

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:二〇一二年八月二十八日

建信恒稳价值混合型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

2.1 基金基本情况
2.2 基金产品说明
2.3 基金管理人基本情况
2.4 信息披露方式

2.5 主要会计数据和财务指标
3.1 主要会计数据和财务指标
3.2 基金净值表现

Table with 2 columns: Item, Value. Details of fund basic information.

Table with 4 columns: Item, Reference, Current Period, Previous Period. Financial indicators.

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

Table with 5 columns: Period, Fund Net Value Growth Rate, Benchmark Growth Rate, Difference, etc.

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金成立于2011年11月22日,截止报告期末满一年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

Table with 5 columns: Period, Fund Net Value Growth Rate, Benchmark Growth Rate, Difference, etc.

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金成立于2011年11月22日,截止报告期末满一年。
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率变动的比较

6.4.4.7 关联交易

6.4.4.7 关联交易
6.4.4.8 关联交易
6.4.4.9 关联交易

6.4.4.11 费用确认和计提

6.4.4.11 费用确认和计提
6.4.4.12 费用确认和计提

6.4.4.13 费用确认和计提

6.4.4.13 费用确认和计提
6.4.4.14 费用确认和计提

6.4.4.15 费用确认和计提

6.4.4.15 费用确认和计提
6.4.4.16 费用确认和计提

6.4.4.17 费用确认和计提

6.4.4.17 费用确认和计提
6.4.4.18 费用确认和计提

6.4.4.19 费用确认和计提

6.4.4.19 费用确认和计提
6.4.4.20 费用确认和计提

6.4.4.21 费用确认和计提

6.4.4.21 费用确认和计提
6.4.4.22 费用确认和计提

6.4.4.23 费用确认和计提

6.4.4.23 费用确认和计提
6.4.4.24 费用确认和计提

6.4.4.25 费用确认和计提

6.4.4.25 费用确认和计提
6.4.4.26 费用确认和计提

6.4.4.27 费用确认和计提

6.4.4.27 费用确认和计提
6.4.4.28 费用确认和计提

6.4.4.29 费用确认和计提

6.4.4.29 费用确认和计提
6.4.4.30 费用确认和计提

6.4.4.31 费用确认和计提

6.4.4.31 费用确认和计提
6.4.4.32 费用确认和计提

6.4.4.33 费用确认和计提

6.4.4.33 费用确认和计提
6.4.4.34 费用确认和计提

6.4.4.35 费用确认和计提

6.4.4.35 费用确认和计提
6.4.4.36 费用确认和计提

6.4.4.37 费用确认和计提

6.4.4.37 费用确认和计提
6.4.4.38 费用确认和计提

6.4.4.39 费用确认和计提

6.4.4.39 费用确认和计提
6.4.4.40 费用确认和计提

6.4.4.41 费用确认和计提

6.4.4.41 费用确认和计提
6.4.4.42 费用确认和计提

6.4.4.43 费用确认和计提

6.4.4.43 费用确认和计提
6.4.4.44 费用确认和计提

6.4.4.45 费用确认和计提

6.4.4.45 费用确认和计提
6.4.4.46 费用确认和计提

6.4.4.47 费用确认和计提

6.4.4.47 费用确认和计提
6.4.4.48 费用确认和计提

6.4.4.49 费用确认和计提

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 10 stock holdings.

注:以上行业分类以2012年6月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Buy Amount, Fair Value, Ratio. Top 20 stock purchases.

注:以上买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Sell Amount, Fair Value, Ratio. Top 20 stock sales.

注:以上买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

7.4.3 买入股票的成本/减值准备/公允价值变动损益/其他综合收益

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Cost, Impairment, etc. Stock transaction details.

注:以上买入股票的成本/减值准备/公允价值变动损益/其他综合收益

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Bond portfolio details.

7.6 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 5 bond holdings.

7.7 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 10 asset-backed securities.

7.8 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 5 warrant holdings.

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金投资的前十名证券的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。

7.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 期末按各项资产分类

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Asset classification details.

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.6 本基金投资的前十名权证未持有流通受限情况的说明

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Shareholder structure details.

8.2 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 10 asset-backed securities.

8.3 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 5 warrant holdings.

8.4 投资组合报告附注

8.4.1 本基金投资的前十名证券的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。

8.4.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.4.3 期末按各项资产分类

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Asset classification details.

8.4.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.4.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.4.6 本基金投资的前十名权证未持有流通受限情况的说明

8.4.7 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Shareholder structure details.

