建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

2011 半年度 报告摘要

2011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
报告送出日期:二〇一一年八月二十四日

§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。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2011年8月19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2011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	4,307,188,156.89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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://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(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	-30,648,925.17
本期利润	-41,386,097.92
加权平均基金份额本期利润	-0.0089
本期基金份额净值增长率	-2.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1344
期末基金资产净值	3,728,455,906.12
期末基金份额净值	0.866

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。

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

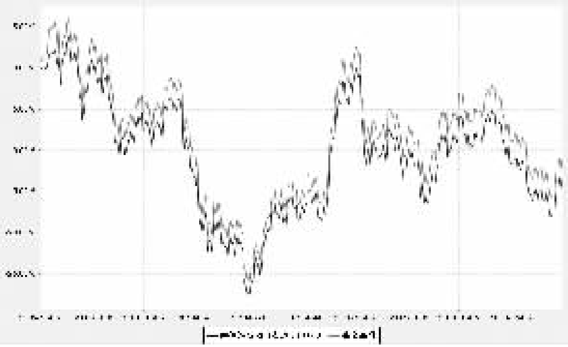
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.88%	1.12%	1.35%	1.13%	0.53%	-0.01%
过去三个月	-4.73%	1.04%	-5.27%	1.04%	0.54%	0.00%
过去六个月	-2.26%	1.17%	-2.51%	1.17%	0.25%	0.00%
过去一年	17.66%	1.34%	17.91%	1.33%	-0.25%	0.01%
成立至今	-13.40%	1.39%	-11.09%	1.42%	-2.31%	-0.03%

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)

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11月5日至2011年6月30日)



注:1、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。

2、2011年2月9日,中国人民银行上调了金融机构人民币存款基准利率。作为本基金业绩比较基准的商业银行税后活期存款利率由0.36%上调至0.40%。2011年4月6日,该收益率上调至0.50%。

3、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、中国华电集团资本控股有限公司,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%,中国华电集团资本控股有限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2011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、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、建信保本混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金15只开放式基金和建信优势动力股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金2只封闭式基金,管理的基金资产规模共计为433.13亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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		
梁洪昀先生	投资管理部副总监,本基金基金经理	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。2010年5月28日起任上证社会责任ETF及其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

在报告期内,本基金根据基金合同规定,采取了对指数的被动复制策略,将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了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源自标的指数中工商银行和建设银行两只股票限于法律法规规定无法投资,必须寻找其他股票进行替代。本基金管理人在量化分析研究基础上,采取了相应的替代策略,并不断根据市场最新情况优化和调整替代方案,以达到尽可能降低跟踪误差及偏离度的目标。

在报告期内,个别时间段内遇到比较频繁的大额申购赎回、部分股票长期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选择适当的策略尽力克服这些不利影响。

在报告期末期,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,为在7月1日进行的今年第2次沪深300指数成份股定期调整进行了准备,尽可能地降低了这一事件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

2011年上半年本基金净值增长率-2.26%,波动率1.17%,业绩比较基准收益率-2.51%,波动率1.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

为应对席卷全球的经济危机,政府在2008年末至2009年采取了超强的政策刺激手段,经济得以迅速复苏,但为此所支付的代价正逐渐显现。自2010年4季度开始,新一轮通胀来势汹汹,并于2011年6月创出2年多以来的新高。展望下半年,我们认为,通胀水平会继续在较高位置运行一段时间,随着基数的抬高以及货币政策的持续紧缩,通胀压力进一步增加的可能性有所降低,并有望在4季度暂时减轻,市场的悲观情绪可能会有所缓解。我们认为下半年沪深300指数可能依然呈现区间运行格局。

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、成份股停牌等各种因素造成的不利影响,不断优化和改进量化模型,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,公司已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

截止本报告期末本基金可供分配利润为-578,732,250.77元,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,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

2011年上半年,本基金托管人在对建信沪深300指数证券投资基金(LOF)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

2011年上半年,建信沪深300指数证券投资基金(LOF)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(LOF)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(LOF)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沪深300指数证券投资基金(LOF)2011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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部
2011年8月19日

