建信双息红利债券型证券投资基金

2012 年半年度报告摘要

2012 年 6 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年八月二十八日

§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。本半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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 24 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信双息红利债券
基金主代码	530017
交易代码	530017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月13日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	352,706,110.70份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主动管理债券组合，力争在追求基金资产稳定增长基础上为投资者取得高于投资业绩比较基准的回报。
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债券投资组合。同时在固定收益资产所提供的稳健收益基础上，适当进行股票投资，本基金的股票投资作为债券投资的辅助和补充，以本金安全为最重要因素。
业绩比较基准	90%×中国债券总指数收益率+10%×中证红利指数收益率。
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股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	朱义明
	联系电话	010-66228888	010-65556899
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	zhuyiming@citicbank.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95558
传真		010-66228001	010-65550832

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所。

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	12,318,493.76

本期利润	20,022,967.73
加权平均基金份额本期利润	0.0326
本期基金份额净值增长率	3.80%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末（2012 年 6 月 30 日）**
期末可供分配基金份额利润	0.0227
期末基金资产净值	366,313,908.56
期末基金份额净值	1.039

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 2011 年 12 月 13 日起生效，至 2011 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

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
过去一个月	0.19%	0.18%	-0.54%	0.11%	0.73%	0.07%
过去三个月	3.80%	0.18%	1.45%	0.11%	2.35%	0.07%
过去六个月	3.80%	0.16%	2.33%	0.13%	1.47%	0.03%
成立至今	3.90%	0.16%	2.16%	0.13%	1.74%	0.03%

注：1、本基金成立于 2011 年 12 月 13 日，截止报告日未满一年。

2、本基金投资业绩比较基准为：90%×中国债券总指数收益率+10%×中证红利指数收益率，其中中国债券总指数衡量债券投资业绩，中证红利指数衡量权益类投资业绩。中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于 2001 年 12 月 31 日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。因此，本基金债券投资的业绩比较基准选择中国债券总指数收益率。

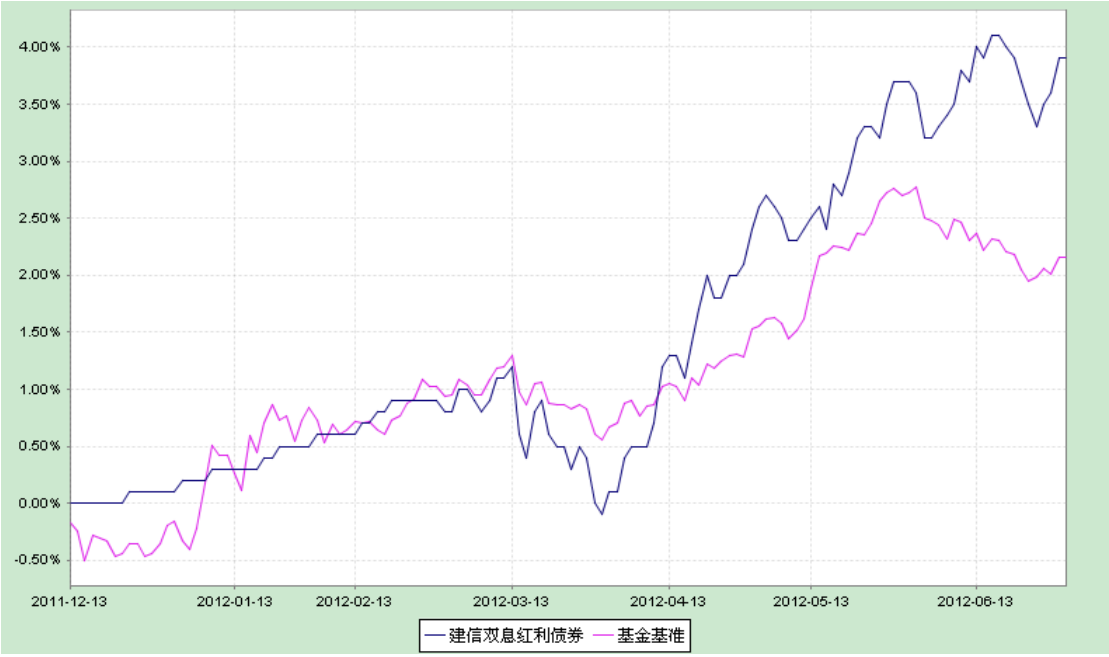
中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的 100 只股票作为样本，以反映 A 股市场高红利股票的整体状况和走势。因此，本基金权益类证券品种的业绩比较基准选择中证红利指数收益率。

