

---

# 建信优化配置混合型证券投资基金

## 2011 年半年度报告

2011 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

报告送出日期：二〇一一年八月二十四日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告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。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	4
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告.....	6
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	28
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	33
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	33
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	33
7.9 投资组合报告附注.....	33
§8 基金份额持有人信息.....	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	34
§9 开放式基金份额变动.....	34
§10 重大事件揭示.....	35
10.1 基金份额持有人大会决议.....	35
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	35
10.4 基金投资策略的改变.....	35

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	35
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 .....	35
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	35
10.8 其他重大事件 .....	38
§11 备查文件目录 .....	39
11.1 备查文件目录 .....	39
11.2 存放地点 .....	40
11.3 查阅方式 .....	40

## §2 基金简介

### 2.1 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	建信优化配置混合
基金主代码	530005
交易代码	530005
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
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
报告期末基金份额总额	9,595,958,849.87份
基金合同存续期	不定期

### 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	基金管理人通过对宏观经济、行业及上市公司、债券、货币市场工具等进行定性与定量相结合的研究，运用自上而下和自下而上相结合的投资策略，在大类资产配置这一宏观层面与个个券选择这一微观层面优化投资组合
业绩比较基准	60% × 富时中国A600指数 + 40% × 中国债券总指数
风险收益特征	本基金属于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，低于股票型基金

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	赵会军
	联系电话	010-66228888	010—66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	010—66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		江先周	姜建清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	633,337,271.05
本期利润	-378,895,231.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0380
本期加权平均净值利润率	-4.14%
本期基金份额净值增长率	-4.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-1,040,440,993.49
期末可供分配基金份额利润	-0.1084
期末基金资产净值	8,555,517,856.38
期末基金份额净值	0.8916
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	31.74%

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、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、所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所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.38%	1.07%	0.93%	0.76%	0.45%	0.31%
过去三个月	-4.68%	0.96%	-3.61%	0.68%	-1.07%	0.28%
过去六个月	-4.32%	1.16%	-2.10%	0.75%	-2.22%	0.41%
过去一年	22.25%	1.34%	11.98%	0.84%	10.27%	0.50%
过去三年	21.45%	1.72%	18.65%	1.20%	2.80%	0.52%
成立至今	31.74%	1.87%	26.81%	1.32%	4.93%	0.55%

注：本基金业绩比较基准：60%×富时中国 A600 指数+40%×中国债券总指数。其中：富时中国 A600 指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准，中国债券总指数收益率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。

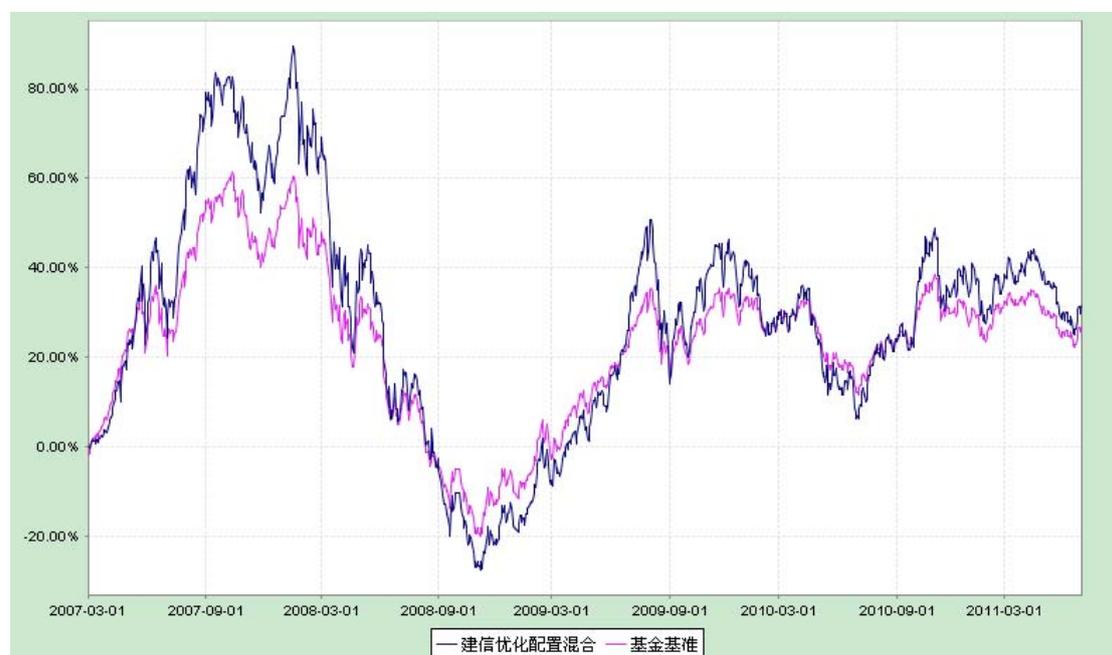
富时中国 A600 指数由富时集团发布，该指数包含中国深沪两个市场流通市值最大的六百家上市公司，涵盖了几乎所有行业。该指数在市场代表性、市场相关度、流动性等方面具备作为基准指数的可行性。中债系列指数由一个总指数（即中国债券总指数），若干个分指数构成。中国债券总指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债券等），理论上能客观反映中国债券总体情况。

