建信保本混合型证券投资基金

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2011年1月18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	建信保本混合
基金主代码	530012
交易代码	530012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月18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	2,865,498,898.84份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	本基金通过风险资产与安全资产的动态配置和有效的组合管理，在为适用保本条款的每份基金份额提供人民币1.00元的保本保证的基础上，寻求组合资产的稳定增长和保本周期收益的最大化。
投资策略	本基金投资策略分为两个层次：一层为基金在风险资产和安全资产两大类资产上的配置策略；另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：三年期银行定期存款收益率（税前）。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险品种。

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18日(基金合同生效日)至2011年6月30日)
本期已实现收益	33,902,356.04
本期利润	22,840,851.56
加权平均基金份额本期利润	0.0075
本期基金份额净值增长率	0.70%
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	0.0070
期末基金资产净值	2,885,667,585.65
期末基金份额净值	1.007

注：1、本基金合同于2011年1月18日正式生效，合同生效当期未满六个月。

2、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。

3、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）。

4、上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	-0.49%	0.13%	0.40%	0.01%	-0.89%	0.12%
过去三个月	0.10%	0.12%	1.21%	0.01%	-1.11%	0.11%
成立至今	0.70%	0.10%	2.11%	0.01%	-1.41%	0.09%

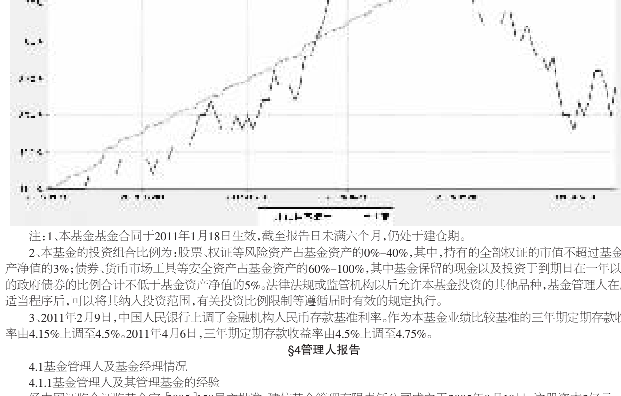
注：本基金基金合同于2011年1月18日生效。

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

建信保本混合型证券投资基金

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

（2011年1月18日至2011年6月30日）



注：1、本基金基金合同于2011年1月18日生效，截至报告日末满六个月，仍处于建仓期。

2、本基金的投资组合比例为：股票、权证等风险资产占基金资产的0%-40%，其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的60%-100%，其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。法律法规或监管机构以后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。

3、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三年期定期存款收益率由4.15%上调至4.5%。2011年4月6日，三年期定期存款收益率由4.5%上调至4.75%。

§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		
黎颖芳女士	本基金基金经理	2011-01-18	-	11	硕士，2000年毕业于湖南大学金融保险学院，毕业后就职于大成基金管理公司，先后在金融工程部和规划发展部担任研究员和产品设计师等职。黎颖芳于2005年11月加入建信基金管理公司研究部，先后担任债券研究员、高级债券研究员和基金经理助理等职，自2009年2月19日至2011年5月11日担任建信稳定增利债券基金的基金经理。

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

自去年四季度以来，管理通胀成为政府宏观调控的首要问题。今年上半年，面对居高不下的物价和楼价，政府继续推进货币信贷的正常化，数度上调了存款准备金率和存贷款利率，资金面在春节前夕和6月下旬出现前所未有的紧张。随着调控的加码，投资者对未来经济增长的预期也有所走弱，在此多重利空的叠加下，上半年资本市场走势较为平淡，十年期国债收益率基本走平，沪深300指数下跌2.69%，中信标普转债指数下跌2.29%。

本基金在上半年基本完成了安全资产的构建，结构上主要以剩余期限三年左右的信用债为主；风险资产比例一直维持较低，在市场底部配置了部分转债作为攻守相宜的资产，但遗憾的是没有较好的把握二季度转债的波段操作机会。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金于2011年1月18日成立，截至2011年6月30日，本基金净值增长率为0.70%，波动率为0.10%，业绩比较基准收益率为2.11%，波动率为0.01%。

