建信沪深300指数证券投资基金(LOF)2010年年度报告摘要

2010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:二〇一一年三月二十八日

§1 重要提示

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2011年3月23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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所有限公司为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告。

本报告期自2010年1月1日起至12月31日止(本期财务报表的实际编制期还包括2009年11月5日(基金合同生效日)至2009年12月31日期间)。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信沪深300指数(LOF)
基金主代码	165309
交易代码	165309
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5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
报告期末基金份额总额	5,213,405,911.30份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2009年11月30日

2.2 基金产品说明

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组成及其权重来拟合、复制标的指数,并根据标的指数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%×商业银行税后活期存款利率。
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。

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	赵会军
	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

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010年	2009年11月5日至2009年12月31日
本期已实现收益	-174,691,527.96	7,903,770.00
本期利润	-410,178,304.68	58,375,100.64
加权平均基金份额本期利润	-0.0804	0.0116
本期基金份额净值增长率	-12.28%	1.00%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1140	0.0014
期末基金资产净值	4,619,029,777.58	4,656,217,003.64
期末基金份额净值	0.886	1.010

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上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。

4、本基金合同于2009年11月5日生效,至2009年12月31日未满一年。

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
过去三个月	5.73%	1.68%	6.28%	1.68%	-0.55%	0.00%
过去六个月	20.38%	1.49%	20.94%	1.47%	-0.56%	0.02%
过去一年	-12.28%	1.51%	-11.78%	1.50%	-0.50%	0.01%
自基金合同生效起至今	-11.40%	1.47%	-8.80%	1.52%	-2.60%	-0.05%

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

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)
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11月5日至2010年12月31日)

注:1、建信沪深300指数基金基金合同于2009年11月5日生效,截至报告日本基金成立未满3年。

2、本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深300指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%,投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种(如股票指数期货等),基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

3、本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)
合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:本基金合同自2009年11月5日生效,至2010年12月31日未满两年,2009年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本基金基金合同自2009年11月5日起生效,基金合同生效以来未发生过利润分配。

§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、上海、北京四家分公司。自成立以来,公司秉持"诚信、专业、规范、创新"的核心价值观,恪守"持有人利益重于泰山"的原则,以"建设财富生活"为崇高使命,坚持规范运作,致力成为"最可信赖、持续领先的资产管理公司"。

截至2010年12月31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、建信沪深300指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金12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485.66亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
梁洪昀先生	投资管理部副总监,本基金的基金经理	2009-11-05	-	8	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,历任金融工程部研究员、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,现任投资管理部副总监。2009年11月5日起任建信沪深300指数基金经理,2010年5月28日起任建信社会责任ETF及联接基金的基金经理。

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》、《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 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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在报告期内按照基金合同规定,采用被动式指数化投资策略,对标的指数进行拟合、复制,期间年化跟踪误差和日均跟踪偏离度均被控制在基金合同约定的范围之内。

在报告期内,本基金跟踪误差主要缘于标的指数中的两只股票——工商银行和建设银行限于法律法规规定无法投资,而必须寻找其他股票替代。本基金管理人通过数量化分析,建立模型,制定了相应的替代方案,并不断根据市场最新情况对方案进行优化和调整,以尽可能地降低跟踪误差及偏离度。

在报告期内,部分交易日的大额申购赎回、某些成份股长期停牌造成的估值调整、部分时期市场波动性增加等因素也对跟踪误差及偏离度产生了一定影响,本基金管理人亦在日常管理中通过选择适当的策略尽力克服了这些不利影响。

在报告期内,本基金管理人在量化分析基础上,采取了适当的组合调整策略,对沪深300指数每年例行的两次成份股定期调整和农业银行上市后的临时成份股调整进行了相应的操作应对,以尽可能地降低其对基金跟踪误差及偏离度的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010年本基金净值增长率为-12.28%,波动率为1.51%,业绩比较基准收益率为-11.78%,波动率为1.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为,我们在2011年将面临非常复杂的国际、国内经济及政治环境。控制通货膨胀与保证经济增长之间的政策权衡、短中长经济周期的交织、部分国家和地区政治局势的动荡,都将给宏观经济及证券市场带来诸多不确定性,市场在部分时期内将出现比较明显的波动,预计出现单边趋势性行情的可能性不大。

