

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	建信核心精选股票
基金主代码	530006
交易代码	530006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月25日
报告期末基金份额总额	2,318,686,271.96份
投资目标	本基金通过对宏观经济环境、市场环境、行业特征和公司基本面的深入分析,精选具有良好成长性和价值性的上市公司股票,在有效控制风险的前提下力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人从经济环境、市场状况、行业特征等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行分析,作出投资决策。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×中国国债总指数。
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,一般情况下其风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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

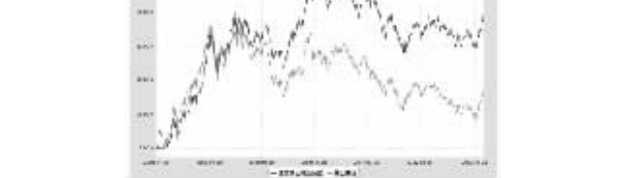
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2012年10月1日至2012年12月31日)
1.本期已实现收益	8,927,731.95
2.本期利润	201,227,386.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0937
4.期末基金资产净值	2,477,783,971.32
5.期末基金份额净值	1.069

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 准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.97%	0.82%	7.68%	0.96%	1.29%	-0.14%

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
建信核心精选股票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
2008年11月25日至2012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	建信沪深300指数(LOF)
基金主代码	163309
交易代码	163309
基金运作方式	契约型、上市开放式
报告期末基金份额总额	4,323,026,557.24份
投资目标	本基金采取指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数投资策略,紧密跟踪标的指数,构建主要按照标的指数的成份股及其权重来组合,复制标的指数,并跟踪标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行税后存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2012年10月1日至2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-55,701,621.81
2.本期利润	271,670,581.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0629
4.期末基金资产净值	3,169,337,197.05
5.期末基金份额净值	0.733

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 准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.40%	1.23%	9.53%	1.22%	-0.13%	0.01%

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
建信沪深300指数证券投资基金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
2009年1月5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

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:招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。
基金托管人招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	建信双利分级股票
基金主代码	163310
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月6日
报告期末基金份额总额	1,670,659,139.14份
投资目标	本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司,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提供超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过自上而下的方式,通过对经济发展周期中结构性、周期性或周期性趋势的分析和研判,深入挖掘上述趋势得以产生和持续的原因在驱动因素以及潜在的投资主题,在前述主题筛选和主题配置的基础上,本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具,采用自下而上方式精选具有投资价值股票构建投资组合。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作、股票型基金,其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和股票型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

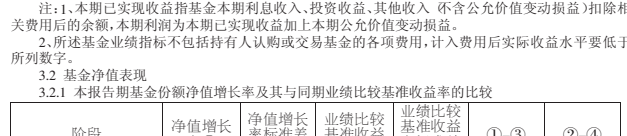
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	
单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2012年10月1日至2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-31,844,260.25
2.本期利润	106,512,189.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0621
4.期末基金资产净值	1,539,348,525.38
5.期末基金份额净值	0.921

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 准标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.47%	1.19%	9.53%	1.22%	-2.06%	-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
建信双利策略主题分级股票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5月6日至2012年12月31日



建信核心精选股票型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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	副总经理, 本基金基金经理	2010-4-27	-	14	注册金融分析师(CFA), 中国人民银行研究生部硕士。1998年10月加入长盛基金管理有限公司, 历任研究员、基金理财助理、基金经理等职。2002年11月2日至2004年5月22日任长盛成长价值贰号证券投资基金基金经理。2004年6月加入长盛成长贰号基金管理有限公司, 历任基金经理、投资副总监、投资总监等职。2005年3月16日至2009年3月16日任长盛成长贰号证券投资基金基金经理。(LOF)的基金经理, 2007年6月18日至2009年3月16日任景顺长城成长策略股票证券投资基金基金经理。2009年3月16日起任长盛成长贰号证券投资基金基金经理。2009年3月16日起任公司副总经理。2009年12月1日至2011年2月1日任建信上证资源基金基金经理。2010年11月16日至2011年12月20日任建信内生动力基金基金经理。

