
建信收益增强债券型证券投资基金
2010 年年度报告摘要

2010 年 12 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月二十八日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所有限公司为基金财务出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信收益增强债券型证券投资基金	
基金简称	建信增强债券	
基金主代码	530009	
交易代码	530009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 6 月 2 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,286,298,716.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信增强债券 A	建信增强债券 C
下属分级基金的交易代码	530009	531009
报告期末下属分级基金的份额总额	501,317,355.96 份	784,981,360.52 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持资产流动性的基础上，发挥投研团队在固定收益、股票及金融衍生产品方面的综合研究实力，在有效控制风险的前提下追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建信用类债券投资组合，运用基本面研究择机介入上市公司股票及参与新股申购，以实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	30%×中债企业债总指数+70%×中债国债总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，但高于货币市场基金以及不涉及股票二级市场投资的债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	李芳菲
	联系电话	010-66228888	010-63201510

	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-81-95533, 010-66228000	95599
传真		010-66228001	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年		2009 年 6 月 2 日至 2009 年 12 月 31 日		2008 年	
	建信增强债券 A	建信增强债券 C	建信增强债券 A	建信增强债券 C	建信增强债券 A	建信增强债券 C
本期已实现收益	62,950,491.39	110,092,641.08	36,647,032.05	66,061,713.78	-	-
本期利润	56,604,867.63	99,664,287.77	58,650,278.74	113,966,509.14	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0909	0.0851	0.0326	0.0302	-	-
本期基金份额净值增长率	9.67%	9.21%	3.40%	3.20%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末		2009 年末		2008 年末	
	建信增强债券 A	建信增强债券 C	建信增强债券 A	建信增强债券 C	建信增强债券 A	建信增强债券 C
期末可供分配基金份额利润	0.1306	0.1232	0.0255	0.0231	-	-
期末基金资产净值	568,519,576.98	884,441,527.90	990,272,495.84	2,045,857,554.92	-	-
期末基金份额净值	1.134	1.127	1.034	1.032	-	-

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（不含公允价值变动收益）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收益。

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，至 2009 年 12 月 31 日未满一年。

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

建信增强债券 A:

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
过去三个月	3.47%	0.41%	-2.88%	0.18%	6.35%	0.23%
过去六个月	8.72%	0.32%	-1.85%	0.14%	10.57%	0.18%
过去一年	9.67%	0.28%	2.57%	0.12%	7.10%	0.16%
自基金合同生效起至今	13.40%	0.28%	1.86%	0.10%	11.54%	0.18%

注：本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，至本报告截止日 2010 年 12 月 31 日未
满两年。

建信增强债券 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	3.39%	0.42%	-2.88%	0.18%	6.27%	0.24%
过去六个月	8.57%	0.32%	-1.85%	0.14%	10.42%	0.18%
过去一年	9.21%	0.29%	2.57%	0.12%	6.64%	0.17%
自基金合同生效起至今	12.70%	0.28%	1.86%	0.10%	10.84%	0.18%

注：本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，至本报告截止日 2010 年 12 月 31 日未
满两年。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

建信收益增强债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009 年 6 月 2 日至 2010 年 12 月 31 日)

