

中信经典配置证券投资基金 2007年半年度报告摘要

报告期间:2007年1月1日至6月30日 基金管理人:中信基金管理有限责任公司 基金托管人:招商银行股份有限公司

第一节 重要提示

(一)重要提示 中信经典配置证券投资基金管理人-中信基金管理有限责任公司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。

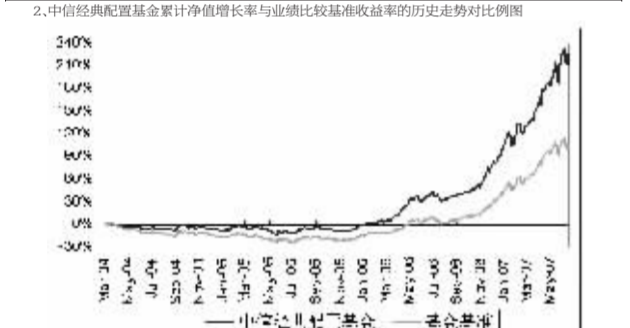
第二节 基金简介

(一)基金基本情况 基金名称:中信经典配置证券投资基金 基金简称:中信经典配置基金 基金代码:288001 基金运作方式:契约型开放式

第三节 主要财务指标和基金净值表现

(一)主要财务指标 1.基金本期净收益:1,438,411,845.21元 2.基金本期公允价值变动损益:9,936.31元 3.期末可供分配基金收益:847,778,273.07元

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率(%), 业绩比较基准, 净值增长率(%) (1)-(3), (3)-(4), (2)-(4). Rows include 过去1个月, 过去3个月, 过去6个月, 过去12个月, 自基金合同生效至今.



附注: 根据本基金合同规定的资产配置投资范围,股票资产45%-75%,债券资产5%-35%,短期金融工具5%-35%。2007年6月30日实际持仓情况为:股票资产占基金资产净值为65.44%,债券资产(包括可转债)占基金资产净值为23.94%。

第四节 管理人报告

(一)基金管理人及基金经理简介 基金管理人基本情况 中信基金管理有限责任公司由中信证券股份有限公司、国家开发投资公司、上海久事公司、中海信托投资有限责任公司共同发起设立。

(二)基金管理人及基金经理简介 基金管理人基本情况 中信基金管理有限责任公司由中信证券股份有限公司、国家开发投资公司、上海久事公司、中海信托投资有限责任公司共同发起设立。

(三)投资策略和业绩表现说明及解释 1.报告基金的业绩表现 截止2007年6月30日,本基金净值18338元,累计净值为28338元。上半年基金净值上涨63.80%。

(四)宏观环境、证券市场及行业走势的展望 目前市场状况下,股票估值相对较高,所以我们保持适度的警惕。下半年大盘股集中回调,将在一定程度上对估值水平产生影响。

第五节 托管人报告

托管人声明:在本报告期内,基金托管人不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《基金法》及其他相关法律法规、基金合同,完全尽职尽责履行了应尽的义务。

Table with 3 columns: 项目, 附注, 2007年6月30日, 2006年12月31日. Rows include 资产, 负债, 所有者权益, 未分配收益, 其他应收款, 其他应付款, 其他流动资产, 其他长期资产, 其他长期负债, 其他长期权益, 其他长期负债, 其他长期权益, 其他长期负债, 其他长期权益.

Table with 3 columns: 项目, 附注, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、公允价值变动损益, 四、其他综合收益, 五、其他综合收益, 六、其他综合收益, 七、其他综合收益, 八、其他综合收益, 九、其他综合收益, 十、其他综合收益.

Table with 3 columns: 项目, 附注, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、公允价值变动损益, 四、其他综合收益, 五、其他综合收益, 六、其他综合收益, 七、其他综合收益, 八、其他综合收益, 九、其他综合收益, 十、其他综合收益.

Table with 3 columns: 项目, 附注, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、公允价值变动损益, 四、其他综合收益, 五、其他综合收益, 六、其他综合收益, 七、其他综合收益, 八、其他综合收益, 九、其他综合收益, 十、其他综合收益.

Table with 3 columns: 项目, 附注, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、公允价值变动损益, 四、其他综合收益, 五、其他综合收益, 六、其他综合收益, 七、其他综合收益, 八、其他综合收益, 九、其他综合收益, 十、其他综合收益.

Table with 3 columns: 项目, 附注, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、公允价值变动损益, 四、其他综合收益, 五、其他综合收益, 六、其他综合收益, 七、其他综合收益, 八、其他综合收益, 九、其他综合收益, 十、其他综合收益.

