

建信优化配置混合型证券投资基金 2014 年半年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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 2014 年 8 月 21 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、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息	43

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	48
§11 备查文件目录.....	48
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	48

§ 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
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	6,922,228,901.78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股个券选择这一微观层面优化投资组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准： $60\% \times$ 富时中国 A600 指数 $+40\% \times$ 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	杨文升	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	http://www.ccbfund.cn
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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	299,236,105.70
本期利润	-41,692,672.84
加权平均基金份额本期利润	-0.0058
本期加权平均净值利润率	-0.67%
本期基金份额净值增长率	-0.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-924,858,545.11
期末可供分配基金份额利润	-0.1336
期末基金资产净值	5,997,370,356.67
期末基金份额净值	0.8664
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	28.02%

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

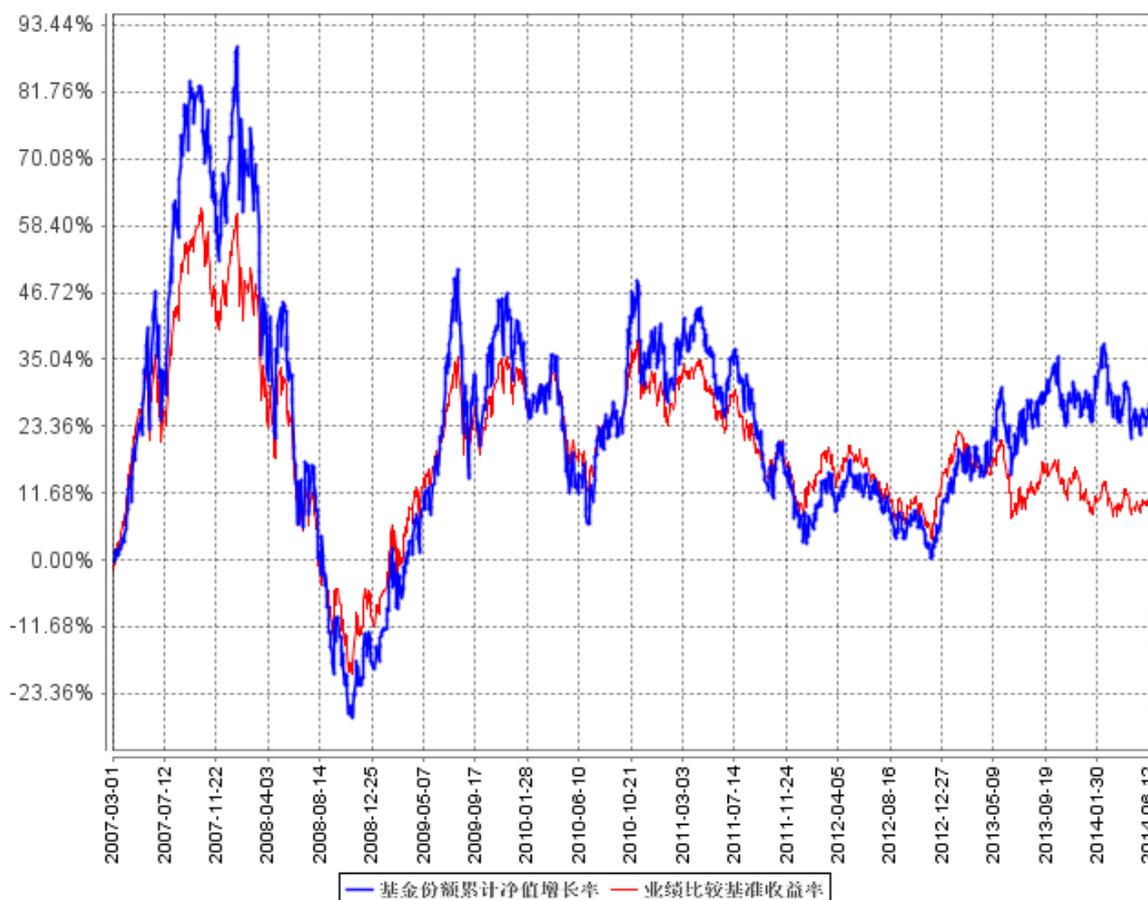
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.31%	0.71%	0.76%	0.48%	1.55%	0.23%
过去三个月	3.23%	0.86%	2.09%	0.53%	1.14%	0.33%
过去六个月	-0.70%	1.10%	-1.19%	0.62%	0.49%	0.48%
过去一年	8.04%	1.11%	2.07%	0.70%	5.97%	0.41%
过去三年	-2.83%	1.07%	-12.53%	0.78%	9.70%	0.29%
自基金合同生效起至今	28.02%	1.59%	10.93%	1.13%	17.09%	0.46%

