建信货币市场基金 2007年半年度报告摘要

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2007年8月27日复核了本报告中的财务指标、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。

本报告期间：2007年1月1日至2007年6月30日。本报告中财务数据未经审计。

本半年报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。

一、基金简介

（一）基金名称：建信货币市场基金

基金简称：建信货币基金

基金代码：530002

基金运作方式：契约型开放式基金

基金合同生效日：2006年4月25日

报告期末基金份额总额：2,237,285,397.37份

基金合同存续期：不定期

（二）基金投资目标：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。具体而言，包括短期资金利率走势预测、组合剩余期限调整策略、债券期限配置策略、类属资产配置策略、品种选择策略和交易策略等方面。

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。当法律法规变化或市场有更加合理的业绩比较基准时，本基金管理人有权对此业绩比较基准进行调整，并予以公告。

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、混合基金、股票基金。

（三）基金管理人

基金管理人名称：建信基金管理有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座18层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

邮政编码：100034

法定代表人：江先周

信息披露负责人：路彩营

联系电话：010-66228888，66228000

传真：010-66228001

电子信箱：xinxipilu@ccbfund.cn

（四）基金托管人

基金托管人名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

邮政编码：100032

法定代表人：姜建清

信息披露负责人：蒋松云

电话：（010）6610 6720

传真：（010）6610 6904

电子信箱：songyun.jiang@icbc.com.cn

（五）信息披露事宜

信息披露报纸：中国证券报、上海证券报、证券时报

基金管理人互联网网址：http://www.ccbfund.cn

本报告在基金管理人、基金托管人的办公地址有备置，投资者可要求查阅、复制。

二、基金主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标

重要提示：本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。基金收益分配按日结转基金份额。

单位：人民币元

项目	2007年1月1日至2007年6月30日
基金本期净收益	32,648,617.69
期末基金资产净值	2,237,285,397.37
期末基金份额净值	1.0000
基金本期净值收益率	1.2402%
基金累计净值收益率	2.5692%

注：上述主要财务指标根据中国证监会2005年3月25日颁布的《证券投资基金信息披露编报规则第5号<货币市场基金信息披露特别规定>》中的要求计算及披露。

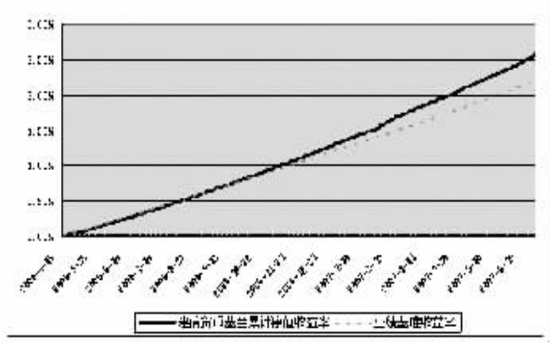
（二）基金净值表现

1、基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值收益率①	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1个月	0.2328%	0.0022%	0.1741%	0.0000%	0.0587%	0.0022%
过去3个月	0.6449%	0.0022%	0.5099%	0.0002%	0.1350%	0.0020%
过去6个月	1.2402%	0.0024%	0.9688%	0.0003%	0.2714%	0.0021%
过去一年	2.2771%	0.0020%	1.8820%	0.0003%	0.3951%	0.0017%
基金合同生效至今	2.5692%	0.0021%	2.1965%	0.0004%	0.3727%	0.0017%

2、基金累计份额净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（基金合同生效之日2006年4月25日至2007年6月30日）



注：中国人民银行于2006年8月19日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则由原先的1.656%调整至1.80%。2007年3月18日，该收益率由1.80%调整至1.944%。2007年5月19日，该收益率由1.944%调整到2.088%。

三、管理人报告

（一）基金管理人情况

本基金管理人为建信基金管理有限责任公司。经中国证监会证监基字[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、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部。自成立以来，良好的治理结构和健全的内部控制保证了公司合法规范经营，并逐步形成稳健、务实、规范、创新的经营风格。

截至2007年6月30日，公司旗下有建信恒久价值股票型基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型基金和建信优化配置混合型基金四只开放式基金，管理的基金资产规模为399.08亿元。