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	23,609,557.18	0.95
B	采矿业	32,953,276.20	1.33
C	制造业	601,446,819.13	24.27
CD	批发和零售业	155,719,647.86	6.28
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	92,976,068.86	3.75
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	54,262,947.01	2.19
C7	机械、设备、仪器	140,680,181.65	5.68

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《建信核心精选股票型证券投资基金基金合同》的规定。
4.3 管理人对于报告期内本基金投资情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
为了公平对待投资者,保护投资者利益,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》、《证券投资基金管理人内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、基金管理人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》等风险管理制度,公司使用的交易系统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超过该证券当日成交量5%的情况。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。
4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析
4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
在报告期内,本基金跟踪误差主要源自标的指数中工商银行和建设银行两只股票于法律法规规定无法投资,必须寻找其他股票进行替代。本基金管理人以量化分析研究为基础,制定及执行了相应的替代策略,并持续根据市场数据对替代方案进行优化和调整,以尽可能降低跟踪误差及偏离度。
在报告期内,个别交易日的大额申购赎回、成份股分红、停牌等因素也对跟踪误差及偏离度产生了一定影响。本基金管理人已在日常管理中通过适当的策略尽力克服这些不利影响。
在报告期末,本基金积极应对对指数成份股的调整,较好地控制了跟踪误差及交易成本。
4.4.2 报告期内基金的投资组合和资产分布
本基金本报告期净值增长率为9.04%,波动率1.23%,业绩比较基准收益率为9.53%,波动率1.22%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
在四季度初期,指数延续第三季度的颓势继续下跌,但到12月份,在银行股等权重股的带领下,指数走出了一波明显的反弹行情,市场情绪也得到了一定程度的修复。预计一季度初期,市场仍然有望保持比较积极的情绪。
本基金管理人将根据基金合同,继续秉承被动复制策略,并以量化方式不断改进,克服个别成份股无法投资、基金日常申购、成份股停牌等各种因素造成的不利影响,不断优化和优化模型,将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。
§ 5 投资组合报告

4.4 报告期内各期的投资策略和业绩表现说明			
4.4.1 报告期内本基金投资策略和业绩表现分析			
2012年度,本基金投资策略为:9月、10月、11月市场延续之前的弱势格局,强势股回调,同时低估值蓝筹、前期增持行业率先企稳。前18大重仓宏观政策逐渐明朗,市场开始预期短期经济见底的现实,市场提升了对中期经济增速的预期。宽松、稳货币的背景,海外投资者对人民币资产需求;经过前两周快速下跌,大盘出现了比较明显的估值优势。在上述因素的共同作用下,市场在12月快速上涨,上证综指创出了新高。			
本基金在4季度延续了前期相对均衡的配置策略,同时自10月下旬增持了部分低估值蓝筹股。			
4.4.2 报告期内本基金业绩表现			
报告期内本基金净值增长率为97%,波动率为82%,业绩比较基准收益率为68%,波动率为96%。			
4.5 管理人对本期投资策略、证券市场及行业走势的简要展望			
展望2013年1季度,本基金认为中国经济企稳回升已经在股价中得到一定程度的反映,经济企稳和通胀的复苏为货币政策宽松提供了空间,我们看好科技工业、消费品、以及政府对于中国经济中长期发展的作用。			
本基金将延续一贯的均衡风格,在1季度宏观相对均衡的投资策略,灵活调整权益资产的配置,精选优质个股,在保持整体资产仓位稳定的前提下,适度增加科技工业、消费品、增长潜力强的消费股,是成长性与价值相配的组合。上述三方面是一个改善趋势的周期股。			

5.3 报告期内基金资产公允价值与公允价值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	600036	招商银行	9,985,600	137,302,000.00	5.54
2	000002	万科A	13,029,648	131,860,037.76	5.32
3	000004	招商地产	4,007,786	119,729,723.54	4.83
4	600038	1地能国际	1,299,864	114,490,045.28	4.62
5	600519	贵州茅台	108,752	90,339,343.00	3.69
6	601318	中国平安	1,988,891	90,076,473.24	3.62
7	601628	中国人寿	3,405,003	72,867,064.20	2.94
8	600016	民生银行	1,914,214	71,559,122.04	2.89
9	600809	山西汾酒	1,099,812	45,183,167.92	1.85
10	600085	同仁堂	2,569,555	45,789,470.00	1.85

