建信货币市场基金 2009 年半年度报告摘要

2009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 送出日期:2009年8月29日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国工商银行有限公司根据本基金合同规定,于2009年8月25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 导性陈述或者重大溃漏。

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

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2009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	建信货币			
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	4,857,944,270.21 份			
2.2 基金产品说明				

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。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

項 目 名称		基金管理人	基金托管人	
		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司	
	姓名	路彩营	蒋松云	
信息披露负责人 联系电话		010-66228888	010-66105799	
	电子邮箱	xinxipilu@eebfund.cn	custody@icbc.com.cn	
客户服务电话 传真		400-81-95533, 010-66228000	95588	
		010-66228001	010-66105798	

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.eebfund.en
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 2009年1月1日-2009年6月30日)
本期已实现收益	67,041,968.79
本期利润	67,041,968.79
本期净值收益率	0.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 2009 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	4,857,944,270.21
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 2009 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	9.86%

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、本基金的基金利润分配是按日结转份额。
- 3、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
- 321 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	份额净值收 益率①	份额净值收 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
过去一个月	0.1672%	0.0073%	0.1651%	0.0000%	0.0021%	0.0073%
过去三个月	0.3742%	0.0049%	0.5017%	0.0000%	-0.1275%	0.0049%
过去六个月	0.7721%	0.0061%	1.0004%	0.0000%	-0.2283%	0.0061%
过去一年	3.1226%	0.0109%	2.6974%	0.0021%	0.4252%	0.0088%
过去三年	9.5443%	0.0076%	8.1721%	0.0022%	1.3722%	0.0054%
自基金合同生效 起至今	9.8571%	0.0075%	8.5060%	0.0022%	1.3511%	0.0053%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

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,成都分公司。自公司成立以来,就一直不断完善公司治理结构,坚持规范运作,科学管理,秉持、储信、 专业、规范、创新"的核心价值观,稳步推进战略实施,不断完善内控机制,公司保持了稳定、良性发展。

截至2009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七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371.12亿元。

4.1.2 基金经理简介

Art. de	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年	2440	
姓名	职务	任职日期	离任日期	限	说明	
汪沛 先生	投资管理部副 总监,本基金基 金经理	2006年4月25日	-	九年	師士、2000年进入中国农业 行总符签金额定中心、担任 今交易是、2001年3月加 富田基金管理等限处司。历 定职与债券研究员、固定收 61月任富国天利增长债券投 基金基金经理。2006年1月 入量信基金经增,2006年1月 日 1007年3月至今縣任建 付化配置基金基金经理。2006年2008年6月至今縣任建信 定增利基金基金经理之	
李菁女士	本基金基金经理	2007年 11 月 1 日	-	四年	硕士。2002年7月进入中国设银行股份有限公司基金托等业务。 部工作、从事基金托管业务、主任科员。2005年9月加入信基金管理有限责任公司。 后任债券研究员和基金经助理,2009年6月1日起兼建馆收益增强基金基金经理一。	

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》等风险管控流程。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

- 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

比较基准收益率 1.0004%。

- 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
- 2009年6月30日本基金万份收益为0.2617元,2009年上半年份额净值收益率为0.7721%,同期业绩

上半年政府从去年四季度以来刺激经济的各项政策开始初显成效,工业增加值、固定资产投资、发电 量等指标均显示经济活跃度有所提升,经济回暖的预期有所增强。与此同时,居民物价指数同比虽然仍在 负值区间,但环比数据逐步趋好。政策方面,央行整体执行宽松的货币政策,货币供应量和新增贷款数据都 在高位运行,市场流动性充裕,货币市场利率在低位徘徊。二季度末,随着新股发行的重启和后续1年期央 票的恢复发行,货币市场利率有小幅上扬趋势。

