

建信货币市场基金

2010年第一季度报告

2010年3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

§1 重要提示

基金管理人及基金托管人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2010年4月16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。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (建信货币), 基金代码 (530002), 基金运作方式 (契约型、开放式), 基金合同生效日 (2006年6月2日), 报告期末基金份额总额 (2,800,560,015.44份), 投资目标 (在力争本金安全和基金资产较高流动性的前提下,争取获得超越投资基准的收益), 投资策略 (综合考虑宏观经济和利率走势,采用自上而下的资产配置策略), 业绩比较基准 (本基金的业绩比较基准为6个月银行定期存款税后利率), 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 主要财务指标和净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2010年1月1日至2010年3月31日), 单位:人民币元. 1.本期已实现收益: 17,973,352.57; 2.本期利润: 17,973,352.57; 3.期末基金资产净值: 2,800,560,015.44

Table with 2 columns: 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: 0.4728%, 0.0135%, 0.4962%, 0.0000%, -0.0234%, 0.0135%

注:本基金收益分配方式按日结转。
3.2.2 自基金合同成立以来本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

Table with 2 columns: 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: 0.4728%, 0.0135%, 0.4962%, 0.0000%, -0.0234%, 0.0135%

注:本报告期,本基金的基金投资组合比例符合基金合同的约定。
4.1 基金经理 (基金经理小组) 简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 从业年限, 说明. 汪海先生: 投资管理部总经理, 2006-4-25, 9, 硕士, 2000年进入中国农业银行总行...

4.2 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。
4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易专项说明
4.3.2 异常交易专项说明

4.3.3 异常交易专项说明
4.3.4 异常交易专项说明

4.3.5 异常交易专项说明
4.3.6 异常交易专项说明

4.3.7 异常交易专项说明
4.3.8 异常交易专项说明

4.3.9 异常交易专项说明
4.3.10 异常交易专项说明

4.3.11 异常交易专项说明
4.3.12 异常交易专项说明

4.3.13 异常交易专项说明
4.3.14 异常交易专项说明

4.3.15 异常交易专项说明
4.3.16 异常交易专项说明

4.3.17 异常交易专项说明
4.3.18 异常交易专项说明

4.3.19 异常交易专项说明
4.3.20 异常交易专项说明

4.3.21 异常交易专项说明
4.3.22 异常交易专项说明

4.3.23 异常交易专项说明
4.3.24 异常交易专项说明

4.3.25 异常交易专项说明
4.3.26 异常交易专项说明

4.3.27 异常交易专项说明
4.3.28 异常交易专项说明

4.3.29 异常交易专项说明
4.3.30 异常交易专项说明

4.3.31 异常交易专项说明
4.3.32 异常交易专项说明

4.3.33 异常交易专项说明
4.3.34 异常交易专项说明

4.3.35 异常交易专项说明
4.3.36 异常交易专项说明

4.3.37 异常交易专项说明
4.3.38 异常交易专项说明

4.3.39 异常交易专项说明
4.3.40 异常交易专项说明

4.3.41 异常交易专项说明
4.3.42 异常交易专项说明

4.3.43 异常交易专项说明
4.3.44 异常交易专项说明

4.3.45 异常交易专项说明
4.3.46 异常交易专项说明

4.3.47 异常交易专项说明
4.3.48 异常交易专项说明

4.3.49 异常交易专项说明
4.3.50 异常交易专项说明

4.3.51 异常交易专项说明
4.3.52 异常交易专项说明

4.3.53 异常交易专项说明
4.3.54 异常交易专项说明

4.3.55 异常交易专项说明
4.3.56 异常交易专项说明

4.3.57 异常交易专项说明
4.3.58 异常交易专项说明

4.3.59 异常交易专项说明
4.3.60 异常交易专项说明

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

2010年第一季度报告

2010年3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

§1 重要提示

基金管理人及基金托管人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2010年4月16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。