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

建信优化配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2007 年 3 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）



注：1、本基金股票占基金资产的 30%-90%；债券、现金、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 10%-70%，其中，基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

2、本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，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。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建

设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司。自成立以来，公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“最可信赖、持续领先的资产管理公司”。

截至 2011 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信保本混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金 15 只开放式基金和建信优势动力股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金 2 只封闭式基金，管理的基金资产规模共计为 433.13 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汪沛先生	本基金基金经理	2007-03-01	2011-05-11	10	硕士。2000 年进入中国农业银行总行资金营运中心，担任债券交易员。2001 年 3 月，加入富国基金管理有限公司，历任宏观与债券研究员、固定收益主管，2003 年 12 月 2 日至 2006 年 1 月 12 日任富国天利增长债券投资基金基金经理。2006 年 1 月进入本公司，2006 年 4 月 25 日至 2011 年 2 月 1 日任建信货币市场基金基金经理，2008 年 6 月 25 日至 2011 年

					2月1日任建信稳定增利基金基金经理。2011年5月因个人原因从本公司离职。
李涛先生	本基金基金经理	2011-05-11	-	12	学士。先后就职于中国经济开发信托投资公司、西南证券、国泰君安证券公司、新时代证券、中海基金管理公司等单位，曾担任投资银行部经理、行业研究员、基金经理等职。李涛于2005年6月16日至2007年7月9日担任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理；于2007年7月10日至2008年7月22日担任中海优质成长证券投资基金基金经理。李涛于2008年9月加入建信基金管理公司。2008年11月27日起任建信优选成长股票型证券投资基金基金经理。
陶灿先生	本基金基金经理	2011-07-11	-	4	硕士。2007年7月加入本公司，从事行业研究，历任研究员、基金经理助理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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》、《基金管理公司特定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》等风险管控制度。公司使用的交易系统中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，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，本基金管理人不存在与本基金投资风格相似的投资组合。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年度内，市场先涨后跌，总体呈现震荡格局，同时在风格上出现明显的分化。高估值板块和个股在盈利不达预期的情形下，遭遇较大调整；低估值板块和个股依靠较稳健的盈利而获得一定超额收益。

报告期内，本基金的大类资产配置、行业配置回顾如下：

大类资产配置上，本基金在 1 季度保持较高仓位，在 4 月初适时降低仓位，而在二季度末又适时调高了仓位，整体上保持了较好的节奏，符合市场运行特征。

行业配置上，本基金以低估值行业为主，组合结构契合今年市场风格，年初以来规避了高估值成长股下跌的风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年上半年本基金净值增长率-4.32%，波动率 1.16%，业绩比较基准收益率-2.10%，波动率 0.75%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年宏观经济运行中，通胀成为最大的焦点，依此展开的抗通胀与保增长之间的博弈，引发了证券市场对面预期的扰动，并因此呈现出震荡的格局。

预期下半年，通胀较大概率上呈现高位下行态势，经济增长面临的调控压力在逐步减小，特别是海外经济的增长势头放缓将为政策调控提供较大余地。

在行业趋势上，我们密切关注上半年表现较差、下半年景气有望恢复的行业，比如医药、TMT 行业等。

从长期看，我们依然对符合产业结构调整、升级的行业、个股进行筛选，

在把握业绩增长确定性的基础上，进行侧重配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本报告期内，公司已与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末本基金可供分配利润为-1,040,440,993.49 元，根据相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定，未达到进行利润分配的条件，未进行利润分配。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011 年上半年，本基金托管人在对建信优化配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年上半年，建信优化配置混合型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信优化配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，建信优化配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准全和完整发表意见

托本托管人依法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 2011 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2011 年 8 月 19 日