（二）基金经理简介

汪沛先生，硕士学位，证券从业五年。2000年2月毕业于中国人民银行研究生部，同年进入中国农业银行总行资金营运中心，担任债券交易员。2001年3月，加入富国基金管理有限公司，任宏观与债券研究员、固定收益主管，2003年12月至2006年1月任富国天利增长债券投资基金经理。2006年1月进入建信基金管理有限责任公司投资管理部，2006年4月至今任建信货币市场基金基金经理，并自2007年3月以来为建信优化配置混合型证券投资基金基金经理之一。

（三）基金运作合规性说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

（四）报告期内基金的业绩表现和投资策略

1、本基金业绩表现

2007年6月30日本基金万份收益为1.2980元，2007年上半年累计万份收益率为1.2402%，同期业绩比较基准收益率0.9688%。

2、行情回顾及运作分析

在世界经济增长好于预期和国内总需求扩张的大背景下，今年上半年经济继续保持平稳快速增长，固定资产投资增速回落，外贸顺差大幅上升，企业利润增幅明显。

由于外汇占款持续增加和消费物价指数不断走高，央行年内已五次上调存款准备金率，三次上调存贷款基准利率。经过这些调控，银行体系流动性过剩状况得到一定控制，债券市场收益率曲线较之年初已明显陡峭化，长期债券价格出现了明显下跌。

今年上半年以来，建信货币市场基金一直保持着平稳运行的基本态势。出于对通胀水平逐步上升的判断，基金一直保持了中性偏低的剩余期限配置结构，比较好地控制了利率风险。通过加强对基金客户结构的跟踪研究，我们制定了比较合理的流动性管理策略，保证了基金的平稳运行。在类属资产配置结构方面，基金在品种选择的基础上，维持了一定比例的信用产品配置比例，提高了基金的收益水平。

3、对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体来看，虽然支持本轮经济增长的基础条件大为改善，但结构上仍然主要由投资和出口拉动，并且走向偏热的风险正在加大。中央政府将延续宏观调控的基本思路，采取综合措施，以促进经济增长方式和结构的调整。针对通胀预期抬头的现象，预计央行下半年仍将执行适度从紧的货币政策，运用多种货币政策工具加以调控。

我们将特别关注有关政策措施可能对市场和基金产生的影响，并对投资策略进行动态调整。总体而言，我们判断紧缩政策虽然导致1年期以内债券利率有上行风险，但冲击有限。建信货币基金将继续保持稳健的操作风格，力争保证组合能够跟随市场的发展变化，获得合理的收益。

四、托管人报告

2007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。

2007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、基金收益分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《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别规定》等有关法律法规。

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司在2007年上半年所编制和披露的建信货币市场基金2007年半年度报告中财务指标、净值收益率、收益分配情况、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

2007年8月27日

五、财务会计报告(未经审计)

（一）基金会计报表

建信货币市场基金

2007年6月30日资产负债表

单位：人民币元

	附注	2007年6月30日	2006年12月31日
资产			
银行存款	6(1)	113,414,154.60	5,801,942.72
结算备付金		555,558.95	11,336,434.46
应收证券清算款		-	100,098,309.00
应收利息	6(2)	7,263,244.87	6,753,142.17
应收申购款		43,414,808.08	-
债券投资市值		2,226,879,383.48	2,923,042,003.48
其中：债券投资成本		2,226,879,383.48	2,923,042,003.48
买入返售证券		208,000,000.00	1,050,000,000.00
资产总计		2,599,527,149.98	4,097,031,831.83
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		108,001,215.10	-
应付赎回款		2,458,170.62	307,197.17
应付管理人报酬		636,992.51	998,010.08
应付托管费		193,028.02	302,427.30
应付销售服务费		482,570.08	756,068.24
应付利息	6(3)	24,661.48	138,086.76
其他应付款	6(4)	26,528.84	30,664.59
卖出回购证券款		250,040,000.00	300,010,000.00
预提费用	6(5)	378,585.96	316,713.92
负债合计		362,241,752.61	302,859,168.06
持有人权益			
实收基金	6(6)	2,237,285,397.37	3,794,172,663.77
负债及持有人权益总计		2,599,527,149.98	4,097,031,831.83

