建信优选成长股票型证券投资基金 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

1.1 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。

基金托管人中国工商银行股份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	建信优选成长股票
交易代码	530003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月8日
报告期末基金份额总额	4,130,938,302.70份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于具有良好业绩成长性和投资价值的上市公司,实现基金资产长期增值。
投资策略	综合运用定量分析和定性分析手段,对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估,并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,定期或不定期地进行调整,以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	75%×新华富时600成长指数+20%×中国债券总指数+5%×1年定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	蒋松云
	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	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(2009年1月1日-2009年6月30日)
本期已实现收益	-96,269,132.43
本期利润	1,249,786,074.13
加权平均基金份额本期利润	0.2896
本期加权平均净值利润率	37.97%
本期基金份额净值增长率	46.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2009年6月30日)
期末可供分配利润	-1,222,749,169.35
期末可供分配基金份额利润	-0.2960
期末基金资产净值	3,742,820,453.26
期末基金份额净值	0.9060
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2009年6月30日)
基金份额累计净值增长率	106.20%

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。

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。

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	10.02%	1.12%	9.82%	0.89%	0.20%	0.23%
过去三个月	18.57%	1.44%	17.40%	1.17%	1.17%	0.27%
过去六个月	46.82%	1.67%	49.46%	1.50%	-2.64%	0.17%
过去一年	4.57%	1.85%	11.10%	1.95%	-6.53%	-0.10%
自基金合同生效起至今	106.20%	1.94%	83.58%	1.84%	22.62%	0.10%

注:1、本基金合同自2006年9月8日生效,未满三年。

2、本基金投资业绩比较基准为:75%×新华富时600成长指数+20%×中国债券总指数+5%×1年定期存款利率。其中:新华富时600成长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,1年定期存款利率作为衡量现金或到期日在一年以内的政府债券部分的业绩基准。

新华富时600成长指数是新华富时风格指数之一,新华富时风格指数以新华富时600指数为股票池,通过7个风格因子对股票进行测评,然后将综合测评的风格因子评分进行综合,进而决定股票在价值和成长指数中的市值分布。作为一个理想的工具,新华富时风格指数使得投资者能够方便地衡量不同风格特点的公司在经历完整市场周期时的表现。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。本基金现金或到期日在一年以内的政府债券部分则可以用1年定期存款利率来衡量。

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

建信优选成长股票型证券投资基金
累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的
历史走势对比图
(2006年9月8日至2009年6月30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"诚信、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

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		
田擎 先生	本基金基金经理	2007年10月23日。	-	八年	硕士。2001年硕士毕业后就职于华夏基金管理公司,先后担任交易员、研究员、华夏成长证券投资基金的基金经理助理,于2004年2月至2005年10月任华夏成长证券投资基金基金经理。2006年8月加入建信基金管理有限责任公司,2008年11月起至今任建信核心精选基金的基金经理。
李涛 先生	本基金基金经理	2008年11月27日	-	十一年	学士。先后就职于中国经济开发信托投资公司、西南证券、国泰君安证券公司、新时代证券、中海基金管理公司等单位,曾担任投资银行部经理、行业研究员、基金经理等职。李涛于2005年6月至2007年7月期间担任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理;于2007年7月至2008年7月期间担任中海优质成长证券投资基金基金经理。李涛于2008年9月加入本公司。

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

2009年6月30日本基金份额净值为0.9060元;2009年上半年基金净值增长率为46.82%,同期业绩比较基准收益率49.46%。

"危机"往往意味中"危险和机遇",09年资本市场酣畅淋漓的对这句话做出了诠释,上半年市场的表现应该是让经历了08年单边持续下跌行情的投资人大跌眼镜,对09年市场,我们认为是流动性、估值、宏观经济三个主要因素共振的结果,在全球央行的大幅度降低基准利率之后,流动性充沛成为全球市场的主基调,宏观基本面改善的预期在政府强力刺激政策下伴随着宏观数据向好也不断提升,市场的表现正是充沛的流动性和"预期"改善的指引下引发的强有力的"共振"。

在扩张性货币政策和财政政策的刺激下,国内外经济均出现了明显的回暖信号,本轮经济危机的导火索,美国房地产市场呈现构筑底部迹象,外围经济最坏的时候正在过去。就国内经济而言,基于PMI指数、发电量等先行指标的指示,工业生产恢复回升的态势事实上已确立,宏观经济最差的阶段在2季度已经渡过。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于A股市场而言,中国经济可能在全球率先走出低谷,明年有可能达到二位数GDP的增长,中国资产将得到越来越多海外投资者关注。而国内在财富效应和通胀预期的支持下,A股市场也将是资金重点关注的领域之一。因此虽然经过半年的大涨,A股市场产生了一定的局部泡沫,但A股市场中期向上的格局仍未变化。