本基金管理人将根据基金合同,继续秉承被动复制策略,并以量化分析研究为基础,克服个别成份股无法投资、基金日常申赎、成份股停牌及成份股调整等各种因素造成的不利影响,将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平。

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》等相关规定,继续加强和完善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。

本报告期内,公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金)。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定,本报告期内本基金未达到进行利润分配的条件,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

2010年,本基金托管人在对建信沪深300指数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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010年,建信沪深300指数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沪深300指数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,建信沪深300指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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沪深300指数证券投资基金2010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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部
2011年3月23日

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司审计了后附的建信沪深300指数证券投资基金(LOF)(以下简称"建信沪深300基金")的财务报表,包括2010年12月31日和2009年12月31日的资产负债表、2010年度和2009年11月5日(基金合同生效日)至2009年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了普华永道中天审字(2011)第21253号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:建信沪深300指数证券投资基金(LOF)
报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产:			
银行存款		148,878,218.14	104,354,821.25
结算备付金		2,771,079.64	75,042,758.25
存出保证金		779,415.77	-
交易性金融资产		4,473,933,602.69	4,517,610,622.87
其中:股票投资		4,373,573,602.69	4,417,940,622.87
基金投资		-	-
债券投资		100,360,000.00	99,670,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		17,491,000.96	14,585,555.40
应收利息		3,257,245.83	133,433.30
应收股利		-	-
应收申购款		1,493,600.37	745,405.11
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		4,648,604,163.40	4,712,472,596.18
负债和所有者权益		本期末 2010年12月31日	上年度末 2009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		-	-
应付证券清算款		19,569,330.10	36,758,986.16
应付赎回款		944,323.54	9,225,710.38
应付管理人报酬		2,983,144.57	3,025,268.40
应付托管费		596,628.92	605,053.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		5,305,338.14	6,538,641.41
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		175,620.55	101,932.48
负债合计		29,574,385.82	56,255,592.54
所有者权益:			
实收基金		5,213,405,911.30	4,610,567,360.02
未分配利润		-594,376,133.72	45,649,643.62
所有者权益合计		4,619,029,777.58	4,656,217,003.64
负债和所有者权益总计		4,648,604,163.40	4,712,472,596.18

注:1.报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.886元,基金份额总额5,213,405,911.30份。

2.本基金基金合同自2009年11月5日生效,上年度可比期间未满一年。

7.2 利润表

会计主体:建信沪深300指数证券投资基金(LOF)
本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年11月5日至2009年12月31日
一、收入		-362,869,629.07	75,281,411.04
1.利息收入		4,541,183.39	2,173,823.19
其中:存款利息收入		1,388,734.50	1,537,294.31
债券利息收入		3,152,448.89	61,648.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	574,880.52
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-134,278,300.14	21,442,598.91
其中:股票投资收益		-177,155,713.73	21,412,204.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-6,600.00	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		42,884,013.59	30,394.85
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-235,486,776.72	50,471,330.64
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		2,354,264.40	1,193,658.30
减:二、费用		47,308,675.61	16,906,310.40
1.管理人报酬		33,477,020.91	5,771,653.30
2.托管费		6,695,404.16	1,154,330.70
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		6,594,388.08	9,876,286.38
5.利息支出		-	31,861.71
其中:卖出回购金融资产支出		-	31,861.71
6.其他费用		541,862.46	72,178.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-410,178,304.68	58,375,100.64
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-410,178,304.68	58,375,100.64