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

建信双息红利债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2011 年 12 月 13 日至 2012 年 6 月 30 日）



注：1、本基金成立于 2011 年 12 月 13 日，截止报告日未满一年。

2、本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购等）、股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可参与一级市场新股申购或增发新股，也可在二级市场上投资股票、权证等权益类证券。法律法规或中国证监会以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券类资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于权益类资产占基金资产的比例不高于 20%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3、本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§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、中国华电集团资本控股有限公司，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%，中国华电集团资本控股有限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 2012 年 6 月 30 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、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、建信保本混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金 22 只开放式基金和建信优势动力股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金 2 只封闭式基金，管理的基金资产规模共计为 475.31 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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	投资管理部副总监，本基金基金经理	2011-12-13	-	7	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 月毕业于加拿大大不列颠哥伦比亚大学，获共商管理硕士学位。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 月加入本公司，2008 年 8 月 15 日起任建信稳定增利债券基金基金经理；2009 年 6 月 2 日至 2011 年 5 月 11 日任建信收益增强债券型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。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

上半年通胀水平明显回落，CPI 同比 1 季度震荡向下，2 季度则进一步加速回落。这主要来自于以下几方面因素的带动；其一，翘尾因素明显回落；其二，食品价格大幅下跌，其中猪肉和蔬菜价格跌幅明显。其三，国际大宗商品价格急转直下，原油价格由 1 季度上涨转为 2 季度的急挫，输入性通胀压力由强转弱，非食品价格面临的传导压力明显减轻。

经济增长方面，上半年增长动能明显放缓是主基调。1 季度主要以需求下滑为主，2 季度则更多呈现供给加速收缩的态势，库存调整穿插在供需矛盾的变换中，放大了短周期经济的波动，GDP 同比增速滑落 8％以下；具体来看，需求的放缓是全面的，出口增速跌落 10％以内，欧债危机的持续发酵使欧元区出口成为最大的拖累，新兴市场国家经济增速放缓也带来负面影响，只有美国经济的温和复苏仍形成支撑；投资方面增速也出现明显下滑；消费方面，实际零售增速受制于收入增速放缓以及高油价影响也出现小幅下滑；正是在内外需全面放缓的带动下，供给端转入收缩，2 季度工业增加值增速全面掉落 10％以下，同时原材料活动也从 1 季度的补库存转入去库存。

由于上半年银行间市场资金面宽松，通货膨胀数据温和，债券市场表现良好，收益率下行，而信用债尤其是中低评级的信用债收益率下降较多，债券投资者在信用债上普遍获利较多，信用债收益率的大幅下降也反映了市场风险偏好有所增加。转债上半年总体表现良好。

本基金在一月份打开赎回后，逐步增加了信用债和转债的配置，取得了不错的收益。三月份后组合增加了股票的配置，股票市场的下跌使组合业绩受到一定的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率 3.80%，波动率 0.16%，业绩比较基准收益率 2.33%，波动率 0.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在经历了连续两次降息后，政策稳增长意图明显，下半年经济企稳回升概率上升，但回升的幅度可能仅是温和的，经济潜在增速放缓仍是大