建信增强债券 A

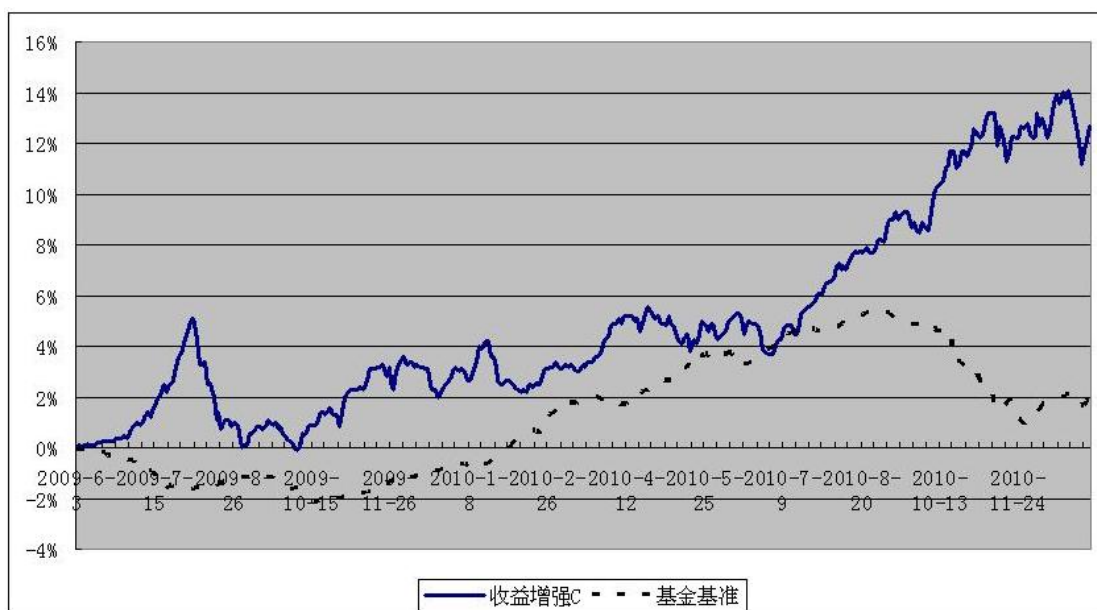


注：1、本基金债券类资产(含可转换债券)投资比例不低于基金资产的 80%，其中，本基金持有公司债、金融债、企业债、资产支持证券等除国债、中央银行票据以外的固定收益类资产的比例不低于债券资产的 30%，本基金投资于股票(含一级市场新股申购)等权益类品种的比例为基金资产的 0-20%，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

2、根据基金合同，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3、建仓期满后，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

建信增强债券 C



注：1、本基金债券类资产(含可转换债券)投资比例不低于基金资产的 80%，其中，本基金持有公司债、金融债、企业债、资产支持证券等除国债、中央银行票据以外的固定收益类资产的比例不低于债券资产的 30%，本基金投资于股票(含一级市场新股申购)等权益类品种的比例为基金资产的 0-20%，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

2、根据基金合同，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

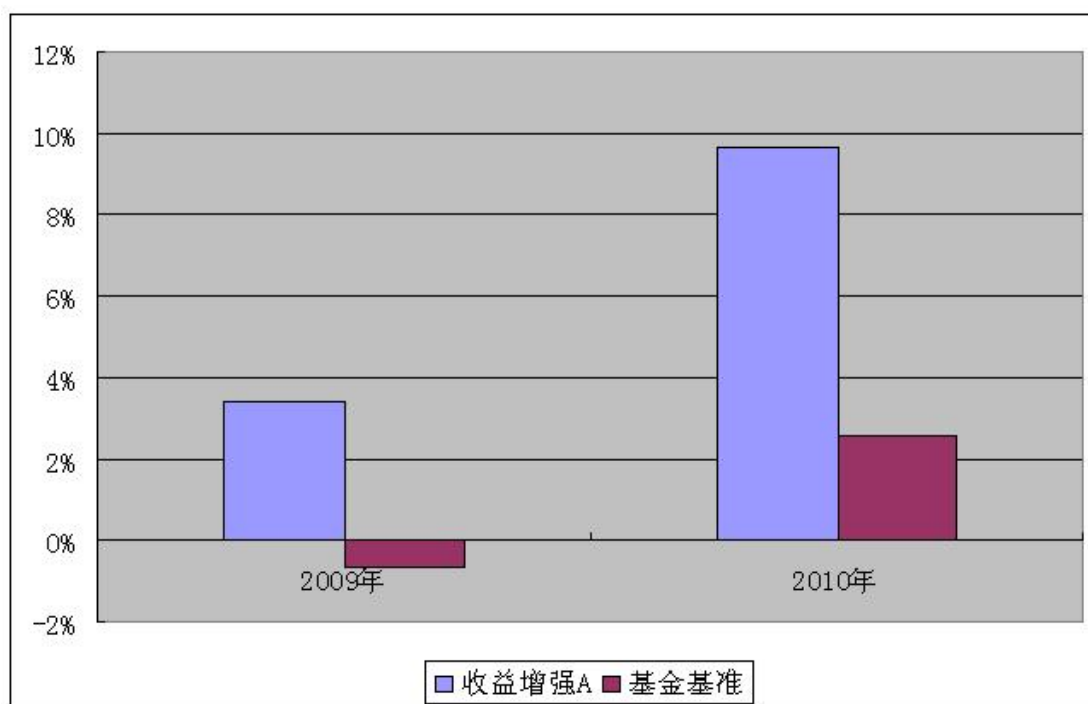
3、建仓期满后，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信收益增强债券型证券投资基金