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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:2011年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产:			
银行存款		97,830,473.95	148,878,218.14
结算备付金		260,670.51	2,771,079.64
存出保证金		1,138,404.46	779,415.77
交易性金融资产		3,637,058,215.83	4,473,933,602.69
其中:股票投资		3,537,808,215.83	4,373,573,602.69
基金投资		-	-
债券投资		99,250,000.00	100,360,000.00
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		14,682,983.17	17,491,000.96
应收利息		628,458.24	3,257,245.83
应收股利		2,396,297.39	-
应收申购款		96,487.61	1,493,600.37
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,754,091,991.16	4,648,604,163.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010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		16,499,239.67	19,569,330.10
应付赎回款		1,745,008.18	944,323.54
应付管理人报酬		2,227,997.10	2,983,144.57
应付托管费		445,599.43	596,628.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		4,428,421.56	5,305,338.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		289,819.10	175,620.55
负债合计		25,636,085.04	29,574,385.82
所有者权益:			
实收基金		4,307,188,156.89	5,213,405,911.30
未分配利润		-578,732,250.77	-594,376,133.72
所有者权益合计		3,728,455,906.12	4,619,029,777.58
负债和所有者权益总计		3,754,091,991.16	4,648,604,163.40

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值0.866元,基金份额总额4,307,188,156.89份。

6.2 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:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入		-19,094,716.32	-1,247,868,031.50
1.利息收入		2,404,743.35	1,451,577.47
其中:存款利息收入		498,177.64	597,868.31
债券利息收入		1,906,565.71	853,709.16
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)		-12,330,368.02	-55,264,828.34
其中:股票投资收益		-41,842,827.58	-79,631,115.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,876,510.76	-6,600.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		31,388,970.32	24,372,887.55
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-10,737,172.75	-1,194,708,392.21
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,568,081.10	653,611.58
减:二、费用		22,291,381.60	21,019,040.97
1.管理人报酬		15,426,686.66	15,559,837.45
2.托管费		3,085,337.33	3,111,967.50
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		3,524,296.05	2,086,747.15
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		255,061.56	260,488.87
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-41,386,097.92	-1,268,887,072.47
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-41,386,097.92	-1,268,887,072.47

6.3 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:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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)	5,213,405,911.30	-594,376,133.72	4,619,029,777.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-41,386,097.92	-41,386,097.92
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)	-906,217,754.41	57,029,980.87	-849,187,773.54
其中:1.基金申购款	631,834,423.60	-76,412,331.35	555,422,092.25
2.基金赎回款	-1,538,052,178.01	133,442,312.22	-1,404,609,865.79
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)	4,307,188,156.89	-578,732,250.77	3,728,455,906.12
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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)	4,610,567,360.02	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)	-	-1,268,887,072.47	-1,268,887,072.47
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)	661,716,654.32	-170,711,488.42	491,005,165.90
其中:1.基金申购款	1,235,287,360.67	-221,405,718.14	1,013,881,642.53
2.基金赎回款	-573,570,706.35	50,694,229.72	-522,876,476.63
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)	5,272,284,014.34	-1,393,948,917.27	3,878,335,097.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,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

6.4 报表附注(摘要)

6.4.1 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。

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6.4.4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。

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2011年6月30日的财务状况以及2011年1月1日至2011年6月30日止期间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.差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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

经建信基金管理有限责任公司(以下简称"公司")2010年度第二次临时股东会审议通过,并于2011年5月4日中国证监会证监许可[2011]648号文批准,本公司原股东中国华电集团公司将所持有的建信基金管理有限责任公司10%的股权转让给中国华电集团资本控股有限公司。该事项已于2011年6月9日在中国证券报、上海证券报、证券时报及我公司网站公开披露。

6.4.6.2 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、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

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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,426,686.66	15,559,837.45
其中:支付销售机构的客户维护费	4,062,104.61	4,673,875.52

注:1、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。

2、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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,085,337.33	3,111,967.50

注: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。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未存在与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.7.4.2 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均未持有本基金。

6.4.7.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	97,830,473.95	476,703.43	168,795,486.93	558,357.59

