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:二〇一二年八月二十八日

建信沪深300指数证券投资基金(LOF)

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

§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2012年8月24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。

半年度报告摘要摘自半年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012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	4,339,314,669.16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	010一66105799
	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	010一66105798

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(2012年1月1日至2012年6月30日)
本期已实现收益	-145,274,472.15
本期利润	206,703,198.02
加权平均基金份额本期利润	0.0440
本期基金份额净值增长率	5.47%
3.1.2期末数据和指标	**报告期末(2012年6月30日)**
期末可供分配基金份额利润	-0.2869
期末基金资产净值	3,094,462,074.44
期末基金份额净值	0.713

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(已实现部分抵补未实现部分)。

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	-5.31%	1.04%	-6.15%	1.04%	0.84%	0.00%
过去三个月	1.28%	1.06%	0.28%	1.07%	1.00%	-0.01%
过去六个月	5.47%	1.25%	4.75%	1.26%	0.72%	-0.01%
过去一年	-17.67%	1.28%	-18.16%	1.28%	0.49%	0.00%
成立至今	-28.70%	1.34%	-27.24%	1.37%	-1.46%	-0.03%

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三年。

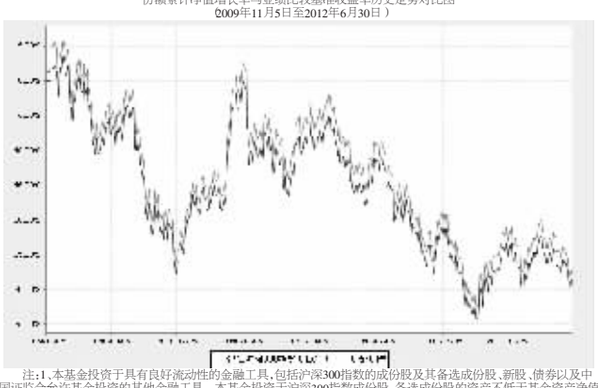
2.本基金投资业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。其中:沪深300指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准,商业银行活期存款利率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数,它是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。指数样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值。成份股为市场中市场代表性好,流动性高,交易活跃的主流投资股票,能够反映市场主流投资的收益情况。

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2012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.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2012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、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、深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金22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475.31亿元。

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	投资管理部执行总监,本基金基金经理	2009-11-05	-	9	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、投资管理部副总监。2010年5月28日至2012年5月28日任上证社会责任ETF及联接基金基金经理;2011年9月8日起任深证基本面60ETF及联接基金基金经理;2012年3月16日起任建信深证100指数基金的基金经理。

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 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。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。本基金管理人以量化分析研究为基础,制定及执行了相应的替代策略,并持续根据市场情况对替代方案进行优化和调整,以尽可能降低跟踪误差及偏离度。

在报告期内,个别交易日的大额申赎赎回、成份股分红、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。

在六月底,本基金管理人根据即将到来的标的指数成分股变动提前进行了调仓,减少了冲击成本,并控制了跟踪误差。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率5.47%,波动率1.25%,业绩比较基准收益率4.75%,波动率1.26%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在报告期间,指数曾经有反弹,但在经济基本面的压制下重回低点,展望2012年下半年,经济的基本面仍然不容乐观,各经济指标仍在低点徘徊,流动性虽有好转,但真实需求不足,预计指数上行压力仍大。

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。

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

本报告期内本基金未实施利润分配,符合相关法律法规及本基金合同中关于利润分配条款的规定。

§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

2012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

2012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)2012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。

§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:2012年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资产:			
银行存款		115,568,385.92	84,422,970.98
结算备付金		1,230,532.29	1,396,205.32
存出保证金		604,166.66	1,082,443.77
交易性金融资产		3,015,369,998.37	3,205,958,184.95
其中:股票投资		2,918,409,998.37	3,109,138,184.95
基金投资		-	-
债券投资		96,960,000.00	96,820,000.00
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		-	-
应收利息		1,922,489.96	2,367,274.50
应收股利		4,707,309.98	-
应收申购款		283,502.38	159,516.58
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,139,686,385.56	3,295,386,596.10
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2012年6月30日**	**上年度末 2011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		40,499,756.15	3,550,438.38
应付赎回款		1,050,614.32	763,596.40
应付管理人报酬		1,935,361.98	2,121,500.47
应付托管费		387,072.40	424,300.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,065,741.57	641,895.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		285,764.70	461,455.05
负债合计		45,224,311.12	7,963,185.53
所有者权益:			
实收基金		4,339,314,669.16	4,863,927,940.12
未分配利润		-1,244,852,594.72	-1,576,504,529.55
所有者权益合计		3,094,462,074.44	3,287,423,410.57
负债和所有者权益总计		3,139,686,385.56	3,295,386,596.10

