2.1 基金基本情况

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

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

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 1 日起至 6 月 30 日止 §2 基金简介

基金简称	建信货币
基金主代码	530002
交易代码	530002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年 4 月 25 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	1,878,988,455.33 份
基金合同存续期	不定期
2.2 基金产品说明	
投资目标	在力保本金安全和基金财产较高流动性的前提下,争取获得超过投资基准的 收益率。
投资策略	综合运用定量分析和定性分析手段,全面评估货币市场的利率走势、类属资 产和券种的风险收益水平及流动性特征,在此基础上制订本基金投资策略。
业绩比较基准	本基金投资业绩比较基准为6个月银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种;预期收益和风险均低于债券基金。混合其金、股票其金

2.3 基金管理	人和基金托管人		
I	更目	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
	姓名	路彩营	赵会军
信息披露负责人	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	

83 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

	並似于世:八八川
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	55,843,908.41
本期利润	55,843,908.41
本期净值收益率	1.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末基金资产净值	1,878,988,455.33
期末基金份額净值	1.0000
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。由于货币主 场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额

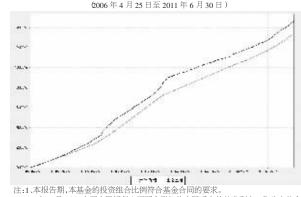
- 2、本基金的利润分配按日结转基金份额。
- 3、持有人认购或交易本基金时,不需缴纳任何费用。 3.2基金净值表现

3.21 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较其准收益率的比较

5.2.1 经业份额守值收益于及共与国务证实际依据中的记载						
阶段	份额净值收益 率①	份额净值收益率 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	0.3001%	0.0048%	0.2545%	0.0000%	0.0456%	0.0048%
过去三个月	0.7982%	0.0030%	0.7704%	0.0002%	0.0278%	0.0028%
过去六个月	1.6345%	0.0027%	1.4453%	0.0006%	0.1892%	0.0021%
过去一年	2.6403%	0.0032%	2.5279%	0.0012%	0.1124%	0.0020%
过去三年	7.6268%	0.0085%	7.4286%	0.0016%	0.1982%	0.0069%
成立至今	14.6554%	0.0073%	13.5048%	0.0019%	1.1506%	0.0054%
注 其合版老八和坡口往妹八碗						

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率

建信货币市场基金 份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注:1.本报告期.本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。 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6个月定期存款税后收益率由2.50%上调至2.80%。2011年4月6日,该收益率上

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.11 基金百里人及基金产星情况。 4.11 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 l158 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 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,公司秉持城信、专业、规范、创新"的核心价值观,恪守特有人利益重于泰山"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、建信代选成长股票型证券投资基金、建信作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、建信核它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 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	5.金经理期限	证券从业年	逆期	
81.75	朝で対	任职日期	离任日期	限	児明	
李菁女士	本基金基金经理	2007-11-01	-	5	硕士、2002年7月进入中国建 银行股份有限公司基金托管部 银厂从事基金托管业务,任主任任 员。2005年9月加入本公司。5 启任债券研究员和本基金总量,2009年6月 日起任建修改益增强基金总理 理,2011年6月16日起任建 信用增强债券型证券投资基金 金经理。	
汪沛先生	投资管理部总监,本 基金基金经理	2006-04-25	2011–02–01	10	部士。2000年班內国來型與 並行資金營配中心,担任债券 易別。2001年3月,加入當屆 金營理有限公司,所在窓場与 参研究员、固定收益主管。200年 年12月2日至2006年1月进入 信基金營理有限無任公司。200年 年1月进入在500年1月进入 信基金管理有限無任公司。200 年1月进入在501年5月11日至 位化配置基金经理。2008 6月25日至2011年5月11日 位化配置基金经理。2008 6月26日增初券基金基金型。2008 6月26日增加券基金基金型。2008 7011年5月因个人原因从公司商职。	
為那女士	本基金基金经理助理	2009-07-03		5	硕士,2006年7月至2007年 月在中信建投证券公司销售交 部工作,任交易员。2007年6 进入本公司,历任初级交易员、 易员等职,于2009年7月任基 经理助理。	