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，我们认为宏观调控已进入尾声，通货膨胀问题虽然不会迅速消除，但已经显现出逐步见顶之势，关于地产的调控虽然还有加码之势，主要原因是许多政策行政色彩太浓，执行起来容易打折扣，随着按揭利率逼近历史高点，相信地产价格回落是大势所趋，由此带来的经济增长下滑预期会有所强化，但政府推进保障房建设的决心和力度将直接影响未来两年经济增速下滑的速度。目前我们对此保持相对乐观。

我们初步判断资本市场面临的环境将优于上半年。目前权益市场的估值从长远来看属于偏低的水平。关于地方融资平台及城投债风险问题，本基金认为总体来看风险可控，毕竟中国政府（包括地方和中央政府）的整体资产负债率并不高，但局部地区可能在金融危机后负债过度扩张，造成在信贷偏紧的环境中违约风险加大。随着政府对地方融资平台清理方案的逐步落实，相信这部分的风险将会得到解决。

本基金下半年将继续遵照基金合同，利用CPPI策略，合理调整风险资产的比例，力争为投资者创造稳健的收益。

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，负责审查批准新估值政策、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和建议，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

截止本报告期末基金可供分配利润为20,168,686.81元，本报告期内未进行利润分配。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，未存在应分配未分配利润的情况。

§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保本混合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

2011年上半年，建信保本混合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保本混合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。

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保本混合型证券投资基金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：建信保本混合型证券投资基金

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		18,196,194.50	-
结算备付金		3,516,419.85	-
存出保证金		172,314.17	-
交易性金融资产		2,691,325,181.76	-
其中：股票投资		115,018,274.06	-
基金投资		-	-
债券投资		2,576,306,907.70	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		144,000,576.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		36,786,767.57	-
应收股利		-	-
应收申购款		35,488.19	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,894,032,942.04	-
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		-	-
应付赎回款		4,423,407.08	-
应付管理人报酬		2,880,895.30	-
应付托管费		480,149.23	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		386,634.70	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		194,270.08	-
负债合计		8,365,356.39	-
所有者权益：			
实收基金		2,865,498,898.84	-
未分配利润		20,168,686.81	-
所有者权益合计		2,885,667,585.65	-
负债和所有者权益总计		2,894,032,942.04	-

注：1、报告截止日2011年6月30日，基金份额净值1.007元，基金份额总额2,865,498,898.84份。

2、本基金合同于2011年1月18日正式生效，合同生效当期未满六个月。

6.2利润表

会计主体：建信保本混合型证券投资基金

本报告期：2011年1月18日（基金合同生效日）至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2011年1月18日(基金合同生效日)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		42,998,237.67	-
1.利息收入		44,646,570.51	-
其中：存款利息收入		1,085,753.74	-
债券利息收入		30,930,231.47	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,630,585.30	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		8,009,629.07	-
其中：股票投资收益		1,745,326.02	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		5,159,868.10	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,104,434.95	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-11,061,504.48	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,403,542.57	-
减：二、费用		20,157,386.11	-
1.管理人报酬		16,383,574.23	-
2.托管费		2,730,595.75	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		675,476.41	-
5.利息支出		197,793.25	-
其中：卖出回购金融资产支出		197,793.25	-
6.其他费用		169,946.47	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		22,840,851.56	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		22,840,851.56	-

注：本基金合同于2011年1月18日正式生效，合同生效当期未满六个月。

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信保本混合型证券投资基金

本报告期：2011年1月18日（基金合同生效日）至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月18日(基金合同生效日)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)	3,125,506,923.65	-	3,125,506,923.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,840,851.56	22,840,851.56
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)	-260,008,024.81	-2,672,164.75	-262,680,189.56
其中：1.基金申购款	17,859,153.34	168,246.36	18,027,399.70
2.基金赎回款	-277,867,178.15	-2,840,411.11	-280,707,589.26
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)	2,865,498,898.84	20,168,686.81	2,885,667,585.65
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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