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。

6.4.7.6 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。

6.4.7.7 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。

6.4.8 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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
600170	上海建工	2011-06-29	筹划重大资产重组事项	15.59	2011-07-04	16.25	272,793	3,967,313.89	4,252,842.87	-
600216	浙江医药	2011-06-27	筹划非公开发行股票融资事宜	31.39	2011-07-04	32.60	176,727	5,917,629.29	5,547,460.53	-
600369	西南证券	2011-03-01	筹划重大资产重组事项	11.87	-	-	351,833	5,714,453.83	4,176,257.71	-
601998	中信银行	2011-06-29	筹划配股事项停牌	4.75	2011-07-07	4.59	1,959,517	11,951,186.87	9,307,705.75	-
000652	泰达股份	2010-11-22	重大事项停牌	7.78	2011-07-08	7.68	907,878	7,785,133.49	7,063,290.84	-
000876	新希望	2011-06-29	筹划重大资产重组事项	19.95	2011-07-05	21.95	272,475	3,611,117.47	5,435,876.25	-
000959	首钢股份	2010-10-29	筹划重大资产重组事项	4.42	-	-	1,070,227	5,781,324.91	4,730,403.34	-

注:本基金截至2011年6月30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。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间正回购余额,故未存在作为抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

报告期末,本基金未持有交易所市场债券正回购品种。

6.4.9 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2011年6月30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3,497,294,378.54元,属于第二层级的余额为139,763,837.29元,无属于第三层级的余额(2010年6月30日:第一层级3,409,851,836.49元,第二层级285,281,537.63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(上年度可比期间: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(上年度可比期间:同)。

于本会计期间内,本基金持有的河南双汇投资发展股份有限公司发行的股票("双汇发展")因重大事项停牌。由于该重大事项对于双汇发展估值的影响程度更多取决于不可观察的输入值,本基金于停牌期间将双汇发展从第一层级转入第三层级,并于复牌后打开跌停之日起将其从第三层级转回第一层级。在上述层级转换中,从第一层级转入第三层级时涉及的公允价值为15,902,373.65元,从第三层级转回第一层时涉及的公允价值为12,256,945.60元(在从第三层级转回第一层级前卖出股票实现收益262,420.91元),在估值属于第三层级期间计入损益的公允价值变动损失为1,412,764.00元。

(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。

§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	3,537,808,215.83	94.24
	其中:股票	3,537,808,215.83	94.24
2	固定收益投资	99,250,000.00	2.64
	其中:债券	99,250,000.00	2.64
	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	98,091,144.46	2.61
6	其他各项资产	18,942,630.87	0.50
7	合计	3,754,091,991.16	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	19,326,362.37	0.52
B	采掘业	416,414,187.49	11.17
C	制造业	1,300,968,895.97	34.89
C0	食品、饮料	214,962,920.20	5.77
C1	纺织、服装、皮毛	12,250,541.73	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	87,262,481.25	2.34
C5	电子	37,913,688.30	1.02
C6	金属、非金属	327,870,616.64	8.79
C7	机械、设备、仪表	469,498,544.01	12.59
C8	医药、生物制品	144,142,664.24	3.87
C99	其他制造业	7,067,439.60	0.19
D	电力、煤气及水的生产和供应业	78,357,370.02	2.10
E	建筑业	113,018,036.88	3.03
F	交通运输、仓储业	134,056,100.11	3.60
G	信息技术业	113,857,941.04	3.05
H	批发和零售贸易	106,508,338.14	2.86
I	金融、保险业	968,757,458.80	25.98
J	房地产业	172,018,313.52	4.61
K	社会服务业	30,458,787.91	0.82
L	传播与文化产业	6,757,384.88	0.18
M	综合类	77,309,038.70	2.07
	合计	3,537,808,215.83	94.89

注:以上行业分类以2011年6月30日的证监会行业分类标准为依据。

7.2.2 积极投资期末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。

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

7.3.1 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	600036	招商银行	8,544,190	111,245,353.80	2.98
2	601318	中国平安	2,107,304	101,719,564.08	2.73
3	600016	民生银行	14,206,574	81,403,669.02	2.18
4	601328	交通银行	13,584,679	75,259,121.66	2.02
5	600000	浦发银行	7,039,311	69,266,820.24	1.86
6	601288	农业银行	24,238,208	67,866,982.40	1.82
7	601166	兴业银行	4,748,914	64,015,360.72	1.72
8	601088	中国神华	2,074,423	62,523,109.22	1.68
9	600030	中信证券	4,378,776	57,274,390.08	1.54
10	000002	万科A	6,088,440	51,447,318.00	1.38