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有积极投资股票。
5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	600036	招商银行	9,985,600	137,302,000.00	5.54
2	000002	万科A	13,029,648	131,860,037.76	5.32
3	000024	招商地产	4,007,786	119,792,723.54	4.83
4	600383	金地集团	16,299,864	114,425,045.28	4.62
5	600519	贵州茅台	508,752	106,339,343.04	4.29
6	601318	中国平安	1,988,891	90,076,873.39	3.64
7	601628	中国人寿	3,405,003	72,867,064.20	2.94
8	600016	民生银行	9,104,214	71,559,122.04	2.89
9	600809	山西广厦	1,099,812	45,818,167.92	1.85
10	600085	同仁堂	2,569,555	45,789,470.10	1.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.4.1 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.4.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

【2012】第四季度报告

4.1 基金经理 或基金经理小组简介		姓名	职务	任本基金基金经理期限	证券从业年限	说明
梁洪均先生	投资管理部执行总监、本基金基金经理	2009-11-5	-	10		注册金融分析师(CFA)，2003年1月获清华大学经济学博士学位，2003年1月至2005年8月，就职于大成基金管理有限公司，历任金融工程研究员、规划发展部产品设计师、机构理财部高级经理，2005年9月加入本公司，历任研究部研究员、高级研究员、研究部总监助理、研究部副总监、投资管理部副总监，2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任ETF及联接基金基金经理，2011年9月8日起任深证基本面60ETF及联接基金基金经理，2012年3月16日起任信诚深证100投资基金的基金经理。

2	固定收益投资	89,937,000.00	2.83
	其中：债券	89,937,000.00	2.83
3	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	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	78,650,048.26	2.48
6	其他各项资产	5,849,794.37	0.18
7	合计	3,175,343,038.97	100.00
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合			
5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合			
报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合			
5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合			

4.2 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《建信沪深300指数证券投资基金基金合同》的规定。
4.3 管理人对于报告期内本基金投资情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
为了公平对待投资者,保护投资者利益,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》、《证券投资基金管理人内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、基金管理人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》等风险管理制度,公司使用的交易系统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超过该证券当日成交量5%的情况。本报告期,未发现本基金存在异常交易行为。
4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析
4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
在报告期内,本基金跟踪误差主要源自标的指数中工商银行和建设银行两只股票于法律法规规定无法投资,必须寻找其他股票进行替代。本基金管理人以量化分析研究为基础,制定及执行了相应的替代策略,并持续根据市场数据对替代方案进行优化和调整,以尽可能降低跟踪误差及偏离度。
在报告期内,个别交易日的大额申购赎回、成份股分红、停牌等因素也对跟踪误差及偏离度产生了一定影响。本基金管理人已在日常管理中通过适当的策略尽力克服这些不利影响。
在报告期末,本基金积极应对对指数成份股的调整,较好地控制了跟踪误差及交易成本。
4.4.2 报告期内基金的投资组合和资产分布
本基金本报告期净值增长率为9.04%,波动率1.23%,业绩比较基准收益率为9.53%,波动率1.22%。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
在四季度初期,指数延续第三季度的颓势继续下跌,但到12月份,在银行股等权重股的带领下,指数走出了一波明显的反弹行情,市场情绪也得到了一定程度的修复。预计一季度初期,市场仍然有望保持比较积极的情绪。
本基金管理人将根据基金合同,继续秉承被动复制策略,并以量化方式不断改进,克服个别成份股无法投资、基金日常申购、成份股停牌等各种因素造成的不利影响,不断优化和优化模型,将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。
§ 5 投资组合报告