所附附注为本会计报表的组成部分

建信货币市场基金

2007年1月1日至2007年6月30日

经营业绩表

单位：人民币元

	附注	本期数	上年同期数
收入			
债券差价收入	6(7)	1,635,988.79	1,603,346.58
债券利息收入		34,224,341.14	11,872,027.18
存款利息收入		676,796.11	1,016,728.26
买入返售证券收入		7,154,840.58	6,916,746.65
收入合计		43,691,966.62	21,408,848.67
费用			
基金管理人报酬		(4,456,879.57)	(3,117,723.05)
基金托管费		(1,350,569.58)	(944,764.57)
基金销售服务费		(3,376,423.84)	(2,361,911.41)
卖出回购证券支出		(1,510,302.85)	(196,827.12)
其他费用	6(8)	(349,173.09)	(379,163.60)
其中：信息披露费		(102,200.46)	(80,080.41)
审计费用		(39,671.58)	(26,693.47)
费用合计		11,043,348.93	7,000,389.75
基金净收益/(损失)		32,648,617.69	14,408,458.92
加：未实现利得		-	-
基金经营业绩		32,648,617.69	14,408,458.92

所附附注为本会计报表的组成部分

建信货币市场基金

2007年1月1日至2007年6月30日

收益分配表

单位：人民币元

	附注	本期数	上年同期数
基金净收益		32,648,617.69	14,408,458.92
加：期初基金净收益			
可供分配基金净收益		32,648,617.69	14,408,458.92
减：本期已分配基金净收益	6(9)	(32,648,617.69)	(14,408,458.92)
未分配基金净收益		-	-

所附附注为本会计报表的组成部分

建信货币市场基金

2007年1月1日至2007年6月30日

基金净值变动表

单位：人民币元

	附注	本期数	上年同期数
期初基金净值		3,794,172,663.77	7,660,614,611.89
本期经营活动			
基金净收益		32,648,617.69	14,408,458.92
经营活动产生的基金净值变动数		32,648,617.69	14,408,458.92
本期基金份额交易			
基金申购款		7,945,489,426.33	598,973,986.47
其中：分红再投资		32,648,617.69	14,408,458.92
基金赎回款		(9,502,376,692.73)	(4,881,981,350.75)
基金份额交易产生的基金净值变动数		(1,556,887,266.40)	(4,283,007,364.28)
本期向基金份额持有人分配收益			
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数		(32,648,617.69)	(14,408,458.92)
期末基金净值		2,237,285,397.37	3,377,607,247.61

所附附注为本会计报表的组成部分

（二）基金会计报表附注

附注1. 基金的基本情况

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”)证监基字(2006)第56号文核准，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，《建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。

根据《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；一年以内的银行定期存款、大额存单；剩余期限在397天以内的债券；期限在一年以内的债券回购；期限在一年以内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。

附注2. 本基金半年度会计报表所采用的会计政策和会计估计

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

附注3.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》及其他相关税务法规和实务操作，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）基金买卖债券的差价收入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。

附注4.资产负债表日后事项

本基金无重要期后事项。

附注5.关联方关系及关联方交易

（1）主要关联方关系

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
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

本基金本期未通过关联方席位进行交易。

（3）关联方报酬

A.基金管理人报酬

支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的基金管理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：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬4,456,879.57元（上年同期数：3,117,723.05元）。

B.基金托管人报酬

支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%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：

日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费1,350,569.58元（上年同期数：944,764.57元）。

C.基金销售服务费

支付给基金注册登记机构的基金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。计算公式为：

日销售服务费＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

本基金在本会计期间需支付基金销售服务费3,376,423.84元（上年同期数：2,361,911.41元）。

本基金需支付给关联方的基金销售服务费如下：

单位：人民币元

	本期数	上年同期数
建信基金管理有限责任公司	245,696.78	-
中国建设银行股份有限公司	1,222,930.72	1,816,572.63
中国工商银行股份有限公司	1,853,431.10	392,993.66
合计	3,322,058.60	2,209,566.29

（4）与关联方进行的银行间同业市场债券(含回购)交易

本基金在本会计期间与基金托管人中国工商银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

单位：人民币元

	本期数	上年同期数
买入债券结算金额	658,319,056.37	88,384,107.82
卖出债券结算金额	309,356,604.66	20,129,436.41
卖出回购证券结算金额	651,942,100.00	1,008,910,000.00
卖出回购证券利息支出	91,921.32	38,832.29

（5）由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

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。基金托管人于2007年6月30日保管的银行存款余额为113,414,154.60元（上年同期数：34,002,563.35元）。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为179,520.98元（上年同期数：936,220.33元）。