势所趋；而通胀水平有望在 3 季度实现短期筑底，而后技术性温和回升，整体来看下半年通胀不会转化为主要矛盾；

在这样的大背景下，利率债券已经具备不错的配置价值，下一季度基金将择机增加利率债券配置比例。大盘转债价值相对较高，基金维持目前的配置比例。权益市场将面临压力，基金将坚持自下而上的思路，选好目标品种，把握好逢低吸纳的机会。

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，公司已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

截止本报告期末本基金可供分配利润为 8,009,219.35 元，本报告期末未进行利润分配，符合相关法律法规及基金合同关于利润分配条款的规定。

§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

自 2011 年 12 月 13 日建信双息红利债券型证券投资基金（以下称“建信双息基金”或“本基金”）成立以来，作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——建信基金管理有限责任公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由建信双息基金管理人——建信基金管理有限责任公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信双息红利债券型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末

		2012 年 6 月 30 日	2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		5,231,080.38	68,207,967.56
结算备付金		1,528,849.52	-
存出保证金		27,579.20	-
交易性金融资产		457,560,623.39	48,320,000.00
其中：股票投资		38,937,259.49	-
基金投资		-	-
债券投资		418,623,363.90	48,320,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	1,837,501,906.25
应收证券清算款		4,774,050.33	-
应收利息		8,793,001.92	911,882.49
应收股利		-	-
应收申购款		30,884.59	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		477,946,069.33	1,954,941,756.30
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2012 年 6 月 30 日**	**上年度末 2011 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		110,000,000.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		870,649.27	-
应付管理人报酬		230,496.39	674,042.23
应付托管费		65,856.11	192,583.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		229,910.68	2,181.25
应交税费		-	-
应付利息		15,962.63	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		219,285.69	14,753.88
负债合计		111,632,160.77	883,560.87
所有者权益：			
实收基金		352,706,110.70	1,951,677,612.70
未分配利润		13,607,797.86	2,380,582.73
所有者权益合计		**366,313,908.56**	**1,954,058,195.43**
负债和所有者权益总计		**477,946,069.33**	**1,954,941,756.30**

注：1、报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.039 元，基金份额总额 352,706,110.70 份。

6.2 利润表

会计主体：建信双息红利债券型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		**23,976,688.86**	**-**
1.利息收入		13,500,285.48	-
其中：存款利息收入		181,558.32	-
债券利息收入		8,883,790.52	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,434,936.64	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,244,496.81	-
其中：股票投资收益		-1,757,400.36	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		3,869,681.86	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		132,215.31	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		7,704,473.97	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		527,432.60	-
减：二、费用		**3,953,721.13**	**-**
1.管理人报酬		2,241,707.07	-
2.托管费		640,487.79	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		409,342.79	-
5.利息支出		436,576.99	-
其中：卖出回购金融资产支出		436,576.99	-
6.其他费用		225,606.49	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**20,022,967.73**	**-**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**20,022,967.73**	**-**

注：本基金基金合同自 2011 年 12 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信双息红利债券型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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）	1,951,677,612.70	2,380,582.73	1,954,058,195.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	20,022,967.73	20,022,967.73

期利润）			
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）	-1,598,971,502.00	-8,795,752.60	-1,607,767,254.60
其中：1.基金申购款	485,550,654.72	5,359,539.37	490,910,194.09
2.基金赎回款	-2,084,522,156.72	-14,155,291.97	-2,098,677,448.69
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）	352,706,110.70	13,607,797.86	366,313,908.56
项目	**上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金基金合同自 2011 年 12 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信双息红利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[2011]第 1660 号《关于核准建信双息红利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《建信双息红利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2011 年 11 月 21 日起至 2011 年 12 月 09 日止。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 1,951,677,612.70 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(2011)第 499 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信双息红利债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,951,604,406.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 73,206.37 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双息红利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市交易的债券、股票、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：投资于债券类基金资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于权益类资产占基金资产的比例不高于 20%，持有现金或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 90%×中国债券总指数收益率+10%×中证红利指数收益率。

