

建信优化配置混合型证券投资基金 2008年半年度报告摘要

重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构不存在虚假记载、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。

建信优化配置混合型证券投资基金 利润表

Table with columns: 项目, 附注, 本期数, 2007年3月1日至2007年6月30日止期间, 2007年3月1日至2007年6月30日止期间

后附财务报表附注为本财务报表的重要组成部分。

所有者权益基金净值变动表

Table with columns: 项目, 本期数, 所有者权益合计

后附财务报表附注为本财务报表的重要组成部分。

(二) 会计报表附注(摘要)

1. 基金基本情况

建信优化配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2007年12月11日证监基金字[2007]263号文核准注册,由建信基金管理有限责任公司(以下简称“建信基金”)担任基金管理人,中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)担任基金托管人。

2. 财务报表的编制基础

本基金自2006年2月16日以前颁布的企业会计准则、《金融企业会计准则》和《证券投资基金会计核算办法》(以下简称“原会计准则和制度”)、《建信优化配置混合型证券投资基金合同》以及中国证监会允许的基金行业实务操作规范编制财务报表。

3. 重要会计政策和会计估计

本报告期会计政策与上年度会计政策一致,所采用的会计政策、会计估计与上年度会计政策相一致,所采用的会计政策、会计估计与上年度会计政策一致。

4. 关联方关系及其交易

(a) 关联方关系
关联方名称: 建信基金管理有限责任公司
关联方名称: 中国工商银行股份有限公司

(b) 关联交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(c) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(d) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(e) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(f) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(g) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(h) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(i) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(j) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(k) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(l) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(m) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(n) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(o) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(p) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(q) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(r) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(s) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(t) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(u) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(v) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(w) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(x) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(y) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(z) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(aa) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(ab) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(ac) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(ad) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(ae) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(af) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(ag) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(ah) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(ai) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(aj) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(ak) 关联方交易
(1) 关联方交易
(2) 关联方交易
(3) 关联方交易

(a) 风险管理政策和组织结构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及评估风险,并设定适当的风险管理及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控所有这些风险。

(b) 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未能履行合同义务,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。

(c) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具的变现难度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可能要求赎回持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

(d) 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险,包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(e) 公允价值

Table with columns: 项目, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例

(f) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险,包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(g) 公允价值

Table with columns: 项目, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例

(h) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具的变现难度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可能要求赎回持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

(i) 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险,包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(j) 公允价值

Table with columns: 项目, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例

(k) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险,包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(l) 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险,包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(m) 公允价值

Table with columns: 项目, 公允价值, 公允价值占基金资产净值比例

(n) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险,包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(o) 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险,包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

3. 本报告期末买入股票的成本总额为 16,440,444,212.05 元; 卖出股票的收入总额为 13,137,013,934.05 元。

5. 本报告期末按资产分配的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券名称, 市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例(%)

(六) 本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: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 期末市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例(%)

(七) 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的权证明细

Table with columns: 序号, 代码, 权证名称, 数量(份), 期末市值(单位:人民币元), 占基金资产净值比例(%)

(八) 投资组合报告附注

1. 报告期内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,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2. 基金投资前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

3. 基金的其他资产构成

Table with columns: 资产类别, 金额(单位:人民币元)

4. 各本报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

5. 本报告期末本基金未持有资产支持证券

6. 报告期末本基金投资的权证情况

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

七、基金份额持有人户数及持有人结构

截至2008年6月30日建信优化配置混合型证券投资基金持有人情况如下:

截至2008年6月30日基金份额持有人户数情况如下:

基金份额持有人户数

截至2008年6月30日基金份额持有人结构情况如下:

Table with columns: 项目, 基金份额(%)

(三) 期末基金管理公司从业人员投资本基金的情况

Table with columns: 基金管理人持有本基金的所有从业人员, 期末持有本基金基金份额的总量(元), 占本基金总份额的比例(%)

八、开放式基金业绩比较

本基金自成立以来的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

Table with columns: 单位:元, 基金份额净值, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率