§2 基金产品概况

Table with 2 columns: 基金名称 (建信沪深300指数LOF), 基金代码 (163309), 基金运作方式 (契约型、上市开放式), 基金合同生效日 (2009年11月9日), 报告期末基金份额总额 (4,553,426,239.97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,力求跟踪标的指数表现,追求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化投资策略,原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股及其权重来构建), 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+4%银行活期存款利率), 风险收益特征 (本基金属于采用指数化投资的股票型基金,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 主要财务指标和净值表现

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期 (2010年1月1日至2010年3月31日), 单位:人民币元. 1.本期已实现收益: -18,252,521.82; 2.本期利润: -284,118,949.40; 3.加权平均基金份额本期利润: -0.0622; 4.期末基金资产净值: 4,314,914,498.76; 5.期末基金份额净值: 0.948; 6.基金份额持有人户数: 1,010

Table with 2 columns: 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: -6.14%, 1.25%, -6.10%, 1.25%, -0.04%, 0.00%

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收益。
2.本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据。
3.本基金合同于2009年11月9日生效,投资起始日为2009年11月9日。

3.2 本报告期末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

Table with 2 columns: 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: -6.14%, 1.25%, -6.10%, 1.25%, -0.04%, 0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来本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

Table with 2 columns: 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: -6.14%, 1.25%, -6.10%, 1.25%, -0.04%, 0.00%

注:1.建信沪深300指数证券投资基金于2009年11月9日生效,截至报告日本基金成立未满六个月,仍处于建仓期。
2.本报告期,本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。
3.公平交易专项说明

4.1 基金经理 (基金经理小组) 简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 从业年限, 说明. 汪海先生: 投资管理部总经理, 2009-11-5, 7, 硕士, 2000年进入中国农业银行总行...

4.2 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。
4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易专项说明
4.3.2 异常交易专项说明

4.3.3 异常交易专项说明
4.3.4 异常交易专项说明

4.3.5 异常交易专项说明
4.3.6 异常交易专项说明

4.3.7 异常交易专项说明
4.3.8 异常交易专项说明

4.3.9 异常交易专项说明
4.3.10 异常交易专项说明

4.3.11 异常交易专项说明
4.3.12 异常交易专项说明

4.3.13 异常交易专项说明
4.3.14 异常交易专项说明

4.3.15 异常交易专项说明
4.3.16 异常交易专项说明

4.3.17 异常交易专项说明
4.3.18 异常交易专项说明

4.3.19 异常交易专项说明
4.3.20 异常交易专项说明

4.3.21 异常交易专项说明
4.3.22 异常交易专项说明

4.3.23 异常交易专项说明
4.3.24 异常交易专项说明

4.3.25 异常交易专项说明
4.3.26 异常交易专项说明

4.3.27 异常交易专项说明
4.3.28 异常交易专项说明

4.3.29 异常交易专项说明
4.3.30 异常交易专项说明

4.3.31 异常交易专项说明
4.3.32 异常交易专项说明

4.3.33 异常交易专项说明
4.3.34 异常交易专项说明

4.3.35 异常交易专项说明
4.3.36 异常交易专项说明

4.3.37 异常交易专项说明
4.3.38 异常交易专项说明

4.3.39 异常交易专项说明
4.3.40 异常交易专项说明

4.3.41 异常交易专项说明
4.3.42 异常交易专项说明

4.3.43 异常交易专项说明
4.3.44 异常交易专项说明

4.3.45 异常交易专项说明
4.3.46 异常交易专项说明

4.3.47 异常交易专项说明
4.3.48 异常交易专项说明

4.3.49 异常交易专项说明
4.3.50 异常交易专项说明

4.3.51 异常交易专项说明
4.3.52 异常交易专项说明

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78

Table with 2 columns: 序号, 基金名称, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). 1.买入返售金融资产: -; 2.其中:买入返售的买入返售金融资产: -; 3.银行存款和拆出资金: 158,407,903.07; 4.其他资产: 36,553,665.64; 5.合计: 4,358,524,463.78