

建信优化配置混合型证券投资基金 2007 年年度报告摘要

(上接 D97 页) 注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站 www.ccbfund.cn 的年度报告正文。

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动 1. 报告期内累计买入价值超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计买入金额, 占期末基金资产净值的比例(%). Lists top 20 stocks bought during the period.

注:本期累计买入金额为本报告期内买入股票的累计成本。2007 年 7 月 1 日以前买入股票成本包括买入股票所发生的交易费用,2007 年 7 月 1 日以前买入股票成本不包括相关的交易费用。

2. 报告期内累计卖出价值超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计卖出金额, 占期末基金资产净值的比例(%). Lists top 20 stocks sold during the period.

3. 本报告期内买入股票的成本总额为 34,630,626.0414 元;卖出股票的收入总额为 31,471,765,106.569 元。

Table with columns: 品种分类, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例(%). Shows portfolio composition by asset class.

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with columns: 债券券种, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例(%). Lists top 5 bonds.

Table with columns: 权证名称, 数量(份), 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例(%). Lists top 5 warrants.

(八) 投资组合报告附注 1. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

Table with columns: 资产项目, 金额(单位:人民币元). Shows asset breakdown.

4. 至本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。 5. 本报告期末本基金未投资资产支持证券。

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 持有份数(份), 成本总额(单位:人民币元). Lists warrants held.

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 持有份数(份), 成本总额(单位:人民币元). Lists warrants held.

八、基金份额持有人户数及持有人结构 截至 2007 年 12 月 31 日建信优化配置基金持有人情况如下: (一) 持有人户数 截至 2007 年 12 月 31 日基金份额持有人户数情况如下:

Table with columns: 基金份额持有人户数, 平均每户持有基金份额. Shows holder statistics.

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 持有份数(份), 占基金总资产比例(%). Lists warrants held.

Table with columns: 项目, 期末持有未开放基金份数的总额(份), 占本基金总份额的比例(%). Shows unopened shares.

Table with columns: 项目, 单位:份. Shows various portfolio metrics.

十、重大事件揭示 (一) 本基金报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。 (二) 根据建信基金管理有限责任公司 2007 年第二次临时股东大会会议通过的决议并经中国证监会基金部 2007 年 12 月 25 号文核准,建信基金管理有限责任公司修订了《公司章程》。

(三) 本基金报告期内,本基金托管人的托管部门未发生重大人事变动。 (四) 本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。 (五) 本报告期基金投资策略未发生变更。 (六) 本报告期基金收益分配情况:

Table with columns: 项目, 分红报告日, 分红公告日, 权益登记日, 每 10 份基金收益分配金额(单位:人民币元), 收益分配金额(单位:人民币元). Shows dividend details.

建信恒久价值股票型证券投资基金 2007 年年度报告摘要

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例(%). Lists top 20 stocks.

注:本期累计买入金额为本报告期内买入股票的累计成本。2007 年 7 月 1 日以前买入股票成本包括买入股票所发生的交易费用,2007 年 7 月 1 日以前买入股票成本不包括相关的交易费用。

2. 报告期内累计卖出价值超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计买入金额, 占期末基金资产净值的比例(%). Lists top 20 stocks bought.

注:本期累计买入金额为本报告期内买入股票的累计成本。2007 年 7 月 1 日以前买入股票成本包括买入股票所发生的交易费用,2007 年 7 月 1 日以前买入股票成本不包括相关的交易费用。

2. 报告期内累计卖出价值超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with columns: 品种分类, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例(%). Shows portfolio composition.

Table with columns: 权证名称, 数量(份), 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例(%). Lists top 5 warrants.

(八) 投资组合报告附注 1. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

Table with columns: 资产项目, 金额(单位:人民币元). Shows asset breakdown.

4. 至本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。 5. 本报告期末本基金未投资资产支持证券。

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 持有份数(份), 成本总额(单位:人民币元). Lists warrants held.

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 持有份数(份), 成本总额(单位:人民币元). Lists warrants held.

八、基金份额持有人户数及持有人结构 截至 2007 年 12 月 31 日建信恒久价值基金持有人情况如下: (一) 持有人户数 截至 2007 年 12 月 31 日基金份额持有人户数情况如下:

Table with columns: 基金份额持有人户数, 平均每户持有基金份额. Shows holder statistics.