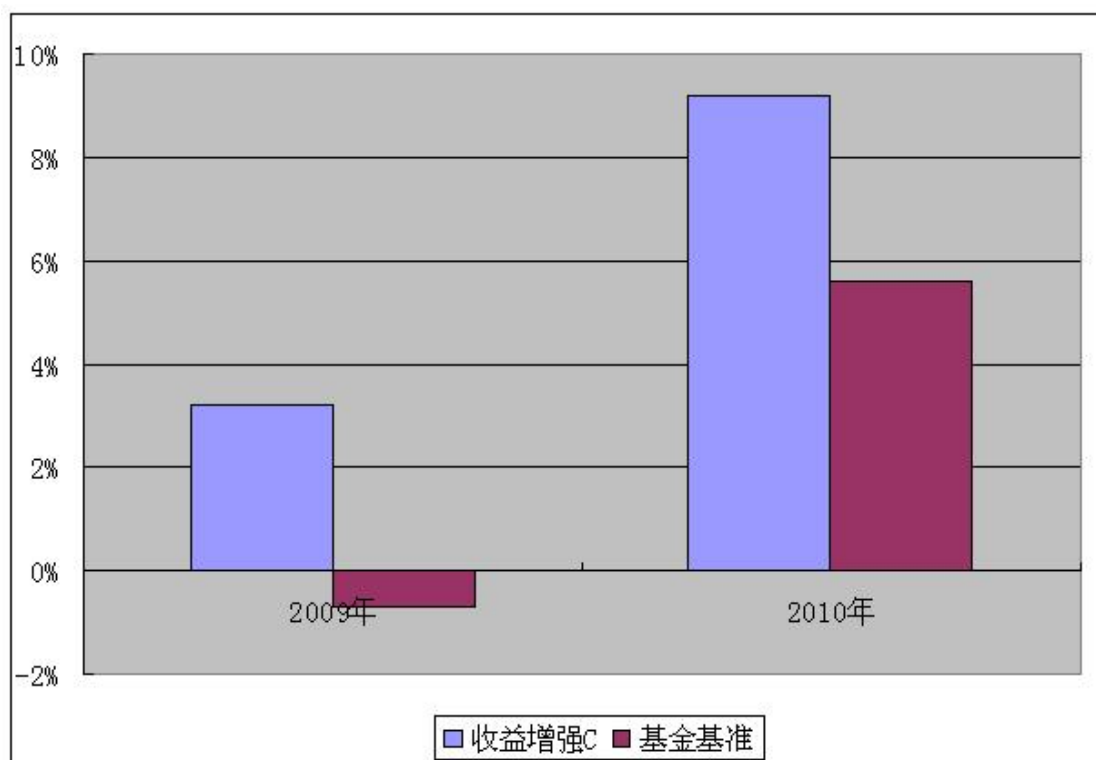
合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

建信增强债券 A



注：本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，至本报告截止日 2010 年 12 月 31 日未
满两年，2009 年净值增长率以实际存续期计算。

建信增强债券 C



注：本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，至本报告截止日 2010 年 12 月 31 日未
满两年，2009 年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

1、建信增强债券 A：

自基金合同生效以来，本基金未实施利润分配。

2、建信增强债券 C：

自基金合同生效以来，本基金未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、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、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司。自成立以来，公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“最可信赖、持续领先的资产管理公司”。截至 2010 年 12 月 31 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金 12 只开放式基金和建信优势动力股票型证券投资基金一只创新封闭式基金，管理的基金资产规模共计为 485.66 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钟敬棣先生	本基金基金经理	2009-06-02	-	5	CFA，硕士；加拿大籍华人。1995 年 7 月毕业于南开大学金融系，获经济学学士学位，2004 年 5 月毕业于加拿大不列颠哥伦比亚大学，获工商管理硕士学位。曾先后任职于广东发展银行珠海分行、深圳发展银行珠海分行、嘉实基金管理有限公司等，从事外汇交易、信贷、债券研究及投资组合管理等工作。2008 年 5 月加入建信基金管理有限责任公司。2008 年 8 月 15 日起任建信稳定增利债券基金的基金经理。
李菁女士	本基金的基金经理	2009-06-02	-	5	硕士。2002 年 7 月进入中国建设银行股份有限公司基金托管部工作，从事基金托管业务，任主任科员。2005 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，先后任债券研究员和基金经理助理。2007 年 11 月 1 日起任建信货币市场基金的基金经理。

卓利伟先生	本基金的 基金经理	2009-06-27	-	5	1994年毕业于浙江工业大学，获得学士学位。2005年毕业于浙江大学工商管理专业，获硕士学位。曾就职于杭州经济建设集团工商公司投资部、北京恒逸实业有限公司投资部、上海石油交易所筹备组、百荣投资控股集团投资部等。2005年9月加入本公司，先后担任行业研究员、高级行业研究员和基金经理助理、基金经理、资深基金经理等职。2009年3月25日起任建信恒久价值基金的基金经理；2010年11月16日起任建信内生动力股票基金的基金经理。
-------	--------------	------------	---	---	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，本基金管理人不存在与本基金投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年政府整体政策整体偏向调结构过程，年初随着各项经济活动指标的高位运行以及房价在一季度末的短暂飙升，信贷额度控制、清理地方政府融资平台、抑制房地产泡沫、节能减排政策、取消出口退税以及汇率等政策频出，使得二季度后经济增速逐步放缓。随着居民物价指数在下半年逐月攀升，欧美经济体的持续量化宽松政策使得国内面临的物价环境更趋复杂，下半年货币政策开始全面趋紧，利率和数量政策频出，以控制信贷并抑制通胀。