操作上本基金仍将坚持一贯的相对均衡行业配置思路,组合主要关注三个方面的投资机会,其一,从早周期角度出发,关注银行、地产、汽车、券商和机械、煤炭;其二,从业绩增长角度出发,关注输配电设备、水泥、医药以及电信设备制造;其三,后周期的行业如食品、零售、消费品提前布局。

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(以下简称"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(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。

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

报告期末本基金期末可供分配利润为负,基金管理人按照法律法规及《基金合同》的相关规定,在本报告期内未进行利润分配。

§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

2009年上半年,本基金托管人在对建信优选成长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

2009年上半年,建信优选成长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优选成长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,建信优选成长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优选成长股票型证券投资基金2009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。

§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:建信优选成长股票型证券投资基金
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		160,948,785.29	644,399,572.93
结算备付金		8,324,564.85	4,945,650.30
存出保证金		3,177,186.23	1,461,486.92
交易性金融资产		3,540,142,030.99	2,117,663,306.70
其中:股票投资		3,432,915,902.99	1,894,785,797.90
基金投资		-	-
债券投资		107,226,128.00	222,877,508.80
资产支持证券		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		98,369,594.15	6,891,611.90
应收利息		1,088,180.83	5,546,199.83
应收股利		223,112.88	-
应收申购款		2,883,560.99	1,936,379.67
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,815,157,016.21	2,782,844,208.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008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		38,949,821.57	-
应付证券清算款		6,962,342.79	2,012,196.24
应付赎回款		9,799,258.82	2,303,055.16
应付管理人报酬		4,386,417.05	3,622,305.65
应付托管费		731,069.51	603,717.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		10,183,620.50	5,880,640.05
应交税费		-	-
应付利息		6,391.35	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,317,641.36	1,231,242.93
负债合计		72,336,562.95	15,653,157.63
所有者权益:			
实收基金		4,130,938,302.70	4,484,023,843.15
未分配利润		-388,117,849.44	-1,716,832,792.53
所有者权益合计		3,742,820,453.26	2,767,191,050.62
负债和所有者权益总计		3,815,157,016.21	2,782,844,208.25

注:报告截止日2009年6月30日,基金份额净值0.9060元,基金份额总额4,130,938,302.70份。

6.2 利润表

会计主体:建信优选成长股票型证券投资基金
本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

项目	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		1,296,806,576.95	-2,583,192,743.63
1.利息收入		4,520,806.12	5,833,503.31
其中:存款利息收入		1,466,546.68	4,604,878.50
债券利息收入		3,054,259.44	1,228,624.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-54,129,521.83	-318,923,980.78
其中:股票投资收益		-70,267,492.01	-341,173,716.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益		721,110.00	375,331.19
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	384,141.07
股利收益		15,416,860.18	21,490,263.46
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		1,346,055,206.56	-2,271,856,264.64
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		360,086.10	1,753,998.48
二、费用(以"-"号填列)		-47,020,502.82	-117,599,435.53
1.管理人报酬		-24,341,355.42	-44,750,168.64
2.托管费		-4,056,892.56	-7,458,361.46
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		-18,396,758.30	-65,123,154.68
5.利息支出		-6,391.35	-
其中:卖出回购金融资产支出		-6,391.35	-
6.其他费用		-219,105.19	-267,750.75
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,249,786,074.13	-2,700,792,179.16
所得税费用(以"-"号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,249,786,074.13	-2,700,792,179.16

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信优选成长股票型证券投资基金
本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009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)	4,484,023,843.15	-1,716,832,792.53	2,767,191,050.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,249,786,074.13	1,249,786,074.13
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)	-353,085,540.45	78,928,868.96	-274,156,671.49
其中:1.基金申购款	378,618,908.19	-76,406,340.31	302,212,567.88
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-731,704,448.64	155,335,209.27	-576,369,239.37
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)	4,130,938,302.70	-388,117,849.44	3,742,820,453.26
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008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)	5,465,566,165.72	2,067,279,999.52	7,532,846,165.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,700,792,179.16	-2,700,792,179.16
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)	-583,940,397.47	-18,810,582.35	-602,750,979.82
其中:1.基金申购款	804,549,695.43	193,513,046.92	998,062,742.35
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-1,388,490,092.90	-212,323,629.27	-1,600,813,722.17
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)	4,881,625,768.25	-652,322,761.99	4,229,303,006.26

6.4 报表附注(摘要)

6.4.1 基金基本情况

建信优选成长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")证监基金字[2006]第147号《关于同意建信优选成长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《建信优选成长股票型证券投资基金基金合同》的规定公开募集。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6,113,360,965.39元,认购期间产生的认购资金利息1,363,761.21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119号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信优选成长股票型证券投资基金基金合同》于2006年9月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为6,114,724,726.60份基金份额,其中认购资金利息折合1,363,761.21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《建信优选成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。基金投资组合中股票占基金资产的60%-95%,其中投资于具有良好业绩成长潜力并具备投资价值的上市公司发行的股票占非现金资产的比例不低于80%;现金、债券、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%,其中,基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:新华富时600成长指数×75%+中国债券总指数×20%+1年期定期存款利率×5%。