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》基金合同和其他比律法规、 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

43.1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 为了公平对行投资人,除升投资人利益,避免出现不正当夫联交易、利益输送专违法违规行 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》、征券投资基金 公司公平交易制度指导意见》、醣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》、停常交易管理办法》、《公司防范内幕交易 管理办法》、《创益冲突管理办法》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 建行利达验送

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明 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

上半年,在居民物价水平同比数据屡创新高的情况下,年初伊始,货币信贷政策环境进一步 收紧,房地产调控政策也进一步从严,在严控信贷的前提下,央行逐月上调存款准备金率并伴随上调存贷款基准利率。欧债危机恶化,美国经济复苏持续低于预期,外围经济的不确定性和紧缩

性政策执行力度的不确定性使得投资面临的环境更趋复杂。 季度货币市场经历了春节前后资金紧张的脉冲式冲高回落的震荡行情,但由于上半年准

备金率的连续上调以及监管机构对南业银行产货比、资本充足率等指标的监管严格化使得银行间资金在二季度呈现逐月紧张的态势,回购利率逐步上行,并在6月底大幅飙升,各期限品种收益率均有所上行,短端上行幅度较大。同时随着地方融资平台资金链隐忧的出现,信用债收益率

回顾上半年的投资管理工作,建信货币基金保持稳健的投资风格,在一季度根据申购赎回 情况逐步提高了高评级短融资产和定期存款的配置比例,二季度仍然以回购和定期存款等筛选为性资产为配置重点,较为平稳地渡过了资金紧张期和季末赎回期。但对从5月开始的大规模赎 回预估不足,在短期利率大幅上升的情况下,组合的平均剩余期限被动有所延长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

建信货币市场基金

2011年6月30日

2011年上半年本基金净值收益率 1.6345%, 波动率 0.0027%, 业绩比较基准收益率 1.4453%,波动率 0.0006%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

政府一直以来在经济增长和控制通货膨胀之间进行政策调控的相机抉择,近期政府仍然表示出对通货膨胀的担忧以及严控通胀的决心。展望下半年,我们认为前期紧缩的各项政策将逐 步体现其效应,经济增速放缓并伴随居民物价水平的冲高回落,目前来看,政策进一步收紧的必 要性在降低,但短期内由于通胀同比数据的高企货币政策难以出现根本性的转向,从中长期看

随着后续政策效应的体现政策也将出现相应的调整。 基于以上判断,我们对三季度货币市场资金状况并不乐观,而银行理财产品对货币基金的 冲击效应在短期内仍然难以完全消除,本基金仍将保持稳健的投资风格,增强组合的流动性,加强组合投资的灵活性,力争保证组合能够跟随市场的发展变化,获得合理的收益。

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。

本ならショニにのに出りすりた。同一では「自己のでは、これでは、これでは、 本根告期内、公司と与中央国債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。值用非货币基金 威影子定价 值用货币基金)。 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式为红利再投资,每日将当日收益结转为基金份额,当日收益参与下一日基金收益分配,并按月结转到投资者基金账户。本会计期间基金应分配利润为 55,843,908.41元,已全部分配,符合法律法规和 45。在6月》的相关规定。 \$5.托管人报告

51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货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资 基金法》、货币市场基金管理暂行规定》、货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关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,建信货币市场基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上、一个格遵循(证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特见程》、《货币市场基金信息披露特

53.托管人对太坐年度报告中财务信息等内容的直实,准确和完整发表音贝 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货币市场基金 2011 年半年 度报告中财务指标、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