Table with columns: 项目, 期末持有未开放基金份数的总额(份), 占本基金总份额的比例(%). Shows unopened shares.

Table with columns: 项目, 单位:份. Shows various portfolio metrics.

十、重大事件揭示 (一) 本基金报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。 (二) 根据建信基金管理有限责任公司 2007 年第二次临时股东大会会议通过的决议并经中国证监会基金部 2007 年 12 月 25 号文核准,建信基金管理有限责任公司修订了《公司章程》。

(三) 本基金报告期内,本基金托管人的托管部门未发生重大人事变动。 (四) 本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。 (五) 本报告期基金投资策略未发生变更。 (六) 本报告期基金收益分配情况:

Table with columns: 项目, 分红报告日, 分红公告日, 权益登记日, 每 10 份基金收益分配金额(单位:人民币元), 收益分配金额(单位:人民币元). Shows dividend details.

(七) 本基金本报告年度应付给普华永中天会计师事务所有限公司报酬为人民币 160,000.00 元。该会计师事务所自本基金合同生效之日起为本基金提供审计服务至今。

(八) 本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的高级管理人员在本期内未受到监管部门的稽查和处罚。

(九) 选择证券服务机构交易商的情况 为了贯彻中国证监会的有关规定,本基金管理人制定了选择券商的标准,即: 1. 财务状况良好,经营管理制度健全,风险管理严格,能够满足基金运作高度保密的要求,在最近一年内没有发生重大违规行为。

2. 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合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、全面的分析,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。 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。

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《公募基金交易席位管理制度》,选择海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、联合证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中国建投证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、长城证券股份有限公司交易席位。

2007 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日本基金租用各券商席位的情况、股票交易明细如下:

Table with columns: 序号, 券商名称, 租用席位数量, 股票交易金额(单位:人民币元), 占股票交易总额比例(%). Shows broker usage.

2007 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日本基金租用各券商席位进行权证交易的情况如下:

Table with columns: 序号, 券商名称, 权证交易金额(单位:人民币元), 占权证交易总额比例(%). Shows warrant broker usage.

2007 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日本基金租用各券商席位进行债券、回购交易的情况如下:

Table with columns: 序号, 券商名称, 债券交易金额(单位:人民币元), 占债券交易总额比例(%), 回购交易金额(单位:人民币元), 占回购交易总额比例(%). Shows bond and repo broker usage.

2007 年 3 月 1 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日本基金租用各券商席位佣金情况如下:

Table with columns: 序号, 券商名称, 应付佣金(单位:人民币元), 占应付佣金总额比例(%). Shows broker commissions.

(十) 其他重大事项 1. 建信基金管理有限责任公司关于系统维护的公告,2007 年 12 月 27 日; 2. 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 12 月 18 日;

3. 关于参加招商证券股份有限公司开展开放式基金网上交易费率优惠活动的公告,2007 年 12 月 13 日; 4. 关于参加交通银行股份有限公司开放式基金网上交易费率优惠活动的公告,2007 年 12 月 7 日;

5. 关于在交通银行开通建信基金“定期定额投资计划”的公告,2007 年 12 月 7 日; 6. 关于在交通银行开通建信基金“定期定额投资计划”的公告,2007 年 12 月 7 日;

7. 建信优化配置混合型证券投资基金分红公告,2007 年 11 月 8 日; 8. 关于参加长城证券有限责任公司开展开放式基金网上交易费率优惠活动的公告,2007 年 11 月 5 日;

9. 建信优化配置混合型证券投资基金分红公告,2007 年 11 月 2 日; 10. 关于参加海通证券股份有限公司开展开放式基金网上交易费率优惠活动的公告,2007 年 10 月 15 日;

11. 关于建信基金管理有限责任公司旗下三只开放式基金参加中国建设银行开展网上银行基金申购费率优惠活动的公告,2007 年 9 月 29 日; 12. 建信基金管理有限责任公司关于修改公司旗下开放式基金基金合同中估值部分公告,2007 年 9 月 28 日;

13. 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关联交易的公告,2007 年 9 月 27 日; 14. 关于旗下基金投资中宝科控股股份有限公司非公开发行股票的公告,2007 年 9 月 7 日;