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：建信优化配置混合型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	189,234,031.49	62,918,858.98
结算备付金		5,677,670.94	9,012,012.10
存出保证金		4,348,777.09	5,120,739.20
交易性金融资产	6.4.7.2	8,411,846,495.34	9,663,157,498.28
其中：股票投资		7,192,601,000.39	8,587,693,755.65
基金投资		-	-
债券投资		1,219,245,494.95	1,075,463,742.63
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	54,706,265.37
应收利息	6.4.7.5	6,436,585.50	16,291,793.70
应收股利		3,574,099.61	-
应收申购款		61,245.51	585,290.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,621,178,905.48	9,811,792,458.52
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		38,101,160.04	-
应付赎回款		4,361,100.34	4,644,713.41
应付管理人报酬		10,315,904.80	12,439,470.50
应付托管费		1,719,317.46	2,073,245.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,672,991.27	12,134,129.12
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	3,490,575.19	1,680,250.45
负债合计		65,661,049.10	32,971,808.60
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	9,595,958,849.87	10,493,043,984.24
未分配利润	6.4.7.10	-1,040,440,993.49	-714,223,334.32
<b>所有者权益合计</b>		<b>8,555,517,856.38</b>	<b>9,778,820,649.92</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>8,621,178,905.48</b>	<b>9,811,792,458.52</b>

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8916 元，基金份额总额 9,595,958,849.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：建信优化配置混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	
		2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>-286,389,793.00</b>	<b>-2,656,017,996.17</b>
1.利息收入		13,837,868.35	7,961,161.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,185,847.07	1,738,827.30
债券利息收入		12,000,355.80	6,222,334.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		651,665.48	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		711,647,202.07	348,577,580.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	669,335,567.25	307,626,807.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,481,453.98	-2,700.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	46,793,088.80	40,953,472.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,012,232,502.78	-3,012,754,178.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	357,639.36	197,440.33
<b>减：二、费用</b>		<b>92,505,438.73</b>	<b>107,370,156.99</b>
1.管理人报酬		68,106,818.06	76,483,003.05
2.托管费		11,351,136.42	12,747,167.19
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	12,281,699.54	17,708,036.21
5.利息支出		503,619.33	173,302.45
其中：卖出回购金融资产支出		503,619.33	173,302.45
6.其他费用	6.4.7.19	262,165.38	258,648.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-378,895,231.73</b>	<b>-2,763,388,153.16</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-378,895,231.73</b>	<b>-2,763,388,153.16</b>

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：建信优化配置混合型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2011年1月1日至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,493,043,984.24	-714,223,334.32	9,778,820,649.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-378,895,231.73	-378,895,231.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-897,085,134.37	52,677,572.56	-844,407,561.81

(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	213,799,551.66	-17,364,161.56	196,435,390.10
2.基金赎回款	-1,110,884,686.03	70,041,734.12	-1,040,842,951.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	9,595,958,849.87	-1,040,440,993.49	8,555,517,856.38
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	12,345,648,335.30	-499,168,173.69	11,846,480,161.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,763,388,153.16	-2,763,388,153.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-503,017,591.43	56,192,713.48	-446,824,877.95
其中: 1.基金申购款	283,217,821.77	-38,212,323.04	245,005,498.73
2.基金赎回款	-786,235,413.20	94,405,036.52	-691,830,376.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	11,842,630,743.87	-3,206,363,613.37	8,636,267,130.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：孙志晨，主管会计工作负责人：何斌，会计机构负责人：秦绪华

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信优化配置混合型基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第 36 号《关于同意建信优化配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 9,658,460,290.75 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公

司普华永道中天验字(2007)第 018 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》于 2007 年 3 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 9,658,655,708.23 份基金份额,其中认购资金利息折合 195,417.48 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证以及经国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票占基金资产的 30%-90%;债券、现金、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 10%-70%,其中,基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为富时中国 A 600 指数 X60% + 中国债券总指数 X40%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	189,234,031.49
定期存款	-
其他存款	-
合计	189,234,031.49

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	7,205,128,080.18	7,192,601,000.39	-12,527,079.79	
债券	交易所市场	744,182,452.20	725,680,494.95	-18,501,957.25
	银行间市场	494,022,100.00	493,565,000.00	-457,100.00
	合计	1,238,204,552.20	1,219,245,494.95	-18,959,057.25
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	8,443,332,632.38	8,411,846,495.34	-31,486,137.04	

注: 1. 于 2011 年 6 月 30 日, 股票投资余额中包括按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票 14,018,425.6 元。

