建信保本混合型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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:2013年1月21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。

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2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信保本混合
基金主代码	530012
交易代码	530012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月18日
报告期末基金份额总额	1,826,658,910.12份
投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理,在为适用保本条款的每份基金份额提供人民币1.00元的保本保证的基础上,寻求组合资产的稳定增长和保本周期收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略(Constant-Proportion Portfolio Insurance,CPPI),通过良好的资产配置、组合管理和风险控制,来实现保本和增值的目标。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税前)
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险品种。
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
基金保证人	中国投资担保有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	18,338,133.55
2.本期利润	18,977,138.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.0099
4.期末基金资产净值	1,895,690,329.95
5.期末基金份额净值	1.038

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、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。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期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

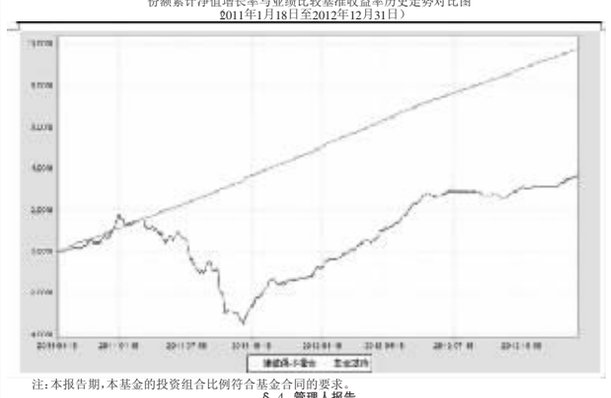
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.97%	0.04%	1.09%	0.01%	-0.12%	0.03%

3.2.2自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

建信保本混合型证券投资基金

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1月18日至2012年12月31日)



注: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基金经理(或基金经理小组)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		
黎颖芳	本基金基金经理	2011-1-18	-	12	黎颖芳女士,硕士。2000年毕业于湖南大学金融保险学院,毕业后就职于大成基金管理公司,先后在金融工程部和规划发展部担任研究员和产品设计师等职。黎颖芳于2005年11月加入建信基金管理公司研究部,先后担任债券研究员、高级债券研究员和基金经理助理等职,2009年2月19日至2011年5月11日任建信稳定增利债券基金的基金经理;2012年11月15日起任建信纯债债券基金基金经理。
彭云峰	本基金基金经理	2011-11-30	-	7	硕士。曾任中经网数据有限公司财经分析师、国都证券有限责任公司债券研究员兼宏观研究员,2006年5月起就职于鹏华基金管理公司,历任债券研究员、社保组合投资经理、债券基金经理等职,2010年5月31日至2011年6月14日任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理。彭云峰于2011年6月加入我公司。2012年2月17日起任建信货币市场基金的基金经理;2012年5月29日起任建信转债增强基金的基金经理。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信保本混合型证券投资基金合同》的规定。

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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

4季度国内经济数据有所好转,工业增加值和发电量小幅回升,投资增速保持平稳,房地产销售和汽车销售向好推动消费也有所好转,物价指数同比数据预计在12月受食品价格拉动重返2%以上水平。在此宏观环境下,央行货币政策继续保持中性,公开市场操作将市场短期利率引导在一个较为平稳的水平。但10年期国债受经济复苏驱动力影响收益率较上季末3.45%水平上升15bp至3.60%左右;信用债涨跌不一,高等级信用债跟随利率债有所调整,低等级信用债收益率反而有所下降,反映投资者对信用风险的偏好明显上升。总体来看中债财富总指数仅上涨0.56%,权益资产中沪深300指数上涨10.02%,中信标普转债指数上涨4.39%。

本基金在本季度以持有短久期安全资产(住要为信用债)为主,风险资产比例较低。

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0.97%,波动率0.04%,业绩比较基准收益率1.09%,波动率0.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断2013年一季度经济仍将处于弱复苏通道中,央行货币政策仍将保持中性。在此环境下对利率产品的中长端难以有较强表现,中低等级信用债仍将受到市场追捧,风险资产或将继续上演反弹行情。我们将密切关注价格走势的变化,以观测此轮经济反弹的强度以及拐点,以便灵活调整资产配置,在遵守基金合同基础上力争继续为投资者创造稳健的收益。