今年以来,由于股票市场的持续向好以及货币市场利率的低位徘徊,货币市场基金规模有所缩减。建 信货币市场基金根据市场情况和规模变化,采取动态调整的低久期策略。一季度初增加了高等级信用产品 的配置比例,二季度大幅缩短了组合的平均剩余期限,增强组合的流动性配置,以防止后续新股尤其是大 盘股发行对流动性的冲击。

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,我们认为后续经济先行指标仍然会在高位维持,宏观经济向好的预期将愈发增强,居民 物价指数可能稳中有升。同时虽然从总的基调上讲,央行仍会执行适度宽松的货币政策,但也会采取适当 的手段进行微调,货币市场的流动性宽裕程度应呈边际下降趋势,货币市场利率或将维持小幅上扬趋势。 我们也将特别关注大盘股发行等事件可能对市场和基金产生的影响,并在投资策略制定中进行动态调整。

-如既往,建信货币市场基金仍将保持稳健的投资风格,增强组合的流动性,力争保证组合能够跟随 市场的发展变化,获得合理的收益,以回报持有人的信任和厚爱。

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》的规定,为保护持有人利益,建信基金管理有限责任公司 億见简称 公司")进一步加强和完善了 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

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富相关领域专业知识、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 俱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

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

基会经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值完价过程中,充分表达对相关问题及完价方案的 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。

截至本报告期期末,尚未存在与本公司签约的定价服务机构。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式为红利再投资,每日将当日收益结转为基金份额,当日收益参与下一日基金收益 分配,并按月结转到投资者基金账户。本半年度基金应分配利润为67,041,968.79元,已全部分配,符合法 律法规和 (基金合同)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 2009年上半年,本基金托管人在对建信货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、 《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关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 2009年上半年,建信货币市场基金的管理人——建信基金管理有限公司在建信货币市场基金的投资 运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资 基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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公司编制和披露的建信货币市场基金 2009 年半年度报告中财务 指标、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。

§ 6 半年度财务会计报表(未经审计)

6.1 资产负债表 会计主体:建信货币市场基金 报告截止日:2009年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2009年 6 月 30 日	上年度末 2008年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		12,050,173.97	625,008,000.68
结算备付金		59,307,777.78	-
存出保证金		-	
交易性金融资产		2,596,326,737.55	11,959,559,476.42
其中:股票投资		-	
基金投资		-	
债券投资		2,596,326,737.55	11,959,559,476.42
资产支持证券投资		-	
衍生金融资产		-	-
买人返售金融资产		1,910,000,870.00	2,026,800,195.00
应收证券清算款		150,084,000.00	
应收利息		31,040,003.90	62,926,634.35
应收股利		-	
应收申购款		103,541,862.10	500.00
递延所得税资产		_	-
其他资产		-	93,700.20
资产总计		4,862,351,425.30	14,674,388,506.65
负债和所有者权益			
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		-	-
应付证券清算款		-	320,978,400.00
应付赎回款		661,235.38	3,639,631.24
应付管理人报酬		1,750,358.26	3,355,306.80
应付托管费		530,411.62	1,016,759.64
应付销售服务费		1,326,029.00	2,541,899.07
应付交易费用		21,462.62	244,003.07
应交税费		-	
应付利息		-	
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	
其他负债		117,658.21	95,000.00
负债合计		4,407,155.09	331,870,999.82
所有者权益:		-	_
实收基金		4,857,944,270.21	14,342,517,506.83
未分配利润		-	_
所有者权益合计		4,857,944,270.21	14,342,517,506.83
负债和所有者权益总计		4,862,351,425.30	14,674,388,506.65

注:报告截止日 2009 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.0000 元,基金份额总额 4,857,944,270.21 份。 6.2 利润表