2. 债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限公司独立提供；采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本报告期间利润表中确认的公允价值变动收益为 5,730,450.00 元。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	41,954.01
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,555.00
应收债券利息	6,392,076.49
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	6,436,585.50

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	7,670,441.27
银行间市场应付交易费用	2,550.00
合计	7,672,991.27

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	3,000,000.00
应付赎回费	1,775.92

预提费用	488,799.27
合计	3,490,575.19

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	10,493,043,984.24	10,493,043,984.24
本期申购	213,799,551.66	213,799,551.66
本期赎回(以“-”号填列)	-1,110,884,686.03	-1,110,884,686.03
本期末	9,595,958,849.87	9,595,958,849.87

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,032,576,564.10	318,353,229.78	-714,223,334.32
本期利润	633,337,271.05	-1,012,232,502.78	-378,895,231.73
本期基金份额交易产生的变动数	63,263,965.54	-10,586,392.98	52,677,572.56
其中：基金申购款	-13,692,698.51	-3,671,463.05	-17,364,161.56
基金赎回款	76,956,664.05	-6,914,929.93	70,041,734.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-335,975,327.51	-704,465,665.98	-1,040,440,993.49

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	1,142,931.77
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	42,625.99
其他	289.31
合计	1,185,847.07

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	4,445,284,340.38
减：卖出股票成本总额	3,775,948,773.13
买卖股票差价收入	669,335,567.25

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	533,283,068.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	516,718,896.57
减：应收利息总额	21,045,626.01
债券投资收益	-4,481,453.98

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	46,793,088.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	46,793,088.80

##### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1.交易性金融资产	-1,012,232,502.78
——股票投资	-1,005,373,186.32
——债券投资	-6,859,316.46
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-1,012,232,502.78

##### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	205,377.44
基金转换费收入	128,377.90
印花税手续费返还	23,884.02
其他	-
合计	357,639.36

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产，转出费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	12,279,849.54
银行间市场交易费用	1,850.00
合计	12,281,699.54

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	84,300.75
信息披露费	148,760.76
银行汇划费用	20,103.87
债券托管账户维护费	9,000.00
其他	-
合计	262,165.38

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金未存在或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至报表批准报出日，本基金未存在资产负债表日后发生的利润分配、基金拆分、基金转型等非调整事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

经建信基金管理有限责任公司(以下简称"公司")2010年度第二次临时股东会审议通过，并于2011年5月4日中国证监会证监许可[2011]648号文批准，本公司原股东中国华电集团公司将所持有的建信基金管理有限责任公司10%的股权转让给中国华电集团资本控股有限公司。该事项已于2011年6月9日在中国证券报、上海证券报、证券时报及我公司网站公开披露。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	68,106,818.06	76,483,003.05
其中：支付销售机构的客户维护费	10,519,815.64	11,837,359.57

注：1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产里列支的费用项目。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年 6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,351,136.42	12,747,167.19

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

##### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

###### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	189,234,031.49	1,142,931.77	554,596,347.27	1,679,574.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
600216	浙江医药	2011-06-27	筹划非公开发行股票融资事宜	31.39	2011-07-04	32.60	299,924	11,499,703.90	9,414,614.36
000609	绵世股份	2011-06-30	存在未公告重大事项	10.73	2011-08-16	11.78	6,078,369	70,176,891.85	65,220,899.37
600315	上海家化	2010-12-06	筹划国企改革事宜	35.60	-	-	393,776	7,283,660.34	14,018,425.60

注：本基金截至 2011 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末，无银行间市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

至本报告期末，本基金无债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为偏股型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计与风险控制委员会，根据公司总体战略负责拟订公司风险战略和风险管理政策，并对其实施情况及效果进行监督和评价，指导公司的风险管理和内控制度建设；对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估；

监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评估公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责制定公司经营管理中的风险控制政策，组织制定公司经营管理中的内部风险控制制度；对公司管理层在投资、市场、信用、操作等方面的风险控制情况进行监督，管理层应如实向风险管理委员会汇报有关风险控制情况；以及对公司经营管理过程中的风险状况进行定期或不定期评估。在业务操作层面，风险管理部负责公司旗下基金及其它受托资产投资中的风险识别、评估和控制；监察稽核部承担合规风险的管理职责，负责在各业务部门一线风险控制的基础上实施风险再控制。

本基金的基金管理人建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金

均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除报告中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风

险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2011年6月30日)	上年度末(2010年12月31日)
	市场利率下降25个基点	增加约5,169,091.79	增加约6,578,948.47
	市场利率上升25个基点	减少约5,104,585.29	减少约6,498,152.91