注：本基金业绩比较基准： $60\% \times \text{富时中国 A600 指数} + 40\% \times \text{中国债券总指数}$ 。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 指数由新华富时指数公司发布，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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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，设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。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、持续领先的综合性、专业化资产管理公司”。

截至 2014 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、建信优选成长股票型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）、建信创新中国股票型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、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、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇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、建信全球资源股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金和建信货币市场基金，共计 42 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 551.21 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔林建	本基金的基金经理	2013 年 1 月 5 日	2014 年 3 月 6 日	12	硕士。 2002 年 6 月起就职于新华人寿保险公司，历任研究员、

					<p>投资经理；2006年6月起就职于新华资产管理公司，任高级投资经理。2008年2月加入我公司，历任高级投资经理、资深投资经理、基金经理助理，2013年1月5日至2014年3月6日任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理；2013年9月24日起任建信创新中国股票型证券投资基金基金经理；2013年11月13日起任建信核心精选基金经理。</p>
陶灿	本基金的基金经理	2011年7月11日	-	7	<p>硕士。2007年7月加入本公司，从事行业研究，历任研究员、</p>

					<p>基金经理助理。</p> <p>2011年7月11日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理；2014年5月14日起任建信改革红利股票型证券投资基金基金经理。</p>
马志强	本基金的基金经理	2013年11月13日	-	10	<p>博士。曾就职于东北证券公司、北京高汇投资管理有限公司、北京蓝巢投资有限公司，2004年11月起就职于天弘基金管理有限公司，2008年12月2日至2011年3月23日任天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理。2011年3月加入本公司，2011年8月2</p>

					日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理；2013年11月13日起任建信优化配置基金经理。
--	--	--	--	--	---

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 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。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

2014 年上半年期间，市场整体走势较弱，创业板表现相对较好，总体上延续了 13 年的风格，但在局部上，也出现较明显的变化，特别是白马成长股，在业绩预期较为稳定情况下，14 年上半年估值出现较大幅度的收缩。宏观经济增长经历了不平静的上半年，微刺激政策的出台，较有力地稳住了经济增速，同时流动性的实质性宽松也有效降低了市场利率，资本市场从宏观层面获得正向支撑，尤其是债券市场及其明显，但我们也看到上市公司盈利增速总体上下滑，对股票表现有较强压制。

本基金在上半年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，从中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 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-0.7%，波动率 1.1%，业绩比较基准收益率-1.19%，波动率 0.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，系列“微刺激”政策的落地实施，预计将一定程度上稳住经济增速，宏观经济层面对资本市场的影响将呈现中性偏正面的态势，但我们也需留意企业盈利依然在下半年面临较大的困境，上市公司中报压力依然存在，市场的机会更多来自于主题投资、以及中观层面景气上行行业。本基金将在综合考量成长确定性、估值合理性的基础上聚焦投资，同时在估值极度压缩的旧周期行业，寻求政策、流动性带来的阶段机会，积极为投资者创造超额回报。

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适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。

公司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

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，本基金本报告期未达到利润分配条件，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

本报告期内，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

本报告期内，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、准确和完整发表意见

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 2014 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。

§ 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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	514,107,675.98	822,267,946.49
结算备付金		5,329,709.87	12,880,398.44
存出保证金		2,186,349.30	2,334,574.09
交易性金融资产	6.4.7.2	4,695,942,799.27	5,354,831,798.50
其中：股票投资		4,695,942,799.27	5,282,499,176.50
基金投资		-	-
债券投资		-	72,332,622.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	500,000,450.00	436,180,774.53
应收证券清算款		311,065,790.33	-
应收利息	6.4.7.5	262,052.75	693,949.42
应收股利		-	-
应收申购款		107,184.00	428,069.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,029,002,011.50	6,629,617,510.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	26,370,849.62