§5 投资组合报告

5.1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	24,552,052.00	1.29
	其中,股票	24,552,052.00	1.29
2	固定收益投资	1,831,522,934.17	96.19
	其中:债券	1,831,522,934.17	96.19
	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	22,854,919.19	1.20
6	其他各项资产	25,145,750.66	1.32
7	合计	1,904,075,656.02	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	8,310,000.00	0.44
C0	食品、饮料	5,790,000.00	0.31
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	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	2,520,000.00	0.13
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	5,260,000.00	0.28
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	6,320,652.00	0.33
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	4,661,400.00	0.25
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	24,552,052.00	1.30

注:以上行业分类以2012年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.3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	000895	双汇发展	100,000	5,790,000.00	0.31
2	002344	海宁皮城	200,000	5,316,000.00	0.28
3	600795	国电电力	2,000,000	5,260,000.00	0.28
4	601888	中国国旅	170,000	4,661,400.00	0.25
5	600066	宇通客车	100,000	2,520,000.00	0.13
6	601010	文峰股份	70,800	1,004,652.00	0.05

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,512,000.00	5.30
	其中:政策性金融债	100,512,000.00	5.30
4	企业债券	959,335,288.87	50.61
5	企业短期融资券	542,333,000.00	28.61
6	中期票据	89,934,000.00	4.74
7	可转债	139,408,645.30	7.35
8	其他	-	-
9	合计	1,831,522,934.17	96.62

5.5报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	126011	08石化债	944,330	90,655,680.00	4.78
2	088064	08蒙路债	800,000	81,096,000.00	4.28
3	1080178	10玉溪开投债01	800,000	80,280,000.00	4.23
4	1080053	10首旅债	800,000	80,216,000.00	4.23
5	122092	11大秦01	711,990	71,526,515.40	3.77

5.6报告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。

5.7报告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。

5.8投资组合报告附注

5.8.1本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.8.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	404,665.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,526,658.01
5	应收申购款	214,426.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,145,750.66

5.8.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	64,610,383.00	3.41
2	110015	石化转债	41,891,573.70	2.21
3	110003	新钢转债	22,167,474.80	1.17
4	110018	国电转债	7,979,417.60	0.42
5	110011	歌华转债	1,874,596.20	0.10
6	110017	中海转债	885,200.00	0.05

5.8.5报告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不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,994,012,159.31
本报告期基金总申购份额	4,078,537.40
减:本报告期基金总赎回份额	171,431,786.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,826,658,910.12

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1备查文件目录

1、中国证监会批准建信保本混合型证券投资基金设立的文件;

2、《建信保本混合型证券投资基金基金合同》;

3、《建信保本混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《建信保本混合型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件和营业执照;

6、基金托管人业务资格批件和营业执照;

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

7.2存放地点:

基金管理人或基金托管人处。

7.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

二〇一三年一月二十一日

建信货币市场基金

【2012】第四季度报告

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:2013年1月21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。

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2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信货币
基金主代码	530002
交易代码	530002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月25日
报告期末基金份额总额	13,269,549,341.78份
投资目标	在力保本金安全和基金财产较高流动性的前提下,争取获得超过投资基准的收益率。
投资策略	综合运用定量分析和定性分析手段,全面评估货币市场的利率走势、类属资产和券种的风险收益水平及流动性特征,在此基础上制订本基金投资策略。具体而言,包括短期资金利率走势预测、组合剩余期限调整策略、债券期限配置策略、类属资产配置策略、品种选择策略和交易策略等方面。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为6个月银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种;预期收益和风险均低于债券基金、混合基金、股票基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	56,258,050.42
2.本期利润	56,258,050.42
3.期末基金资产净值	13,269,549,341.78

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入本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9410%	0.0082%	0.7181%	0.0000%	0.2229%	0.0082%

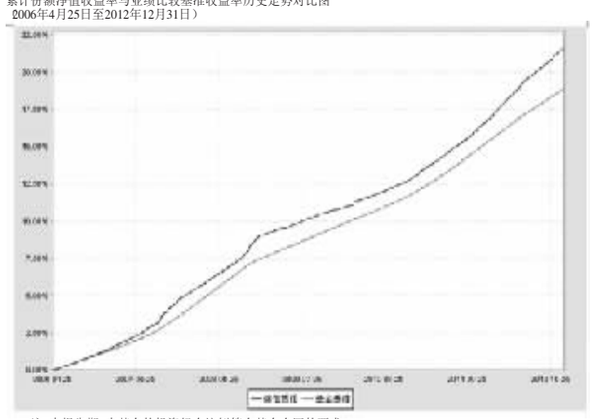
注:基金收益分配按日结转份额。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信货币市场基金

累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2006年4月25日至2012年12月31日)