6.4.2 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》、《建信双息红利债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年半年度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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日 1 至 2012 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日，无比较会计期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、基金投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资和衍生工具(主要为权证投资)投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确

认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资和基金投资在持有期间应取得的现金股利扣除适用的境内及境外代扣代缴所得税后，于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净值确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分

的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

1、计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

2、重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37 号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生会计政策的变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生会计估计的变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。本基金基金合同

自 2011 年 12 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,241,707.07	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1,301,244.69	-

注：1、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。

2、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。

3、本基金基金合同自 2011 年 12 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	640,487.79	-

注：1、支付基金托管人中国工商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。

2、本基金基金合同自 2011 年 12 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金基金合同自 2011 年 12 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。本基金基金合同自 2011 年 12 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方本报告期末持有本基金。本基金基金合同自 2011 年 12 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	5,231,080.38	112,709.18	-	-

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中心银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金基金合同自 2011 年 12 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生承销期内参与关联方承销证券的情况，本基金基金合同自 2011 年 12 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期未发生其他需要说明的关联交易事项，本基金基金合同自 2011 年 12 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.9 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 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 110,000,000.00 元，于 2012 年 7 月 6 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的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。

6.4.10 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

（ｉ）金融工具公允价值计量的方法

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)。

（ii）各层次金融工具公允价值

于 2012 年 06 月 30 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 284,863,623.39 元，属于第二层级的余额为 172,697,000.00 元，无属于第三层级的余额。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层级或第三层级。

（iv）第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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。

§7 投资组合报告

7.1 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	38,937,259.49	8.15
	其中：股票	38,937,259.49	8.15
2	固定收益投资	418,623,363.90	87.59
	其中：债券	418,623,363.90	87.59
	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	6,759,929.90	1.41
6	其他各项资产	13,625,516.04	2.85
7	合计	477,946,069.33	100.00

7.2 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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	19,090,719.23	5.21
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	4,042,834.60	1.10
C6	金属、非金属	2,438,286.11	0.67
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	8,846,414.20	2.41
C99	其他制造业	3,763,184.32	1.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	19,846,540.26	5.42
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	38,937,259.49	10.63

注：以上行业分类以 2012 年 06 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

7.3 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	601318	中国平安	433,899	19,846,540.26	5.42

2	000919	金陵药业	612,000	5,153,040.00	1.41
3	300115	长盈精密	169,867	4,042,834.60	1.10
4	002549	凯美特气	239,999	3,763,184.32	1.03
5	600557	康缘药业	249,890	3,693,374.20	1.01
6	002444	巨星科技	279,941	2,438,286.11	0.67

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

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	601318	中国平安	18,131,789.82	0.93
2	601336	新华保险	17,896,084.14	0.92
3	002285	世联地产	11,617,260.84	0.59
4	000858	五 粮 液	10,467,147.61	0.54
5	600875	东方电气	7,683,820.30	0.39
6	600748	上实发展	6,943,217.28	0.36
7	000024	招商地产	6,771,404.00	0.35
8	600426	华鲁恒升	6,155,045.80	0.31
9	600887	伊利股份	6,145,504.39	0.31
10	000401	冀东水泥	6,044,102.86	0.31
11	600395	盘江股份	5,922,603.17	0.30
12	000422	湖北宜化	5,835,490.30	0.30
13	000919	金陵药业	5,814,820.07	0.30
14	601111	中国国航	5,409,482.00	0.28
15	600971	恒源煤电	4,826,141.04	0.25
16	600880	博瑞传播	4,376,023.07	0.22
17	600418	江淮汽车	4,328,927.78	0.22
18	300115	长盈精密	4,023,645.02	0.21
19	600557	康缘药业	3,702,526.95	0.19
20	002549	凯美特气	3,449,447.85	0.18