应付赎回款		8,898,242.24	7,312,934.85
应付管理人报酬		7,317,073.14	8,343,902.75
应付托管费		1,219,512.18	1,390,650.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	13,226,210.64	21,037,162.57
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	970,616.63	1,491,033.92
负债合计		31,631,654.83	65,946,534.17
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	6,922,228,901.78	7,522,589,554.93
未分配利润	6.4.7.10	-924,858,545.11	-958,918,578.19
所有者权益合计		5,997,370,356.67	6,563,670,976.74
负债和所有者权益总计		6,029,002,011.50	6,629,617,510.91

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8664 元，基金份额总额 6,922,228,901.78 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		30,463,423.40	568,294,199.18
1.利息收入		5,765,063.84	8,037,056.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,778,015.84	4,540,814.71
债券利息收入		317,295.86	1,514,808.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		669,752.14	1,981,433.73
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		365,587,639.60	454,960,981.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	333,413,182.59	421,419,933.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	567,373.01	-6,595,928.28
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	31,607,084.00	40,136,976.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.17	-340,928,778.54	105,253,852.75

号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	39,498.50	42,308.35
减:二、费用		72,156,096.24	90,632,765.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	46,373,399.24	50,808,848.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,728,899.86	8,468,141.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	17,799,862.64	31,108,582.37
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	253,934.50	247,193.92
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-41,692,672.84	477,661,433.25
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-41,692,672.84	477,661,433.25

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: 2014年1月1日至2014年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	7,522,589,554.93	-958,918,578.19	6,563,670,976.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-41,692,672.84	-41,692,672.84
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)	-600,360,653.15	75,752,705.92	-524,607,947.23
其中: 1.基金申购款	55,093,490.16	-7,256,507.22	47,836,982.94
2. 基金赎回款	-655,454,143.31	83,009,213.14	-572,444,930.17
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	6,922,228,901.78	-924,858,545.11	5,997,370,356.67

项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	8,776,172,978.59	-2,211,333,124.74	6,564,839,853.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	477,661,433.25	477,661,433.25
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)	-530,327,960.02	100,275,797.28	-430,052,162.74
其中：1.基金申购款	56,018,955.62	-11,077,087.75	44,941,867.87
2.基金赎回款	-586,346,915.64	111,352,885.03	-474,994,030.61
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)	8,245,845,018.57	-1,633,395,894.21	6,612,449,124.36

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：

孙志晨

何斌

秦绪华

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

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。

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 A600 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”）、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《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》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 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[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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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
	2014 年 6 月 30 日
活期存款	514,107,675.98
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	514,107,675.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,278,705,493.05	4,695,942,799.27	417,237,306.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	4,278,705,493.05	4,695,942,799.27	417,237,306.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无

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

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	500,000,450.00	-
合计	500,000,450.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	219,394.52
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	2,398.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	39,276.03
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	983.80
合计	262,052.75

6.4.7.6 其他资产

无

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	13,224,605.04
银行间市场应付交易费用	1,605.60
合计	13,226,210.64

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	1,911.13
预提费用	468,705.50
合计	970,616.63

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,522,589,554.93	7,522,589,554.93
本期申购	55,093,490.16	55,093,490.16
本期赎回(以“-”号填列)	-655,454,143.31	-655,454,143.31
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	6,922,228,901.78	6,922,228,901.78

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	-1,089,219,406.23	130,300,828.04	-958,918,578.19
本期利润	299,236,105.70	-340,928,778.54	-41,692,672.84
本期基金份额交易产生的变动数	71,352,360.15	4,400,345.77	75,752,705.92
其中：基金申购款	-6,671,931.10	-584,576.12	-7,256,507.22
基金赎回款	78,024,291.25	4,984,921.89	83,009,213.14
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-718,630,940.38	-206,227,604.73	-924,858,545.11
-----	-----------------	-----------------	-----------------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	4,675,172.47
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	83,532.81
其他	19,310.56
合计	4,778,015.84

