建信收益增强债券型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013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:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2013年8月26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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22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2013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	建信收益增强债券	
基金主代码	530009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年6月2日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,066,375,712.98份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
下属分级基金的交易代码:	530009	531009
报告期末下属分级基金的份额总额	805,173,388.23份	261,202,324.75份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持资产流动性的基础上,发挥投研团队在固定收益、股票及金融衍生产品方面的综合研究实力,在有效控制风险的前提下追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建信用类债券投资组合,运用基本面研究择机介入上市公司股票及参与新股申购,以实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	30%×中债企业债总指数+70%×中债国债总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,但高于货币市场基金以及不涉及股票二级市场投资的债券型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	李芳菲
	联系电话	010-66228888	010-66060069
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95599
传真		010-66228001	010-63201816

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

基金级别	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日－2013年6月30日)	报告期(2013年1月1日 － 2013年6月30日)
本期已实现收益	34,261,262.33	10,718,470.69
本期利润	23,939,315.67	7,162,809.89
加权平均基金份额本期利润	0.0278	0.0248
本期基金份额净值增长率	2.33%	2.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0558	0.0393
期末基金资产净值	850,109,779.90	271,469,690.21
期末基金份额净值	1.056	1.039

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

建信收益增强债券A

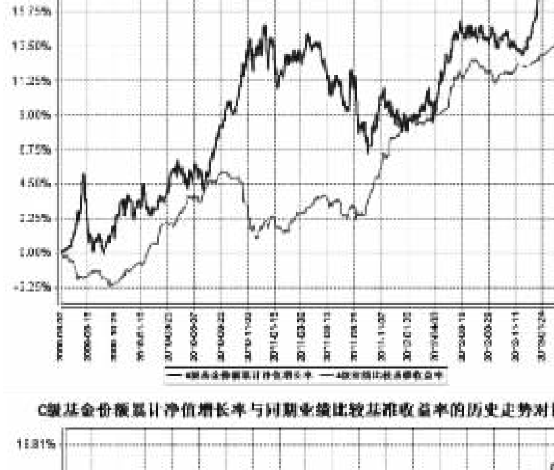
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.31%	0.35%	-0.24%	0.21%	-2.07%	0.14%
过去三个月	-1.12%	0.27%	1.22%	0.13%	-2.34%	0.14%
过去六个月	2.33%	0.30%	2.52%	0.10%	-0.19%	0.20%
过去一年	2.85%	0.24%	3.04%	0.08%	-0.19%	0.16%
过去三年	12.71%	0.28%	11.13%	0.11%	1.58%	0.17%
自基金合同生效起至今	17.55%	0.27%	15.33%	0.10%	2.22%	0.17%

建信收益增强债券C

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	-2.44%	0.33%	-0.24%	0.21%	-2.20%	0.12%
过去三个月	-1.24%	0.26%	1.22%	0.13%	-2.46%	0.13%
过去六个月	2.06%	0.29%	2.52%	0.10%	-0.46%	0.19%
过去一年	2.51%	0.23%	3.04%	0.08%	-0.53%	0.15%
过去三年	11.60%	0.28%	11.13%	0.11%	0.47%	0.17%
自基金合同生效起至今	15.84%	0.27%	15.33%	0.10%	0.51%	0.17%

注:本基金的业绩比较基准为:30%×中债企业债总指数+70%×中债国债总指数。中债企业债总指数、中债国债总指数是由中央国债登记结算有限责任公司(简称"中债公司")编制的、分别反映我国国债市场和企业债市场整体价格和投资回报情况的指数。其中,中债国债总指数样本券包括在银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所交易的所有记帐式国债;中债企业债总指数样本券包括在银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所交易的所有中央企业债和地方企业债。该两个指数具有广泛的市场代表性,能够分别反映我国国债、企业债市场的总体走势。

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



注:本报告期基金投资组合比例符合基金合同的约定。

§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。在上海设立了子公司--建信资本管理有限责任公司。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、持续领先的综合性、专业化资产管理公司"。

截至2013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、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、建信社会责任股票型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金31只开放式基金和建信信用增强债券型证券投资基金1只封闭式基金,管理的基金资产规模共计为483.16亿元。

