

---

# 建信内生动力股票型证券投资基金

## 2011 年半年度报告摘要

2011 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年八月二十四日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和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。

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 2011 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	建信内生动力股票
基金主代码	530011
交易代码	530011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月16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
报告期末基金份额总额	3,870,319,365.31份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，重点投资于消费性内生动力行业、投资性内生动力行业、服务性内生动力行业中具有持续竞争力优势的上市公司股票，力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为： $75\% \times$ 沪深300 指数收益率 $+25\% \times$ 中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，一般情况下其风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	赵会军
	联系电话	010-66228888	010—66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	010—66105798

### 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	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
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 (2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-54,012,352.22
本期利润	-115,744,902.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0264
本期基金份额净值增长率	-3.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0363
期末基金资产净值	3,730,016,166.54
期末基金份额净值	0.964

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 2010 年 11 月 16 日起生效，合同生效当期未满 2 个月。

## 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	2.55%	0.90%	0.98%	0.90%	1.57%	0.00%
过去三个月	-3.50%	0.84%	-4.05%	0.83%	0.55%	0.01%
过去六个月	-3.89%	0.90%	-1.61%	0.93%	-2.28%	-0.03%
成立至今	-3.60%	0.79%	-5.62%	0.98%	2.02%	-0.19%

注：本基金投资业绩比较基准为：75%×沪深 300 指数收益率+25%×中国债券总指数收益率。其中：沪深 300 指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准，中国债券总指数收益率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。

沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，它是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。指数样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值。成份股为市场中市场代表性好，流动性高，交易活跃的主流投资股票，能够反映市场主流投资的收益情况。中债系列指数由一个总指数（即中国债券总指数），若干个分指数构成。中国债券总指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债券等），理论上能客观反映中国债券总体情况。

### 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

## 建信内生动力股票型证券投资基金

## 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

(2010 年 11 月 16 日至 2011 年 6 月 30 日)



注：1、本基金基金合同于 2010 年 11 月 16 日生效，截至报告日基金合同生效未满一年。

2、本基金投资于股票的基金资产占基金资产比例为 60%-95%，其中投资于内生动力行业（包括消费性内生动力行业、投资性内生动力行业和服务性内生动力行业）的基金资产占投资于股票的基金资产的比例不低于 80%；现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 5%-40%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，资产支持证券占基金资产净值的比例为 0-20%，权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%。法律法规或中国证监会以后允许基金投资的其他金融工具或品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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 2011 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(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、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 15 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 433.13 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		
王新艳女士	副总经理，本基金基金经理	2010-11-16	-	12	注册金融分析师（CFA），硕士。1998 年 10 月加入长盛基金管理公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理等职，2002 年 11 月 2 日至 2004 年 5 月 22 日担任长盛成长价值股票型证券投资基金基金经理。2004 年 6 月加入景顺长城基金管理公司，历任基金经理、投资副总监、投资总监等职，于 2005 年 3 月 16 日至 2009 年 3 月 16 日担任景顺长城鼎益股票型证券投资基金(LOF)的基金经理，于 2007 年 6 月 18 日至

					2009 年 3 月 16 日担任景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金基金经理。2009 年 3 月加入本公司，任总经理助理，2010 年 5 月起任公司副总经理。2009 年 12 月 17 日至 2011 年 2 月 1 日任建信恒久价值基金基金经理；2010 年 4 月 27 日起任建信核心精选股票型证券投资基金基金经理。
卓利伟 先生	投资管理部副 总监，本基金 基金经理	2010-11-16	2011-07-15	5	硕士。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 月加入建信基金管理有限责任公司，先后担任行业研究员、高级行业研究员和基金经理助理等职。2009 年 3 月 25 日至 2011 年 7 月 15 日任建信恒久价值股票型证券投资基金基金经理，2009 年 6 月 27 日至 2011 年 7 月 15 日任建信收益增强债券型证券投资基金基金经理。2011 年 7 月因个人原因从本公司离职。
万志勇 先生	研究部执行总 监，本基金基 金经理	2010-11-17	-	10	硕士。曾就职于西安创新互联网孵化器有限公司、北方证券有限责任公司、大成基金管理有限公司、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司（原巨田基金管理有限公司）、银华基金管理有限公司。2008 年 10 月 23 日至 2009 年 11 月 11 日任银华领先策略基金基金经理，2009 年 6 月 1 日至 2010 年 6 月 19 日任银华和谐主题基金基金经理。2010 年 7 月加入建信基金管理有限责任公司，2010

					年 11 月起任研究部执行总监。2011 年 5 月 6 日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理。2011 年 7 月 11 日起任建信优势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