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	6,086,054,394.86
减：卖出股票成本总额	5,752,641,212.27
买卖股票差价收入	333,413,182.59

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	107,825,230.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	106,542,301.08
减：应收利息总额	715,556.61
债券投资收益	567,373.01

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

无

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	31,607,084.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	31,607,084.00

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-340,928,778.54
——股票投资	-344,240,572.68
——债券投资	3,311,794.14
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-340,928,778.54

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	38,499.29
转换费收入	999.21
合计	39,498.50

注：1、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。

2、本基金在转出时收取的转换费由本基金赎回费和适用情况下的申购补差费构成，其中赎回费部分的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	17,799,862.64
银行间市场交易费用	-
合计	17,799,862.64

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	68,432.48
信息披露费	148,768.56
其他费用	18,400.00
银行费用	18,333.46
合计	253,934.50

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本报告期末未存在或有事项。

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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

6.4.10.1.1 股票交易

无

6.4.10.1.2 权证交易

无

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无

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 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	46,373,399.24	50,808,848.27
其中：支付销售机构的客户维护费	7,212,858.02	7,893,299.06

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，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,728,899.86	8,468,141.37

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无

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

无

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

无

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

无

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		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	2013年1月1日至2013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	514,107,675.98	4,675,172.47	1,493,307,398.24	4,363,635.75

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况**

无

6.4.12 期末（2014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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002727	一心堂	2014年6月25日	2014年7月2日	新股流通受限	12.20	12.20	34,975	426,695.00	426,695.00	-
603168	沙普爱思	2014年6月24日	2014年7月2日	新股流通受限	21.85	21.85	9,892	216,140.20	216,140.20	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无

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、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和
控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会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，并由独立于公司管理层和其他业务部门的

督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构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。在定期存款和银行间同业市场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产品投资流程，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。

本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的如附注 6.4.13.4.3.1 所示，与债券投资相关的信用风险不重大（上年末：同）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 6.4.12 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，其余均能以合理价格适时变现。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资产的公允价值。

除 6.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他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，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资和买入返售金融资产等，本基金的基金管理人每日通过影子价格对本基金面临的市场风险进行监控，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利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年6 月 30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	514,107,675.98	-	-	-	514,107,675.98
结算备付金	5,329,709.87	-	-	-	5,329,709.87
存出保证金	2,186,349.30	-	-	-	2,186,349.30
交易性金	-	-	-	4,695,942,799.27	4,695,942,799.27

融 资 产					
衍 生 金 融 资 产		-	-	-	-
买 入 返 售 金 融 资 产	500,000,450.00		-	-	500,000,450.00
应 收 证 券 清 算 款		-	-	311,065,790.33	311,065,790.33
应 收 利 息		-	-	262,052.75	262,052.75
应 收 股 利		-	-	-	-
应 收 申 购 款		-	-	107,184.00	107,184.00
其 他 资 产		-	-	-	-
资 产 总 计	1,021,624,185.15		-	5,007,377,826.35	6,029,002,011.50
负 债					
卖 出 回 购 金 融 资 产 款		-	-	-	-
短 期 借 款		-	-	-	-
交 易 性 金 融 负 债		-	-	-	-
衍 生 金 融 负 债		-	-	-	-
应 付 证 券 清 算 款		-	-	-	-
应 付		-	-	8,898,242.24	8,898,242.24

赎回款					
应付管理人报酬	-	-	-	7,317,073.14	7,317,073.14
应付托管费	-	-	-	1,219,512.18	1,219,512.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	13,226,210.64	13,226,210.64
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	970,616.63	970,616.63
负债总计	-	-	-	31,631,654.83	31,631,654.83
利率敏感度缺口	1,021,624,185.15	-	-	-4,975,746,171.52	5,997,370,356.67
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	822,267,946.49	-	-	-	822,267,946.49
结算备付金	12,880,398.44	-	-	-	12,880,398.44

存出保证金	2,334,574.09	-	-	-	2,334,574.09
交易性金融资产	-	68,204,097.60	4,128,524.40	5,282,499,176.50	5,354,831,798.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	436,180,774.53	-	-	-	436,180,774.53
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	693,949.42	693,949.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	428,069.44	428,069.44
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,273,663,693.55	68,204,097.60	4,128,524.40	5,283,621,195.36	6,629,617,510.91
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-

