

---

# 建信全球机遇股票型证券投资基金

## 2012 年半年度报告

2012 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：二〇一二年八月二十八日

## §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 2012 年 8 月 24 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 2012 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
§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 境外投资顾问和境外资产托管人.....	4
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 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.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	33
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	33
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	34
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	56
7.7 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.....	56
7.8 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.....	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	56
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	56
7.11 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58

---

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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等情况 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	62
§11 备查文件目录.....	63
11.1 备查文件目录.....	63
11.2 存放地点.....	63
11.3 查阅方式.....	63

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信全球机遇股票型证券投资基金
基金简称	建信全球机遇股票（QDII）
基金主代码	539001
交易代码	539001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月14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	311,019,771.96份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过全球化的资产配置和组合管理，在分散和控制投资风险的同时追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的资产配置与“自下而上”的证券选择相结合、定量研究与定性研究相结合、组合构建与风险控制相结合的投资策略进行投资组合的构建
业绩比较基准	标准普尔全球BMI市场指数总收益率（S&P Global BMI）×70%+标准普尔BMI中国（除A、B股）指数总收益率（S&P BMI China ex-A-B-Shares）×30%
风险收益特征	本基金是全球股票型基金，其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。

### 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	100032
法定代表人		江先周	姜建清

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Principal Global Investors. LLC.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	信安环球投资有限公司	布朗兄弟哈里曼银行

注册地址	801 Grand Avenue, Des Moines	140 Broadway New York
办公地址	801 Grand Avenue, Des Moines	140 Broadway New York
邮政编码	IA 50392-0490	NY10005

## 2.5 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。	

## 2.6 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（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	211,153.98
本期利润	14,290,352.33
加权平均基金份额本期利润	0.0440
本期加权平均净值利润率	5.14%
本期基金份额净值增长率	5.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-50,312,596.83
期末可供分配基金份额利润	-0.1618
期末基金资产净值	260,707,175.13
期末基金份额净值	0.838
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-16.20%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、汇兑损益、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、上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、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）。

### 3.2 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	2.57%	1.07%	3.58%	1.16%	-1.01%	-0.09%
过去三个月	-4.12%	0.94%	-5.18%	1.01%	1.06%	-0.07%
过去六个月	5.14%	0.83%	6.31%	0.89%	-1.17%	-0.06%
过去一年	-14.40%	1.15%	-11.56%	1.32%	-2.84%	-0.17%
成立至今	-16.20%	0.99%	-2.97%	1.12%	-13.23%	-0.13%

注：：1、本基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，截至报告日未满三年。

2、本基金的业绩比较基准为：标准普尔全球 BMI 市场指数总收益率（S&P Global BMI） $\times$ 70%+标准普尔 BMI 中国（除 A、B 股）指数总收益率（S&P BMI China ex-A-B-Shares） $\times$ 30%。

标准普尔全球市场指数（S&P Global BMI）是市场中首只采用自由流通市值进行加权的全市场指数。该指数覆盖全球 47 个市场的 12,000 多家上市公司，其中包括 26 个发达市场和 21 个发展中市场；涵盖全球上市股票约 97%的市值，在国际上被广泛采用为有关投资产品的业绩基准。

标准普尔 BMI 中国（除 A、B 股）指数（S&P BMI China ex-A-B-Shares）是由标准普尔指数公司于 2007 年 11 月 15 日推出的标准普尔 QDII 系列指数之一，旨在为中国境内合格机构投资者（QDII）在海外资本市场进行投资提供广泛的市场比较基准和投资方案。该指数反映在香港证券市场、美国证券市场、新加坡证券市场、日本证券市场上市的以外币计价的中國公司股票价格走势。