注：本基金合同于2011年1月18日正式生效，合同生效当期未满六个月。

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

建信保本混合型证券投资基金（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"）证监许可［2010］1808号文核准，自2010年12月20日至2011年1月14日期间向全社会公开募集。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《建信保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集，募集期至2011年1月14日结束。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3,124,920,245.43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（2011）第010号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信保本混合型证券投资基金基金合同》于2011年1月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,125,506,923.65份基金份额，其中认购资金利息折合586,678.22份基金份额。其中，建信基金管理有限责任公司（以下简称"本基金管理人"）以固有资金2,000万元人民币于2010年12月20日认购了本基金，认购费1,000元，持有的基金份额总额为20,004,400.00份（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例为0.64%。本基金管理人员工持有的基金份额总额为109,038.11份（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例为0.0035%。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《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的债券、股票、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金按照恒定比例组合保险策略将资产配置于安全资产与风险资产。本基金投资的安全资产为国内依法发行交易的债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具等；本基金投资的风险资产为股票、权证等。本基金的投资组合比例为：股票、权证等风险资产占基金资产的0%-40%，其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的60%-100%，其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。法律法规或监管机构以后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款收益率（税前）。

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》、《建信保本混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注6.4.4所列示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2011年6月30日的财务状况以及2011年1月18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

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 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。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式：（1）保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；（2）转型后：基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准。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。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 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。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3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、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

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18日(基金合同生效日)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	16,383,574.23	-
其中：支付销售机构的客户维护费	5,710,505.66	-

注：1、本基金合同于2011年1月18日正式生效，合同生效当期未满六个月。

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1.20%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：

日管理费=前一日基金资产净值 X 1.20% / 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。

6.4.7.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2011年1月18日(基金合同生效日)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	2,730,595.75	-

注：1、本基金合同于2011年1月18日正式生效，合同生效当期未满六个月。

2、支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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 0.20% / 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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2011年1月18日(基金合同生效日)至2011年6月30日					
	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	30,820,701.37	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日					
	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	-	-	-	-	-	-

注：本基金合同于2011年1月18日正式生效，合同生效当期未满六个月。

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

份额单位：份

项目	本期2011年1月18日(基金合同生效日)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
基金合同生效日(2011年1月18日)持有的基金份额	20,004,400.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	20,004,400.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.70%	-

注：本基金合同于2011年1月18日正式生效，合同生效当期未满六个月。

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18日(基金合同生效日)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	18,196,194.50	1,016,199.15	-	-

注：1、本基金合同于2011年1月18日正式生效，合同生效当期未满六个月。

2、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

本报告期内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

本报告期内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

截至报告期末，本基金未持有因认购新发\增发证券而流通受限证券。

6.4.8.2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
600098	广州控股	2011-06-20	筹划重大事项	6.79	2011-07-08	7.47	500,000	3,397,836.80	3,395,000.00	-

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债券正回购余额，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1,188,756,181.76元，属于第二层级的余额为1,502,569,000.00元，无属于第三级的余额。

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。

对于持有的认购新发证券，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。

（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	115,018,274.06	3.97
	其中：股票	115,018,274.06	3.97
2	固定收益投资	2,576,306,907.70	89.02
	其中：债券	2,576,306,907.70	89.02
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	144,000,576.00	4.98
	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	21,712,614.35	0.75
6	其他各项资产	36,994,569.93	1.28
7	合计	2,894,032,942.04	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	-	-
C	制造业	22,683,297.34	0.79
C0	食品、饮料	2,787,676.20	0.10
C1	纺织、服装、皮毛	12,815,834.50	0.44
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	4,791,005.64	0.17
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	2,288,781.00	0.08
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	10,048,109.12	0.35
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	2,780,000.00	0.10
I	金融、保险业	61,685,946.66	2.14
J	房地产业	17,820,920.94	0.62
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	115,018,274.06	3.99

注：以上行业分类以2011年6月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

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	601318	中国平安	403,648	19,484,088.96	0.68
2	601601	中国太保	849,790	19,026,798.10	0.66
3	000002	万科A	1,999,867	16,898,876.15	0.59
4	601169	北京银行	1,489,250	14,847,822.50	0.51
5	002029	七匹狼	404,285	12,815,834.50	0.44
6	600016	民生银行	1,453,270	8,327,237.10	0.29
7	600795	国电电力	2,247,672	6,653,109.12	0.23
8	000709	河北钢铁	1,059,957	4,791,005.64	0.17
9	600098	广州控股	500,000	3,395,000.00	0.12
10	600887	伊利股份	167,428	2,787,676.20	0.10