应付 证券 清算 款	-	-	-	26,370,849.62	26,370,849.62
应付 赎回 款	-	-	-	7,312,934.85	7,312,934.85
应付 管理 人报 酬	-	-	-	8,343,902.75	8,343,902.75
应付 托管 费	-	-	-	1,390,650.46	1,390,650.46
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-
应付 交易 费用	-	-	-	21,037,162.57	21,037,162.57
应交 税费	-	-	-	-	-
应付 利息	-	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	1,491,033.92	1,491,033.92
负债 总计	-	-	-	65,946,534.17	65,946,534.17
利率 敏感 度缺 口	1,273,663,693.55	68,204,097.60	4,128,524.40	5,217,674,661.19	6,563,670,976.74

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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，持有现金及投资于在一年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，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	4,695,942,799.27	78.30	5,282,499,176.50	80.48
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	72,332,622.00	1.10
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	4,695,942,799.27	78.30	5,354,831,798.50	81.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	393,457,175.68	403,665,765.07
	业绩比较基准下降 5%	-393,457,175.68	-403,665,765.07

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无

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

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2014 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 4,695,942,799.27 元，无属于第二层级的余额，无属于第三层级的余额(2013 年 6 月 30 日：第一层级 4,802,998,943.51 元，第二层级 130,269,279.17 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票

的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	4,695,942,799.27	77.89
	其中：股票	4,695,942,799.27	77.89
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	500,000,450.00	8.29
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	519,437,385.85	8.62
7	其他各项资产	313,621,376.38	5.20
8	合计	6,029,002,011.50	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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	532,453,782.52	8.88
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,480,591,340.37	41.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,352,095.35	0.84
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	154,436,642.57	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	74,425,442.04	1.24

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	232,180,819.40	3.87
J	金融业	289,717,674.75	4.83
K	房地产业	427,260,728.10	7.12
L	租赁和商务服务业	97,910,439.10	1.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	121,038,442.08	2.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	70,026,931.22	1.17
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	165,548,461.77	2.76
S	综合	-	-
	合计	4,695,942,799.27	78.30

注：以上行业分类以 2014 年 6 月 30 日的中国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	600570	恒生电子	7,625,764	224,197,461.60	3.74
2	600887	伊利股份	6,341,485	210,029,983.20	3.50
3	300202	聚龙股份	7,425,886	207,627,772.56	3.46
4	000998	隆平高科	6,774,287	186,157,406.76	3.10
5	000002	万科A	22,085,767	182,649,293.09	3.05
6	600340	华夏幸福	6,937,163	174,608,392.71	2.91
7	600109	国金证券	8,039,503	159,744,924.61	2.66
8	601766	中国南车	33,770,300	151,966,350.00	2.53
9	002299	圣农发展	11,073,049	128,336,637.91	2.14
10	002714	牧原股份	2,835,609	124,908,576.45	2.08
11	002437	誉衡药业	2,319,562	119,457,443.00	1.99
12	002456	欧菲光	5,267,550	112,883,596.50	1.88
13	603008	喜临门	12,056,809	112,610,596.06	1.88
14	300303	聚飞光电	6,002,073	110,378,122.47	1.84
15	002008	大族激光	6,191,851	107,366,696.34	1.79
16	300058	蓝色光标	3,689,165	97,910,439.10	1.63
17	002477	雏鹰农牧	9,888,540	93,051,161.40	1.55

