

# 建信优化配置混合型证券投资基金

# 2008年上半年度报告摘要

**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。

建信基金管理有限公司根据本基金合同规定，于2008年8月20日将本报告中的各托管人、净值表现、收益分配情况、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，基金过往业绩并不代表未来表现，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2008年1月1日起至2008年6月30日止。本报告的财务资料未经审计。

本半年报需要摘录自年度报告正文，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) 基金概况

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

交易代码：530006

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007年3月1日

报告期末基金份额总额：15,357,746,600.51份

基金合同存续期：不定期

(二) 基金产品类型

基金的投资目标：通过合理的资产配置和积极的股票选择，在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益，基金的投资范围：主要投资于人民币债券、行业及上市公司的债券、货币市场工具等进行定性与定量相结合的研究，运用买入而下卖出而上和结合的证券投资策略，在大类资产配置这一宏观层面上个股选择这一微观层面上优化组合。

本基金的业绩比较基准：60%×沪深300指数+40%×中国债券总指数。

本基金的风险特征：本基金属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。

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

CCB 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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

邮政编码：100140

法定代表人：王洪军

信息披露义务人：建信基金管理有限责任公司

电子邮箱：xinxipu@cbcfundcn

(三) 基金托管人有关情况

基金托管人：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7号英蓝国际金融中心16层

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

邮政编码：100140

法定代表人：胡继东

信息披露义务人：建信基金管理有限责任公司

电子邮箱：tongguo@cbcfundcn

(四) 报告期内基金利润分配情况

报告期利润：无

基金份额净值及收益分配情况

重要提示：下述基金利润指基金不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所示数字。

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

序号	项目	2008年1月1日至2008年6月30日
1	本期利润	-7,171,581,967.72
2	本期利润扣除非经常性损益后的净利润	-826,479,564.52
3	年初至报告期利润总额	85,469.00
4	报告期利润分配比例(%)	4,084,222,220.00
5	期末可供分配利润	8,059.67
6	期末基金资产净值	11,273,747,416.26
7	期末基金份额净值	0.7341
8	加权平均基金份额净值	(66.60%)
9	本期份额净值增长率	(7.62%)
10	份额净值增长率标准差	8.47%

注：(1) 数字以人民币元表示。(2) 根据基金合同的规定，本基金的利润分配方式为现金分红。

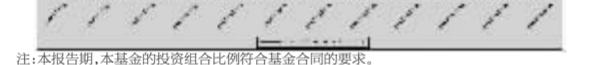
(二) 基金净值表现及收益分配情况

1. 基金份额净值增长率及其相对基准收益率的比较

阶段 净增长比率① 净增长标准差② 相对基准收益率③ 收益率波动率④ ①-③ ②-④

过去一个月	-17.90%	2.89%	-14.32%	2.12%	-3.58%	0.77%
过去二个月	-23.02%	2.90%	-17.08%	2.02%	-5.94%	0.76%
过去六个月	-37.62%	2.66%	-30.27%	1.98%	-7.36%	0.77%
过去一年	-17.75%	2.26%	-14.43%	1.59%	-3.32%	0.96%
基金份额生效至今	0.47%	2.17%	6.88%	1.56%	1.05%	0.63%

2. 基金合同生效以来基金份额净值增长率历史走势对比图



注：本基金的净值增长率是指基金净值增长率，而不是扣除申购赎回费用后的净值增长率。

3. 基金管理人报告

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[2007]36号文《关于同意建信优化配置混合型证券投资基金基金募集的批复》批准设立。

基金托管人：建信基金管理有限责任公司，经中国证监会证监基金字[2007]36号文《关于同意建信优化配置混合型证券投资基金基金募集的批复》批准设立。

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

交易代码：530006

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007年3月1日

报告期：2008年1月1日至2008年6月30日

报告期利润：-7,171,581,967.72元

报告期利润扣除非经常性损益后的净利润：-826,479,564.52元

年初至报告期利润总额：85,469.00元

报告期利润分配比例(%)：4,084,222,220.00%

期末可供分配利润：8,059.67元

期末基金资产净值：11,273,747,416.26元

期末基金份额净值：0.7341元

加权平均基金份额净值：(66.60%)

本期份额净值增长率：(7.62%)

份额净值增长率标准差：8.47%

4. 报告期内基金利润分配情况

报告期利润：无

基金份额净值及收益分配情况

重要提示：下述基金利润指基金不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所示数字。

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

序号	项目	2008年1月1日至2008年6月30日
1	本期利润	-7,171,581,967.72
2	本期利润扣除非经常性损益后的净利润	-826,479,564.52
3	年初至报告期利润总额	85,469.00
4	报告期利润分配比例(%)	4,084,222,220.00
5	期末可供分配利润	8,059.67
6	期末基金资产净值	11,273,747,416.26
7	期末基金份额净值	0.7341
8	加权平均基金份额净值	(66.60%)
9	本期份额净值增长率	(7.62%)
10	份额净值增长率标准差	8.47%

注：(1) 数字以人民币元表示。(2) 根据基金合同的规定，本基金的利润分配方式为现金分红。

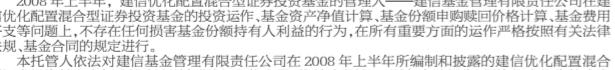
(二) 基金净值表现及收益分配情况

1. 基金份额净值增长率及其相对基准收益率的比较

阶段 净增长比率① 净增长标准差② 相对基准收益率③ 收益率波动率④ ①-③ ②-④

过去一个月	-17.90%	2.89%	-14.32%	2.12%	-3.58%	0.77%
过去二个月	-23.02%	2.90%	-17.08%	2.02%	-5.94%	0.76%
过去六个月	-37.62%	2.66%	-30.27%	1.98%	-7.36%	0.77%
过去一年	-17.75%	2.26%	-14.43%	1.59%	-3.32%	0.96%
基金份额生效至今	0.47%	2.17%	6.88%	1.56%	1.05%	0.63%

2. 基金合同生效以来基金份额净值增长率历史走势对比图



注：本基金的净值增长率是指基金净值增长率，而不是扣除申购赎回费用后的净值增长率。

3. 基金管理人报告

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[2007]36号文《关于同意建信优化配置混合型证券投资基金基金募集的批复》批准设立。

基金托管人：建信基金管理有限责任公司，经中国证监会证监基金字[2007]36号文《关于同意建信优化配置混合型证券投资基金基金募集的批复》批准设立。

基金名称：建信优化配置

交易代码：530006

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007年3月1日

报告期：2008年1月1日至2008年6月30日

报告期利润：-7,171,581,967.72元

报告期利润扣除非经常性损益后的净利润：-826,479,564.52元

年初至报告期利润总额：85,469.00元

报告期利润分配比例(%)：4,084,222,220.00%

期末可供分配利润：8,059.67元

期末基金资产净值：11,273,747,416.26元

期末基金份额净值：0.7341元

加权平均基金份额净值：(66.60%)

本期份额净值增长率：(7.62%)