

## 建信优化配置混合型证券投资基金

## 2007年第二季度报告

## 一、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，并对其实质内容、准确性和完整性承担个别及连带责任。基金合同于2007年7月11日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

基金经理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

本报告期为2007年4月1日起至2007年6月30日止。本报告中的财务数据未经审计。

## 二、基金产品概况

1. 基金简称	建信优化配置混合基金
2. 基金运作方式	契约型,开放式
3. 基金合同生效日	2007年3月1日
4. 报告期末基金份额总额	13,999,518,258.16份
5. 投资目标	通过合理的资产配置和积极的证券投资，在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。
6. 投资策略	基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。
7. 业绩比较基准	本基金业绩比较基准:60%×沪深300指数+40%×中国债券总指数
8. 风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
9. 基金管理人	建信基金管理有限责任公司
10. 基金托管人	中国工商银行股份有限公司

## 三、主要财务指标和基金净值表现

下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。

## 1. 主要财务指标

		单位:人民币元
基金份额本期收入	2,006,430,635.92	
基金份额本期净收益	0.1360	
期末基金份额净值	18,462,124,684.46	
期末基金份额总额	13,999,518,258.16份	

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。

## 2. 基金份额净值

	单位:人民币元
基金份额净值	2,006,430,635.92
基金份额本期净收益	0.1360
期末基金份额净值	18,462,124,684.46
期末基金份额总额	13,999,518,258.16份

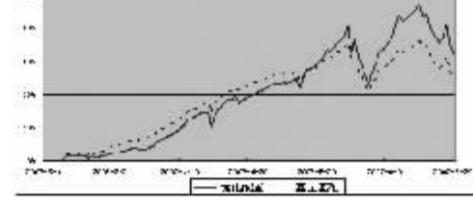
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3. 基金份额净值增长率和基金净值增长率

阶段	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率③	业绩比较基准④	①-③	②-④
过去三个月	2.22%	17.72%	1.8%	10.15%	0.64%	

自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并同同期业绩比较基准的变动进行比较。

建信优化配置混合型证券投资基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：  
1. 自基金合同2007年3月1日生效以来，截至2007年6月30日本基金基金合同生效未满一年。  
2. 本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

## 四、基金管理人报告

## 1. 基金经理简介

陈鹏先生，硕士学历，证券从业八年。1999年6月毕业于中国人寿保险研究生部。1999年4月进入泰康人寿保险股份有限公司担任研究员，先后任研究员、基金经理助理、项目经理。2004年4月进入华信证券资产管理有限公司，任基金经理助理、基金经理。2006年6月进入建信基金管理有限公司担任基金经理。

汪沛先生，硕士学位，证券从业五年。2000年6月毕业于中国人寿保险研究生部，同年进入中海农业银行总行资金营运中心，担任信贷交易员。2001年3月，加入富国基金管理有限公司，历任宏观与债券研究员、固定收益主管、国债天安增利债券型基金经理。2006年1月进入建信基金管理有限公司担任基金经理助理、基金经理。

陈鹏先生承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

本报告期为2007年4月1日起至2007年6月30日止。本报告中的财务数据未经审计。

## 2. 基金产品概况

1. 基金简称	建信优化配置混合基金
2. 基金运作方式	契约型,开放式
3. 基金合同生效日	2007年3月1日
4. 报告期末基金份额总额	13,999,518,258.16份
5. 投资目标	通过合理的资产配置和积极的证券投资，在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。

6. 投资策略

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

本报告期为2007年4月1日起至2007年6月30日止。本报告中的财务数据未经审计。

## 3. 基金份额净值增长率和基金净值增长率

阶段	净值增长率①	业绩比较基准②	净值增长率③	业绩比较基准④	①-③	②-④
过去三个月	2.22%	17.72%	1.8%	10.15%	0.64%	

自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并同同期业绩比较基准的变动进行比较。

建信优化配置混合型证券投资基金 累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2007年3月1日至2007年6月30日)

## 4. 投资组合报告

## (一) 报告期末基金资产组合情况

类别	金额(单位:人民币元)	占基金总资产比例(%)
股票	15,490,734,897.19	82.83%
债券	789,789,270.65	4.15%
权证	511,222,882.65	2.72%
银行存款和清算备付金合计	1,881,134,378.67	10.01%
其它资产	137,946,806.15	0.73%
合 计	18,081,928,251.71	100.00%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

(3) 报告期内基金投资组合变化情况说明

在报告期内，本基金将持有的股票资产根据行业分类，按市值占比重新调整后，股票资产的比例范围为80%-95%，并保持在规定范围内。

本基金将持有的股票资产根据行业分类，按市值占比重新调整后，股票资产的比例范围为80%-95%，并保持在规定范围内。

本基金将持有的股票资产根据行业分类，按市值占比重新调整后，股票资产的比例范围为80%-95%，并保持在规定