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用“自上而下”的策略,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票占基金资产的30%-90%;债券、现金、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的10%-70%,其中,基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

## 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	7,192,601,000.39	84.07	8,587,693,755.65	87.82
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,192,601,000.39	84.07	8,587,693,755.65	87.82

## 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	1、业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	增加约453,314,113.62	增加约823,523,381.00
	2、业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	减少约453,314,113.62	减少约823,523,381.00

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## (1) 公允价值

## (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## (b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2011年6月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为7,829,627,556.01元，属于第二层级的余额为582,218,939.33元，

无属于第三层级的余额(2010年6月30日：第一层级 6,844,588,040.66 元，第二层级 1,247,909,783.01 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(上年度可比期间：同)。

对于持有的认购新发和增发证券，本基金将相关证券公允价值所属层级于流通受限期间列入第二层级，待其可流通后从第二层级转入第一层级(上年度可比期间：同)。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,192,601,000.39	83.43
	其中：股票	7,192,601,000.39	83.43
2	固定收益投资	1,219,245,494.95	14.14
	其中：债券	1,219,245,494.95	14.14
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	194,911,702.43	2.26
6	其他各项资产	14,420,707.71	0.17
7	合计	8,621,178,905.48	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	633,604,995.36	7.41
C	制造业	2,186,812,242.63	25.56
C0	食品、饮料	582,298,197.54	6.81
C1	纺织、服装、皮毛	47,034,653.10	0.55
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	910,147.50	0.01
C4	石油、化学、塑胶、塑料	224,083,586.07	2.62
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	649,167,717.51	7.59
C7	机械、设备、仪表	415,682,021.35	4.86

C8	医药、生物制品	246,979,786.22	2.89
C99	其他制造业	20,656,133.34	0.24
D	电力、煤气及水的生产和供应业	51,065,454.70	0.60
E	建筑业	272,429,806.00	3.18
F	交通运输、仓储业	161,073,034.69	1.88
G	信息技术业	95,912,040.45	1.12
H	批发和零售贸易	724,905,669.79	8.47
I	金融、保险业	1,687,666,583.24	19.73
J	房地产业	984,678,565.03	11.51
K	社会服务业	133,462,998.10	1.56
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	260,989,610.40	3.05
	合计	7,192,601,000.39	84.07

注：以上行业分类以 2011 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	50,808,741	429,333,861.45	5.02
2	601318	中国平安	8,814,659	425,483,589.93	4.97
3	601601	中国太保	12,061,674	270,060,880.86	3.16
4	600015	华夏银行	21,156,047	229,966,230.89	2.69
5	000401	冀东水泥	7,809,355	195,155,781.45	2.28
6	600000	浦发银行	19,207,540	189,002,193.60	2.21
7	600690	青岛海尔	6,370,545	178,056,732.75	2.08
8	600048	保利地产	15,895,878	174,695,699.22	2.04
9	600036	招商银行	12,969,194	168,858,905.88	1.97
10	601166	兴业银行	12,037,314	162,262,992.72	1.90
11	000001	深发展A	9,010,236	153,804,728.52	1.80
12	000568	泸州老窖	3,040,074	137,168,138.88	1.60
13	600888	新疆众和	5,260,296	127,562,178.00	1.49
14	002344	海宁皮城	5,565,278	121,601,324.30	1.42
15	000792	盐湖股份	2,037,859	120,233,681.00	1.41
16	600887	伊利股份	7,034,050	117,116,932.50	1.37
17	000968	煤气化	4,461,429	113,007,996.57	1.32
18	600785	新华百货	3,957,201	105,578,122.68	1.23
19	600723	首商股份	8,147,693	102,253,547.15	1.20
20	601699	潞安环能	2,958,506	97,068,581.86	1.13
21	600361	华联综超	11,025,304	96,802,169.12	1.13
22	600859	王府井	2,345,726	93,758,668.22	1.10
23	000933	神火股份	6,112,922	92,977,543.62	1.09
24	600537	海通集团	2,520,008	92,282,692.96	1.08
25	600809	山西汾酒	1,309,462	91,727,813.10	1.07
26	000937	冀中能源	3,584,084	90,856,529.40	1.06
27	600383	金地集团	13,787,007	88,374,714.87	1.03
28	600009	上海机场	6,769,663	86,651,686.40	1.01