综观全年债券市场，上半年在充裕资金和经济增速下滑预期的推动下，债券市场各品种利率维持低位，但随着 5 月下旬资金面趋紧各品种收益率均有所上升，下半年尤其是四季度加息后，债市经历了大幅调整，收益率较年初大幅上行。股票市场则经历了上半年大幅下跌、三季度冲高继而回落的震荡行情。

回顾全年的基金管理工作，作为股票收益增强的债券型基金，本基金全年基本维持偏低的组合久期，在二季度末适度参与了波动操作，并在控制风险的前提下对信用产品进行适度的滚动投资，在四季度末加大了高收益信用产品配置比例。权益市场方面，上半年采取了积极防御策略，在三季度加大了转债品种的配置，精选个股并谨慎参与了新股投资，取得了一定的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010 年本基金 A 净值增长率为 9.67%，波动率为 0.28%，业绩比较基准收益率为 2.57%，波动率为 0.12%。

2010 年本基金 C 净值增长率为 9.21%，波动率为 0.29%，业绩比较基准收益率为 2.57%，波动率为 0.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新年，我们认为全年宏观经济运行仍然将较为平稳，经济增速仍将保持在相对高位，但通胀水平仍将是市场关注的焦点，而如何控制通胀以及调整居民通胀预期将至少是上半年政策调控的重心，而政策调控的力度也将在一定程度上影响未来经济增长的速度。新年伊始，准备金率和利率政策频出，地产调控政策进一步从严，显示政府抑制通胀、关注民生、稳定经济政治发展局面的决心。外围经济的逐步趋好和宽松政策退出的步伐和节奏增加了政府调控政策的复杂性。我们认为政策层面上，央行仍然会延续数量和利率工具并用的策略，而是否能有效控制信贷的投放成为后续关注重点。

整体而言，我们认为债券市场方面，随着资金成本的逐步抬升，上半年利率产品仍将难有起色，而高收益且流动性尚可的信用产品或将受到市场的追捧，通胀是否能抑制住以及抑

制通胀带来对经济增长的影响程度将决定下半年债券品种的走势。权益市场方面，我们认为在流动性逐步趋紧的情况下，难以实现系统性的估值扩张，但部分长期估值具备安全边际和增长比较确定且有持续性的股票仍具有一定投资价值。

本基金仍将维持偏低的久期策略，加强组合投资的灵活性，并在控制风险的前提下进行信用产品的滚动投资以提高组合的收益率，权益市场方面，采取相对防御与均衡的投资策略，精选个股，力求为持有人获得较好的绝对收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本报告期内，公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，本基金可供分配利润为 162,209,842.70 元（其中：建信增强债券 A 期末可供分配利润为 65,471,221.12 元，建信增强债券 C 期末可供分配利润为 96,738,621.58 元）。本报告期内未实施利润分配，符合基金合同中关于分红条款的相关规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管建信收益增强债券型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》、《建信收益增强债券型投资基金托管协议》的约定，对建信收益增强债券型证券投资基金管理人—建信基金管理有限公司 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司在建信收益增强债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的建信收益增强债券型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部

2011 年 3 月 23 日

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司审计了后附的建信收益增强债券型证券投资基金

(以下简称“建信收益增强基金”)的财务报表,包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了普华永道中天审字(2011)第 21252 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:建信收益增强债券型证券投资基金

报告截止日:2010 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产:			
银行存款		71,406,605.02	956,666,210.03
结算备付金		16,353,729.72	6,132,754.09
存出保证金		454,408.04	1,935,950.63
交易性金融资产		1,486,279,892.35	3,085,815,798.03
其中:股票投资		254,258,484.53	496,412,832.80
基金投资		-	-
债券投资		1,232,021,407.82	2,589,402,965.23
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		2,000,899.96	-
应收利息		9,752,620.28	19,852,002.72
应收股利		-	-
应收申购款		13,390,226.34	317,383.79
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,599,638,381.71	4,070,720,099.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		75,000,000.00	965,598,800.00
应付证券清算款		65,047,952.06	15,541,551.64

