)
减：报告期基金总赎回份额	(本报告期基金总赎回份额)
本报告期基金拆分变动份额	(本报告期基金拆分变动份额)
本报告期末基金份额总额	(本报告期末基金份额总额)

注：①申购份额含转入份额，总赎回份额含转出赎回份额。

§ 备查文件目录

一、 备查文件目录
 1. 中国证监会批准建信内生动力股票型证券投资基金设立的文件；
 2. 国证内生动力股票型证券投资基金合同书；
 3. 国证内生动力股票型证券投资基金招募说明书；
 4. 国证内生动力股票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及指定媒体上披露的各项公告。

二、 查阅地点：
 基金管理人或基金托管人处。

三、 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