29	000024	招商地产	3,971,167	72,672,356.10	0.85
30	600790	轻纺城	8,831,860	70,919,835.80	0.83
31	600415	小商品城	5,571,070	68,468,450.30	0.80
32	000848	承德露露	4,272,840	68,194,526.40	0.80
33	000715	中兴商业	6,616,602	67,423,174.38	0.79
34	300070	碧水源	1,653,771	66,150,840.00	0.77
35	000961	中南建设	6,199,945	65,347,420.30	0.76
36	000609	绵世股份	6,078,369	65,220,899.37	0.76
37	002024	苏宁电器	4,906,581	62,853,302.61	0.73
38	600062	双鹤药业	2,378,603	58,965,568.37	0.69
39	600782	新钢股份	8,231,012	57,699,394.12	0.67
40	600395	盘江股份	1,729,690	57,408,411.10	0.67
41	000061	农产品	3,459,183	55,208,560.68	0.65
42	600456	宝钛股份	1,849,620	53,380,033.20	0.62
43	002482	广田股份	1,752,279	52,901,303.01	0.62
44	600970	中材国际	1,874,376	51,226,696.08	0.60
45	601607	上海医药	3,000,000	50,400,000.00	0.59
46	600997	开滦股份	3,070,893	49,011,452.28	0.57
47	600497	驰宏锌锗	2,199,946	48,508,809.30	0.57
48	601169	北京银行	4,820,664	48,062,020.08	0.56
49	002146	荣盛发展	4,833,216	47,365,516.80	0.55
50	002029	七匹狼	1,483,743	47,034,653.10	0.55
51	600631	百联股份	2,999,973	44,639,598.24	0.52
52	002073	软控股份	2,083,460	42,919,276.00	0.50
53	600007	中国国贸	4,458,627	40,484,333.16	0.47
54	601009	南京银行	4,477,708	40,165,040.76	0.47
55	002065	东华软件	1,667,655	39,523,423.50	0.46
56	000858	五粮液	1,094,253	39,086,717.16	0.46
57	002244	滨江集团	3,150,597	38,752,343.10	0.45
58	601668	中国建筑	9,551,870	38,494,036.10	0.45
59	000709	河北钢铁	7,999,910	36,159,593.20	0.42
60	600028	中国石化	4,374,189	35,999,575.47	0.42
61	600066	宇通客车	1,532,251	35,456,288.14	0.41
62	601186	中国铁建	5,835,437	35,304,393.85	0.41
63	600276	恒瑞医药	1,177,575	35,291,922.75	0.41
64	600325	华发股份	3,099,913	34,781,023.86	0.41
65	601866	中海集运	9,451,752	34,404,377.28	0.40
66	601088	中国神华	1,099,985	33,153,547.90	0.39
67	600307	酒钢宏兴	5,819,418	31,890,410.64	0.37
68	000807	云铝股份	2,757,345	29,669,032.20	0.35
69	600795	国电电力	10,000,000	29,600,000.00	0.35
70	601618	中国中冶	7,399,989	29,155,956.66	0.34
71	000423	东阿阿胶	699,925	28,878,905.50	0.34
72	600150	中国船舶	375,080	27,752,169.20	0.32
73	000629	攀钢钒钛	2,499,968	27,674,645.76	0.32
74	000069	华侨城 A	3,391,634	26,827,824.94	0.31
75	600050	中国联通	5,000,000	26,250,000.00	0.31
76	002008	大族激光	2,099,925	26,207,064.00	0.31
77	600739	辽宁成大	919,093	25,550,785.40	0.30