Table with 3 columns: 项目, 附注, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、公允价值变动损益, 四、其他综合收益, 五、其他综合收益, 六、其他综合收益, 七、其他综合收益, 八、其他综合收益, 九、其他综合收益, 十、其他综合收益.

Table with 3 columns: 项目, 附注, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、公允价值变动损益, 四、其他综合收益, 五、其他综合收益, 六、其他综合收益, 七、其他综合收益, 八、其他综合收益, 九、其他综合收益, 十、其他综合收益.

Table with 3 columns: 项目, 附注, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、公允价值变动损益, 四、其他综合收益, 五、其他综合收益, 六、其他综合收益, 七、其他综合收益, 八、其他综合收益, 九、其他综合收益, 十、其他综合收益.

Table with 3 columns: 项目, 附注, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、公允价值变动损益, 四、其他综合收益, 五、其他综合收益, 六、其他综合收益, 七、其他综合收益, 八、其他综合收益, 九、其他综合收益, 十、其他综合收益.

Table with 3 columns: 项目, 附注, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、公允价值变动损益, 四、其他综合收益, 五、其他综合收益, 六、其他综合收益, 七、其他综合收益, 八、其他综合收益, 九、其他综合收益, 十、其他综合收益.

Table with 3 columns: 项目, 附注, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、公允价值变动损益, 四、其他综合收益, 五、其他综合收益, 六、其他综合收益, 七、其他综合收益, 八、其他综合收益, 九、其他综合收益, 十、其他综合收益.

Table with 3 columns: 关联方名称, 单位(人民币元), 占本期期末总资产的比例%. Rows include 中信证券, 中信万通证券, 中国建设银行.

Table with 4 columns: 项目, 本报告期间累计计提金额, 本报告期间支付金额, 可比期间累计计提金额, 可比期间支付金额. Rows include 管理费, 托管费, 销售服务费.

Table with 4 columns: 项目, 本报告期间累计计提金额, 本报告期间支付金额, 可比期间累计计提金额, 可比期间支付金额. Rows include 托管费, 销售服务费, 其他费用.

Table with 4 columns: 项目, 本报告期间累计计提金额, 本报告期间支付金额, 可比期间累计计提金额, 可比期间支付金额. Rows include 托管费, 销售服务费, 其他费用.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票数量, 投资成本(单位:人民币元), 期末公允价值(单位:人民币元), 买入日期, 卖出日期, 锁定期. Rows include 金陵药业, 白云山, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票数量, 投资成本(单位:人民币元), 期末公允价值(单位:人民币元), 买入日期, 卖出日期, 锁定期. Rows include 金陵药业, 白云山, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票数量, 投资成本(单位:人民币元), 期末公允价值(单位:人民币元), 买入日期, 卖出日期, 锁定期. Rows include 金陵药业, 白云山, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票数量, 投资成本(单位:人民币元), 期末公允价值(单位:人民币元), 买入日期, 卖出日期, 锁定期. Rows include 金陵药业, 白云山, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票数量, 投资成本(单位:人民币元), 期末公允价值(单位:人民币元), 买入日期, 卖出日期, 锁定期. Rows include 金陵药业, 白云山, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票数量, 投资成本(单位:人民币元), 期末公允价值(单位:人民币元), 买入日期, 卖出日期, 锁定期. Rows include 金陵药业, 白云山, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票数量, 投资成本(单位:人民币元), 期末公允价值(单位:人民币元), 买入日期, 卖出日期, 锁定期. Rows include 金陵药业, 白云山, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票数量, 投资成本(单位:人民币元), 期末公允价值(单位:人民币元), 买入日期, 卖出日期, 锁定期. Rows include 金陵药业, 白云山, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票数量, 投资成本(单位:人民币元), 期末公允价值(单位:人民币元), 买入日期, 卖出日期, 锁定期. Rows include 金陵药业, 白云山, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票数量, 投资成本(单位:人民币元), 期末公允价值(单位:人民币元), 买入日期, 卖出日期, 锁定期. Rows include 金陵药业, 白云山, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电.

Table with 5 columns: 股票代码, 股票数量, 投资成本(单位:人民币元), 期末公允价值(单位:人民币元), 买入日期, 卖出日期, 锁定期. Rows include 金陵药业, 白云山, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电, 中研院, 德棉股份, 航天机电.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.

Table with 2 columns: 名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例%. Rows include 国债, 企业债, 可转债, 股票, 权证, 其他.