会计主体:建信货币市场基金

本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币

項目	附注号	本期 2009年1月1日至2009 年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至 2008年6月30日
一、收入		98,933,926.26	60,748,313.98
1.利息收入		70,302,531.29	57,164,558.94
其中:存款利息收入		850,917.17	383,302.31
债券利息收入		56,003,953.29	49,289,375.49
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收入		13,447,660.83	7,491,881.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益 损失以 ""填列)		28,631,135.37	3,583,755.04
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		28,631,135.37	3,583,755.04
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益		-	-
4.汇兑收益 {损失以 ""号填列)		-	-
5.其他收入 损失以 ""号填列)		259.60	-
二、费用(以""号填列)		-31,891,957.47	- 12,515,759.51
1.管理人报酬		-14,928,242.68	-5,091,620.55
2.托管费		-4,523,709.98	-1,542,915.33
3.销售服务费		-11,309,274.82	-3,857,288.21
4.交易费用		-	-
5.利息支出		-860,126.14	-1,737,179.05
其中:卖出回购金融资产支出		-860,126.14	-1,737,179.05
6.其他费用		-270,603.85	-286,756.37
三、利润总额 (亏损总额以""号填列)		67,041,968.79	48,232,554.47
所得税费用 (以""号填列)		-	-
四、净利润(争亏损以""号填列)		67,041,968.79	48,232,554.47

6.3 所有者权益 基金净值)变动表 会计主体:建信货币市场基金

本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 、期初所有者权益 (基金 14,342,517,506.8 14,342,517,506.8 67,041,968.7 -9,484,573,236.62 -9,484,573,236.6 . 中:1.基金申购款 33,865,870,238,3 33,865,870,238,32 基金赎回款 似"" -43,350,443,474.94 -43,350,443,474.9 }配利润产生的巫 复动 (争值减少以: -67,041,968.7 1、期末所有者权益 (基 4,857,944,270.2 4,857,944,270.2 上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日 项目 、期初所有者权益 (基金 2,807,998,938.3 2,807,998,938.3

、本期经营活动产生的 金净值变动数 (本期和 48,232,554.4 792,553,719. 21,112,109,769.9 21,112,109,769.99 .基金赎回款 似 ""号 -20,319,556,050.2 -20,319,556,050.2 五、期末所有者权益 (基)净值)

3,600,552,658.08

6.4 报表附注 嫡要

建信货币市场基金 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")证监基 金字 2006]第56号《关于同意建信货币市场基金募集的批复》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《建信货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型交易 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7,659,641,315.67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 2006)第48号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 健信货币市场基金基金合同》于2006年4月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为7,660, 614,611.89 份基金份额,其中认购资金利息折合 973,296.22 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(以下简称 中国工商银行")。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《建信货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围 为现金;通知存款;一年以内 焓一年 的银行定期存款、大额存单;剩余期限在397天 焓397天 以内的债 券:期限在一年以内(含一年)的债券回购:期限在一年以内(含一年)的中央银行票据以及中国证监会、中 国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为六个月银行定期存款 税后收益率。

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")、中国证监会基金部通知 2009 14 号关于发布《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> (試行)》等问题的通知、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》、健信货币市场基金基金合同》和中国证监会允许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 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009年1月1日至6月30日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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 本报告期不存在控制关系或其他重大利塞关系的关联方发生变化的情况

6.4.5.2 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				

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。 6.4.6.1 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

6.4.6.2 关联方报酬 6.4.6.2.1 基金管理费

单位, 人民币元

3,600,552,658.0

		40:7000
项目	本期 2009年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008年 1 月 1 日 至 2008 年 6 月 30 日
当期应支付的管理费	14,928,242.68	5,091,620.55
其中:当期已支付	13,177,884.42	4,030,399.49
期末未支付	1,750,358.26	1,061,221.06

注: 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E× 0.33%±当年天数,H为每日计提的基金管理费,E为前一日的基金资产净值。基金管理费每日计算,逐日累 计至每月月末,按月支付。

6.4.6.2.2 基金托管费

项 目	本期 2009年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008年1月1日 至2008年6月30日
当期应支付的托管费	4,523,709.98	1,542,915.33
其中:当期已支付	3,993,298.36	1,221,333.17
期末未支付	530,411.62	321,582.16