78	600660	福耀玻璃	2,362,869	24,479,322.84	0.29
79	600600	青岛啤酒	710,841	24,268,111.74	0.28
80	601799	星宇股份	1,223,943	22,875,494.67	0.27
81	002152	广电运通	730,839	22,531,766.37	0.26
82	601006	大秦铁路	2,676,543	21,920,887.17	0.26
83	600079	人福医药	987,348	21,780,896.88	0.25
84	600327	大东方	2,299,856	21,526,652.16	0.25
85	601179	中国西电	3,518,927	21,465,454.70	0.25
86	002003	伟星股份	1,236,154	20,656,133.34	0.24
87	002167	东方锆业	499,990	19,844,603.10	0.23
88	300080	新大新材	449,905	19,750,829.50	0.23
89	600096	云天化	962,701	19,148,122.89	0.22
90	000060	中金岭南	1,437,654	19,120,798.20	0.22
91	600582	天地科技	855,089	18,931,670.46	0.22
92	600125	铁龙物流	1,716,896	18,096,083.84	0.21
93	002092	中泰化学	1,338,224	17,557,498.88	0.21
94	600588	用友软件	839,251	17,338,925.66	0.20
95	600521	华海药业	1,199,917	17,014,823.06	0.20
96	300005	探路者	1,020,198	16,119,128.40	0.19
97	601933	永辉超市	647,049	15,652,115.31	0.18
98	002155	辰州矿业	477,594	15,612,547.86	0.18
99	000650	仁和药业	1,091,992	15,539,046.16	0.18
100	000698	沈阳化工	1,588,228	15,008,754.60	0.18
101	002001	新 和 成	500,000	14,725,000.00	0.17
102	000651	格力电器	600,000	14,100,000.00	0.16
103	002559	亚威股份	477,514	14,081,887.86	0.16
104	600315	上海家化	393,776	14,018,425.60	0.16
105	002082	栋梁新材	999,960	13,979,440.80	0.16
106	002261	拓维信息	716,267	12,799,691.29	0.15
107	600064	南京高科	919,143	12,730,130.55	0.15
108	000825	太钢不锈	2,455,584	12,646,257.60	0.15
109	000729	燕京啤酒	733,840	12,453,264.80	0.15
110	600748	上实发展	1,575,220	11,404,592.80	0.13
111	600312	平高电气	962,265	9,766,989.75	0.11
112	600867	通化东宝	1,156,803	9,694,009.14	0.11
113	600216	浙江医药	299,924	9,414,614.36	0.11
114	600639	浦东金桥	970,657	9,347,426.91	0.11
115	000028	一致药业	299,927	7,744,115.14	0.09
116	002563	森马服饰	99,950	4,816,590.50	0.06
117	002243	通产丽星	250,000	3,547,500.00	0.04
118	600697	欧亚集团	100,000	2,780,000.00	0.03
119	600998	九州通	178,068	2,199,139.80	0.03
120	000400	许继电气	62,142	1,914,595.02	0.02
121	601126	四方股份	59,361	1,088,087.13	0.01
122	300057	万顺股份	80,902	910,147.50	0.01

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600009	上海机场	126,357,988.90	1.29
2	600123	兰花科创	114,695,062.79	1.17
3	600785	新华百货	113,720,368.83	1.16
4	000933	神火股份	104,282,983.78	1.07
5	600383	金地集团	100,961,494.43	1.03
6	600537	海通集团	98,086,119.37	1.00
7	000848	承德露露	88,890,362.66	0.91
8	000568	泸州老窖	84,243,261.82	0.86
9	600887	伊利股份	79,178,561.17	0.81
10	000609	绵世股份	70,176,891.85	0.72
11	601699	潞安环能	69,326,295.42	0.71
12	002024	苏宁电器	69,319,296.20	0.71
13	000400	许继电气	67,609,831.76	0.69
14	601607	上海医药	64,418,162.27	0.66
15	300070	碧水源	63,150,180.41	0.65
16	600062	双鹤药业	60,675,994.07	0.62
17	002482	广田股份	57,973,999.94	0.59
18	600456	宝钛股份	57,531,024.20	0.59
19	600325	华发股份	57,065,808.92	0.58
20	601866	中海集运	56,067,503.44	0.57

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

**7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600585	海螺水泥	500,096,806.69	5.11
2	600096	云天化	261,897,217.33	2.68
3	000401	冀东水泥	242,248,502.39	2.48
4	000002	万科 A	167,044,093.53	1.71
5	601318	中国平安	161,820,166.86	1.65
6	000937	冀中能源	157,334,610.18	1.61
7	601111	中国国航	149,959,560.59	1.53
8	600123	兰花科创	144,985,784.67	1.48
9	601088	中国神华	126,913,539.53	1.30
10	600036	招商银行	113,664,327.72	1.16
11	600048	保利地产	112,680,225.39	1.15
12	600029	南方航空	109,403,000.51	1.12
13	000630	铜陵有色	108,475,391.38	1.11
14	601808	中海油服	97,702,585.68	1.00
15	600582	天地科技	94,050,690.41	0.96
16	002269	美邦服饰	88,364,847.46	0.90
17	000001	深发展 A	84,613,021.72	0.87
18	601117	中国化学	76,328,106.89	0.78
19	601601	中国太保	75,950,930.25	0.78
20	600362	江西铜业	72,294,347.04	0.74

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 7.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	3,386,229,204.19
卖出股票收入（成交）总额	4,445,284,340.38

注：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（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,210,380.00	0.03
2	央行票据	493,565,000.00	5.77
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	723,470,114.95	8.46
8	其他	-	-
9	合计	1,219,245,494.95	14.25