§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:建信货币市场基金

报告截止日:2011年6月30日

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		201,645,166.74	1,589,727,397.5
结算备付金		-	9,437,727.2
存出保证金		-	
交易性金融资产		1,371,531,708.71	949,972,266.2
其中:股票投资		-	
基金投资		-	
债券投资		1,371,531,708.71	949,972,266.2
资产支持证券投资		-	
衍生金融资产		-	
买人返售金融资产		519,166,818.75	7,216,660,552.9
应收证券清算款		-	15,619,619.4
应收利息		13,062,997.08	18,605,057.8
应收股利		-	
应收申购款		23,591,580.00	200.0
递延所得税资产		-	
其他资产		-	
资产总计		2,128,998,271.28	9,800,022,821.
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		247,949,676.02	
应付证券清算款		-	
应付赎回款		103,230.90	164,644.
应付管理人报酬		713,166.40	1,178,118.
应付托管费		216,111.01	357,005.
应付销售服务费		540,277.59	892,514.
应付交易费用		52,587.18	65,322.
应交税费		_	
应付利息		34,018.01	
应付利润		_	
递延所得税负债		_	
其他负债		400,748.84	295,547.
负债合计		250,009,815.95	2,953,152.
所有者权益:			
实收基金		1,878,988,455.33	9,797,069,668.
未分配利润		-,,,	.,,,,
所有者权益合计		1,878,988,455.33	9,797,069,668.
负债和所有者权益总计		2,128,998,271.28	9,800,022,821.2

6.2 利润表

会计主体:建信货币市场基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

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		70,901,696.36	44,265,315.69
1.利息收入		71,480,332.28	36,885,838.07
其中:存款利息收入		18,962,718.23	304,489.00
债券利息收入		23,480,090.31	20,797,612.59
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收入		29,037,523.74	15,783,736.48
其他利息收入		-	_
2.投资收益(损失以"-"填列)		-578,635.92	7,379,477.62
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-578,635.92	7,379,477.62
资产支持证券投资收益		-	_
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-	-
减:二、费用		15,057,787.95	15,668,865.07
1.管理人报酬		5,779,168.10	6,020,629.19
2.托管费		1,751,263.06	1,824,433.09
3.销售服务费		4,378,157.70	4,561,082.78
4.交易费用		-	-
5.利息支出		2,837,779.74	2,952,429.19
其中:卖出回购金融资产支出		2,837,779.74	2,952,429.19
6.其他费用		311,419.35	310,290.82
三、利润总额(亏损总额以""号填列)		55,843,908.41	28,596,450.62
減:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"="号填列)		55,843,908.41	28,596,450.62

			单位:人民币:
项目	2011年	本期 5 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	3
	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)	9,797,069,668.29	-	9,797,069,668.29
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润)	-	55,843,908.41	55,843,908.41
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)	-7,918,081,212.96	-	-7,918,081,212.96
其中:1.基金申购款	18,787,543,497.35	-	18,787,543,497.35
2.基金赎回款	-26,705,624,710.31	-	-26,705,624,710.31
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)	-	-55,843,908.41	-55,843,908.41
五、期末所有者权益(基金净值)	1,878,988,455.33	-	1,878,988,455.33
项目	2010年	上年度可比期间 5 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	1
	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)	9,801,275,775.62	-	9,801,275,775.62
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润)	-	28,596,450.62	28,596,450.62
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)	-7,651,648,912.16	-	-7,651,648,912.16
其中:1.基金申购款	18,846,394,328.09	-	18,846,394,328.09
2.基金赎回款	-26,498,043,240.25	-	-26,498,043,240.25
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)	-	-28,596,450.62	-28,596,450.62
五、期末所有者权益(基金净值)	2,149,626,863.46	-	2,149,626,863.46

2011 半年度 报告摘要

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

64 报表附注 缩要)

6.4.1 基金基本情况 建信货币市场基金 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 56号 关于同意建信货币市场基金募集的批复》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《建信货币市场基金基金合同》负责 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 7,659,641,315.67 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 48 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,健信货币市场基金基金合同》于2006年4月25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为7,660,614,611.89份基金份额,其中认购资金 利息折合 973,296.22 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(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》、《货币市场基金管理暂行规定》和《建信货币市场 基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;通知存款;一年以内(含一年)的银行定 期存款、大额存单;剩余期限在397天 焓397天)以内的债券;期限在一年以内焓一年)的债券 回购;期限在一年以内 含一年)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具 有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为六个月银行定期存款税后收益率。

