

建信优化配置混合型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月19日

1 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法律责任。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

2 基金产品概况

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金代码, etc.) and Value (建信优化配置, 530005, etc.)

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)

Table with 2 columns: Item (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and Value (30,376,253.36, 192,248,004.69, etc.)

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.本报告基金净值指标不包括持有未认购或交易基金的款项,计入费用后实际收益率水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: Item (阶段, 过去三个月, 过去六个月) and Value (净值增长率, 净值增长率标准差, etc.)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较
基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本报告期,本基金投资运作符合基金合同的要求。
4 管理人报告
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: Name (陶然, 马志超), Position (基金经理), Tenure (2011年7月11日, 2013年11月13日), and Remarks (硕士, 2007年7月加入本公司, etc.)

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规情况的说明
在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》和《建信优化配置混合型证券投资基金合同》等法律法规的规定。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
为了公平对待投资人,保护投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司规范客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险控制制度。公司使用的交易系统设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或间接从事不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现
4.4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现
2014年二季度,市场整体呈现震荡向上走势,大盘股和小盘股之间联动效应明显提升,主题投资依然是市场热点。二季度期间,宏观经济增长超预期,实体经济数据不断超预期,“微刺激”政策出台,货币政策的实际宽松化也给市场带来利好支撑。
本基金在二季度紧密跟踪流动性变化,以及中观层面的行业景气变化,适度加大景气上行行业的配置,淡化宏观与微观的影响,从宏观角度为投资者寻求能够穿越转型的成长行业,谋求超额收益。

4.4.2 报告期内基金投资策略和业绩表现
本报告期末净值增长率为3.23%,波动率为0.86%,业绩比较基准收益率为2.09%,波动率为0.53%。
本基金对宏观经济、证券市场运行走势的跟踪展望
展望二季度,系列“微刺激”政策的落地实施,预计将一定程度利好经济增长,宏观经济数据对资本市场的影响将呈中性偏积极态势,但市场预期在二季度出现较大分歧,上市公司中报业绩压力较大,在市场的信心更多来自于主题投资,以及宏观层面景气上行行业。本基金将在符合政策导向、估值性价比的基础上,聚焦投资,同时在估值偏压的周期行业,寻求政策、流动性带来的投资机会,积极为投资者创造超额回报。

4.4.3 报告期内基金投资策略和业绩表现
4.4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.5 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.6 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.7 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.8 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.9 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.10 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.11 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.12 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.13 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.14 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.15 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.16 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.17 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.18 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.19 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.20 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.21 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.22 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.23 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.24 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.25 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.26 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.27 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.28 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.29 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.30 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.31 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.32 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.33 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.34 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.35 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.36 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.37 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.38 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.39 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.40 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.41 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.42 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.43 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.44 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.45 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.46 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.47 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.48 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.49 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.50 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.51 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.52 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.53 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.54 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.55 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.56 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.57 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.58 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.59 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.60 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.61 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.62 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.63 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.64 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.65 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.66 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.67 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.68 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.69 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.70 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.71 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.72 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.73 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.74 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.75 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.76 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.77 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.78 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.79 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.80 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.81 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.82 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.83 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.84 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.85 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.86 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.87 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.88 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.89 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.90 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.91 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.92 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.93 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.94 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.95 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.96 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.97 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.98 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.99 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.100 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.101 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.102 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.103 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.104 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.105 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.106 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.107 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.108 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.109 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.110 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.111 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.112 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.113 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.114 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.115 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.116 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.117 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.118 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.119 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.120 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.121 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.122 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.123 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.124 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.125 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.126 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.127 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.128 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.129 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.130 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.131 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.132 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.133 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.134 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.135 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.136 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.137 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.138 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.139 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.140 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.141 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.142 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.143 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.144 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.145 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.146 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.147 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.148 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.149 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.150 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.151 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.152 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.153 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.154 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.155 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.156 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.157 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.158 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.159 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.160 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.161 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.162 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.163 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.164 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.165 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.166 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.167 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.168 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.169 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.170 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.171 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.172 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.173 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.174 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.175 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.176 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.177 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.178 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.179 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.180 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.181 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.182 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.183 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.184 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.185 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.186 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.187 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.188 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.189 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.190 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.191 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.192 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.193 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.194 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.195 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.196 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.197 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.198 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.199 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.200 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.201 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.202 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.203 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.204 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.205 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.206 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.207 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.208 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.209 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.210 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.211 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.212 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.213 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.214 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.215 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.216 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.217 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.218 报告期内基金投资策略和业绩表现

4.4.219 报告期内基金投资策略和业绩表现