注:本基金基金合同自2009年11月5日生效,上年度可比期间未满一年。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信沪深300指数证券投资基金(LOF)
本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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)	4,610,567,360.02	45,649,643.62	4,656,217,003.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-410,178,304.68	-410,178,304.68
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)	602,838,551.28	-229,847,472.66	372,991,078.62
其中:1.基金申购款	2,808,256,649.01	-428,615,412.06	2,379,641,236.95
2.基金赎回款	-2,205,418,097.73	198,767,939.40	-2,006,650,158.33
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)	5,213,405,911.30	-594,376,133.72	4,619,029,777.58
项目	上年度可比期间 2009年11月5日至2009年12月31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)	5,326,413,369.61	-	5,326,413,369.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	58,375,100.64	58,375,100.64
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)	-715,846,009.59	-12,725,457.02	-728,571,466.61
其中:1.基金申购款	79,886,365.77	-1,347,495.66	78,538,870.11
2.基金赎回款	-795,732,375.36	-11,377,961.36	-807,110,336.72
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)	4,610,567,360.02	45,649,643.62	4,656,217,003.64

注:本基金基金合同自2009年11月5日生效,上年度可比期间未满一年。

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:孙志晨,主管会计工作负责人:何斌,会计机构负责人:秦绪华

7.4 报表附注(摘要)

7.4.1 基金基本情况

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)(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")证监许可[2009]第882号《关于核准建信沪深300指数证券投资基金(LOF)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《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自2009年9月21日至2009年10月30日止。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5,324,471,976.73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(2009)第233号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金合同》于2009年11月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为5,326,413,369.61份基金份额,其中认购资金利息折合1,941,392.88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。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上字[2009]第157号文审核同意,本基金59,552,590.00份基金份额于2009年11月30日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数的成份股及其备选成份股、新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于沪深300指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%,投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。本基金业绩比较基准为95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于2011年3月21日批准报出。

7.4.2 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")、中国证监会公告[2010]5号《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>》、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》、《建信沪深300指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 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2010年12月31日和2009年12月31日的财务状况以及2010年度和2009年11月5日(基金合同生效日)至2009年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2010年度和2009年11月5日(基金合同生效日)至2009年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资,场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若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后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(a)对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值,通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动,停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用的行业指数为中证协(SAC)基金行业股票估值指数。

(b)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内未发生会计政策的变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期内未发生会计估计的变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内未发生会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

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、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
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团公司	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年11月5日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	33,477,020.91	5,771,653.30
其中:支付销售机构的客户维护费	9,750,985.75	1,443,899.99

注:1、本基金基金合同自2009年11月5日生效,上年度可比期间未满一年。

2、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.75% / 当年天数。

3、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年11月5日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,695,404.16	1,154,330.70

注:1、本基金基金合同自2009年11月5日生效,上年度可比期间未满一年。

2、支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年11月5日至2009年12月31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	148,878,218.14	1,280,122.07	104,354,821.25	1,458,491.13

注1、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。

2、本基金基金合同自2009年11月5日生效,上年度可比期间未满一年。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

7.4.9 期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600816	安信信托	2010-06-02	重要事项未公告	13.60	-	-	272,791	4,958,934.96	3,709,957.60	-
600518	康美药业	2010-12-28	配股	19.71	2011-01-06	17.29	978,939	12,144,059.24	19,294,887.69	-
600664	哈药股份	2010-12-29	控股股东研究公司重大事项	22.57	2011-02-16	24.83	617,299	12,217,028.32	13,932,438.43	-
000059	辽通化工	2010-12-02	筹划资产重组	11.59	-	-	499,425	5,501,566.43	5,788,335.75	-
000652	泰达股份	2010-11-22	筹划重大事项	7.78	-	-	907,878	7,785,133.49	7,063,290.84	-
000959	首钢股份	2010-10-29	筹划资产重组	4.42	-	-	1,070,227	5,781,324.91	4,730,403.34	-

注:本基金截至2010年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

至本报告期末,本基金无银行间市场债券正回购交易余额,故未存在作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