0.1%:当年天数,H为每日计提的基金托管费,E为前一日的基金资产净值,基金托管费每日计算,逐日累 计至每月月末,按月支付。

获得销售服务费的	本期 2009年1月1日至2009年6月30日				
各关联方名称	当其	用应支付的销售服务费			
	当期已支付	期末未支付	合计		
中国建设银行	3,847,630.06	2,369,487.06	6,217,117.12		
中国工商银行	2,716,686.69	411,022.05	3,127,708.74		
畫信基金管理有限责任公司	170,969.07	32,542.70	203,511.77		
合计	6,735,285.82	2,813,051.81	9,548,337.63		
获得销售服务费的	上年度可比期间 2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日				
各关联方名称	当其	用应支付的销售服务费			
	当期已支付	期末未支付	合计		
中国建设银行	565,098.14	1,008,039.68	1,573,137.82		
中国工商银行	863,663.75	1,155,626.87	2,019,290.62		
生信基金管理有限责任公司	39,302.13	28,950.77	68,252.90		
合 计	1,468,064.02	2,192,617.32	3,660,681.34		

注:本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。销售服务费的计算方法如下: H=Ex0.25%;当年天数,H为每日应计提的销售服务费,E为前一日的基金资产净值,基金销售服务费每日 计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

11010 3700032	TI 1 MY I 1 I GILLITE	(12 ->>> H 2 (34 22) 4 H 1	ニハッノヘップ			
					单位	人民币元
	2	本期 009年1月1日至:		30 ⊟		
银行间市场交易	债券交	易金額	基金法	逆回购	基金正回购	
的各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金额	利息收人	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	50,862,857.53	-	-	200,070, 000.00	4,549.54
	2	上年度可 008年1月1日至:	比期间 2008年6月:	30 ⊟		
银行间市场交易	债券交	易金額	基金法	逆回购	基金正	可购
的各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	697,283,469.74	235,646,420.46	-	-	_	_

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况 6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内及上年度可比期间,基金管理人未运用固有资金投资本基金。 6.4.6.4.2 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及上年度末未持有本基金。

6.4.6.5 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 12,050,173.97 522,423.14 635,281.02 注: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。

6.4.6.6 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。

6.4.7 期末 2009 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券 6.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末,本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。 6.4.7.2 期末持有的暂时停牌股票

报告期末,本基金未持有暂时停牌的股票。 6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

报告期末,本基金无银行间市场或交易所市场债券正回购余额,故未存在作为抵押的债券。

71 期末基金资产组合情况

٠.	1 291/	LARGE DE DE LE HEIDE		
				金额单位:人民币元
	序号	项 目	金 额	占基金总资产的比例 %)
	1	固定收益投资	2,596,326,737.55	53.40
		其中:债券	2,596,326,737.55	53.40
		资产支持证券	-	-
	2	买人返售金融资产	1,910,000,870.00	39.28
		其中: 买断式回购的买人返售金融 资产	-	-
	3	银行存款和结算备付金合计	71,357,951.75	1.47
	4	其他资产	284,665,866.00	5.85
		台 计	4,862,351,425.30	100.00

7.2 债券回购融资情况

			金额单位:人民币元
序号	项 目	金 額	占基金资产净值的比例 %)
1	报告期内债券回购融资余额	28,536,225,602.29	2.53
	其中:买断式回购融资	-	_
2	报告期末债券回购融资余额	-	_
	其中, 买断式回睑融资	_	

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% 7.3 基金投资组合平均剩余期限

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			52
报告期内投资组合平均剩余期限最高值			175
报告期内投资组合平均剩余期限最低值			45
· -	88		

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

		々物阻冷な上せん冷なな体	各期限负债占基金资产净值
序号	平均剩余期限	各期限50广白基金50广净恒 的比例 %)	各期限页價白基並資产淨值 的比例 %)
1	30天以内	46.75	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.61	-
2	30天 含)—60 天	6.57	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	4.30	-
3	60天 含)—90 天	25.05	
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.04	-
4	90天 含)—180 天	16.47	
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	-	-
5	180天 含)-397天 含)	2.47	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	-	-
	合 计	97.32	_