应付赎回款		4,027,608.37	47,560,824.08
应付管理人报酬		931,180.72	1,968,892.99
应付托管费		266,051.65	562,540.87
应付销售服务费		316,250.60	769,524.00
应付交易费用		456,588.84	1,930,408.80
应交税费		-	-
应付利息		14,670.03	62,363.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		616,974.56	595,143.15
负债合计		146,677,276.83	1,034,590,048.53
所有者权益：			
实收基金		1,286,298,716.48	2,940,516,221.32
未分配利润		166,662,388.40	95,613,829.44
所有者权益合计		1,452,961,104.88	3,036,130,050.76
负债和所有者权益总计		1,599,638,381.71	4,070,720,099.29

注：1、报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,286,298,716.48 份。其中建信收益增强基金 A 类基金份额净值 1.134 元，基金份额总额 501,317,355.96 份；建信收益增强基金 C 类基金份额净值 1.127 元，基金份额总额 784,981,360.52 份。

2、本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，至上年度末未满一年。

7.2 利润表

会计主体：建信收益增强债券型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年6月2日至2009年12 月31日
一、收入		190,327,890.64	223,411,664.08
1. 利息收入		50,419,208.24	39,549,761.13
其中：存款利息收入		1,366,468.10	25,224,232.95
债券利息收入		49,052,740.14	10,995,978.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,329,550.10
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		155,892,049.60	112,054,966.79
其中：股票投资收益		154,245,463.97	124,243,973.03
债券投资收益		996,783.11	-16,755,797.05
基金投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-

衍生工具收益		-	1,732,533.62
股利收益		649,802.52	2,834,257.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-16,773,977.07	69,908,042.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		790,609.87	1,898,894.11
减：二、费用		34,058,735.24	50,794,876.20
1. 管理人报酬		13,396,151.21	22,847,404.64
2. 托管费		3,827,471.82	6,527,829.89
3. 销售服务费		4,994,019.91	8,854,135.08
4. 交易费用		5,953,741.42	11,300,985.21
5. 利息支出		5,467,680.88	949,454.55
其中：卖出回购金融资产支出		5,467,680.88	949,454.55
6. 其他费用		419,670.00	315,066.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		156,269,155.40	172,616,787.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		156,269,155.40	172,616,787.88

注：本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，上年度可比期间未满一年。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信收益增强债券型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,940,516,221.32	95,613,829.44	3,036,130,050.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	156,269,155.40	156,269,155.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,654,217,504.84	-85,220,596.44	-1,739,438,101.28
其中：1. 基金申购款	1,600,312,095.97	159,638,276.74	1,759,950,372.71
2. 基金赎回款	-3,254,529,600.81	-244,858,873.18	-3,499,388,473.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,286,298,716.48	166,662,388.40	1,452,961,104.88
项目	上年度可比期间		

	2009年6月2日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,964,474,021.08	-	7,964,474,021.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	172,616,787.88	172,616,787.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-5,023,957,799.76	-77,002,958.44	-5,100,960,758.20
其中：1. 基金申购款	2,434,332,386.01	65,231,273.04	2,499,563,659.05
2. 基金赎回款	-7,458,290,185.77	-142,234,231.48	-7,600,524,417.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,940,516,221.32	95,613,829.44	3,036,130,050.76

注：本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，上年度可比期间未满一年。

报表附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：孙志晨，主管会计工作负责人：何斌，会计机构负责人：秦绪华

7.4 报表附注（摘要）

7.4.1 基金基本情况

建信收益增强债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 281 号《关于核准建信收益增强债券型证券投资基金募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 7,962,663,348.06 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 107 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》于 2009 年 6 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,964,474,021.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,810,673.02 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》和《建信收益增强债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金自募集期起根据认购、申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用的，称为 A 类基金份额；不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基

金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为公司债、国债、金融债、企业债、可转换债券(含可分离式)、中央银行票据、资产支持证券、债券回购、股票、权证以及中国证监会批准的允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的 80%，其中，本基金持有公司债、金融债、企业债、资产支持证券等除国债、中央银行票据以外的固定收益类资产的比例不低于债券资产的 30%，本基金投资于股票(含一级市场新股申购)等权益类品种的比例为基金资产的 0-20%，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中债企业债总指数 X 30% + 中债国债总指数 X 70%。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2011 年 3 月 21 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金代销机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年 12月31日	上年度可比期间 2009年6月2日（基金合同生效日） 至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,396,151.21	22,847,404.64
其中：支付销售机构的客户	2,778,678.06	4,572,051.37

维护费		
-----	--	--

注：1、本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，上年度可比期间不满一年。

2、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.70% / 当年天数。

3、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年 12月31日	上年度可比期间 2009年6月2日至2009年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,827,471.82	6,527,829.89