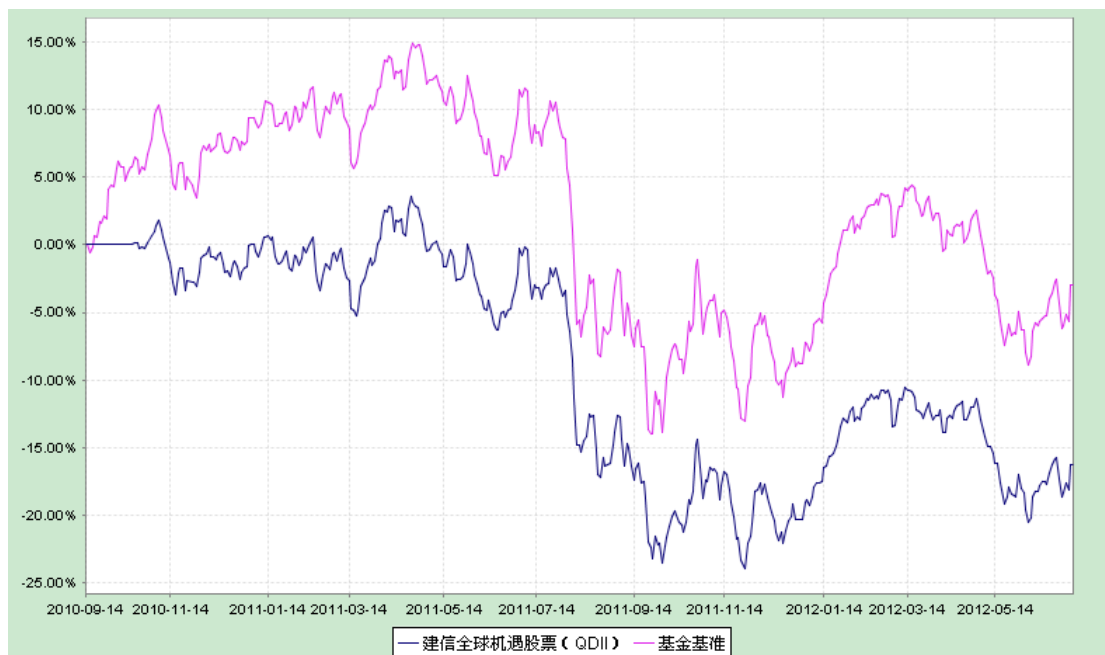
3、同期业绩比较基准以人民币计价。

### 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

建信全球机遇股票型证券投资基金

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

（2010 年 9 月 14 日至 2012 年 6 月 30 日）



注：1、本基金为股票型基金，投资组合中股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例不低于 60%；现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具市值占基金资产的比例不高于 40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金投资于境外上市的中国公司股票的股票投资组合称为“海外中国组合”，投资于其他上市公司股票的股票投资组合称为“全球（中国除外）组合”。其中，境外上市的中国公司是指在香港、美国、英国、新加坡等地上市的公司，这些公司注册于中国大陆境内，或者虽注册于中国大陆境外，但其主要控股股东或主要业务收入源自中国大陆。

海外中国组合占本基金股票投资的目标比例为 30%（比例范围 0%-60%）；全球（中国除外）组合占本基金股票投资的目标比例为 70%（比例范围 40%-100%）。

2、同期业绩比较基准以人民币计价。

3、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 2012 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、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、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、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金 22 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 475.31 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		
赵英楷先生	海外投资部总监，本基金基金经理	2011-04-20	-	15	美国哥伦比亚大学商学院 MBA，曾任美国美林证券公司研究员、高盛证券公司研究员、美林证券公司投资组合策略分析师、美国阿罗亚投资公司基金经理；2010 年 3 月加入建信基金管理有限责任公司，历任海外投资部执行总监（主持工作）、总监。2011 年 6 月 21 日起任建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金经理；2012 年