18	600196	复星医药	4,344,722	87,719,937.18	1.46
19	600594	益佰制药	2,076,858	85,421,169.54	1.42
20	300133	华策影视	2,612,459	83,468,065.05	1.39
21	601098	中南传媒	5,684,238	82,080,396.72	1.37
22	600535	天士力	2,095,156	81,229,198.12	1.35
23	000069	华侨城 A	16,948,257	79,487,325.33	1.33
24	000001	平安银行	7,972,110	79,003,610.10	1.32
25	600872	中炬高新	7,367,278	78,608,856.26	1.31
26	600422	昆明制药	3,679,546	77,307,261.46	1.29
27	600587	新华医疗	1,034,286	77,106,021.30	1.29
28	000876	新希望	6,784,122	76,592,737.38	1.28
29	000400	许继电气	3,761,574	75,419,558.70	1.26
30	600787	中储股份	5,694,372	74,425,442.04	1.24
31	600661	新南洋	2,638,543	70,026,931.22	1.17
32	600185	格力地产	8,353,585	70,003,042.30	1.17
33	002304	洋河股份	1,276,851	64,800,188.25	1.08
34	600976	武汉健民	3,223,616	64,407,847.68	1.07
35	002241	歌尔声学	2,398,900	63,954,674.00	1.07
36	600858	银座股份	8,687,241	60,897,559.41	1.02
37	600519	贵州茅台	403,824	57,334,931.52	0.96
38	600702	沱牌舍得	5,437,345	56,929,002.15	0.95
39	600195	中牧股份	4,275,665	55,626,401.65	0.93
40	600201	金宇集团	1,671,572	52,019,320.64	0.87
41	601318	中国平安	1,295,606	50,969,140.04	0.85
42	600323	瀚蓝环境	3,918,451	50,352,095.35	0.84
43	002584	西陇化工	2,939,256	45,705,430.80	0.76
44	002111	威海广泰	2,952,296	45,022,514.00	0.75
45	600261	阳光照明	4,535,395	44,809,702.60	0.75
46	300070	碧水源	1,420,551	41,551,116.75	0.69
47	002157	正邦科技	5,531,728	40,879,469.92	0.68
48	001696	宗申动力	8,359,491	37,868,494.23	0.63
49	000651	格力电器	1,260,716	37,128,086.20	0.62
50	002202	金风科技	3,733,588	35,431,750.12	0.59
51	000516	开元投资	4,271,509	28,704,540.48	0.48
52	601218	吉鑫科技	4,526,030	26,703,577.00	0.45
53	600217	秦岭水泥	3,631,152	22,404,207.84	0.37
54	600312	平高电气	1,551,319	21,625,386.86	0.36
55	300017	网宿科技	125,131	7,983,357.80	0.13
56	002727	一心堂	34,975	426,695.00	0.01

57	300385	雪浪环境	15,852	406,762.32	0.01
58	603168	沙普爱思	9,892	216,140.20	0.00

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	000002	万科A	252,827,511.97	3.85
2	002456	欧菲光	152,255,179.32	2.32
3	601766	中国南车	146,347,756.22	2.23
4	002202	金风科技	128,441,830.22	1.96
5	002299	圣农发展	114,748,035.29	1.75
6	600150	中国船舶	109,742,108.40	1.67
7	002714	牧原股份	109,593,980.52	1.67
8	600028	中国石化	108,972,214.87	1.66
9	600109	国金证券	106,994,911.65	1.63
10	600271	航天信息	105,618,268.00	1.61
11	601318	中国平安	99,478,409.50	1.52
12	601099	太平洋	99,065,431.13	1.51
13	002477	雏鹰农牧	94,861,485.09	1.45
14	600340	华夏幸福	92,459,813.58	1.41
15	600585	海螺水泥	90,485,835.61	1.38
16	600787	中储股份	87,761,507.78	1.34
17	000400	许继电气	87,496,234.98	1.33
18	600519	贵州茅台	86,645,995.05	1.32
19	300133	华策影视	86,087,111.42	1.31
20	000876	新希望	85,371,525.35	1.30

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	601318	中国平安	185,303,446.56	2.82

2	002344	海宁皮城	152,440,372.37	2.32
3	600699	均胜电子	148,840,950.41	2.27
4	000541	佛山照明	147,877,896.52	2.25
5	300070	碧水源	136,841,898.55	2.08
6	000625	长安汽车	119,792,876.50	1.83
7	600703	三安光电	108,622,241.40	1.65
8	600893	航空动力	105,875,750.05	1.61
9	002429	兆驰股份	101,176,283.42	1.54
10	600028	中国石化	100,945,706.29	1.54
11	600271	航天信息	99,505,843.77	1.52
12	000997	新大陆	95,570,570.42	1.46
13	600150	中国船舶	95,122,020.71	1.45
14	002202	金风科技	94,850,565.03	1.45
15	000413	东旭光电	94,837,422.98	1.44
16	002604	龙力生物	94,206,544.80	1.44
17	600585	海螺水泥	86,686,900.51	1.32
18	600637	百视通	85,018,478.20	1.30
19	601099	太平洋	84,337,114.32	1.28
20	002104	恒宝股份	83,764,351.25	1.28