2011 年上半年，全球经济持续复苏，通胀压力逐步显现，流动性面临拐点。中国经济增长迅速，通货膨胀压力较大，经济政策持续紧缩。在此背景下，A 股



市场在上半年整体震荡格局，结构分化较为明显，高估值股票有所回落，低估值股票表现较好。

本基金在上半年的仓位控制较好，配置相对均衡，个股适度分散，以保持灵活性。具体选择上，我们相对看好行业供需结构良好的周期股，相对看好增长速度与估值相匹配的成长股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年上半年本基金净值增长率-3.89%，波动率 0.90%，业绩比较基准收益率-1.61%，波动率 0.93%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为全球经济仍然保持复苏态势，但结构性问题突出，主要经济体的政策逐步收紧，全球流动性面临拐点。中国经济仍然保持较快增长，通胀压力难以迅速缓解，经济政策持续偏紧。在此背景下，A 股市场整体保持震荡格局，市场结构分化的态势将随着估值差距缩小和基本面变化情况而趋于平缓。

本基金将在 2011 年下半年维持均衡配置、适度分散的整体策略，加强个股选择以优化投资收益，尽力为基金持有人获取较好的回报。

#### 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-140,303,198.77 元，根据相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定，本基金本报告期末未达到利润分配条件，未进行利润分配。

### **§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**

2011 年上半年，本基金托管人在对建信内生动力股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### **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**

2011 年上半年，建信内生动力股票型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信内生动力股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进

行。本报告期内，建信内生动力股票型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信内生动力股票型证券投资基金 2011 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2011 年 8 月 19 日

## §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：建信内生动力股票型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		965,824,914.61	577,429,418.79
结算备付金		2,063,179.55	38,353,852.54
存出保证金		5,255,588.29	-
交易性金融资产		2,771,324,831.18	71,020,364.20
其中：股票投资		2,771,324,831.18	71,020,364.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	4,719,200,207.30
应收证券清算款		13,561,624.63	2,067,409.61
应收利息		193,636.34	1,831,811.94
应收股利		1,148,908.44	-
应收申购款		215,494.21	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,759,588,177.25	5,409,903,064.38
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2010 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付证券清算款		13,362,095.64	-
应付赎回款		4,218,842.38	-

应付管理人报酬		4,431,802.85	6,870,770.42
应付托管费		738,633.83	1,145,128.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		6,289,470.24	62,966.92
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		531,165.77	50,994.24
负债合计		29,572,010.71	8,129,859.99
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		3,870,319,365.31	5,388,220,664.00
未分配利润		-140,303,198.77	13,552,540.39
<b>所有者权益合计</b>		<b>3,730,016,166.54</b>	<b>5,401,773,204.39</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>3,759,588,177.25</b>	<b>5,409,903,064.38</b>

注：1、报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.964 元，基金份额总额 3,870,319,365.31 份。

2、本基金基金合同自 2010 年 11 月 16 日生效,合同生效当期未满 2 个月。

## 6.2 利润表

会计主体：建信内生动力股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-65,204,285.83</b>	-
1.利息收入		8,315,573.57	-
其中：存款利息收入		4,317,582.45	-
债券利息收入		3,797.07	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,994,194.05	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-14,046,463.63	-
其中：股票投资收益		-33,125,068.26	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,816,592.93	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		16,262,011.70	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-61,732,550.73	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		2,259,154.96	-
<b>减：二、费用</b>		<b>50,540,617.12</b>	-
1.管理人报酬		32,501,406.21	-
2.托管费		5,416,901.09	-

3.销售服务费		-	-
4.交易费用		12,381,838.46	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		240,471.36	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-115,744,902.95</b>	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-115,744,902.95</b>	-

注：本基金基金合同自 2010 年 11 月 16 日生效,合同生效当期未满 2 个月。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信内生动力股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	5,388,220,664.00	13,552,540.39	5,401,773,204.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-115,744,902.95	-115,744,902.95
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）	-1,517,901,298.69	-38,110,836.21	-1,556,012,134.90
其中：1.基金申购款	262,288,758.56	-11,007,017.27	251,281,741.29
2.基金赎回款	-1,780,190,057.25	-27,103,818.94	-1,807,293,876.19
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）	3,870,319,365.31	-140,303,198.77	3,730,016,166.54
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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 2010 年 11 月 16 日生效,合同生效当期未满 2 个月。

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（摘要）

### 6.4.1 基金基本情况

建信内生动力股票型证券投资基金(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[2010]第 1206 号《关于核准建信内生动力股票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《建信内生动力股票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 2010 年 10 月 20 日起至 2010 年 11 月 12 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 5,387,627,567.80 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(2010)第 299 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信内生动力股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 11 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,388,220,664.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 593,096.20 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信内生动力股票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股票、债券、资产支持证券、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：投资于股票的基金资产占基金资产比例为 60%-95%，其中投资于内生动力行业（包括消费性内生动力行业、投资性内生动力行业和服务性内生动力行业）的基金资产占投资于股票的基金资产的比例不低于 80%；现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其

