

建信保本混合型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年九月二十六日

重要提示
基金管理人及董事等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。

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年九月二十六日

主要财务指标
单位:人民币元
报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)

1.本期已实现收益 21,076,909.01

2.本期利润 2,204,127.33

3.加权平均基金份额本期利润 0.0011

4.期末基金资产净值 2,049,376,506.53

5.期末基金份额净值 1.028

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.本基金净值增长率扣除持有人认购基金的各项费用,计入费用后实际净值增长率低于同期业绩比较基准。

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.10% 0.06% 1.10% 0.01% -1.00% 0.05%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.10% 0.06% 1.10% 0.01% -1.00% 0.05%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.10% 0.06% 1.10% 0.01% -1.00% 0.05%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.10% 0.06% 1.10% 0.01% -1.00% 0.05%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.10% 0.06% 1.10% 0.01% -1.00% 0.05%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.10% 0.06% 1.10% 0.01% -1.00% 0.05%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.10% 0.06% 1.10% 0.01% -1.00% 0.05%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.10% 0.06% 1.10% 0.01% -1.00% 0.05%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.10% 0.06% 1.10% 0.01% -1.00% 0.05%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.10% 0.06% 1.10% 0.01% -1.00% 0.05%

3.2.2.本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

一步降低,我们预期四季度经济企稳回升的力度和速度仍然偏弱,资本市场难以有很强表现,我们将密切关注政府政策和实体经济动向,及时调整资产配置,力争为基金份额持有人创造长期稳定的投资回报。

5. 投资组合报告

8.1 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 13,794,884.69 0.67

2 固定收益 13,794,884.69 0.67

3 金融衍生品投资 - -

4 买入返售金融资产 47,500,191.25 2.31

5 其中:买断式回购的买入返售金融资产 2,550,911.08 0.12

6 其他金融资产 1,935,087,065.94 93.90

7 合计 2,060,743,976.25 100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林牧渔 - -

B 制造业 8,772,884.69 0.43

C 采矿业 - -

D 食品饮料 - -

E 医药生物 - -

F 信息技术 - -

G 公用事业 - -

H 房地产业 - -

I 金融业 - -

J 其他行业 - -

合计 13,794,884.69 0.67

注:1.以上行业分类以2012年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.3 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 002344 海宁皮业 200,000 5,022,000.00 0.25

2 600101 康恩药业 200,000 4,616,000.00 0.23

3 600967 东方创业 249,963 4,156,884.69 0.20

4 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

5 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

6 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

7 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

8 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

9 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

10 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

11 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

12 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

13 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

14 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

15 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

16 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

17 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

18 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

19 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

20 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

21 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

22 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

23 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

24 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

25 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

26 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

27 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

28 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

29 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

30 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

31 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

32 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

33 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

34 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

35 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

36 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

37 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

38 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

39 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

40 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

41 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

42 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

43 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

44 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

45 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

46 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

47 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

48 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

49 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

50 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

51 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

52 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

53 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

54 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

55 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

56 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

57 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

58 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

59 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

60 002001 新和成 200,000 4,156,884.69 0.20

建信内生动力股票型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年九月二十六日

重要提示
基金管理人及董事等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。

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年九月二十六日

主要财务指标
单位:人民币元
报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)

1.本期已实现收益 -17,862,725.68

2.本期利润 -177,135,966.66

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0451

4.期末基金资产净值 3,304,460,492.67

5.期末基金份额净值 0.838

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.本基金净值增长率扣除持有人认购基金的各项费用,计入费用后实际净值增长率低于同期业绩比较基准。

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -5.10% 0.89% -5.19% 0.89% 0.09% 0.00%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -5.10% 0.89% -5.19% 0.89% 0.09% 0.00%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -5.10% 0.89% -5.19% 0.89% 0.09% 0.00%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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 净值增长率基准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -5.10% 0.89% -5.19% 0.89% 0.09% 0.00%

3.2.2.本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

2.本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

3.2.1.本报告期末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