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	5,510,325,407.72
卖出股票收入（成交）总额	6,086,054,394.86

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

无

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

无

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	2,186,349.30
2	应收证券清算款	311,065,790.33
3	应收股利	-
4	应收利息	262,052.75
5	应收申购款	107,184.00
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	313,621,376.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

§ 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
277,470	24,947.67	4,358,393.81	0.06%	6,917,870,507.97	99.94%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	16,603.24	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 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	7,522,589,554.93
本报告期基金总申购份额	55,093,490.16
减：本报告期基金总赎回份额	655,454,143.31
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	6,922,228,901.78

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

我公司于 2014 年 3 月 21 日召开 2014 年度第一次临时股东会，会议决定请解聘江先周先生董事职务、解聘罗中涛女士监事职务，并聘任杨文升先生为董事、聘任张涛女士为公司监事。2014 年 3 月 21 日公司召开第三届董事会第六次会议，会议决定选举杨文升先生为公司董事长，公司分别于 2014 年 3 月 27 日和 2014 年 6 月 21 日在指定媒体和公司网站公开披露了原董事长的离任公告和现董事长的任职公告。上述事项符合《证券投资基金管理公司管理办法》的相关规定，并已在中国证监会备案。公司已于 2014 年 7 月 7 日完成公司法定代表人变更手续，杨文升先生为法定代表人。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

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稽查或处罚等情况

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	
东方证券	3	1,626,958,476.99	14.07%	1,440,904.08	13.86%	-
东北证券	2	1,599,431,744.58	13.83%	1,435,363.62	13.81%	-
宏源证券	2	954,874,651.39	8.26%	869,319.77	8.36%	-
渤海证券	1	924,866,813.14	8.00%	842,000.38	8.10%	-
中信证券	1	724,091,585.79	6.26%	659,215.18	6.34%	-
广发证券	1	695,701,281.85	6.02%	620,681.64	5.97%	-
平安证券	1	608,669,806.84	5.26%	554,132.45	5.33%	-
中投证券	2	604,435,839.26	5.23%	538,055.61	5.18%	-
申银万国	1	523,055,200.20	4.52%	464,724.69	4.47%	-
招商证券	1	516,376,858.17	4.46%	470,109.98	4.52%	-
长城证券	3	475,412,427.33	4.11%	427,965.63	4.12%	-
广州证券	1	390,657,939.03	3.38%	347,434.50	3.34%	-
联合证券	1	318,854,897.63	2.76%	290,285.80	2.79%	-
海通证券	2	298,526,661.53	2.58%	261,964.23	2.52%	-
民生证券	1	268,989,142.25	2.33%	244,887.40	2.36%	-
兴业证券	1	266,374,578.16	2.30%	242,507.82	2.33%	-
长江证券	1	249,971,344.97	2.16%	223,096.73	2.15%	-
川财证券	1	244,517,961.84	2.11%	214,247.99	2.06%	-
上海证券	2	223,946,395.50	1.94%	200,564.52	1.93%	-
中航证券	1	50,333,798.65	0.44%	45,823.61	0.44%	-

中信证券(山东)	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

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、本报告期内新增中航证券、宏源证券各一个交易单元，无剔除交易单元；

4、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
东方证券	63,036,864.88	58.75%	-	-	-	-
东北证券	-	-	300,000,000.00	100.00%	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	5,932,536.44	5.53%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	33,218,305.00	30.96%	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	5,115,600.00	4.77%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(山 东)	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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	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	2014年3月7日
2	2013年第四季度基金产品风险评价结果	指定报刊和/或公司网站	2014年2月18日
3	2013年第三季度基金产品风险评价结果	指定报刊和/或公司网站	2014年2月18日

§ 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
2014年8月25日