15. 关于建信优化配置混合型证券投资基金投资安泰集团非公开发行股票的公告,2007 年 8 月 23 日; 16. 关于运用自有资金投资公司旗下开放式基金的公告,2007 年 7 月 13 日;

17. 建信基金管理有限责任公司关于旗下基金实施新会计准则的公告,2007 年 7 月 2 日; 18. 关于在中国工商银行开展网上银行基金申购费率优惠活动的公告,2007 年 6 月 20 日;

19. 关于旗下基金投资山东新华医疗器械股份有限公司非公开发行股票的公告,2007 年 6 月 15 日; 20. 关于通过中国建设银行股份有限公司开办建信优化配置混合型证券投资基金定期定额投资业务的公告,2007 年 6 月 15 日;

21. 关于建信优化配置混合型证券投资基金分红公告,2007 年 6 月 6 日; 22. 建信优化配置混合型证券投资基金日常申购的公告,2007 年 6 月 6 日;

23. 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方式的公告,2007 年 6 月 6 日; 24. 关于建信优化配置混合型证券投资基金申购费率调整的公告,2007 年 5 月 23 日;

25. 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; 26. 建信基金管理有限责任公司关于修改旗下基金申购费用及申购份额计算方法的公告,2007 年 5 月 16 日;

27. 关于建信优化配置混合型证券投资基金申购费率调整的公告,2007 年 5 月 10 日; 28. 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 28 日;

29. 关于建信优化配置混合型证券投资基金申购费率调整的公告,2007 年 4 月 26 日; 30. 关于建信优化配置混合型证券投资基金申购的公告,2007 年 4 月 11 日;

31. 关于建信优化配置混合型证券投资基金开展日常赎回费率调整的公告,2007 年 3 月 29 日; 32. 关于建信优化配置混合型证券投资基金投资股指期货中权方案的公告,2007 年 3 月 13 日;

33. 关于建信优化配置混合型证券投资基金开放日常申购业务的公告,2007 年 3 月 7 日; 34. 建信优化配置混合型证券投资基金基金合同生效公告,2007 年 3 月 2 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 查询上述公告。

建信基金管理有限责任公司 二〇〇八年三月二十七日

4. 佣金费率合理。 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。

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《公募基金交易席位管理制度》,选择海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、联合证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中国建投证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、长城证券股份有限公司交易席位。

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日本基金租用各券商席位的情况、股票交易明细如下:

Table with columns: 序号, 券商名称, 租用席位数量, 股票交易金额(单位:人民币元), 占股票交易总额比例(%). Shows broker usage.

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日本基金租用各券商席位进行权证交易的情况如下:

Table with columns: 序号, 券商名称, 权证交易金额(单位:人民币元), 占权证交易总额比例(%). Shows warrant broker usage.

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日本基金租用各券商席位进行债券、回购交易的情况如下:

Table with columns: 序号, 券商名称, 债券交易金额(单位:人民币元), 占债券交易总额比例(%), 回购交易金额(单位:人民币元), 占回购交易总额比例(%). Shows bond and repo broker usage.

(十一) 其他重大事项 1. 建信基金管理有限责任公司关于系统维护的公告,2007 年 12 月 27 日; 2. 关于参加招商证券股份有限公司开展开放式基金网上交易费率优惠活动的公告,2007 年 12 月 13 日;

3. 关于参加交通银行股份有限公司开展开放式基金网上交易费率优惠活动的公告,2007 年 12 月 7 日; 4. 关于在交通银行开通建信基金“定期定额投资计划”的公告,2007 年 12 月 7 日;

5. 关于在交通银行开通建信基金“定期定额投资计划”的公告,2007 年 12 月 7 日; 6. 关于在中国工商银行开展网上银行基金申购费率优惠活动的公告,2007 年 11 月 22 日;

7. 建信基金管理有限责任公司关于参加长城证券有限责任公司开展开放式基金网上交易费率优惠活动的公告,2007 年 11 月 5 日; 8. 建信优化配置混合型证券投资基金分红公告,2007 年 11 月 2 日;

9. 关于参加海通证券股份有限公司开展开放式基金网上交易费率优惠活动的公告,2007 年 10 月 15 日; 10. 关于建信基金管理有限责任公司旗下三只开放式基金参加中国建设银行开展网上银行基金申购费率优惠活动的公告,2007 年 9 月 29 日;