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

- 別不	医贝芬帕性牙关的贝芬汉英组合		
			金额单位:人民币元
序号	债券品种	推余成本	占基金资产 净值比例 %)
1	国家债券	-	
2	央行票据	996,822,581.34	20.52
3	金融债券	337,998,768.01	6.96
	其中:政策性金融债	337,998,768.01	6.96
4	企业债券	-	
5	企业短期融资券	1,261,505,388.20	25.97
6	其他	-	
7	合 计	2,596,326,737.55	53.44
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率 债券	337,998,768.01	6.96

7.5 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

				金額	弹位:人民币元
序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本	占基金资产 净值比例 %)
1	0801104	08央票 104	4,000,000	398,908,695.35	8.21
2	0801106	08央票 106	3,000,000	299,142,533.62	6.16
3	0801114	08央票 114	3,000,000	298,771,352.37	6.15
4	0881209	08大唐 CP01	2,100,000	210,807,272.67	4.34
5	060208	06国开 08	2,100,000	209,061,082.72	4.30
6	0881256	08太不锈 CP01	1,400,000	140,223,149.90	2.89
7	0881267	08邯辆 CP01	1,000,000	100,233,809.66	2.06
8	0881195	08南玻 CP01	1,000,000	100,228,553.31	2.06
9	0881253	08陕有色 CP02	1,000,000	100,188,483.60	2.06
10	0881260	08蒙电力 CP01	1,000,000	100.129.844.02	2.06

告期内偏离度的最低值

影子定价"与 摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 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。

7.8.1 基金计价方法说明。 水基金计价采用铜金成本法,即估值对象以买人成本列示,按票面利率成商定利率并考虑其买人时自 运价与折价。在艾勒索即限内按照实际利率法每日计提图益。水基金通过每日分至使基金份额净值维持存 7.8.2 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店 本超过当日基金资产净值的 20%的情况 7.8.3 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到公开谴责,处罚的情形。

7.8.4 其他资产构成

		单位:人民币元
序号	名 称	金 額
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	150,084,000.00
3	应收利息	31,040,003.90
4	应收申购款	103,541,862.10
5	其他应收款	-
6	其他	-
	合 计	284,665,866.00

§ 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

0.229

					17:	例中177:177	
			持有人结构				
	持有人户数	户均持有的基 金份額	机构投资者	机构投资者			
	(≐)		持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比 例	
	48,742	99,666.49	803,231,132.14	16.53%	4,054,713,138.07	83.47%	
١.	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	持有份額	D. 总数(份)	占基金总份署	i比例	
	其全管理小?	司所有从业人员特	右木				

13,551,314.44 0.28% § 9 开放式基金份额变动 ,660,614,611.89 14,342,517,506.83 告期期间基金总赎回份额 43,350,443,474.94

报告期期末基金份额总额 4,857,944,270.21 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

§ 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,经建信基金管理有限责任公司 2009 年度第一次临时股东会会议决议并备案中国证 江先周先生,孙志晨先生,马梅琴女士,命献先生,欧阳伯权先生,王瓘先生,嗣建国先生,关启昌先生 证集生当选为建信基金管理用限责任公司第二届董事会董事,帝一届董事会成员谷裕先生,朱包 殷可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一次会议决议,江先周 从公司董事任任 (2013年) 本报告期,基金管理人经营管理层未发生重大人事变动。 本基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内无重大人事变动。

本报告期基金投资策略未发生改 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

白本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务至今。本基金本报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 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、外汇和时于等的"违政"进入处罚的情况。 在本报告期内、本基金托管之边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 交易单 元数量 券商名称 佣金

1 70,464,100,000.00 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。

 $\mathfrak g$)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 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 3、本报告期内未发生交易单元的变更。

建信基金管理有限责任公司 2009年8月29日