					6 月 26 日起任建信全球资源基金的基金经理。
高茜	海外投资部 副总监, 本基金 基金经理	2010-09-14	2012-04-13	13	注册金融分析师 (CFA), 获清华大学建筑学学士学位及美国俄亥俄州克利夫兰州立大学城市研究学硕士学位, 先后任职于美国美林证券公司、美国基石房地产投资管理公司、英国阿特金斯顾问 (北京) 有限公司、美国信安金融集团等公司, 担任证券研究员、研究总监、首席投资顾问、助理基金经理、投资风险顾问等职。高茜于 2007 年 12 月加入我公司, 曾任海外投资部副总监, 2010 年 9 月 14 日至 2012 年 4 月 13 日任建信全球机遇股票型证券投资基金的基金经理。2012 年 4 月因个人原因从本公司离职。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Mustafa Sagun	在信安环球投资有限公司担任首席投资官 (CIO), 投资组合经理	15	南佛罗里达大学 MagnaCumLaude 博士, 注册金融分析师 (CFA)。1996 年-1997 年, 所罗门兄弟有限公司股权衍生品做市商, 担任联系交易室与后台部门的职能; 为指数套利、风险套利、可转换债券以及拉美衍生品交易室提供支持。1997 年-2000 年, PNC 金融服务集团副总裁、数量研究员, 向总裁办公室以及管理财提供信息及相关工具以供公司决策。2000 年至今,

		信安环球投资有限公司首席投资官(CIO),担任信安环球投资公司股票投资部首席投资官,负责管理所有国外、国内及全球股票投资组合管理和研究情况;同时,管理资产配置并担任全球股票组合的首席基金经理
--	--	---

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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。

##### 4.4.2 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。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年上半年全球市场略有上涨，其中一季度涨幅较大，二季度回落，欧债危机主导了全球市场上半年行情。第一季度受到欧盟一系列救助措施，尤其是 LTRO 的实施，欧洲边缘国家的国债利率大幅下降，银行间流动性危机得到有效控制，欧债危机暂时缓解；全球经济在一季度也表现良好。美国就业、GDP、PMI 等数据都比较正面，房地产销售也有所改善；欧洲经济表现弱于美国，但经济下滑趋势企稳，德国制造业 PMI 也连续几个月超过 50，失业率保持在 20 年低位。成熟市场较好的经济状况带动其他地区经济回暖，新兴市场主要国家经济政策转向谨慎宽松，PMI、工业生产、消费等经济数据表现较好。

市场进入二季度后有了较大转变，尤其是 5 月下跌幅度较大，但在 6 月市场有所反弹。欧美和新兴市场国家的经济数据下滑，希腊大选和西班牙银行体系的坏账问题令欧债危机的风险卷土重来。经济方面，美国经济数据出现明显下滑，GDP 被向下修正，就业数据突然下滑，PMI 也不理想；欧洲方面 PMI 指数连续几个月大幅下滑，失业率超过 10%，欧洲的经济增长引擎德国又表现出经济疲态；新兴市场主要国家经济数据也不乐观，经济增长在放缓，印度通货膨胀重新回到高位。中国经济的低迷表现也令海外投资人担心政策的放松可能对经济的提振作用有限。不过在 6 月份，首先是希腊在六月中旬新一轮的选举中支持欧元区援助计划和承诺将继续紧缩政策的中间右翼新民主党获胜并将主持组建新政府，短期内希腊退出欧盟的风险下降。另外欧盟峰会在欧盟财政联盟和银行监管体系方面取得了比较重要的进展，欧债危机风险有所降低。这几个因素使得市场止跌回升。

本基金对一季度市场行情较为乐观，从年初开始一直保持了较高仓位，行业和股票方面也进行了类似的较积极配置，较好地把握了市场上行机会。进入二季度之后则采取谨慎操作，对仓位、行业、和个股方面都进行了积极调整，在市场总体下行过程中较好地控制了风险，维持了领先市场的相对优势。

#### **4.5.2 报告期内基金的业绩表现**

本报告期本基金净值增长率 5.14%，波动率 0.83%，业绩比较基准收益率 6.31%，波动率 0.89%。

#### **4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望未来，我们认为市场中近期仍将维持震荡行情，全球宏观因素仍是左右市场的决定性因素。正面因素主要包括：美国近期宣布延长“扭转”操作，并指出如果经济加速下滑，美联储有能力推出更有效应对措施。但美联储没有如市