注：1、本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，上年度可比期间不满一年。

2、支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信增强债券 A	建信增强债券 C	合计
中国建设银行	-	4,200,538.95	4,200,538.95
中国农业银行	-	172,914.78	172,914.78
建信基金管理有限责任公司	-	226,369.44	226,369.44
合计	-	4,599,823.17	4,599,823.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年6月2日至2009年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信增强债券A	建信增强债券C	合计
中国建设银行	-	7,729,001.88	7,729,001.88

中国农业银行	-	372,506.77	372,506.77
建信基金管理有限责任公司	-	175,147.50	175,147.50
合计	-	8,276,656.15	8,276,656.15

注：1、本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，上年度可比期间未满一年。

2、支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金管理有限责任公司，再由建信基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	151,431,360.28	-	-	-	-
上年度可比期间 2009年6月2日至2009年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	201,994,098.63	349,044,258.24	-	-	-	-

注：本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，上年度可比期间未满一年。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

建信增强债券 A

除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年末均未持有本基金。

建信增强债券 C

除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年末均未持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年6月2日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国农业银行	71,406,605.02	1,172,272.53	956,666,210.03	1,476,203.81
--------	---------------	--------------	----------------	--------------

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金基金合同自 2009 年 6 月 2 日起生效，上年度可比期间未满一年。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

7.4.9 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600998	九州通	2010-10-27	2011-02-09	新股网下申购	13.00	14.55	133,551	1,736,163.00	1,943,167.05	-
601098	中南传媒	2010-10-22	2011-01-28	新股网下申购	10.66	11.98	729,188	7,773,144.08	8,735,672.24	-
601118	海南橡胶	2010-12-30	2011-04-07	新股网下申购	5.99	5.99	923,659	5,532,717.41	5,532,717.41	-
601126	四方股份	2010-12-28	2011-03-31	新股网下申购	23.00	31.11	59,361	1,365,303.00	1,846,720.71	-
601177	杭齿前进	2010-09-29	2011-01-11	新股网下申购	8.29	16.03	31,926	264,666.54	511,773.78	-
601933	永辉超市	2010-12-09	2011-03-15	新股网下申购	23.98	31.24	39,572	948,936.56	1,236,229.28	-
002486	嘉麟杰	2010-09-29	2011-01-17	新股网下申购	10.90	14.90	108,209	1,179,478.10	1,612,314.10	-
002488	金固股份	2010-10-13	2011-01-21	新股网下申购	22.00	24.41	49,200	1,082,400.00	1,200,972.00	-
002498	汉缆股份	2010-10-29	2011-02-09	新股网下申购	36.00	44.87	74,487	2,681,532.00	3,342,231.69	-
002499	科林环保	2010-10-29	2011-02-09	新股网下申购	25.00	41.55	48,162	1,204,050.00	2,001,131.10	-
002500	山西证券	2010-11-03	2011-02-15	新股网下申购	7.80	12.16	610,115	4,758,897.00	7,418,998.40	-
002504	东光微电	2010-11-10	2011-02-18	新股网下申购	16.00	26.85	42,694	683,104.00	1,146,333.90	-

002505	大康 牧业	2010- 11-10	2011- 02-18	新股网 下申购	24.00	27.90	64,708	1,552,992.00	1,805,353.20	-
002512	达华 智能	2010- 11-24	2011- 03-03	新股网 下申购	26.00	35.50	1,000,000	26,000,000.00	35,500,000.00	-
002531	天顺 风能	2010- 12-24	2011- 03-31	新股网 下申购	24.90	25.32	1,150,000	28,635,000.00	29,118,000.00	-
300126	锐奇 股份	2010- 09-27	2011- 01-13	新股网 下申购	34.00	38.68	89,893	3,056,362.00	3,477,061.24	-
300128	锦富 新材	2010- 09-27	2011- 01-13	新股网 下申购	35.00	47.19	77,567	2,714,845.00	3,660,386.73	-
300129	泰胜 风能	2010- 10-12	2011- 01-19	新股网 下申购	31.00	39.92	163,934	5,081,954.00	6,544,245.28	-
300132	青松 股份	2010- 10-14	2011- 01-26	新股网 下申购	23.00	35.66	47,124	1,083,852.00	1,680,441.84	-
300133	华策 影视	2010- 10-14	2011- 01-26	新股网 下申购	68.00	116.00	34,714	2,360,552.00	4,026,824.00	-
300136	信维 通信	2010- 10-27	2011- 02-09	新股网 下申购	31.75	67.80	62,201	1,974,881.75	4,217,227.80	-
300137	先河 环保	2010- 10-27	2011- 02-09	新股网 下申购	22.00	38.21	61,271	1,347,962.00	2,341,164.91	-
300139	福星 晓程	2010- 11-03	2011- 02-14	新股网 下申购	62.50	72.80	47,985	2,999,062.50	3,493,308.00	-
300142	沃森 生物	2010- 11-03	2011- 02-14	新股网 下申购	95.00	133.20	43,233	4,107,135.00	5,758,635.60	-