（6）本基金关联方及基金管理公司主要股东的控制机构在本报告期末持有的基金份额

无。

（7）在本报告期末，公司基金从业人员持有基金份额的总量及占基金总份额的比例：

基金名称	持有基金份额的总量(份)	占基金总份额的比例
建信货币基金	137,814.65	0.00616198%

附注6.基金会计报表重要项目说明(除特别注明外，金额单位为人民币元)

（1）银行存款

截至2007年6月30日止，银行存款余额均为活期存款。

(2)应收利息

	2007年6月30日
应收债券利息	7,142,152.31
应收买入返售证券利息	109,261.71
应收银行存款利息	11,572.68
应收结算备付金利息	250.00
应收基金申购款利息(注)	8.17
合计	7,263,244.87

注：应收基金申购款利息：本报告期内基金申购款在份额确认日(含)至划入托管账户日(不含)期间，存于基金管理人名义开立的账户所产生的尚未兑付的银行存款利息。

（3）应付利息

截至2007年6月30日止，应付利息余额均为银行间同业市场卖出回购证券产生的应付利息。

（4）其他应付款

	2007年6月30日
银行间债券结算费	7,500.00
银行间回购结算费	7,040.00
银行间回购交易手续费	3,513.84
银行间债券交易手续费	8,475.00
合计	26,528.84

（5）预提费用

	2007年6月30日
银行间债券账户维护费	4,500.00
审计费用	39,671.58
信息披露费	334,414.38
合计	378,585.96

（6）实收基金

	基金份额(份)	基金面值
2006年12月31日	3,794,172,663.77	3,794,172,663.77
本期申购	7,945,489,426.33	7,945,489,426.33
其中：分红再投资	32,648,617.69	32,648,617.69
本期赎回	(9,502,376,692.73)	(9,502,376,692.73)
2007年6月30日	2,237,285,397.37	2,237,285,397.37

(7)债券差价收入

	2007年1月1日至2007年6月30日
卖出及到期兑付债券结算金额	6,035,634,903.42
减：应收利息总额	(7,591,248.27)
减：卖出及到期兑付债券成本总额	(6,026,407,666.36)
合计	1,635,988.79

（8）其他费用

	2007年1月1日至2007年6月30日
信息披露费	102,200.46
回购交易费用	89138.83
银行划款费用	63,187.22
审计费用	39,671.58
银行间债券交易手续费	23925.00
银行间债券结算服务费	22050.00
银行间债券账户维护费	9,000.00
合计	349,173.09

（9）本期已分配净收益

本基金在本会计期间累计分配收益32,648,617.69元，以红利再投资方式结转入实收基金32,648,617.69元。

附注7. 报告期末流通转让受到限制的基金资产

本基金截至2007年6月30日止从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款余额250,040,000.00元，系以如下债券作为抵押：

单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	年末摊余成本单价	数量(张)	年末摊余成本总额
0701055	07央票55	2007/07/02	99.54	632,000	62,909,280.00
0701058	07央票58	2007/07/02	99.49	2000,000	198,980,000.00
合计	-	-	-	-	261,889,280.00

附注8. 其他事项

本基金无需要说明的其他重要事项。

六、投资组合报告

1、2007年6月30日基金资产组合情况

资产组合	金额(单位：人民币元)	占基金总资产比例(%)
债券投资	2,226,879,383.48	85.66
买入返售证券	208,000,000.00	8.00
其中：买断式回购的买入返售证券	-	-
银行存款和清算备付金合计	113,969,713.55	4.38
其他资产	50,678,052.95	1.95
合计	2,599,527,149.98	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(单位：人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	17,816,371,200.00	5.52
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	250,040,000.00	11.18
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

3、基金投资组合剩余期限

(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	119
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	154
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	88

注：报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况

(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	29.31	16
2	30天(含)—60天	3.54	-
3	60天(含)—90天	43.11	-
4	90天(含)—180天	7.05	-
5	180天(含)—397天(含)	30.91	-
合计		113.92	16

4、报告期末债券投资组合

（1）按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	成本(单位：人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	金融债券	159,471,348.87	7.13
	其中：政策性金融债	159,471,348.87	7.13
3	央行票据	910,518,459.46	40.70
4	企业债券	1,156,889,575.15	51.71
5	其他	-	-
合计		2,226,879,383.48	99.53
剩余存续期超过397天的浮动利率债券		-	-