场期待对 QE3 的推出做明确宣示。中国财政货币政策继续转向保增长方向，在 6 月初宣布三年来的首次降息，预示新一轮降息周期的开始。欧盟在财政联盟和强化银行体系方面迈出了重要一步，未来欧盟可能会继续推出应对欧债危机的积极财政货币政策，值得期待。前期市场在欧债危机的恐慌中有所超卖，全球市场估值相对较低，未来市场有估值修复的需求。负面因素主要包括：目前全球经济状况明显弱于今年一季度水平，特别是近期美国、欧盟、德国的 PMI 数据大幅低于预期，新兴市场中印度高通胀、中国经济前景不明朗等因素均为市场增加了不确定因素。另外欧盟峰会成果仍然停留在框架协议的基础上，未来具体实施方案和条款的制定都会对市场产生较大影响。如我们前期反复论述，欧债危机反应了欧盟深层次的制度缺陷，短期内很难得到根本性解决。欧债危机将在未来较长时间困扰全球市场。总体而言，我们对短期市场行情抱有期望，同时认识到近期左右市场因素比较复杂，基本面和政策面各种好坏因素交织，我们将继续密切关注市场的主要驱动因素，控制风险，力争为投资人带来超额收益。

#### 4.7 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。

#### **4.8 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**

2012 年上半年，本基金托管人在对建信全球机遇股票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**

2012 年上半年，建信全球机遇股票型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限公司在建信全球机遇股票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，建信全球机遇股票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公司编制和披露的建信全球机遇股票型证券投资基金 2012 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：建信全球机遇股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	25,344,718.55	35,662,974.99
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	235,062,076.48	233,158,443.71
其中：股票投资		218,640,488.77	208,571,859.93
基金投资		16,421,587.71	24,586,583.78
债券投资		-	-
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		3,263,018.55	955,398.20
应收利息	6.4.7.5	757.78	2,323.26
应收股利		1,604,621.59	209,581.99
应收申购款		11,658.70	9,973.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	3,362,813.55	4,119.34
资产总计		268,649,665.20	270,002,815.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2011 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		3,344,275.65	-
应付赎回款		416,591.68	1,057,808.32
应付管理人报酬		378,510.53	414,577.78
应付托管费		73,599.27	80,612.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
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	3,729,512.94	472,383.17
负债合计		7,942,490.07	2,025,381.62
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	311,019,771.96	336,283,425.49
未分配利润	6.4.7.10	-50,312,596.83	-68,305,991.67
所有者权益合计		260,707,175.13	267,977,433.82
负债和所有者权益总计		268,649,665.20	270,002,815.44

注：1、报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.838 元，基金份额总额 311,019,771.96 份。

2、股票投资所列金额中包括存托凭证。

## 6.2 利润表

会计主体：建信全球机遇股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至 2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年6月30日
<b>一、收入</b>		17,852,249.57	9,917,498.74
1.利息收入		25,516.10	248,449.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,516.10	83,845.56
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	164,603.61
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,620,190.14	6,565,751.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-962,231.17	-717,820.17
基金投资收益	6.4.7.13	801,106.90	1,883,777.17
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	19,962.47
股利收益	6.4.7.16	3,781,314.41	5,379,832.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,079,198.35	3,325,065.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		110,071.25	-468,228.88
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	17,273.73	246,460.67
<b>减：二、费用</b>		3,561,897.24	6,894,689.74
1.管理人报酬		2,488,848.02	4,052,598.85
2.托管费		483,942.61	788,005.30
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	382,783.62	1,743,673.21
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		206,322.99	310,412.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		14,290,352.33	3,022,809.00
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		14,290,352.33	3,022,809.00