注:报告截止日2012年6月30日,基金份额净值0.713元,基金份额总额4,339,314,669.16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:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入		224,619,316.57	-19,094,716.32
1.利息收入		1,888,631.14	2,404,743.35
其中:存款利息收入		370,571.02	498,177.64
债券利息收入		1,518,060.12	1,906,565.71
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)		-129,792,535.89	-12,330,368.02
其中:股票投资收益		-165,371,472.48	-41,842,827.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益		57,500.00	-1,876,510.76
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		35,521,436.59	31,388,970.32
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		351,977,670.17	-10,737,172.75
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		545,551.15	1,568,081.10
减:二、费用		17,916,118.55	22,291,381.60
1.管理人报酬		12,849,603.22	15,426,686.66
2.托管费		2,569,920.62	3,085,337.33
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		2,248,713.19	3,524,296.05
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		247,881.52	255,061.56
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		206,703,198.02	-41,386,097.92
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		206,703,198.02	-41,386,097.92

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:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	4,863,927,940.12	-1,576,504,529.55	3,287,423,410.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	206,703,198.02	206,703,198.02
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)	-524,613,270.96	124,948,736.81	-399,664,534.15
其中:1.基金申购款	414,359,178.57	-111,924,907.15	302,434,271.42
2.基金赎回款	-938,972,449.53	236,873,643.96	-702,098,805.57
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)	4,339,314,669.16	-1,244,852,594.72	3,094,462,074.44
项目	**上年度可比期间 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

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

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]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公开发行募集。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%。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。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。本基金的标的指数使用费由基金管理人建信基金管理有限责任公司承担,不计入本基金费用。

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》和中国证监会允许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2012年6月30日的财务状况以及2012年1月1日至2012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。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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

本报告期,存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2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
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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,849,603.22	15,426,686.66
其中:支付销售机构的客户维护费	2,290,188.56	4,062,104.61

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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,569,920.62	3,085,337.33

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。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1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。

6.4.8.4.2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

除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年末均未持有本基金。

6.4.8.5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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	115,568,385.92	354,731.94	97,830,473.95	476,703.43

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行间业利率计息。

6.4.8.6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。

6.4.8.7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。

6.4.9期末(2012年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末,本基金无因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.9.2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
000059	辽通化工	2012-06-26	筹划非公开发行股票融资事宜	7.91	2012-07-03	8.15	361.933	3,662,739.52	2,862,890.03	-
002500	山西证券	2012-05-15	筹划发行股份购买资产事项	8.19	-	-	286.150	2,515,805.35	2,343,568.50	-

注:本基金截至2012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。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

本基金本报告期末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。

6.4.9.3.2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。

6.4.10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

(i)金融工具公允价值计量的方法

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)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2012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2,913,203,539.84元,属于第二层级的余额为102,166,458.53元,无属于第三层级的余额(2011年6月30日:第一层级3,497,294,378.54元,第二层级139,763,837.29元,无第三层级)。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	2,918,409,998.37	92.95
	其中:股票	2,918,409,998.37	92.95
2	固定收益投资	96,960,000.00	3.09
	其中:债券	96,960,000.00	3.09
	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	116,798,918.21	3.72
6	其他各项资产	7,517,468.98	0.24
7	合计	3,139,686,385.56	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	18,555,709.26	0.60
B	采掘业	291,873,969.05	9.43
C	制造业	988,492,926.61	31.94
C0	食品、饮料	215,488,963.07	6.96
C1	纺织、服装、皮毛	8,228,416.85	0.27
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	52,776,132.55	1.71
C5	电子	34,292,510.98	1.11
C6	金属、非金属	228,314,833.07	7.38
C7	机械、设备、仪表	309,944,858.65	10.02
C8	医药、生物制品	138,516,571.84	4.48
C99	其他制造业	930,639.60	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	61,975,101.94	2.00
E	建筑业	78,972,122.62	2.55
F	交通运输、仓储业	85,192,883.58	2.75
G	信息技术业	84,647,648.50	2.74
H	批发和零售贸易	74,738,692.73	2.42
I	金融、保险业	903,983,751.60	29.21
J	房地产业	155,381,920.58	5.02
K	社会服务业	24,936,846.49	0.81
L	传播与文化产业	5,904,524.23	0.19
M	综合类	46,122,706.69	1.49
	合计