注：附息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

（2）基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(单位：人民币元)	占基金资产净值的比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	07中石集CP01	2,000,000	-	200,001,569.37	8.94
2	07央行票据58	2,000,000	-	198,983,736.26	8.89
3	07央行票据18	2,000,000	-	196,035,882.91	8.76
4	07央行票据55	1,900,000	-	189,133,934.00	8.45
5	07农发07	1,000,000	-	99,470,108.63	4.45
6	06央行票据70	1,000,000	-	99,382,975.80	4.44
7	06农发08	600,000	-	60,001,240.24	2.68
8	06央行票据53	500,000	-	49,913,534.48	2.23
9	06海欣CP01	500,000	-	49,539,093.37	2.21
10	06武钢CP01	500,000	-	49,326,464.38	2.20

5、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	7次
报告期内偏离度的最高值	0.31%
报告期内偏离度的最低值	0.03%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.18%

6、投资组合报告附注

（1）本基金的计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

（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成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

（3）本报告期内没有需要特别说明的证券投资决策程序。

（4）其他资产的构成

序号	其他资产	金额(单位：人民币元)
1	应收利息	7,263,244.87
2	应收申购款	43,414,808.08
合计		50,678,052.95

七、基金份额持有人户数、持有人结构

1、基金份额持有人户数

截止2007年6月30日基金份额持有人户数情况如下：

1	基金份额持有人户数	29,465户
2	平均每户持有基金份额	75,930.27份

2、基金份额持有人结构：

截止2007年6月30日基金份额持有人结构情况如下：

序号	项目	份额(份)	占总份额比例(%)
1	机构投资者	215,226,855.23	9.62
2	个人投资者	2,022,058,542.14	90.38
合计		2,237,285,397.37	100

八、开放式基金份额变动(单位：份)

基金合同生效日基金份额总额	7,660,614,611.89
期初基金份额总额	3,794,172,663.77-
报告期间基金总申购份额	7,945,489,426.33
报告期间基金总赎回份额	(9,502,376,692.73)
报告期末基金份额总额	2,237,285,397.37

九、重大事项揭示

（一）本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会，因此未通过任何基金份额持有人大会决议。

（二）本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动；同期，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

（三）本报告期内本基金管理人及基金未发生重大诉讼、仲裁事项。

（四）本报告期内本基金的投资策略、本基金管理人的内部决策程序未发生重大变化。

（五）本报告期内基金收益分配情况

本基金2007年1月1日至2007年6月30日止期间向投资者每10份基金份额分红0.123元。

（六）本报告期内本基金审计事务所无变化。

（七）本报告期内本基金管理人和托管人的专门基金托管部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

（八）本基金租用专用交易席位的有关情况

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》，选择中国国际金融有限公司共1个席位作为本基金的专用交易席位。在该席位上进行的债券和回购交易不计提佣金。

2007年1月1日至2007年6月30日各券商证券交易量情况如下：

单位：人民币元

序号	券商名称	租用券商席位的数量	回购交易量	占回购交易总量比例(%)
1	中金公司	1	6,363,300,000.00	100.00
合计		1	6,363,300,000.00	100.00

（九）其他重大事项

1、建信基金管理有限责任公司关于在中国工商银行开放建信优选成长股票型证券投资基金与建信货币市场基金日常转换业务的公告，2007年6月6日；

2、建信基金管理有限责任公司旗下开放式证券投资基金调整基金转换费用计算公式的公告，2007年6月6日；

3、关于建信基金管理有限责任公司与中国建设银行股份有限公司之间发生的关联交易的公告，2007年5月19日；

4、建信基金管理有限责任公司关于建信货币市场基金五一假期前暂停申购的公告，2007年4月26日；

5、关于建信基金管理有限责任公司与中国建设银行股份有限公司之间发生的关联交易的公告，2007年4月11日；

6、关于新增联合证券有限责任公司为建信恒久价值股票型证券投资基金和建信货币市场基金代销机构的公告，2007年4月3日；

7、关于建信货币市场基金暂停接受大额申购及转入业务的公告，2007年3月29日；

8、建信基金管理有限责任公司关于建信货币市场基金春节假期前暂停申购的公告，2007年2月10日；

9、建信基金管理公司新增中信建投证券为代销机构的公告，2007年1月19日；

10、建信基金管理有限责任公司关于客户服务系统进行升级的公告，2007年1月17日。

投资者可通过中国证券报、上海证券报、证券时报和基金管理人网站www.ccbfund.cn查阅上述公告。

建信基金管理有限责任公司

2007年8月28日