**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：建信全球机遇股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	336,283,425.49	-68,305,991.67	267,977,433.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,290,352.33	14,290,352.33
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）	-25,263,653.53	3,703,042.51	-21,560,611.02
其中：1.基金申购款	1,329,302.77	-199,683.76	1,129,619.01
2.基金赎回款	-26,592,956.30	3,902,726.27	-22,690,230.03
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）	311,019,771.96	-50,312,596.83	260,707,175.13
项目	上年度可比期间 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）	557,627,789.53	-9,024,391.71	548,603,397.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,022,809.00	3,022,809.00
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）	-194,054,785.75	-1,671,663.72	-195,726,449.47
其中：1.基金申购款	1,452,260.98	-18,947.40	1,433,313.58
2.基金赎回款	-195,507,046.73	-1,652,716.32	-197,159,763.05
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）	363,573,003.78	-7,673,246.43	355,899,757.35

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

建信全球机遇股票型证券投资基金(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”)证监许可[2010]第 982 号《关于核准建信全球机遇股票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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2010 年 8 月 11 日起至 2010 年 9 月 10 日止。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 681,859,858.00 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(2010)第 232 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 9 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 681,944,805.65 份基金份额，其中认购资金利息折合 84,947.65 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，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)，境外投资顾问为信安环球投资有限公司(Principal Global Investors .LLC.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括股票和其他权益类证券、现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具。其中，股票及其他权益类证券包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、存托凭证、公募股票基金等。现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具，中长期政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币市场基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券，中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品等。其中，本基金投资组合中股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例不低于 60%；现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具市值占基金资产的比例不高于 40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为标准普尔全球 BMI

市场指数总收益率(S&P Global BMI)×70% + 标准普尔 BMI 中国(除 A、B 股)指数总收益率(S&P BMI China ex-A-B-Shares)×30%。

#### 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》、《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》和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

本基金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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外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) 基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照

相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 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 2012年6月30日
活期存款	25,344,718.55
定期存款	-
其他存款	-
合计	25,344,718.55

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	216,427,633.45	218,640,488.77	2,212,855.32
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	债券合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	14,902,083.21	16,421,587.71	1,519,504.50
其他	-	-	-
合计	231,329,716.66	235,062,076.48	3,732,359.82

##### 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/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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

###### 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 2012年6月30日
----	-------------------

应收活期存款利息	757.78
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	757.78

## 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
应收未起息外汇交易款	3,362,813.55
合计	3,362,813.55

## 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	981.59
应付券商交易单元保证金	-
预提费用	378,855.47
应付外汇未起息	3,349,675.88
合计	3,729,512.94

## 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	336,283,425.49	336,283,425.49
本期申购	1,329,302.77	1,329,302.77
本期赎回（以“-”号填列）	-26,592,956.30	-26,592,956.30
本期末	311,019,771.96	311,019,771.96

## 6.4.7.9 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	-52,931,081.82	-15,374,909.85	-68,305,991.67
本期利润	211,153.98	14,079,198.35	14,290,352.33
本期基金份额交易产生的变动数	4,019,211.26	-316,168.75	3,703,042.51
其中：基金申购款	-210,802.54	11,118.78	-199,683.76

基金赎回款	4,230,013.80	-327,287.53	3,902,726.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-48,700,716.58	-1,611,880.25	-50,312,596.83

## 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	25,515.28
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	-
其他	0.82
合计	25,516.10

## 6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	116,023,682.69
减：卖出股票成本总额	116,985,913.86
买卖股票差价收入	-962,231.17

## 6.4.7.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	10,185,523.92
减：卖出/赎回基金成本总额	9,384,417.02
基金投资收益	801,106.90

## 6.4.7.13 债券投资收益

本基金报告期末未产生债券投资收益。

## 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

无。

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,647,608.95
基金投资产生的股利收益	133,705.46
合计	3,781,314.41

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1.交易性金融资产	14,079,198.35
——股票投资	12,859,777.40
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	1,219,420.95
2.衍生工具	-
——权证投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	14,079,198.35

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	17,273.73
合计	17,273.73

注：本基金赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	382,783.62
银行间市场交易费用	-
合计	382,783.62

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	35,803.04
信息披露费	149,179.94
其他	21,340.01
合计	206,322.99