注：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。

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

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	601336	新华保险	21,003,774.10	1.07
2	000858	五 粮 液	10,305,893.16	0.53
3	002285	世联地产	10,095,548.41	0.52
4	600875	东方电气	7,654,644.40	0.39
5	000024	招商地产	7,288,547.67	0.37
6	600748	上实发展	6,313,571.00	0.32
7	600395	盘江股份	6,149,656.40	0.31
8	600887	伊利股份	5,834,676.43	0.30
9	000401	冀东水泥	5,705,214.15	0.29
10	000422	湖北宜化	5,598,933.44	0.29
11	600426	华鲁恒升	5,555,891.34	0.28
12	600971	恒源煤电	5,119,029.97	0.26

13	601111	中国国航	5,016,309.00	0.26
14	600880	博瑞传播	4,020,409.95	0.21
15	600418	江淮汽车	3,890,119.08	0.20
16	600837	海通证券	3,071,456.56	0.16
17	002068	黑猫股份	2,917,865.84	0.15
18	300035	中科电气	2,313,680.82	0.12
19	002138	顺络电子	1,423,371.20	0.07
20	600305	恒顺醋业	193,192.80	0.01

注：卖出金额接卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)，不包括相关交易费用。

7.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	159,027,119.21
卖出股票收入（成交）总额	119,471,785.72

注：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。

7.5 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	19,844,000.00	5.42
2	央行票据	29,073,000.00	7.94
3	金融债券	20,332,000.00	5.55
	其中：政策性金融债	20,332,000.00	5.55
4	企业债券	211,491,623.30	57.74
5	企业短期融资券	50,807,000.00	13.87
6	中期票据	10,493,000.00	2.86
7	可转债	76,582,740.60	20.91
8	其他	-	-
9	合计	418,623,363.90	114.28

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

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	113002	工行转债	303,340	33,061,026.60	9.03
2	1181318	11 甘电投 CP01	300,000	30,327,000.00	8.28
3	1101088	11 央行票据 88	300,000	29,073,000.00	7.94
4	122013	08 北辰债	240,890	25,076,649.00	6.85
5	112060	12 金风 01	240,000	24,720,000.00	6.75

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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	27,579.20
2	应收证券清算款	4,774,050.33
3	应收股利	-
4	应收利息	8,793,001.92
5	应收申购款	30,884.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,625,516.04

7.9.4 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	113002	工行转债	33,061,026.60	9.03
2	110003	新钢转债	15,923,150.00	4.35
3	113001	中行转债	15,689,736.00	4.28
4	110015	石化转债	9,991,000.00	2.73

7.9.5 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
5,194	67,906.45	56,329,108.50	15.97%	296,377,002.20	84.03%

8.2 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	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	994.11	0.0003%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、该只基金的基金经理未持有该只基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 12 月 13 日）基金份额总额	1,951,677,612.70
本报告期期初基金份额总额	1,951,677,612.70
本报告期基金总申购份额	485,550,654.72
减：本报告期基金总赎回份额	2,084,522,156.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	352,706,110.70

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。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

2012 年 3 月 28 日，公司 2012 年度第一次临时股东会审议通过了《关于选举建信基金管理有限责任公司第三届董事会董事的议案》，同意江先周、孙志晨、马梅琴、俞斌、袁时奋、殷红军、顾建国、王建国、伏军为公司第三届董事会董事，第二届董事会成员关启昌、沈四宝不再担任公司独立董事。

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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中金公司	2	266,188,688.32	95.58%	218,080.06	95.63%	-
国金证券	1	12,310,216.61	4.42%	9,976.37	4.37%	-

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，所有交易单元均为基金合同生效日新增交易单元。本报告期内无剔除交易单元。

10.7.2 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		股指期货交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期成交总额的比

		的比例		的比例		的比例		例
中金公司	550,672,167.59	79.60%	4,021,000,000.00	81.95%	-	-	-	-
国金证券	141,093,108.34	20.40%	885,500,000.00	18.05%	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司

二〇一二年八月二十八日