九、重大事件概述

(一) 本报告期本基金召开基金份额持有人大会

(二) 本报告期, 经公司第一届董事会第十二次会议决议并经中国证监会核准, 本基金管理人聘请张延川先生担任公司副总经理, 主管专户理财产品, 本变更事项已于2008年6月19日在本基金管理人网站公告。

(三) 本报告期, 本基金管理人的注册地址由“北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座18层”变更为“北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层”。

(四) 本报告期, 本基金管理人聘任曾宇先生担任公司首席运营官, 主管专户理财产品, 本变更事项已于2008年6月19日在本基金管理人网站公告。

(五) 本报告期, 本基金投资策略未发生变更。

(六) 本报告期, 本基金基金经理未发生变更。

(七) 本报告期, 本基金基金托管人未发生变更。

(八) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(九) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(十) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(十一) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(十二) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(十三) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(十四) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(十五) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(十六) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(十七) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(十八) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(十九) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(二十) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(二十一) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(二十二) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(二十三) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(二十四) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(二十五) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(二十六) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(二十七) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(二十八) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(二十九) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(三十) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(三十一) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(三十二) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(三十三) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(三十四) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(三十五) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(三十六) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(三十七) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

(三十八) 本报告期, 本基金管理人及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、稽查和处罚。

一、基金基本情况

基金名称: 建信优化配置混合型证券投资基金

基金简称: 建信优化配置

基金代码: 530006

基金合同生效日: 2007年3月1日

基金期末基金份额总额: 15,357,746,600.51份

基金合同期限: 不定期

(二) 基金产品简介

基金投资目标: 通过合理的资产配置和积极的证券选择, 在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。

基金投资策略: 基金管理人对宏观经济、行业和上市公司、债券、货币市场工具等进行研究与分析, 综合运用自上而下和自下而上的积极投资策略, 在大类资产配置上采取适度分散投资策略, 在个股选择上采取集中投资策略。

业绩比较基准: 60% × 新华富时 A600 指数 + 40% × 中国债券综合指数。

风险收益特征: 本基金属于中高风险证券投资基金, 一般情况下其预期收益高于货币市场基金和债券型基金, 低于股票型基金。

(三) 基金管理人有关情况

基金管理人名称: 建信基金管理有限责任公司

OCB PRINCIPAL ASSET MANAGEMENT CO., LTD.

注册地址: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

北京西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

邮编: 100140

法定代表人: 汪汉东

信息披露负责人: 杨惠敏

联系电话: (010) 66228888

传真: (010) 66228001

网上申购网址: http://www.cbfund.cn

电子邮箱: xinfaxi@cbfund.cn

(四) 基金托管人有关情况

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26号

北京西城区复兴门内大街26号

邮编: 100032

法定代表人: 姜建清

信息披露负责人: 孙志军

联系电话: (010) 6810 6912

传真: (010) 6810 6938

网上申购网址: www.icbc.com.cn

电子邮箱: custody@icbc.com.cn

(五) 信息披露渠道

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.cbfund.cn 查询。

本基金在基金管理人及基金托管人的住所设置, 投资者可要求查阅、复制。

基金财务报表、基金净值表现及收益分配情况

重要提示: 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下列数据。

(一) 主要财务指标

单位: 人民币元

Table with columns: 序号, 项目, 2008年1月1日至2008年6月30日

注: ①—④数字以负数表示亏损。

1. 基金净值增长表及其收益分配情况

Table with columns: 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, ①-③, ②-④

2. 自基金合同生效以来基金净值增长率及其与业绩比较基准变动情况的对比

建信优化配置混合型证券投资基金

业绩比较基准: 60% × 新华富时 A600 指数 + 40% × 中国债券综合指数

(2007年3月1日至2008年6月30日)



注: 本报告期, 本基金的资产配置比例符合基金合同的要求。

三、管理人报告

本基金管理人建信基金管理有限责任公司, 经中国证监会证监基金字[2005]158号文核准, 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。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%。

目前公司管理中国建设银行股份基金, 自有资金规模约100亿元, 其中中国建设银行股份基金占65%, 自有资金规模约100亿元, 其中中国