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]4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>(试行)》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》、《建信优选成长股票型证券投资基金基金合同》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害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

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	24,341,355.42	44,750,168.64
其中:当期已支付	19,954,938.37	39,121,678.40
期末未支付	4,386,417.05	5,628,490.24

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:H=E×1.5%÷当年天数,H为每日应计提的基金管理费,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

单位:人民币元

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	4,056,892.56	7,458,361.46
其中:当期已支付	3,325,823.05	6,520,279.77
期末未支付	731,069.51	938,081.69

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下:H=E×2.5‰÷当年天数,H为每日应计提的基金托管费,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。

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

本期 2009年1月1日至2009年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	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	-	21,331,157.35	-	-	-	-
上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	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	-	-	-	-	-	-

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

份额单位:份

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
期初持有的基金份额	53,794,482.79	53,794,482.79
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	53,794,482.79	-
期末持有的基金份额	-	53,794,482.79
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.10%

注:基金管理人建信基金管理有限公司在本会计期间赎回本基金的交易委托中国建设银行办理,赎回费61,245.86元,其中25%计入基金资产,适用招募说明书中赎回费率的相关规定。

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

关联方名称	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	
	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	160,948,785.29	1,398,006.15	1,025,047,413.11	4,437,100.31

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,本基金未持有因上市公司未能按交易所要求按时披露重要信息、公布的重大事项可能产生重大影响而暂时停牌的股票。

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。

§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	3,432,915,902.99	89.98
	其中:股票	3,432,915,902.99	89.98
2	固定收益投资	107,226,128.00	2.81
	其中:债券	107,226,128.00	2.81
	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	169,273,350.14	4.44
6	其他资产	105,741,635.08	2.77
	合计	3,815,157,016.21	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	322,650,477.68	8.62
C	制造业	1,081,649,474.62	28.90
C0	食品、饮料	60,839,495.59	1.63
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	18,690,000.00	0.50
C3	造纸、印刷	10,738,947.48	0.29
C4	石油、化学、塑胶、塑料	73,228,684.36	1.96
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	328,960,872.44	8.79
C7	机械、设备、仪表	506,708,981.95	13.54
C8	医药、生物制品	37,882,492.80	1.01
C99	其他制造业	44,600,000.00	1.19
D	电力、煤气及水的生产和供应业	50,006,258.04	1.34
E	建筑业	43,815,915.36	1.17
F	交通运输、仓储业	52,995,430.60	1.42
G	信息技术业	45,775,875.00	1.22
H	批发和零售贸易	282,566,156.89	7.55
I	金融、保险业	898,927,237.61	24.02
J	房地产业	527,344,917.49	14.09
K	社会服务业	29,260,000.00	0.78
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	97,924,159.70	2.62
	合计	3,432,915,902.99	91.72

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	000002	万科A	13,815,600	176,148,900.00	4.71
2	600000	浦发银行	6,272,000	144,381,440.00	3.86
3	601318	中国平安	2,899,760	143,422,129.60	3.83
4	600694	大商股份	3,657,245	119,921,063.55	3.20
5	601166	兴业银行	3,059,964	113,555,264.04	3.03
6	600016	民生银行	14,000,000	110,880,000.00	2.96
7	000402	金融街	6,402,116	88,093,116.16	2.35
8	601169	北京银行	5,399,892	87,802,243.92	2.35
9	000651	格力电器	4,044,338	84,526,664.20	2.26
10	600036	招商银行	3,766,300	84,402,783.00	2.26

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人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	600030	中信证券	199,864,314.26	7.22
2	000002	万科A	188,406,644.19	6.81
3	600016	民生银行	145,107,088.73	5.24
4	601318	中国平安	130,055,030.77	4.70
5	600036	招商银行	122,949,606.31	4.44
6	600000	浦发银行	122,248,246.51	4.42
7	000709	唐钢股份	118,474,292.64	4.28
8	600694	大商股份	116,771,209.27	4.22
9	600028	中国石化	108,019,847.18	3.90
10	600050	中国联通	92,492,627.48	3.34
11	601166	兴业银行	92,249,865.77	3.33
12	600837	海通证券	88,330,012.62	3.19
13	600348	国阳新能	82,185,114.67	2.97
14	601899	紫金矿业	79,470,622.17	2.87
15	000402	金融街	78,275,817.27	2.83
16	000063	中兴通讯	76,008,192.01	2.75
17	000562	宏源证券	72,444,713.63	2.62
18	600123	兰花科创	72,426,631.75	2.62
19	601169	北京银行	70,457,414.52	2.55
20	600875