## 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

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、基金销售机构、注册登记机构
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
布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)	境外资产托管人

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

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 2012年1月1日至 2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,488,848.02	4,052,598.85
其中：支付销售机构的客户维护费	694,725.56	2,150,761.62

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按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 1.8% 的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的管理人报酬，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人建信基金管理有限责任公司。其计算公式为：

日管理人报酬 = 估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 X 1.8% / 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 2012年1月1日至 2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	483,942.61	788,005.30

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 0.35%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的托管费，逐日累计至每月月底，按月支付给基金托管人中国工商银行。其计算公式为：

日托管费=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 X 0.35% / 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通过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

报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金本报告期末及上年度报告期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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
布朗兄弟哈里曼银行	20,247,976.80	2,617.39	13,743,767.90	3,451.37
中国工商银行	5,096,741.75	22,897.89	15,922,998.82	80,394.19

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按适用利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末及上年度报告期末未通过关联方购买其承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度报告期末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**

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **6.4.12 期末（2012 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**

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而流通受限股票。

##### **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**

截止本报告期末，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。

###### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截止本报告期末，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。

#### **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**

本基金为全球股票型证券投资基金，其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、基金投资及权证投资等。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通过全球化的资产配置和组合管理，在分散和控制投资风险的同时追求基金资产长期增值。

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；监察稽核部承担其他风险的管理职责,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同责任,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和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行,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与境外当地授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算,违约风险发生的可能性很小。

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。于 2012 年 6 月 30 日,本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00% (2011 年 12 月 31 日: 0.00%)。

#### 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风险管理委员会设定流动性比例要求，独立的风险管理部门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。本基金投资于同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得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不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。除附注 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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012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	25,344,718.55	-	-	-	25,344,718.55
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	235,062,076.48	235,062,076.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,263,018.55	3,263,018.55
应收利息	-	-	-	757.78	757.78
应收股利	-	-	-	1,604,621.59	1,604,621.59
应收申购款	-	-	-	11,658.70	11,658.70
其他资产	-	-	-	3,362,813.55	3,362,813.55
资产总计	25,344,718.55	-	-	243,304,946.65	268,649,665.20
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	3,344,275.65	3,344,275.65
应付赎回款	-	-	-	416,591.68	416,591.68
应付管理人报酬	-	-	-	378,510.53	378,510.53
应付托管费	-	-	-	73,599.27	73,599.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,729,512.94	3,729,512.94
负债总计	-	-	-	7,942,490.07	7,942,490.07
利率敏感度缺口	25,344,718.55	-	-	235,362,456.58	260,707,175.13
上年度末 2011 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	35,662,974.99	-	-	-	35,662,974.99
交易性金融 资产	-	-	-	233,158,443.71	233,158,443.71
应收证券清 算款	-	-	-	955,398.20	955,398.20
应收利息	-	-	-	2,323.26	2,323.26
应收股利	-	-	-	209,581.99	209,581.99
应收申购款	-	-	-	9,973.95	9,973.95
其他资产	-	-	-	4,119.34	4,119.34
资产总计	35,662,974.99	-	-	234,339,840.45	270,002,815.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,057,808.32	1,057,808.32
应付管理人 报酬	-	-	-	414,577.78	414,577.78
应付托管费	-	-	-	80,612.35	80,612.35
其他负债	-	-	-	472,383.17	472,383.17
负债总计	-	-	-	2,025,381.62	2,025,381.62
利率敏感度 缺口	35,662,974.99	-	-	232,314,458.83	267,977,433.82

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2011 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2011 年 12 月 31 日：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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2012年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	18,069,433.19	4,090,418.29	111,615.46	22,271,466.94
交易性金融资产	91,743,694.41	91,156,112.63	52,162,269.44	235,062,076.48
应收股利	124,815.45	929,432.34	102,663.30	1,156,911.09
资产合计	109,937,943.05	96,175,963.26	52,376,548.20	258,490,454.51
以外币计价的负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	109,937,943.05	96,175,963.26	52,376,548.20	258,490,454.51
项目	上年度末 2011年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	22,718,652.57	3,357,941.10	4,139.44	26,080,733.11
交易性金融资产	92,693,297.38	96,805,190.03	43,659,956.30	233,158,443.71
应收股利	154,871.97	17,746.22	36,963.80	209,581.99
资产合计	115,566,821.92	100,180,877.35	43,701,059.54	259,448,758.81
以外币计价的负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	115,566,821.92	100,180,877.35	43,701,059.54	259,448,758.81