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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李菁	投资管理部副总监、本基金的基金经理	2009年6月2日	-	8	硕士。2002年7月进入中国建设银行,从事基金托管业务,任主任科员。2005年9月进入建信基金管理有限责任公司,历任债券研究员、基金经理助理、基金经理、资深基金经理、投资管理部副总监。2007年11月3日至2012年2月17日任建信货币市场基金基金经理,2009年6月2日起任建信收益增强基金基金经理,2011年6月16日起任建信信用增强债券基金基金经理。

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

上半年,宏观经济增长动能偏弱,工业增加值、PMI指数等经济指标并没有延续去年四季度逐月反弹好转的趋势,投资和出口增速仍然呈现疲软趋势。受房地产调控政策影响,房地产开发投资和新开工面积增速也呈趋缓态势,与此同时物价指数也在低位运行。一季度,在欧债危机和日元贬值宽松的大背景下,国内市场流动性较为充裕,而进入二季度后,伴随美国经济的缓慢复苏,对美联储QE退出预期升温,美元指数上升,一季度充裕的流动性环境因此发生变化。国内政策方面,为保持经济平稳健康发展,防止房价过快上涨以及影子银行的不规范发展,国务院于2月20日和3月1日相继颁布了房地产市场调控的新"国五条"及相关细则文件,银监会则于3月27日发布《中国银监会关于规范商业银行理财业务投资运作有关问题的通知》,央行从2月份重启正回购后通过公开市场操作和窗口指导等手段,指导商业银行控制相应风险,进一步规范平台贷款等。在国外流动性收缩而国内政策仍然偏紧的情况下,市场流动性在6月份达到紧张峰值,一天回购利率最高曾达30%的峰值。

在此背景下,上半年二季度股票市场和债券市场都经历了先升后降的过程,股票市场春节后开始调整,而债券市场则是从5月份开始调整,各期限品种收益率均较大幅度上行,债券收益率曲线呈现平坦化趋势。回顾上半年的基金管理工作,本基金在在春节后逐步降低组合久期,减持了部分中低评级信用债,二季度初增加了长期国债和高等级信用品的配置,而权益市场方面,降低了转债和股票配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期收益增强A净值增长率为2.33%,波动率为0.30%;收益增强C净值增长率为2.06%,波动率为0.29%。业绩比较基准收益率为2.52%,波动率为0.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,政府仍然在稳增长和调结构之间选择平衡,如果本届政府坚持调结构转换增长方式的调控思路,我们认为短期经济疲软趋势能持续较长时间,但如果调整能坚持和持续,对未来中国长期经济健康发展是有利的。在国内这种调控背景下,加之美国量化宽松政策退出的预期升温,美元升值日元贬值的情况下,一季度流动性充裕的情况在下季度难以重现,社会融资成本将有所上升,资金将呈现紧平衡的状态。整体而言,我们认为债券市场方面,经济基本面有利于长期利率产品和高等级信用产品,而资金成本的抬高使得目前平坦化的收益率曲线很难回到前期牛市陡峭形态。在经济下行和流动性紧平衡阶段,需充分警惕信用事件对信用产品整体估值的影响。权益市场方面,对长期经济增长趋势和企业盈利下降的担忧,使得市场难以实现系统性的估值扩张行情,但部分长期估值具备安全边际和增长比较确定且有持续性的股票仍具有一定投资价值。

本基金仍将维持目前的久期策略,在严控风险的前提下,积极关注长期利率产品和高等级信用债市场波动带来的机会,加强组合投资的灵活性,权益市场方面,采取相对防御与均衡的投资策略,精选个股,力求为持有人获得较好的绝对收益。

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。

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(适用货币基金和理财类基金)。

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55,203,757.13元(其中:建信增强债券A期末可供分配利润为44,936,391.67元,建信增强债券C期末可供分配利润为10,267,365.46元)。本报告期内本基金本未实施利润分配,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

在托管建信收益增强债券型证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》、《建信收益增强债券型证券投资基金托管协议》的约定,对建信收益增强债券型证券投资基金管理人—建信基金管理有限责任公司2013年1月1日至2013年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司在建信收益增强债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,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

