

建信优化配置混合型证券投资基金 2009 年半年度报告摘要

2009年6月30日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、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法律责任。

1.2 基金概况
基金名称:建信优化配置混合
基金简称:建信混合
基金代码:530005

2.1 基金基本情况
基金简称:建信优化配置混合
基金代码:530005
基金运作方式:契约型开放式

2.2 基金产品说明
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。
投资策略:本基金管理人通过对宏观经济、行业及上市公司、债券、货币市场工具等特定行业与固定收益品种的研究,运用自上而下和自下而上相结合的投资策略。

2.3 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

2.4 信息披露方式
基金年度报告正文的管理人互联网网址:www.ccbfund.cn
基金半年度报告备置地点:基金管理人及基金托管人的住所

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标

Table with 2 columns: 指标名称, 报告期末(2009年6月30日)
3.1.1 期间数据和指标: 本期已实现收益 -295,596,192.50; 本期净利润 4,373,865,092.31
3.1.2 期末数据和指标: 期末可供分配利润 -3,897,792,063.73; 期末可供分配基金份额净值 0.2816

Table with 4 columns: 阶段, 份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差
过去一个月: 15.22%, 1.23%, 7.37%, 0.68%, 7.85%, 0.55%

3.1.3 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年6月30日,本基金累计净值增长率为25.92%,同期业绩比较基准收益率为16.96%。

3.2 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.3 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.4 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.5 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.6 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.7 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.8 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.9 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.10 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.11 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.12 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.13 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.14 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.15 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.16 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.17 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.18 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.19 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.20 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.21 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.22 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.23 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.24 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.25 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.26 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.27 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.28 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.29 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.30 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.31 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.32 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.33 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.34 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.35 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.36 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.37 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.38 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.39 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.40 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.41 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.42 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

3.43 基金管理人、基金托管人
基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

本托管人对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信优化配置混合型证券投资基金2009年半年度报告中财务数据、净值信息、申购赎回数据、投资组合报告、财务会计报告、投资组合报告等内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

6.1 资产负债表
资产: 银行存款 559,584,946.70; 债券投资 643,803,110.92; 其他资产 11,149,406,273.25

6.2 利润表
营业收入 16,443,716.70; 公允价值变动损益 10,505,603,162.33; 净利润 11,867,510,255.20

6.3 所有者权益表
所有者权益合计 11,867,510,255.20

6.4 现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 98,154,149.21; 投资活动产生的现金流量净额 -6,234,032.58; 筹资活动产生的现金流量净额 1,677,208.55

6.5 关联方关系及其交易
关联方名称:中国工商银行股份有限公司
交易内容:存款、贷款、担保、代理收付款项等

6.6 或有事项
截至2009年6月30日,本基金不存在或有事项。

6.7 承诺事项
截至2009年6月30日,本基金不存在承诺事项。

6.8 资产负债表
资产: 银行存款 559,584,946.70; 债券投资 643,803,110.92; 其他资产 11,149,406,273.25

6.9 利润表
营业收入 16,443,716.70; 公允价值变动损益 10,505,603,162.33; 净利润 11,867,510,255.20

6.10 所有者权益表
所有者权益合计 11,867,510,255.20

6.11 现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 98,154,149.21; 投资活动产生的现金流量净额 -6,234,032.58; 筹资活动产生的现金流量净额 1,677,208.55

6.12 关联方关系及其交易
关联方名称:中国工商银行股份有限公司
交易内容:存款、贷款、担保、代理收付款项等

6.13 或有事项
截至2009年6月30日,本基金不存在或有事项。

6.14 承诺事项
截至2009年6月30日,本基金不存在承诺事项。

6.15 资产负债表
资产: 银行存款 559,584,946.70; 债券投资 643,803,110.92; 其他资产 11,149,406,273.25

6.16 利润表
营业收入 16,443,716.70; 公允价值变动损益 10,505,603,162.33; 净利润 11,867,510,255.20

6.17 所有者权益表
所有者权益合计 11,867,510,255.20

6.18 现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 98,154,149.21; 投资活动产生的现金流量净额 -6,234,032.58; 筹资活动产生的现金流量净额 1,677,208.55

6.19 关联方关系及其交易
关联方名称:中国工商银行股份有限公司
交易内容:存款、贷款、担保、代理收付款项等

6.20 或有事项
截至2009年6月30日,本基金不存在或有事项。

6.21 承诺事项
截至2009年6月30日,本基金不存在承诺事项。

6.22 资产负债表
资产: 银行存款 559,584,946.70; 债券投资 643,803,110.92; 其他资产 11,149,406,273.25

6.23 利润表
营业收入 16,443,716.70; 公允价值变动损益 10,505,603,162.33; 净利润 11,867,510,255.20

6.24 所有者权益表
所有者权益合计 11,867,510,255.20

6.25 现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 98,154,149.21; 投资活动产生的现金流量净额 -6,234,032.58; 筹资活动产生的现金流量净额 1,677,208.55

6.26 关联方关系及其交易
关联方名称:中国工商银行股份有限公司
交易内容:存款、贷款、担保、代理收付款项等

6.27 或有事项
截至2009年6月30日,本基金不存在或有事项。

6.28 承诺事项
截至2009年6月30日,本基金不存在承诺事项。

6.29 资产负债表
资产: 银行存款 559,584,946.70; 债券投资 643,803,110.92; 其他资产 11,149,406,273.25

Table with 4 columns: 项目, 2009年1月1日至2009年6月30日, 2008年1月1日至2008年6月30日, 比上年同期增减

7.4.1 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
单位:人民币元

Table with 2 columns: 买入股票成本, 卖出股票收入

7.5 期末按债券品种和类属的债券投资组合
金额单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例

注:1.上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额(成交金额以成交数量乘以成交均价),不包括相关交易费用。