至本报告期末,本基金无交易所市场债券正回购交易余额,故未存在作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2010年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为4,319,054,289.04元,属于第二层级的余额为154,879,313.65元,无属于第三层级的余额(2009年12月31日:第一层级4,352,384,154.32元,第二层级165,226,468.55元,无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票,本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级,并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009年度:同)。

对于持有的认购新发和增发证券,本基金将相关股票公允价值所属层级于流通受限期间列入第二层级,待其可流通后从第二层级转入第一层级(2009年度:同)。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	4,373,573,602.69	94.08
	其中:股票	4,373,573,602.69	94.08
2	固定收益投资	100,360,000.00	2.16
	其中:债券	100,360,000.00	2.16
	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	151,649,297.78	3.26
6	其他各项资产	23,021,262.93	0.50
7	合计	4,648,604,163.40	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资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	14,692,859.37	0.32
B	采掘业	536,669,705.38	11.62
C	制造业	1,569,554,752.16	33.98
C0	食品、饮料	250,276,770.74	5.42
C1	纺织、服装、皮毛	16,675,384.18	0.36
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	112,442,252.64	2.43
C5	电子	26,646,884.31	0.58
C6	金属、非金属	377,514,169.52	8.17
C7	机械、设备、仪表	561,022,553.42	12.15
C8	医药、生物制品	210,298,097.21	4.55
C99	其他制造业	14,678,640.14	0.32
D	电力、煤气及水的生产和供应业	108,932,180.93	2.36
E	建筑业	128,259,090.80	2.78
F	交通运输、仓储业	198,030,366.74	4.29
G	信息技术业	152,508,730.34	3.30
H	批发和零售贸易	128,821,339.24	2.79
I	金融、保险业	1,157,318,102.95	25.06
J	房地产业	230,441,034.27	4.99
K	社会服务业	40,332,464.32	0.87
L	传播与文化产业	6,298,737.50	0.14
M	综合类	98,004,281.09	2.12
	合计	4,369,863,645.09	94.61

注:以上行业分类以2010年12月31日的证监会行业分类标准为依据。

8.2.2 积极投资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	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	-
I	金融、保险业	3,709,957.60	0.08
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,709,957.60	0.08

注:以上行业分类以2010年12月31日的证监会行业分类标准为依据。

8.3 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

8.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	2,653,667	149,029,938.72	3.23
2	600036	招商银行	10,318,217	132,176,359.77	2.86
3	601328	交通银行	19,070,756	104,507,742.88	2.26
4	600016	民生银行	17,889,927	89,807,433.54	1.94
5	600000	浦发银行	6,818,632	84,482,850.48	1.83
6	601166	兴业银行	3,322,316	79,901,699.80	1.73
7	600030	中信证券	5,514,065	69,422,078.35	1.50
8	601088	中国神华	2,612,261	64,548,969.31	1.40
9	000002	万 科A	7,666,996	63,022,707.12	1.36
10	601601	中国太保	2,489,610	57,012,069.00	1.23

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于公司网站www.ccbfund.cn的年度报告正文。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600816	安信信托	272,791	3,709,957.60	0.08

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于公司网站www.ccbfund.cn的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601988	中国银行	92,987,946.09	2.00
2	601328	交通银行	85,721,651.50	1.84
3	600036	招商银行	78,035,417.79	1.68
4	601166	兴业银行	69,235,230.42	1.49
5	601318	中国平安	67,770,456.68	1.46
6	600000	浦发银行	55,327,862.63	1.19
7	601288	农业银行	51,968,021.68	1.12
8	600016	民生银行	49,525,438.25	1.06
9	601006	大秦铁路	33,146,305.75	0.71
10	600030	中信证券	30,929,691.77	0.66
11	601668	中国建筑	28,636,297.70	0.62
12	601169	北京银行	28,475,201.97	0.61
13	601088	中国神华	27,820,182.85	0.60
14	000002	万 科A	26,534,731.23	0.57
15	601601	中国太保	25,061,408.77	0.54
16	000001	深发展A	24,605,620.80	0.53
17	600887	伊利股份	24,263,403.15	0.52
18	600795	国电电力	20,216,137.73	0.43
19	600276	恒瑞医药	19,958,625.65	0.43
20	600837	海通证券	19,903,064.98	0.43