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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（2012年6月30日）	上年度末（2011年12月31日）
	所有外币相对人民币贬值5%	减少约13,035,358.76	减少约13,398,871.69
所有外币相对人民币升值5%	增加约13,035,358.76	增加约13,398,871.69	

## 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

证券交易所上市的股票、基金和衍生工具，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。

本基金投资组合中股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例不低于 60%；现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具市值占基金资产的比例不高于 40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券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，及时可靠地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 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	218,640,488.77	83.86	208,571,859.93	77.83
交易性金融资产-基金投资	16,421,587.71	6.30	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	24,586,583.78	9.17
合计	235,062,076.48	90.16	233,158,443.71	87.00

#### 6.4.13.4.3.2 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 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约10,847,221.74	增加约11,332,417.65
业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	减少约10,847,221.74	减少约11,332,417.65	



**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 2012 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 235,062,076.48 元，无属于第二层级和第三层级的余额(2011 年 6 月 30 日：第一层级 301,156,869.58 元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

**(iii) 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

**(iv) 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额**

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	218,640,488.77	81.38
	其中：普通股	203,271,040.91	75.66
	存托凭证	15,369,447.86	5.72

	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	16,421,587.71	6.11
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,344,718.55	9.43
8	其他各项资产	8,242,870.17	3.07
9	合计	268,649,665.20	100.00

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	91,156,112.63	34.96
美国	71,757,113.18	27.52
英国	16,147,834.44	6.19
日本	11,454,728.45	4.39
德国	9,320,282.66	3.58
澳大利亚	5,961,029.12	2.29
加拿大	3,377,679.01	1.30
法国	2,415,689.08	0.93
瑞典	2,103,923.63	0.81
瑞士	1,904,636.88	0.73
韩国	1,390,915.87	0.53
意大利	944,471.04	0.36
荷兰	706,072.78	0.27
合计	218,640,488.77	83.86

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
金融	53,670,701.25	20.59
信息技术	35,785,463.77	13.73
能源	30,739,869.07	11.79
非必需消费品	13,145,648.31	5.04
工业	17,616,685.35	6.76
材料	8,215,754.62	3.15
公共事业	8,950,283.58	3.43
电信服务	17,348,354.43	6.65

必需消费品	16,255,452.70	6.24
保健	16,912,275.69	6.49
合计	218,640,488.77	83.86

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

#### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	CHINA MOBILE LTD	中国移动	HK0941009539	香港证券交易所	中国香港	151,500	10,467,119.09	4.01
2	CNOOC LTD	中国海洋石油	HK0883013259	香港证券交易所	中国香港	552,000	6,930,022.18	2.66
3	BAIDU INC - SPON ADR	百度股份	US0567521085	纳斯达克交易所	美国	7,718	5,612,815.18	2.15
4	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	CNE1000001Z5	香港证券交易所	中国香港	2,143,000	5,136,228.39	1.97
5	PETROCHINA CO LTD-H	中国石油天然气	CNE1000003W8	香港证券交易所	中国香港	488,000	3,958,382.23	1.52
6	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	KYG875721485	香港证券交易所	中国香港	20,000	3,684,794.40	1.41