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	2,634,050	278,102,999.00	3.25
2	1101025	11 央行票据 25	2,500,000	248,100,000.00	2.90
3	125709	唐钢转债	1,541,111	170,229,579.95	1.99
4	1101023	11 央行票据 23	1,500,000	148,875,000.00	1.74
5	110003	新钢转债	1,261,680	145,976,376.00	1.71

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 投资组合报告附注

**7.9.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.9.2** 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,348,777.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,574,099.61
4	应收利息	6,436,585.50
5	应收申购款	61,245.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,420,707.71

**7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	278,102,999.00	3.25
2	125709	唐钢转债	170,229,579.95	1.99
3	110003	新钢转债	145,976,376.00	1.71

**7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末持有的前十名股票未存在流通受限情况。

**§8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
381,100	25,179.63	26,532,318.90	0.28%	9,569,426,530.97	99.72%

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况**

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	91,457.13	0.00%

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2007年3月1日)基金份额总额	9,658,655,708.23
本报告期期初基金份额总额	10,493,043,984.24
本报告期基金总申购份额	213,799,551.66
减：本报告期基金总赎回份额	1,110,884,686.03
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	9,595,958,849.87
-------------	------------------

注：上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	1,658,776,105.66	21.18%	1,368,846.57	21.42%	-
长江证券	1	1,253,372,217.18	16.00%	1,029,531.73	16.11%	-
中信证券	1	1,188,917,789.47	15.18%	966,004.68	15.12%	-

国开 证券	1	1,139,323,891.29	14.55%	924,407.66	14.46%	-
华泰 联合 证券	1	940,014,739.15	12.00%	763,764.33	11.95%	-
申银 万国 证券	1	840,314,140.95	10.73%	679,535.79	10.63%	-
渤海 证券	1	686,848,448.84	8.77%	558,068.65	8.73%	-
华宝 证券	1	123,946,212.03	1.58%	100,706.37	1.58%	新增
中银 证券	1	-	-	-	-	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-
中信 万通	1	-	-	-	-	-
国信 证券	1	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	-	-	-	-	-
建银 投资 证券	1	-	-	-	-	-
长城 证券	2	-	-	-	-	-
银河 证券	1	-	-	-	-	-
国元 证券	1	-	-	-	-	-
东方 证券	1	-	-	-	-	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
财富 证券	1	-	-	-	-	-
国泰 君安 证券	1	-	-	-	-	-
上海 证券	1	-	-	-	-	-
兴业 证券	1	-	-	-	-	-
招商 证券	1	-	-	-	-	-
安信 证券	1	-	-	-	-	-
宏源	1	-	-	-	-	新增

证券						
东兴 证券	1	-	-	-	-	新增

注：1、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的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、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，交易设施满足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、全面的研究，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。

2、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。

3、本期内，新增的提供交易单元的券商为华宝证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司和东兴证券股份有限公司。以上券商各增加一个交易单元。本报告期内无剔除交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商 名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通 证券	163,706,616.70	87.58%	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-
中信 证券	3,451,920.00	1.85%	-	-	-	-
国开 证券	-	-	-	-	-	-
华泰 联合 证券	19,767,148.60	10.57%	-	-	-	-
申银 万国 证券	-	-	-	-	-	-
渤海 证券	-	-	-	-	-	-
华宝	-	-	-	-	-	-

证券						
中银证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
建银投资证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行及手机银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-28
2	关于开通建设银行借记卡基金网上交易业务并实施费率优惠的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-28

3	建信基金管理有限责任公司关于公司股权变更等相关事项的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-09
4	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	指定报刊和/或公司网站	2011-05-28
5	建信基金管理有限责任公司关于建信优化配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-05-13
6	关于旗下部分开放式基金通过中信证券开通基金转换业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-05-05
7	关于旗下开放式基金通过中信证券开办基金定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-05-05
8	关于新增民生证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-04-21
9	关于参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-30
10	关于通过海通证券开办旗下部分开放式基金定投业务暨参加海通证券定投申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-29
11	建信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的双汇发展估值方法变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-23
12	关于建信优选成长股票型基金、建信优化配置混合型基金业绩比较基准指数更名及修订基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-15
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之间发生的关联交易的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-09
14	关于旗下部分开放式基金参加光大证券网上交易系统定投申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-07
15	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊和/或公司网站	2011-01-25
16	关于旗下部分开放式基金通过信达证券开通基金转换业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-01-14

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信优化配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信优化配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信优化配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

## 11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

## 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

二〇一一年八月二十四日