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。

7.4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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	35,121,222.96	1.22
2	601601	中国太保	27,466,162.82	0.95
3	601169	北京银行	24,716,661.00	0.86
4	600887	伊利股份	18,289,548.94	0.63
5	000002	万科A	16,064,593.59	0.56
6	002029	七匹狼	15,544,611.58	0.54
7	600028	中国石化	13,027,910.00	0.45
8	601009	南京银行	11,449,907.00	0.40
9	601668	中国建筑	10,590,000.00	0.37
10	600016	民生银行	10,112,404.00	0.35
11	002001	新和成	7,730,093.00	0.27
12	600631	百联股份	7,480,459.00	0.26
13	600263	路桥建设	7,071,682.25	0.25
14	600795	国电电力	6,982,643.52	0.24
15	600790	轻纺城	6,460,462.00	0.22
16	600782	新钢股份	6,349,936.50	0.22
17	000858	五粮液	6,329,065.00	0.22
18	000157	中联重科	5,246,500.00	0.18
19	300020	银江股份	4,993,016.56	0.17
20	002073	软控股份	4,660,870.12	0.16

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	15,982,391.33	0.55
2	601318	中国平安	15,598,766.00	0.54
3	600028	中国石化	11,997,580.00	0.42
4	601668	中国建筑	11,310,000.00	0.39
5	601009	南京银行	9,819,027.00	0.34
6	601601	中国太保	9,521,438.97	0.33
7	002001	新和成	8,075,171.40	0.28
8	600631	百联股份	8,033,170.00	0.28
9	600263	路桥建设	7,358,797.55	0.26
10	600782	新钢股份	7,161,588.40	0.25
11	000858	五粮液	6,521,841.73	0.23
12	600790	轻纺城	6,268,437.56	0.22
13	000157	中联重科	5,515,900.00	0.19
14	601169	北京银行	5,500,757.00	0.19
15	002073	软控股份	5,118,518.24	0.18
16	300020	银江股份	4,230,764.50	0.15
17	000650	仁和药业	4,153,165.06	0.14
18	002417	三元达	3,943,098.85	0.14
19	600062	双鹤药业	3,751,899.00	0.13
20	601607	上海医药	3,461,020.21	0.12

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	292,426,253.68
卖出股票收入（成交）总额	176,764,536.23

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	201,781,422.50	6.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,420,814,146.50	49.24
5	企业短期融资券	280,011,000.00	9.70
6	中期票据	-	-
7	可转债	673,700,338.70	23.35
8	其他	-	-
9	合计	2,576,306,907.70	89.28

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	113001	中行转债	3,538,450	373,589,551.00	12.95
2	110015	石化转债	1,807,810	194,972,308.50	6.76
3	0980124	09浦发债	1,500,000	149,385,000.00	5.18
4	010112	21国债(12)	1,222,310	121,925,422.50	4.23
5	098052	09轻纺城债	1,000,000	99,670,000.00	3.45

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。

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	172,314.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,786,767.57
5	应收申购款	35,488.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,994,569.93

7.9.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	373,589,551.00	12.95
2	125709	唐钢转债	33,137,700.00	1.15
3	110003	新钢转债	11,570,000.00	0.40
4	110011	歌华转债	3,424,228.20	0.12

7.9.5期末前十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	600098	广州控股	3,395,000.00	0.12	重大事项连续停牌

§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
35,756	80,140.37	56,654,713.21	1.98%	2,808,844,185.63	98.02%

8.2 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	109,038.11	0.00%

§9开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年1月18日)基金份额总额	3,125,506,923.65
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	17,859,153.34
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	277,867,178.15
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,865,498,898.84

注：1、本基金合同于2011年1月18日正式生效，合同生效当期未满六个月。

2、总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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	
中信建投	1	338,697,590.65	72.19%	272,819.99	72.01%	-
海通证券	1	130,493,199.26	27.81%	106,026.43	27.99%	-

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、本基金合同于2011年1月18日正式生效，本期新增中信建投及海通证券各一个交易单元。

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
中信建投	979,757,800.24	89.12%	11,858,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	119,610,701.25	10.88%	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司
二〇一一年八月二十四日