他证券品种占基金资产的比例为 5%-40%，其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，资产支持证券占基金资产净值的比例为 0-20%，权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%。本基金的业绩比较基准为  $75\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 25\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

#### 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》、《建信内生动力股票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 2011 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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日。

##### 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。

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 关联方关系

##### 6.4.6.1 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

经建信基金管理有限责任公司(以下简称"公司")2010年度第二次临时股东会审议通过,并于2011年5月4日中国证监会证监许可[2011]648号文批准,本公司原股东中国华电集团公司将所持有的建信基金管理有限责任公司10%的股权转让给中国华电集团资本控股有限公司。该事项已于2011年6月9日在中国证券报、上海证券报、证券时报及我公司网站公开披露。

##### 6.4.6.2 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 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 2010 年 11 月 16 日生效，无上年度可比期间。

### 6.4.7.2 关联方报酬

#### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	32,501,406.21	-
其中：支付销售机构的客户维护费	19,984,042.00	-

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 1.50% 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 1.50% / 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 2010 年 11 月 16 日生效，合同生效当期未满 2 个月。

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,416,901.09	-

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 0.25% 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 0.25% / 当年天数。

2、本基金基金合同自 2010 年 11 月 16 日生效，合同生效当期未满 2 个月。

**6.4.7.3 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 2010 年 11 月 16 日生效,无上年度可比期间。

**6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位:份

项目	本期 2011年1月1日至2011年 6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年 6月30日
期初持有的基金份额	9,999,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,000.00	-
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	0.26%	-

注:1、本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司委托中国建设银行以自有资金 1,000 万元人民币于认购期认购本基金,认购费 1,000 元。

2、本基金基金合同自 2010 年 11 月 16 日生效,无上年度可比期间。

**6.4.7.4.2 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**

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。本基金基金合同自 2010 年 11 月 16 日生效,无上年度可比期间。

**6.4.7.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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
中国工商银行	965,824,914.61	4,142,586.80	-	-

注:1、本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

2、本基金基金合同自 2010 年 11 月 16 日生效,合同生效当期未满 2 个月。

**6.4.7.6 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。

**6.4.7.7 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。

**6.4.8 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券****6.4.8.1 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。

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数量（股）	期末成本总 额	期末估值总 额	备注
000759	中百集团	2011-04-14	重大资产重组	12.32	-	-	1,233,943	15,500,167.11	15,202,177.76	-

注：本基金截止 2011 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布的影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2011 年 6 月 30 日，本基金银行间债券正回购交易余额为 0 元。故未存在作为抵押的债券。

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2011 年 6 月 30 日，本基金从事证券交易所债券正回购交易所形成的卖出回购证券款余额为 0 元。故未存在作为抵押的债券。

#### 6.4.9 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 2011 年 6 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 2,756,122,653.42 元，属于第二层级的余额为 15,202,177.76 元，无属于第三层级的余额。

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。

对于持有的认购新发证券，本基金将相关股票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。

于本会计期间内，本基金持有的河南双汇投资发展股份有限公司发行的股票（“双汇发展”）因重大事项停牌。由于该重大事项对于双汇发展估值的影响程度更多取决于不可观察的输入值，本基金于停牌期间将双汇发展从第一层级转入第三层级，并于复牌后打开跌停之日起将其从第三层级转回第一层级。在上述层级转换中，从第一层级转入第三层级时涉及的公允价值为 10,522,500.00 元，从第三层级转回第一层时涉及的公允价值为 9,435,000 元，在估值属于第三层级期间计入损益的公允价值变动损失为 1,087,500.00 元。

(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	2,771,324,831.18	73.71
	其中：股票	2,771,324,831.18	73.71
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	967,888,094.16	25.74
6	其他各项资产	20,375,251.91	0.54
7	合计	3,759,588,177.25	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	75,428,968.52	2.02
C	制造业	1,160,891,251.47	31.12

C0	食品、饮料	248,647,989.23	6.67
C1	纺织、服装、皮毛	97,799,137.01	2.62
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	104,680,489.32	2.81
C5	电子	12,701,581.75	0.34
C6	金属、非金属	117,901,811.01	3.16
C7	机械、设备、仪表	399,370,049.45	10.71
C8	医药、生物制品	179,790,193.70	4.82
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	61,379,494.08	1.65
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	175,928,370.61	4.72
H	批发和零售贸易	345,404,226.83	9.26
I	金融、保险业	588,411,839.31	15.78
J	房地产业	154,639,892.18	4.15
K	社会服务业	76,524,531.92	2.05
L	传播与文化产业	5,616,000.00	0.15
M	综合类	127,100,256.26	3.41
	合计	2,771,324,831.18	74.30