4.3.2 异常交易行为的专项说明		D 电力、煤气及水的生产和供应业		72,729,255.81	2.30
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。		E 建筑业		60,020,323.73	2.27
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明		F 交通运输、仓储业		80,023,448.49	2.82
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析		G 信息技术业		72,297,617.27	2.28
在报告期内,本基金根据基金合同约定,采取了对指数的被动投资策略,将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围之内。		H 批发和零售贸易		71,830,545.87	2.27
在报告期内,本基金跟踪误差主要源自标的指数中工商和服务业银行两只股票限于法律法规规定无法投资,必须予以其他股票进行替代。本基金以量化分析研究为基础,选取及执行了相应的替代策略,使得市场对于该两基金投资组合的跟踪误差较小,可以忽略跟踪误差及交易成本。		I 金融、保险业		1,025,767,822.47	32.37
在报告期内,个别交易日内的大额申购和赎回、成份股停牌等因素也会对跟踪误差及偏离度产生一定影响。本基金管理人已在日常管理中通过选择接近的略宽几只个股来减少其不利影响。		J 房地产业		181,235,488.70	5.72
在报告期内,本基金积极应对指数成份股的调整,较好地控制了跟踪误差及交易成本。		K 制造业		30,155,561.76	0.95
4.4.2 报告期内基金的投资表现		L 通信与文化产业		8,467,984.08	0.27
		M 综合类		42,233,266.20	1.33
				3,000,906,196.34	94.69

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有积极投资股票。
5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	600036	招商银行	14,654,783	115,186,594.38	3.63
2	600036	招商银行	8,072,922	111,002,677.50	3.50
3	601318	中国平安	1,099,196	90,135,523.94	2.84
4	601628	中国人寿	4,675,552	78,034,962.88	2.48
5	601328	交通银行	14,373,835	71,006,744.90	2.24
6	600000	浦发银行	6,648,348	65,951,612.16	2.06
7	601288	农业银行	21,963,232	61,497,049.60	1.94
8	000022	万科A	5,742,530	58,114,403.60	1.82
9	600809	山西广厦	4,091,032	54,656,165.28	1.73
10	600519	贵州茅台	246,672	51,559,381.44	1.63

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

建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

【2012】第四季度报告

经济转型和城镇化的舞台上,超额收益将来自选股能力和耐心。
本基金属于高仓位运作,主动投资的股票型基金,将会通过吸收投研团队的研究成果,优化行业配置并精选个股,来取得超额收益。
§ 5 投资组合报告

经济转型和城镇化的舞台上,超额收益将来自选股能力和耐心。

本基金属于高仓位运作、主动投资的股票型基金,将会通过吸收投研团队的研究成果,优化行业配置并精选个股,来取得超额收益。

§ 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	1,430,983,150.70	92.31
	其中:股票	1,430,983,150.70	92.31
2	固定收益投资	--	--
	其中:债券	--	--
	资产支持证券	--	--

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有积极投资股票。
5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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(%)
A	农林牧渔	-	-	26,246,420.25	1.71
B	采矿业	-	-	93,346,100.99	6.06
C	制造业	-	-	569,577,235.50	37.00
D	消费品、饮料	-	-	105,446,097.67	6.85
E	纺织服装、皮毛	-	-	-	-
F	医药、生物制品	-	-	-	-
G	信息技术业	-	-	-	-
H	房地产业	-	-	-	-
I	金融业	-	-	-	-
J	其他服务业	-	-	-	-
K	社会服务业	-	-	-	-
L	传播与文化产业	-	-	-	-
M	综合类	-	-	-	-
合计	-	-	-	1,430,983,150.70	92.36

注:以上行业分类为以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	600016	民生银行	11,671,995	91,741,880.70	5.96
2	601166	兴业银行	3,748,275	62,558,709.75	4.06
3	601318	中国平安	941,262	62,429,755.88	2.77
4	600519	贵州茅台	191,576	40,043,215.52	2.60
5	000024	招商地产	1,155,401	34,344,935.89	2.24
6	600030	中信证券	2,456,994	32,825,439.84	2.13
7	600422	昆明制药	1,654,872	32,220,357.84	2.09
8	300070	碧水源	800,760	32,110,476.00	2.09
9	600048	保利地产	2,176,485	29,600,196.00	1.92
10	600837	海通证券	2,805,029	28,751,547.25	1.87

注:以上行业分类为以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(%)
A	农林牧渔	-	-	26,246,420.25	1.71
B	采矿业	-	-	93,346,100.99	6.06
C	制造业	-	-	569,577,235.50	37.00
D	消费品、饮料	-	-	105,446,097.67	6.85
E	纺织服装、皮毛	-	-	-	-
F	医药、生物制品	-	-	-	-
G	信息技术业	-	-	-	-
H	房地产业	-	-	-	-