注:上述买入金额为买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	68,207,854.65	1.46
2	601166	兴业银行	65,613,089.57	1.41
3	601328	交通银行	63,791,198.41	1.37
4	601988	中国银行	63,650,155.89	1.37
5	600016	民生银行	55,815,701.28	1.20
6	601318	中国平安	52,620,062.74	1.13
7	600000	浦发银行	44,225,520.84	0.95
8	000001	深发展A	35,577,234.87	0.76
9	601169	北京银行	34,046,753.43	0.73
10	600030	中信证券	32,020,567.92	0.69
11	601088	中国神华	28,477,328.05	0.61
12	600015	华夏银行	27,732,262.09	0.60
13	000002	万 科A	27,258,148.78	0.59
14	600900	长江电力	27,202,084.06	0.58
15	601601	中国太保	24,947,324.41	0.54
16	600104	上海汽车	22,188,479.71	0.48
17	000858	五 粮 液	20,806,092.07	0.45
18	600519	贵州茅台	20,579,057.12	0.44
19	002024	苏宁电器	19,163,068.81	0.41
20	000063	中兴通讯	18,961,636.68	0.41

注:上述卖出金额为卖出成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	2,459,210,767.61
卖出股票的收入(成交)总额	2,092,564,497.34

注:上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额(成交单价乘以成交数量),不包含相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	100,360,000.00	2.17
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	100,360,000.00	2.17

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	0801044	08央行票据44	1,000,000	100,360,000.00	2.17

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	779,415.77
2	应收证券清算款	17,491,000.96
3	应收股利	-
4	应收利息	3,257,245.83
5	应收申购款	1,493,600.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,021,262.93

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600816	安信信托	3,709,957.60	0.08	重要事项未公告

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
80,463	64,792.59	1,633,665,016.00	31.34%	3,579,740,895.30	68.66%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	庄秋玉	1,484,192	6.32%
2	蒋云鹏	1,004,480	4.28%
3	张小玲	994,500	4.23%
4	罗霖	614,620	2.62%
5	许新梅	505,218	2.15%
6	于晓东	500,035	2.13%
7	青海旭阳机电有限公司	500,015	2.13%
8	彭云	495,000	2.11%
9	王家国	466,801	1.99%
10	贺俊彩	441,473	1.88%

注:持有人为场内持有人。

9.3 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	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	326,192.58	0.01%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年11月5日)基金份额总额	5,326,413,369.61
本报告期期初基金份额总额	4,610,567,360.02
本报告期期间基金总申购份额	2,808,256,649.01
减:本报告期期间基金总赎回份额	2,205,418,097.73
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,213,405,911.30

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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2010年度第一次临时股东会会议决议并备案中国证监会,殷红军先生当选为建信基金管理有限责任公司董事会股东董事,王曦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三次会议审议通过,并报经中国证监会证监许可[2010]567号文核准,公司决定聘任王新艳为公司副总经理。上述聘任事项已于2010年5月18日公告。

本报告期,经中国证监会核准,本基金托管人聘任晏秋生先生担任资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为人民币123,000.00元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 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、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内,本基金托管人以及涉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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	2	3,460,164,096.46	76.88%	2,758,838.00	76.54%	-
东北证券	2	895,582,468.91	19.90%	727,665.21	20.19%	-
渤海证券	1	145,220,866.76	3.23%	117,992.85	3.27%	本期新增

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。

(3)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、个股、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,并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金成立于2009年11月5日(基金合同生效日),本期内,渤海证券为本报告期内新签订协议租用的交易单元,本报告期内无剔除交易单元。

4、本基金与其托管行所受托的本公司其他基金存在共用的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本报告期内,本基金租用的证券公司交易单元未进行其他证券投资。

建信基金管理有限责任公司
二〇一一年三月二十八日