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 15 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》、《建信货币市场基金基金合同》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

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、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。 6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金官建筑		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	5,779,168.10	6,020,629.19
其中:支付销售机构的客户维护费	791,061.18	1,082,072.78
注:1、支付基金管理人建	信基金管理有限责任公司的管理	甲人报酬按前一日基金资产净值

0.33%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 0.33% / 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。 6.4.7.2.7 其全兵答要

0.4.7.2.2 至並11百页		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
期发生的基金应支付的托管费	1,751,263.06	1,824,433.09
		14 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1

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 0.10%的年费率计提, 逐目累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10%/当

6.4.7.2.3 销售服务费

单位,人民币元

	单位:人民币元
获得销售服务费的各关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国建设银行	2,550,568.03
中国工商银行	425,939.17
#信基金管理有限责任公司	978 ,434.87
\$tt	3,954,942.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国建设银行	2,737,195.59
中国工商银行	836,817.68
性信基金管理有限责任公司	439,173.54
hit .	4,013,186.81

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累 计至每月月底,按月支付给建信基金管理有限责任公司,再由建信基金管理有限责任公司计算 并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值 x0.25%/当年

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

					1	单位:人民币
		2011年1月1日	本期 至 2011 年 6	5月30日		
银行间市场交易	债	券交易金額	盐	金逆回购	基金正	E回购
的各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中国工商 银行	-	60,494,453.42	-	-	-	
		上年原 2010年1月1日	で可比期间 至 2010 年 6	5月30日		
银行间市场交易	债金	券交易金額	基	金逆回购	基金正	EOM
的各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中国工商银行	-	228,127,780.13	-	-	-	

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 本报告期及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

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 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

本期 2011年1月1日至2011年6月30日 1,645,166.74 588,675.88 注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行银行同业利率计息

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

11进出 08

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生其他关联交易事项。 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

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

报告期末,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。 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 截至本报告期末2011年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出

回购证券款余额 247,949,676.02 元,是以如下债券作为质押: 金额单位, 人民币元 2011-07-01 110206 11国开 06 2011-07-01 500,000 49,945,195.9 120,013,807.

注:期末估值单价计算精确到 0.01 元,小数点后第三位四舍五人 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

至本报告期末,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

2011-07-01

(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

110308

允价值相差很小。 6)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 第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(朱经调整)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

于 2011 年 6 月 30 目,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层级的余 额,属于第二层级的余额为1,371,531,708.71元,无属于第三层级的余额 2010年6月30日: 无第一层级,第二层级1,417,201,305.60元,无第三层级)。于本报告期内,本基金持有的以公 允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动 2010年1月1日至2010年6月

30 日: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。 §7 投资组合报告

7.1 79	7/ NAS 30 / SEE DIE 16 / P		
			金额单位:人民币5
序号	项目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,371,531,708.71	64.42
	其中:债券	1,371,531,708.71	64.42
	资产支持证券	-	_
2	买人返售金融资产	519,166,818.75	24.39
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	201,645,166.74	9.47
4	其他各项资产	36,654,577.08	1.72
5	合计	2,128,998,271.28	100.00

		金额单位:人民币元		
项目	占基金资产净值	直的比例(%)		
内债券回购融资余额		6.80		
(断式回购融资		-		
项目	金額	占基金资产净值的比例(%)		
末债券回购融资余额	247,949,676.02	13.20		
E断式回购融资	-	-		
	内债券回购融资余额 斯式回购融资 项目 末债券回购融资余额	内債券回時融資余額 (新式回時融資 項目 金額 末債券回時融資余額 247,949,676.02		