本托管人认为,建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的建信收益增强债券型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:建信收益增强债券型证券投资基金金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		4,986,530.54	9,554,925.04
结算备付金		10,711,407.11	15,190,543.89
存出保证金		281,130.57	500,000.00
交易性金融资产		1,224,225,443.68	1,676,972,078.92
其中:股票投资		59,857,486.71	111,049,031.62
基金投资		-	-
债券投资		1,164,367,956.97	1,565,923,047.30
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		40,014,353.84	8,924,337.74
应收利息		22,725,953.65	11,976,545.73
应收股利		-	-
应收申购款		33,190.20	100,200,701.49
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,302,978,009.59	1,823,319,132.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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		165,000,000.00	220,000,000.00
应付证券清算款		12,708,893.44	8,491,629.00
应付赎回款		808,535.09	91,659,373.67
应付管理人报酬		654,935.34	1,027,846.84
应付托管费		187,124.38	293,670.51
应付销售服务费		91,316.22	188,930.66
应付交易费用		1,118,805.12	602,538.07
应交税费		-	-
应付利息		69,228.32	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		759,701.57	915,291.37
负债合计		181,398,539.48	323,179,280.12
所有者权益:			
实收基金		1,066,375,712.98	1,458,091,221.06
未分配利润		55,203,757.13	42,048,631.63
所有者权益合计		1,121,579,470.11	1,500,139,852.69
负债和所有者权益总计		1,302,978,009.59	1,823,319,132.81

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.052元,基金份额总额1,066,375,712.98份。其中建信收益增强基金A类基金份额净值1.056元,基金份额总额805,173,388.23份;建信收益增强基金C类基金份额净值1.039元,基金份额总额261,202,324.75份。

6.2 利润表

会计主体:建信收益增强债券型证券投资基金金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		42,570,431.14	53,793,011.37
1.利息收入		24,662,906.70	20,006,866.38
其中:存款利息收入		152,215.42	228,964.67
债券利息收入		24,422,299.32	19,739,007.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		88,391.96	38,894.04
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		31,694,261.58	-636,777.52
其中:股票投资收益		7,192,230.49	-2,139,570.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益		22,953,738.98	378,612.12
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,548,292.11	1,124,181.07
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-13,877,607.46	34,150,859.60
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		90,870.32	272,062.91
减:二、费用		11,468,305.58	9,442,465.83
1.管理人报酬		4,235,438.71	2,922,586.56
2.托管费		1,210,125.29	835,024.72
3.销售服务费		599,763.41	938,589.85
4.交易费用		1,516,427.83	827,795.59
5.利息支出		3,696,873.99	3,692,007.99
其中:卖出回购金融资产支出		3,696,873.99	3,692,007.99
6.其他费用		209,676.35	226,461.12
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		31,102,125.56	44,350,545.54
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		31,102,125.56	44,350,545.54

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信收益增强债券型证券投资基金金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	1,458,091,221.06	42,048,631.63	1,500,139,852.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	31,102,125.56	31,102,125.56
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)	-391,715,508.08	-17,947,000.06	-409,662,508.14
其中:1.基金申购款	42,958,240.09	2,386,673.11	45,344,913.20
2.基金赎回款	-434,673,748.17	-20,333,673.17	-455,007,421.34
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)	1,066,375,712.98	55,203,757.13	1,121,579,470.11

项目	上年度可比期间 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)	796,099,372.89	64,566,046.34	860,665,419.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	44,350,545.54	44,350,545.54
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)	-113,068,907.51	-15,999,177.83	-129,068,085.34
其中:1.基金申购款	1,010,837,892.42	92,085,526.10	1,102,923,418.52
2.基金赎回款	-1,123,906,799.93	-108,084,703.93	-1,231,991,503.86
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)	683,030,465.38	92,917,414.05	775,947,879.43

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:

____孙志晨____ ____何斌____ ____秦绪华____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信收益增强债券型证券投资基金(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[2009]第281号《关于核准建信收益增强债券型证券投资基金募集的批复》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《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》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7,962,663,348.06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107号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》于2009年6月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为7,964,474,021.08份基金份额,其中认购资金利息折合1,810,673.02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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》和《建信收益增强债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金自募集期起根据认购、申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用的,称为A类基金份额;不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择认购、申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为公司债、国债、金融债、企业债、可转换债券(含可分离式)、中央银行票据、资产支持证券、债券回购、股票、权证以及中国证监会批准的允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%,其中,本基金持有公司债、金融债、企业债、资产支持证券等除国债、中央银行票据以外的固定收益类资产的比例不低于债券资产的30%,本基金投资于股票(含一级市场新股申购)等权益类品种的比例为基金资产的0-20%,现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为中债企业债总指数 X 30% + 中债国债总指数 X 70%。

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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信收益增强债券型证券投资基金基金合同》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2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至2013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[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) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