7.4.9.3 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	可流 通日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位：张)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
122858	10盐 城01	2010- 12-17	2011- 02-15	新债未 上市	99.9 7	99.97	100,000	9,997,457.53	9,997,457.53	
122941	10镇 城投	2010- 12-21	-	新债未 上市	99.9 3	99.93	200,000	19,985,183.56	19,985,183.56	
108016 1	10云 城投	2010- 12-14	2011- 01-12	新债未 上市	99.9 9	100.3 1	200,000	19,997,510.14	20,062,000.00	
108016 9	10湖 州城 投债	2010- 12-23	2011- 01-05	新债未 上市	99.9 7	100.7 9	200,000	19,993,845.48	20,158,000.00	
108017 1	10吴 江发 展债	2010- 12-27	2011- 01-12	新债未 上市	99.9 4	100.4 7	400,000	39,977,556.16	40,188,000.00	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。

其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间正回购余额,故未存在作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 12 月 31 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 75,000,000.00 元,于 2011 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 877,682,341.00 元,属于第二层级的余额为 608,597,551.35 元,无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日:第一层级 821,427,303.94 元,第二层级 2,264,388,494.09 元,无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票,本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级,并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 会计期间:同)。

对于持有的认购新发和增发证券,本基金将相关证券公允价值所属层级于流通受限期间列入第二层级,待其可流通后从第二层级转入第一层级(2009 年度:同)。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	254,258,484.53	15.89
	其中:股票	254,258,484.53	15.89
2	固定收益投资	1,232,021,407.82	77.02
	其中:债券	1,232,021,407.82	77.02
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	87,760,334.74	5.49
6	其他各项资产	25,598,154.62	1.60
7	合计	1,599,638,381.71	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,338,070.61	0.51
B	采掘业	-	-
C	制造业	122,408,448.68	8.42
C0	食品、饮料	9,020,500.00	0.62
C1	纺织、服装、皮毛	1,612,314.10	0.11
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,680,441.84	0.12
C5	电子	48,017,256.43	3.30
C6	金属、非金属	5,936,000.00	0.41
C7	机械、设备、仪表	50,383,300.71	3.47
C8	医药、生物制品	5,758,635.60	0.40
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-

E	建筑业	12,791,074.27	0.88
F	交通运输、仓储业	18,746,000.00	1.29
G	信息技术业	6,978,000.00	0.48
H	批发和零售贸易	34,493,396.33	2.37
I	金融、保险业	14,288,998.40	0.98
J	房地产业	11,582,000.00	0.80
K	社会服务业	2,890,000.00	0.20
L	传播与文化产业	12,762,496.24	0.88
M	综合类	9,980,000.00	0.69
	合计	254,258,484.53	17.50

注：以上行业分类以 2010 年 12 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002512	达华智能	1,000,000	35,500,000.00	2.44
2	002531	天顺风能	1,150,000	29,118,000.00	2.00
3	000417	合肥百货	1,000,000	19,400,000.00	1.34
4	600125	铁龙物流	1,300,000	18,746,000.00	1.29
5	600790	轻纺城	1,000,000	9,980,000.00	0.69
6	601098	中南传媒	729,188	8,735,672.24	0.60
7	600361	华联综超	800,000	8,392,000.00	0.58
8	002500	山西证券	610,115	7,418,998.40	0.51
9	600588	用友软件	300,000	6,978,000.00	0.48
10	601601	中国太保	300,000	6,870,000.00	0.47

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站 www.ccbfund.cn 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000417	合肥百货	86,909,177.20	2.86
2	601106	中国一重	85,207,484.15	2.81
3	601601	中国太保	83,352,549.70	2.75
4	600036	招商银行	66,782,493.84	2.20
5	000858	五粮液	65,915,278.84	2.17
6	600588	用友软件	59,175,049.32	1.95

7	600790	轻纺城	55,916,775.44	1.84
8	000063	中兴通讯	49,033,165.47	1.61
9	600376	首开股份	41,621,854.66	1.37
10	600037	歌华有线	40,015,099.41	1.32
11	600361	华联综超	37,233,305.47	1.23
12	000061	农产品	36,636,851.64	1.21
13	600035	楚天高速	36,213,763.05	1.19
14	600694	大商股份	34,168,372.53	1.13
15	600050	中国联通	32,397,182.90	1.07
16	000792	盐湖钾肥	31,988,092.07	1.05
17	600690	青岛海尔	31,171,276.28	1.03
18	000729	燕京啤酒	29,317,872.88	0.97
19	002531	天顺风能	28,635,000.00	0.94
20	600887	伊利股份	28,561,166.85	0.94