注: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基金经理(或基金经理小组)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		
彭云峰	本基金基金经理	2012-2-17	-	7	硕士。曾任中经网数据有限公司财经分析师、国都证券有限责任公司债券研究员兼宏观研究员,2006年5月起就职于鹏华基金管理公司,历任债券研究员、社保组合投资经理、债券基金经理等职,2010年5月31日至2011年6月14日任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理。彭云峰于2011年6月加入我公司。2011年11月30日起任建信保本混合型证券投资基金的基金经理;2012年5月29日起任建信转债增强基金的基金经理。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信货币市场基金基金合同》的规定。

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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

去年四季度,我国经济温和复苏,工业增加值等经济增速指标明显反弹,通胀指标小幅回升。货币政策保持稳健,央行主要通过逆回购在公开市场调节流动性。由于央行持续投放资金,四季度资金面相对宽松,年底资金面也相对平稳,没有出现异常紧张的情况。

由于经济增速和通胀水平仍处于较低水平,资金面相对宽松,四季度债市总体上涨,信用债表现较好,年底收益率小幅上行。

四季度,本基金减持了即将到期的短期债券,少量投资相对较长期限的短期债券,主要投资对象为逆回购和定期存款。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值收益率0.9410%,波动率0.0082%,业绩比较基准收益率0.7181%,波动率0.0000%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望今年一季度,我们认为中国经济可能继续温和复苏。由于换届效应,以及城镇化建设加速,经济增速将持续回升,而通胀水平也可能随之上行。货币政策在保持稳健的情况下,可能需要根据经济形势和通胀水平进行微调,防止经济过热和通胀上升较快。一季度资金面可能相对宽松,春节前或偏紧一些,短期债券收益率可能先降后升,短融可能表现较好。

一季度本基金将审慎投资,灵活调整。具体而言,本基金将更加注重对流动性的管理,适当增加组合的平均剩余期限,适当增加短期信用债券的投资比例,适度投资短期逆回购和定期存款。我们将根据货币市场资金利率和经济形势的变化,积极主动对组合进行调整,在确保组合流动性的基础上,力争获取更多的投资收益。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,720,884,379.74	12.79
	其中:债券	1,720,884,379.74	12.79
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	6,539,013,679.19	48.60
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	4,967,733,288.23	36.92
4	其他各项资产	228,232,660.10	1.70
5	合计	13,455,864,007.26	100.00

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	3.19
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	39
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	78.15	0.03
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.23	-
2	30天(含)—60天	2.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	4.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.43	-
4	90天(含)—180天	10.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	4.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.70	0.03

5.4报告期末按券种品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	29,816,616.67	0.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	860,068,650.15	6.48
	其中:政策性金融债	860,068,650.15	6.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	790,919,108.93	5.96
6	中期票据	40,080,003.99	0.30
7	其他	-	-
8	合计	1,720,884,379.74	12.97
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	219,764,506.87	1.66

5.5报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	120218	12国开18	3,100,000	310,645,099.39	2.34
2	120314	12进出14	1,400,000	139,921,444.50	1.05
3	110212	11国开12	1,300,000	129,789,516.49	0.98
4	120228	12国开28	1,300,000	129,721,932.61	0.98
5	041261013	12津城建CP001	1,200,000	119,984,327.44	0.90
6	041258029	12三花CP001	600,000	60,133,690.45	0.45
7	100236	10国开36	600,000	60,039,503.23	0.45
8	041260094	12湘高速CP003	600,000	60,005,600.82	0.45
9	041254009	12华侨城CP001	500,000	50,226,287.46	0.38
10	041260010	12广控CP001	500,000	50,213,618.95	0.38

5.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.13%
报告期内偏离度的最低值	-0.02%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.04%

5.7报告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。

5.8投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在1.0000元。

5.8.2本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3基金投资的前十名债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。本报告期没有特别需要说明的证券投资决策程序。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	176,187,198.90
3	应收利息	50,082,309.20
4	应收申购款	1,963,152.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	228,232,660.10

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	2,977,852,134.08
本报告期基金总申购份额	19,036,168,944.06
减:本报告期基金总赎回份额	8,744,471,736.36
本报告期期末基金份额总额	13,269,549,341.78

注:上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§7 备查文件目录

7.1备查文件目录

1、中国证监会批准建信货币市场基金设立的文件;

2、《建信货币市场基金基金合同》;

3、《建信货币市场基金招募说明书》;

4、《建信货币市场基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件和营业执照;

6、基金托管人业务资格批件和营业执照;

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

7.2存放地点:

基金管理人或基金托管人处。

7.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

二〇一三年一月二十一日

建信全球机遇股票型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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:2013年1月21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。