注：以上行业分类以 2011 年 6 月 30 日的中国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	4,485,550	216,517,498.50	5.80
2	600016	民生银行	30,500,000	174,765,000.00	4.69
3	002304	洋河股份	812,310	102,481,029.60	2.75
4	600415	小商品城	6,426,994	78,987,756.26	2.12
5	002024	苏宁电器	5,999,939	76,859,218.59	2.06
6	600050	中国联通	13,000,000	68,250,000.00	1.83
7	000527	美的电器	3,681,887	67,709,901.93	1.82
8	600729	重庆百货	1,454,333	62,856,272.26	1.69
9	000568	泸州老窖	1,288,250	58,125,840.00	1.56
10	000581	威孚高科	1,500,000	57,825,000.00	1.55

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 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn) 网站的半年度报告正文。

### 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	295,009,715.92	5.46



2	600016	民生银行	252,744,229.81	4.68
3	600362	江西铜业	185,408,729.19	3.43
4	600585	海螺水泥	129,037,779.18	2.39
5	000729	燕京啤酒	104,161,023.32	1.93
6	600415	小商品城	103,191,902.77	1.91
7	600418	江淮汽车	100,552,720.08	1.86
8	000581	威孚高科	92,968,615.94	1.72
9	002304	洋河股份	87,433,645.22	1.62
10	601607	上海医药	86,917,642.31	1.61
11	000063	中兴通讯	79,464,942.46	1.47
12	600050	中国联通	77,051,100.83	1.43
13	002024	苏宁电器	76,838,079.85	1.42
14	002008	大族激光	75,354,149.72	1.39
15	600036	招商银行	73,490,900.57	1.36
16	600600	青岛啤酒	72,329,926.04	1.34
17	600309	烟台万华	70,533,614.05	1.31
18	300070	碧水源	69,520,337.34	1.29
19	002344	海宁皮城	66,578,980.98	1.23
20	000527	美的电器	66,490,570.25	1.23

注：买入金额接买入成交金额(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	600362	江西铜业	184,826,639.60	3.42
2	600585	海螺水泥	126,899,354.18	2.35
3	600016	民生银行	105,836,479.85	1.96
4	600418	江淮汽车	102,780,266.12	1.90
5	000729	燕京啤酒	97,535,905.95	1.81
6	601607	上海医药	82,362,079.09	1.52
7	601166	兴业银行	67,706,112.77	1.25
8	600600	青岛啤酒	65,664,784.91	1.22
9	002008	大族激光	62,518,541.88	1.16
10	002202	金风科技	61,486,100.99	1.14
11	000338	潍柴动力	60,655,263.26	1.12
12	600309	烟台万华	59,853,258.72	1.11
13	601318	中国平安	57,381,849.95	1.06
14	002417	三元达	57,115,229.26	1.06
15	000063	中兴通讯	52,912,501.34	0.98
16	000630	铜陵有色	46,695,617.31	0.86
17	000968	煤气化	45,401,151.28	0.84
18	000960	锡业股份	44,915,377.84	0.83
19	000157	中联重科	43,066,951.85	0.80
20	600028	中国石化	42,177,249.26	0.78

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	5,990,578,239.61
卖出股票收入（成交）总额	3,195,416,153.64

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

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	5,255,588.29
2	应收证券清算款	13,561,624.63
3	应收股利	1,148,908.44
4	应收利息	193,636.34
5	应收申购款	215,494.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,375,251.91

#### 7.9.4 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处于转股期的可转换债券。

#### 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
69,501	55,687.25	209,744,511.13	5.42%	3,660,574,854.18	94.58%

### 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	9,881.92	0.00%

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年11月16日）基金份额总额	5,388,220,664.00
本报告期期初基金份额总额	5,388,220,664.00
本报告期基金总申购份额	262,288,758.56
减：本报告期基金总赎回份额	1,780,190,057.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,870,319,365.31

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

本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。

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	
中信建投证券	1	2,474,593,781.09	26.94%	2,018,634.85	27.00%	-
国元证券	1	1,980,991,812.14	21.57%	1,609,565.48	21.53%	-
建银投资证券	1	1,801,192,260.56	19.61%	1,468,666.30	19.65%	-
海通证券	1	1,324,333,382.67	14.42%	1,076,027.52	14.39%	-
招商证券	1	952,977,050.31	10.37%	774,300.31	10.36%	-
广发证券	2	651,906,106.48	7.10%	528,796.89	7.07%	-
渤海证券	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，渤海证券新增一个交易单元，其他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	
	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
中信建投证券	30,551,390.00	100.00%	390,000,000.00	100.00%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
建银投资证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司

二〇一一年八月二十四日