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	115,322,540.62	3.80
2	600887	伊利股份	102,989,787.11	3.39
3	000417	合肥百货	84,611,107.78	2.79
4	601106	中国一重	81,460,201.29	2.68
5	601601	中国太保	77,110,335.81	2.54
6	600016	民生银行	74,092,495.08	2.44
7	000858	五粮液	64,108,086.97	2.11
8	601989	中国重工	55,398,207.48	1.82
9	600588	用友软件	52,121,167.30	1.72
10	000063	中兴通讯	48,100,430.70	1.58
11	000792	盐湖钾肥	45,503,671.96	1.50
12	600790	轻纺城	44,339,678.43	1.46
13	601009	南京银行	41,601,217.72	1.37
14	002142	宁波银行	37,578,801.18	1.24
15	600361	华联综超	37,394,641.14	1.23
16	600037	歌华有线	36,373,987.73	1.20
17	600694	大商股份	36,222,612.38	1.19
18	002344	海宁皮城	35,170,709.84	1.16
19	600035	楚天高速	34,605,707.97	1.14
20	600376	首开股份	34,406,012.05	1.13

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,840,862,279.39
卖出股票的收入（成交）总额	2,208,346,675.75

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	286,521,696.00	19.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	494,848,423.69	34.06
5	企业短期融资券	30,057,000.00	2.07
6	可转债	330,324,588.13	22.73
7	公司债	90,269,700.00	6.21
8	其他	-	-
9	合计	1,232,021,407.82	84.79

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	1,453,640	159,696,890.40	10.99
2	109917	10 贴现国债 17	1,500,000	148,890,000.00	10.25
3	113002	工行转债	1,099,970	129,950,455.80	8.94
4	122036	09 沪张江	730,680	74,894,700.00	5.15
5	019004	10 国债 04	600,000	59,982,000.00	4.13

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末没有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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	454,408.04
2	应收证券清算款	2,000,899.96
3	应收股利	-
4	应收利息	9,752,620.28
5	应收申购款	13,390,226.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,598,154.62

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113001	中行转债	159,696,890.40	10.99
2	110003	新钢转债	19,589,100.00	1.35
3	125709	唐钢转债	16,115,758.48	1.11

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002512	达华智能	35,500,000.00	2.44	网下发行获配锁定期三个月
2	002531	天顺风能	29,118,000.00	2.00	网下发行获配锁定期三个月
3	601098	中南传媒	8,735,672.24	0.60	网下发行获配锁定期三个月
4	002500	山西证券	7,418,998.40	0.51	网下发行获配锁定期三个月

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
建信	8,175	61,323.22	108,209,597.38	21.59%	393,107,758.58	78.41%

增强债券 A						
建信增强债券 C	13,580	57,804.22	79,607,146.01	10.14%	705,374,214.51	89.86%
合计	21,755	59,126.58	187,816,743.39	14.60%	1,098,481,973.09	85.40%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	建信增强债券 A	-	-
	建信增强债券 C	11,835.48	0.00%
	合计	11,835.48	0.00%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信增强债券 A	建信增强债券 C
基金合同生效日(2009年6月2日)基金份额总额	2,752,981,309.86	5,211,492,711.22
本报告期期初基金份额总额	957,588,384.99	1,982,927,836.33
本报告期基金总申购份额	696,244,589.77	904,067,506.20
减：本报告期基金总赎回份额	1,152,515,618.80	2,102,013,982.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	501,317,355.96	784,981,360.52

注：上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经建信基金管理有限责任公司 2010 年度第一次临时股东会会议决议并备案中国证监会，殷红军先生当选为建信基金管理有限责任公司董事会股东董事，王曦先生不再担任公司董事。经建信基金管理有限责任公司第二届董事会第三次会议审议通过，并报经中国证监会证监许可[2010]567 号文核准，公司决定聘任王新艳为公司副总经理。上述聘任事项已于 2010 年 5 月 18 日公告。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为人民币 90,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人以及涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	2,179,357,216.50	58.72%	1,761,338.00	58.59%	-
银河证券	1	1,531,869,151.51	41.28%	1,244,654.25	41.41%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金

管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

(1) 财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

(3) 具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个股、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

(4) 佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本报告期内新增广发证券股份有限公司和中信证券股份有限公司的交易单元为新的交易单元,无剔除交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	750,265,697.85	89.82%	35,083,900,000.00	100.00%	-	-
银河证券	85,058,421.31	10.18%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司

二〇一一年三月二十八日