(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、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,235,438.71	2,922,586.56
其中:支付销售机构的客户维护费	355,965.65	561,818.02

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0.70%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 0.70% / 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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,210,125.29	835,024.72

注:支付基金托管人中国农业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。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C	合计
中国建设银行	-	457,161.17	457,161.17
中国农业银行	-	21,457.71	21,457.71
建信基金管理有限责任公司	-	57,521.99	57,521.99
合计	-	536,140.87	536,140.87

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C	合计
中国建设银行	-	764,515.56	764,515.56
中国农业银行	-	29,336.91	29,336.91
建信基金管理有限责任公司	-	21,786.08	21,786.08
合计	-	815,638.55	815,638.55

注:支付基金销售机构的销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.40%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C类基金份额销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值X0.40% / 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。

6.4.8.4 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

建信收益增强债券A

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。

建信收益增强债券C

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。

6.4.8.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国农业银行	4,986,530.54	59,076.02	13,228,442.84	77,156.77

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间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(2013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

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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

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

截至本报告期末,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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额165,000,000.00元,于2013年7月12日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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2013年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为59,857,486.71元,属于第二层级的余额为1,164,367,956.97元,无属于第三层级的余额(2012年06月30日:属于第一层级的余额为550,794,948.19元,属于第二层级的余额为384,951,000.00元,无属于第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,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,本基金不会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将相关股票和债券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,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)第三层级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	59,857,486.71	4.59
	其中:股票	59,857,486.71	4.59
2	固定收益投资	1,164,367,956.97	89.36
	其中:债券	1,164,367,956.97	89.36
	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	15,697,937.65	1.20
6	其他各项资产	63,054,628.26	4.84
7	合计	1,302,978,009.59	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	5,019,076.44	0.45
B	采矿业	4,696,606.20	0.42
C	制造业	10,394,550.74	0.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,601,711.28	0.23
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	37,145,542.05	3.31
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	59,857,486.71	5.34

注:以上行业分类以2013年06月30日的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	000540	中天城投	3,099,959	21,730,712.59	1.94
2	600383	金地集团	1,932,100	13,254,206.00	1.18
3	600108	亚盛集团	769,797	5,019,076.44	0.45
4	600028	中国石化	1,123,590	4,696,606.20	0.42
5	300259	新天科技	299,922	3,650,050.74	0.33
6	002255	海陆重工	200,000	3,440,000.00	0.31
7	300006	莱美药业	150,000	3,304,500.00	0.29
8	601117	中国化学	273,289	2,601,711.28	0.23
9	600340	华夏幸福	66,399	2,160,623.46	0.19

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的半年报报告正文。

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	600329	中新药业	26,017,360.76	1.73
2	600863	内蒙华电	25,675,954.10	1.71
3	000540	中天城投	22,635,354.45	1.51
4	600795	国电电力	22,312,122.21	1.49
5	600161	天坛生物	20,116,331.11	1.34
6	600886	国投电力	19,810,120.56	1.32
7	601989	中国重工	19,270,000.00	1.28
8	002255	海陆重工	16,350,001.69	1.09
9	002410	广 联 达	16,162,129.60	1.08
10	600585	海螺水泥	15,065,021.57	1.00
11	600383	金地集团	14,702,382.92	0.98
12	002550	千红制药	14,605,065.50	0.97
13	600030	中信证券	14,342,011.25	0.96
14	600521	华海药业	12,838,955.34	0.86
15	601318	中国平安	12,480,996.49	0.83
16	002296	辉煌科技	12,337,710.81	0.82
17	300072	三聚环保	12,264,396.21	0.82
18	600837	海通证券	10,786,862.61	0.72
19	300006	莱美药业	10,762,219.34	0.72
20	000725	京东方A	9,557,028.80	0.64

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	601628	中国人寿	31,267,430.52	2.08
2	300006	莱美药业	29,029,696.07	1.94
3	600329	中新药业	26,380,564.88	1.76
4	600863	内蒙华电	21,283,485.53	1.42
5	601989	中国重工	20,357,042.87	1.36
6	600161	天坛生物	19,521,801.29	1.30
7	600886	国投电力	19,473,689.03	1.30
8	600795	国电电力	18,396,495.34	1.23
9	600521	华海药业	18,036,895.61	1.20
10	002550	千红制药	17,738,486.05	1.18
11	002410	广 联 达	17,060,025.69	1.14
12	002255	海陆重工	14,458,348.01	0.96
13	600030	中信证券	13,468,043.88	0.90
14	600585	海螺水泥	12,730,783.12	0.85
15	600837	XD海通证	11,107,101.38	0.74
16	300072	三聚环保	11,023,053.52	0.73
17	300241	瑞丰光电	10,861,016.92	0.72
18	002296	辉煌科技	10,546,515.18	0.70
19	601318	中国平安	10,510,273.40	0.70
20	002630	华西能源	10,108,474.00	0.67