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www.ccbfund.cn网站的半年度报告正文

7.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	601288	农业银行	37,906,320.64	0.82
2	000776	广发证券	18,875,508.16	0.41
3	601988	中国银行	18,640,346.80	0.40
4	600036	招商银行	18,405,058.55	0.40
5	600837	海通证券	16,862,934.92	0.37
6	002304	洋河股份	12,124,202.86	0.26
7	601318	中国平安	9,919,619.99	0.21
8	601989	中国重工	9,553,386.33	0.21
9	600000	浦发银行	9,397,811.34	0.20
10	600582	天地科技	8,907,244.10	0.19
11	601328	交通银行	8,653,682.02	0.19
12	002073	软控股份	7,930,867.22	0.17
13	600016	民生银行	7,890,627.60	0.17
14	601668	中国建筑	7,722,101.90	0.17
15	601166	兴业银行	7,519,309.53	0.16
16	600999	招商证券	6,927,930.21	0.15
17	601088	中国神华	6,774,973.00	0.15
18	601600	中国铝业	6,248,456.86	0.14
19	002106	莱宝高科	5,680,598.42	0.12
20	000157	中联重科	5,636,869.57	0.12

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。

7.4.2 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	43,360,160.67	0.94
2	601988	中国银行	41,360,532.39	0.90
3	601328	交通银行	40,640,341.57	0.88
4	601318	中国平安	38,153,179.60	0.83
5	600000	浦发银行	28,740,419.53	0.62
6	600016	民生银行	28,365,466.61	0.61
7	601166	兴业银行	27,108,987.97	0.59
8	601088	中国神华	22,114,418.15	0.48
9	600030	中信证券	21,895,916.91	0.47
10	000002	万科A	18,932,922.42	0.41
11	601601	中国太保	16,246,604.86	0.35
12	600519	贵州茅台	15,556,759.09	0.34
13	000858	五粮液	14,627,531.69	0.32
14	002024	苏宁电器	12,475,480.51	0.27
15	600031	三一重工	12,242,444.80	0.27
16	601288	农业银行	12,208,573.59	0.26
17	000001	深发展A	11,659,247.96	0.25
18	601169	北京银行	11,495,235.39	0.25
19	601006	大秦铁路	11,453,308.73	0.25
20	600585	海螺水泥	11,344,878.49	0.25

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。

7.4.3 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

买入股票成本(成交)总额	655,971,226.42
卖出股票收入(成交)总额	1,437,552,112.95

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),不包括相关交易费用。

7.5 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	99,250,000.00	2.66
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	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	99,250,000.00	2.66

7.6 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	1101023	11央行票据23	1,000,000	99,250,000.00	2.66

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	1,138,404.46
2	应收证券清算款	14,682,983.17
3	应收股利	2,396,297.39
4	应收利息	628,458.24
5	应收申购款	96,487.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,942,630.87

7.9.4 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。

7.9.5.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。

7.9.6 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§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

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
76,539	56,274.42	1,053,758,442.20	24.47%	3,253,429,714.69	75.53%

8.2 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	1,484,192.00	6.79%
2	蒋云鹏	1,004,480.00	4.60%
3	张小玲	994,500.00	4.55%
4	罗霖	614,620.00	2.81%
5	许新梅	505,218.00	2.31%
6	于晓东	500,035.00	2.29%
7	青海旭阳机电有限公司	500,015.00	2.29%
8	彭云	495,000.00	2.27%
9	王家国	466,801.00	2.14%
10	姜新海	465,593.00	2.13%

注:持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

截至本报告期末,基金管理人的从业人员未持有本基金。

§9 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	5,213,405,911.30
本报告期基金总申购份额	631,834,423.60
减:本报告期基金总赎回份额	1,538,052,178.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,307,188,156.89

§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

本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今,本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	1,552,736,278.46	74.43%	1,235,656.02	74.03%	-
渤海证券	1	533,568,071.33	25.57%	433,527.54	25.97%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
建银投资证券	2	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-

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、本报告期内无新增或剔除交易单元。 4、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	735,417.50	100.00%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
建银投资证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司
二〇一一年八月二十四日