注:报告期内债券回购融资余额占基金净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产

净值比例的简单平均值。

7.3 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明 本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%

7.4 基金投资组合平均剩余期限

7.4.1 投资组合平均剩余期限基本情况	
项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	143
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	143
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	19

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。 7.4.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的 比例(%)	各期限负债占基金资产净值的 比例(%)
1	30天以内	35.69	13.20
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.78	
2	30天(含)-60天	7.98	
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.66	
3	60天(含)-90天	16.04	
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	10.72	
4	90天(含)-180天	2.66	
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	
5	180天(含)-397天(含)	48.98	
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
6	合计	111.35	13.20

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	
2	央行票据	-	
3	金融债券	591,133,419.41	31.4
	其中:政策性金融债	591,133,419.41	31.4
4	企业债券	-	
5	企业短期融资券	780,398,289.30	41.5
6	中期票据	-	
7	其他	-	
8	合计	1,371,531,708.71	72.9
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率 债券	341,289,280.51	18.1
7.6 🎚	明末按摊余成本占基金资产净	值比例大小排名的前十名债	券投资明细

金额单位:人民币元

· 额单位:人民币:	氢				
占基金资产净值比例 (%)	摊余成本	债券数量(张)	债券名称	债券代码	序号
7.98	149,882,346.18	1,500,000	11国开 22	110222	1
6.92	130,014,958.41	1,300,000	11国开 12	110212	2
4.78	89,867,332.46	900,000	11国开 21	110221	3
4.26	80,058,347.02	800,000	11河钢 CP01	1181118	4
3.80	71,461,793.66	700,000	09国开 05	090205	5
2.67	50,173,506.03	500,000	11云铜股 CP01	1181094	6
2.66	50,021,229.94	500,000	11中金集 CP01	1181222	7
2.66	50,003,470.98	500,000	11华侨城 CP02	1181246	8
2.66	50,001,740.76	500,000	11亿利 CP01	1181130	9
2.66	50,000,000.00	500,000	11陕有色 CP01	1181076	10

7.7 影子定价"与 摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

7.0 期末按八分价估上其入次立为估证例十小排	
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	
报告期内偏离度的最低值	-
报告期内偏离度的最高值	
报告期内偏离度的理对但在 0.25(否)-0.5%间的次数	

7.9.1 基金计价方法说明 本基金计价采用摊余成本法,即估值对象以买人成本列示,按票面利率或商定利率并考虑 其买人时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每目计提损益。本基金通过每目分红

使基金份额净值维持在1.0000元。 7.9.2 本报告期内, 本基金不存在持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮

动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。 7.9.3 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

制目前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9.4	- 州木共10台坝页厂1000	
		单位:人民币
序号	名称	金額
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	13,062,997.08
4	应收申购款	23,591,580.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-

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

§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	人结构				
持有人户数 (户)	户均持有的基 金份額	机构投	资者	个人投	资者			
())	302 (F) THE	持有份額	占总份额比例	持有份額	占总份额比例			
29,274	64,186.26	684,091,552.78	36.41%	1,194,896,902.55	63.59%			

§9 井放式:	基金份额变动
	单位:份
基金合同生效日(2006年4月25日)基金份额总额	7,660,614,611.89
本报告期期初基金份額总額	9,797,069,668.29
本报告期基金总申购份额	18,787,543,497.35
减:本报告期基金总赎回份额	26,705,624,710.31
本担生期其今長公市時必需	

注:上述总申购份额含红利再投资和转换转人份额,总赎回份额含转换转出份额

§10 重大事件揭示

101 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:	人民币ラ
	交易单元 数量	於 B 的 二		应支付该多		
券商名称		成交金額	占当期股票成交总 額的比例	佣金	占当期佣金总量的 比例	备注

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》 征 监基金字 2007 148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。 6)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,

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、本报告期内未发生交易单元的变更。 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

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。

成交金額 成交金额

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过 0.5%的情况。

-一年八月二十四日

金额单位:人民币元

建信基金管理有限责任公司