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	476,424,401.29
卖出股票收入(成交)总额	525,832,160.52

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	124,571,000.00	11.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,116,000.00	1.79
	其中:政策性金融债	20,116,000.00	1.79
4	企业债券	532,000,828.17	47.43
5	企业短期融资券	30,087,000.00	2.68
6	中期票据	366,435,000.00	32.67
7	可转债	91,158,128.80	8.13
8	其他	-	-
9	合计	1,164,367,956.97	103.82

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	019307	13国债07	700,000	69,874,000.00	6.23
2	1282464	12沈公用MTN1	600,000	61,494,000.00	5.48
3	1282429	12广汇MTN2	500,000	50,375,000.00	4.49
4	120015	12附息国债15	500,000	49,445,000.00	4.41
5	1282504	12中城建MTN1	400,000	41,100,000.00	3.66

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	281,130.57
2	应收证券清算款	40,014,353.84
3	应收股利	-
4	应收利息	22,725,953.65
5	应收申购款	33,190.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,054,628.26

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	110018	国电转债	34,393,600.00	3.07
2	110015	石化转债	29,946,000.00	2.67
3	113001	中行转债	15,016,500.00	1.34
4	113002	工行转债	7,435,652.40	0.66
5	110016	川投转债	2,416,000.00	0.22
6	110017	中海转债	1,950,376.40	0.17

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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

份额级别	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
建信收益增强债券A	7,246	111,119.71	649,512,483.55	80.67%	155,660,904.68	19.33%
建信收益增强债券C	10,211	25,580.48	28,214,221.72	10.80%	232,988,103.03	89.20%
合计	17,457	61,085.85	677,726,705.27	63.55%	388,649,007.71	36.45%

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

项目	建信收益增强债券A	建信收益增强债券C
基金合同生效日(2009年6月2日)基金份额总额	2,752,981,309.86	5,211,492,711.22
本报告期期初基金份额总额	1,139,958,130.56	318,133,090.50
本报告期基金总申购份额	19,448,296.88	23,509,943.21
减:本报告期基金总赎回份额	354,233,039.21	80,440,708.96
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	805,173,388.23	261,202,324.75

注:上述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

我公司于2013年3月28日召开2013年度第一次临时股东会,会议决定与公司控股股东中国建设银行股份有限公司有关联关系的马梅琴女士、俞斌先生不再担任公司董事,增选中国建设银行股份有限公司提名的曹伟先生和美国信安金融集团提名的欧阳伯权先生担任公司董事。公司已将前述董事任免情况报告备案至中国证监会基金部和北京监管局。公司目前现有9名董事,其中与控股股东中国建设银行股份有限公司有关联关系的董事为3名,符合《证券投资基金管理公司管理办法》第四十一条第三款的监管要求。

2013年6月20日我公司第三届董事会第十二次临时会议一致同意副总经理张延明离职,我公司于2013年6月20日正式上报中国证券投资基金业协会和北京证监局备案,并于2013年6月21日获得中国基金业协会的备案文件。我公司于2013年6月22日对外公告,张延明于2013年6月20日正式离职。

报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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稽查或处罚等情况

本报告期末发生公司和董事、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	
海通证券	1	358,520,441.48	36.53%	315,474.88	36.33%	-
银河证券	1	295,036,235.37	30.07%	265,871.39	30.61%	-
红塔证券	1	207,223,226.46	21.12%	180,466.09	20.78%	新增
中信证券	1	120,528,904.94	12.28%	106,656.13	12.28%	-
广发证券	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、本基金本报告期内新增红塔证券股份有限公司的一个交易单元,未剔除交易单元。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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
海通证券	558,462,799.68	78.66%	5,085,600,000.00	47.47%	-	-
红塔证券	151,504,807.19	21.34%	5,627,700,000.00	52.53%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司

2013年8月26日