8.4.8 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 10 asset-backed securities.

8.4.9 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 5 warrant holdings.

8.4.10 投资组合报告附注

8.4.10.1 本基金投资的前十名证券的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。

8.4.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.4.10.3 期末按各项资产分类

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Asset classification details.

8.4.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.4.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.4.10.6 本基金投资的前十名权证未持有流通受限情况的说明

8.4.10.7 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Shareholder structure details.

8.4.10.8 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 10 asset-backed securities.

8.4.10.9 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 5 warrant holdings.

8.4.10.10 投资组合报告附注

8.4.10.10.1 本基金投资的前十名证券的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。

8.4.10.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.4.10.10.3 期末按各项资产分类

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Asset classification details.

8.4.10.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.4.10.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.4.10.10.6 本基金投资的前十名权证未持有流通受限情况的说明

8.4.10.10.7 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Shareholder structure details.

8.4.10.10.8 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 10 asset-backed securities.

8.4.10.10.9 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 5 warrant holdings.

8.4.10.10.10 投资组合报告附注

8.4.10.10.10.1 本基金投资的前十名证券的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。

8.4.10.10.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.4.10.10.10.3 期末按各项资产分类

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Asset classification details.

8.4.10.10.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.4.10.10.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.4.10.10.10.6 本基金投资的前十名权证未持有流通受限情况的说明

8.4.10.10.10.7 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Shareholder structure details.

8.4.10.10.10.8 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 10 asset-backed securities.

8.4.10.10.10.9 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 5 warrant holdings.

8.4.10.10.10.10 投资组合报告附注

8.4.10.10.10.10.1 本基金投资的前十名证券的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。

8.4.10.10.10.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.4.10.10.10.10.3 期末按各项资产分类

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Asset classification details.

8.4.10.10.10.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.4.10.10.10.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.4.10.10.10.10.6 本基金投资的前十名权证未持有流通受限情况的说明

8.4.10.10.10.10.7 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Shareholder structure details.

8.4.10.10.10.10.8 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 10 asset-backed securities.

8.4.10.10.10.10.9 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 5 warrant holdings.

8.4.10.10.10.10.10 投资组合报告附注

8.4.10.10.10.10.10.1 本基金投资的前十名证券的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。

8.4.10.10.10.10.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.4.10.10.10.10.10.3 期末按各项资产分类

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Asset classification details.

8.4.10.10.10.10.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.4.10.10.10.10.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.4.10.10.10.10.10.6 本基金投资的前十名权证未持有流通受限情况的说明

8.4.10.10.10.10.10.7 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Shareholder structure details.

8.4.10.10.10.10.10.8 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 10 asset-backed securities.

8.4.10.10.10.10.10.9 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 5 warrant holdings.

8.4.10.10.10.10.10.10 投资组合报告附注

8.4.10.10.10.10.10.10.1 本基金投资的前十名证券的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。

8.4.10.10.10.10.10.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.4.10.10.10.10.10.10.3 期末按各项资产分类

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Asset classification details.

8.4.10.10.10.10.10.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.4.10.10.10.10.10.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.4.10.10.10.10.10.10.6 本基金投资的前十名权证未持有流通受限情况的说明

8.4.10.10.10.10.10.10.7 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Shareholder structure details.

8.4.10.10.10.10.10.10.8 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 10 asset-backed securities.

8.4.10.10.10.10.10.10.9 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 5 warrant holdings.

8.4.10.10.10.10.10.10.10 投资组合报告附注

8.4.10.10.10.10.10.10.10.1 本基金投资的前十名证券的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。

8.4.10.10.10.10.10.10.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.4.10.10.10.10.10.10.10.3 期末按各项资产分类

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Asset classification details.

8.4.10.10.10.10.10.10.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.4.10.10.10.10.10.10.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.4.10.10.10.10.10.10.10.6 本基金投资的前十名权证未持有流通受限情况的说明

8.4.10.10.10.10.10.10.10.7 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: Rank, Code, Name, Fair Value, Ratio. Shareholder structure details.

8.4.10.10.10.10.10.10.10.8 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 10 asset-backed securities.

8.4.10.10.10.10.10.10.10.9 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

Table with 6 columns: Rank, Code, Name, Quantity, Fair Value, Ratio. Top 5 warrant holdings.

8.4.10.10.10.10.10.10.10.10 投资组合报告附注

</