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2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信全球机遇股票(QDII)
基金主代码	539001
交易代码	539001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月14日
报告期末基金份额总额	284,626,066.31份
投资目标	本基金通过全球化的资产配置和组合管理,在分散和控制投资风险的同时追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金采取"自上而下"的资产配置与"自下而上"的证券选择相结合、定量研究与定性研究相结合、组合构建与风险控制相结合的投资策略进行投资组合的构建
业绩比较基准	标准普尔全球BMI市场指数总收益率(S&P Global BMI)×70%+标准普尔BMI中国(除A、B股)指数总收益率(S&P BMI China ex-A-B-Shares)×30%
风险收益特征	本基金是全球股票型基金,其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。
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
境外投资顾问英文名称	Principal Global Investors. LLC.
境外投资顾问中文名称	信安环球投资有限公司
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman & Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-3,128,729.02
2.本期利润	11686,094.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0399
4.期末基金资产净值	258,033,955.04
5.期末基金份额净值	0.907

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、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

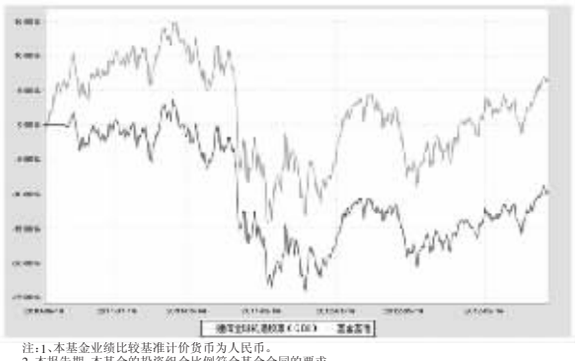
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.73%	0.62%	4.90%	0.60%	-0.17%	0.02%

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

建信全球机遇股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年9月14日至2012年12月31日)



注:1、本基金业绩比较基准计价货币为人民币。

2、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 基金经理(或基金经理小组)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		
赵英楷先生	海外投资部总监,本基金基金经理	2011-4-20	-	15	美国哥伦比亚大学商学院MBA,曾任美国美林证券公司研究员、高盛证券公司研究员、美林证券公司投资组合策略分析师、美国阿罗亚投资公司基金经理;2010年3月加入建信基金管理有限责任公司,历任海外投资部执行总监(主持工作)、总监。2011年6月21日起任建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金经理;2012年6月26日起任建信全球资源基金的基金经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Mustafa Sagun	首席投资官	21	Mustafa是信安环球股票的首席投资官,他负责监督所有国际、国内和全球股票策略的投资组合管理和研究。Mustafa从2002年开始就担任全球股票组合的主管投资经理。他之前也担任公司资产配置策略团队的成员。他2000年加入公司,并且有超过19年投资和风险管理经验。之前,他是PNC金融服务集团的副总裁和分析师和Salomon Brothers的股票衍生品专家。Mustafa从University of South Florida取得金融学Ph.D.学位和国际经济学MA学位。他从土耳其的Bogazici University取得电子和工程的学士学位。Mustafa获得了使用特许金融分析师称号的权利。他是CFA Institute和CFA Society of Iowa的成员。
Christopher Ibach	投资组合经理	18	Christopher负责监督支持所有股票策略的全球研究&发展,包括全球量化研究、股票选择模型发展、投资组合构建和风险管理。他作为共同投资组合经理,专精于主动核心、机会型的和专业全球组合。Chris也监督公司的系统策略团队,负责被动增强和被动股票组合。他在2000年作为股票研究分析师加入公司,专精于分析国际科技公司并在2002年成为投资组合经理。在此之前,Chris在Motorola,Inc取得了6年的相关行业经验。Chris从University of Iowa获得了金融学MBA学位和电子工程学士学位。Chris获得了使用特许金融分析师称号的权利并且是CFA Institute的成员。
Alan Wang	投资组合经理	12	Alan Wang担任香港和中国策略主管。作为全球新兴市场团队的成员,还担任大中华区研究团队负责人。他的职业生涯开始于中国银行,担任财务总监执行顾问超过3年时间,也为该行IPO准备工作提供支持。他最初加入信安时,是全球研发团队的高级成员,负责我们全球研究平台(GRP)的模型搭建,特别是亚洲和大中华选股模型。自2003至2008年他曾是信安组合经理和高级研究员,不仅是香港和中国股票组合经理,还是研究员及亚洲和新兴市场策略的助理组合经理。Alan Wang曾任中国平安资产管理公司(香港)的股票投资