				港 证 券 交 易 所	国 香 港			
7	APPLE INC	苹果电脑	US0378331005	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	949	3,505,360.78	1.34
8	SAMSUNG ELECTR-GDR REG S	三星电子	US7960508882	伦 敦 国 际 交 易 所	英 国	928	3,119,643.08	1.20
9	LENOVO GROUP LTD	联想集团	HK0992009065	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	576,000	3,070,966.35	1.18
10	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国农业 银行	CNE100000Q43	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	1,156,000	2,911,998.45	1.12
11	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	CNE1000003X6	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	55,500	2,791,598.61	1.07
12	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国石化	CNE1000002Q2	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	494,000	2,770,704.52	1.06
13	CHEVRON CORP	雪佛龙德 士古	US1667641005	纽 约	美 国	4,132	2,757,188.36	1.06

				证券交易所				
14	CHINA MINSHENG BANKING-H	民生银行	CNE100000HF9	香港证券交易所	中国香港	479,500	2,685,469.19	1.03
15	CA INC	组合国际集团	US12673P1057	纳斯达克交易所	美国	15,457	2,648,426.20	1.02
16	MICROSOFT CORP	微软	US5949181045	纳斯达克交易所	美国	13,608	2,632,858.03	1.01
17	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海外发展	HK0688002218	香港证券交易所	中国香港	174,000	2,550,432.07	0.98
18	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	中信银行	CNE1000001Q4	香港证券交易所	中国香港	759,000	2,444,070.32	0.94
19	FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	墨西哥经济振兴可变动资本额股份有限公司	US3444191064	纽约证券交易所	美国	4,310	2,432,983.47	0.93
20	SIMON PROPERTY GROUP INC	赛门物业集团	US8288061091	纽约证	美国	2,429	2,391,432.93	0.92

				券交易所				
21	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	Discover 金融服务公司	US2547091080	纽约证券交易所	美国	10,706	2,341,563.24	0.90
22	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特公司	US20030N1019	纳斯达克交易所	美国	11,346	2,294,241.22	0.88
23	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	荷兰皇家壳牌	GB00B03MM408	英国伦敦交易所	英国	10,457	2,284,080.94	0.88
24	CHINA MERCHANTS BANK-H	招商银行	CNE1000002M1	香港证券交易所	中国香港	191,000	2,251,523.51	0.86
25	HUTCHISON TELECOMM HONG KONG	和记电讯香港控股	KYG4672G1064	香港证券交易所	中国香港	762,000	2,230,099.53	0.86
26	ELI LILLY & CO	礼来公司	US5324571083	纽约证券交易所	美国	8,035	2,180,710.72	0.84
27	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	CNE100000338	香港证券	中国香港	172,500	2,162,819.42	0.83

				交易所				
28	DATANG INTL POWER GEN CO-H	大唐发电	CNE1000002Z3	香港 证券 交易 所	中国 香港	814,000	2,017,310.80	0.77
29	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康 集团	US91324P1021	纽约 证券 交易 所	美国	5,342	1,976,575.52	0.76
30	BT GROUP PLC	英国电信 集团	GB0030913577	英国 伦敦 交易 所	英国	94,466	1,960,445.92	0.75
31	BMC SOFTWARE INC	BMC 软件	US0559211000	纳斯 达克 交易 所	美国	7,262	1,960,353.17	0.75
32	VINCI SA	万喜公司	FR0000125486	法国 交易 所	法国	6,723	1,946,542.06	0.75
33	SHIRE PLC	希尔制药	JE00B2QKY057	英国 伦敦 交易 所	英国	10,774	1,937,656.58	0.74
34	ZURICH INSURANCE GROUP AG	苏黎世金 融服务	CH0011075394	瑞士 证券 交易 所	瑞士	1,335	1,904,636.88	0.73

35	WAL-MART STORES INC	沃尔玛百货	US9311421039	纽约证券交易所	美国	4,295	1,893,974.86	0.73
36	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	中国交通建设股份	CNE1000002F5	香港证券交易所	中国香港	338,000	1,865,435.32	0.72
37	POST PROPERTIES INC	-	US7374641071	纽约证券交易所	美国	5,897	1,825,733.93	0.70
38	AMGEN INC	安进	US0311621009	纳斯达克交易所	美国	3,929	1,815,082.86	0.70
39	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国人寿	CNE1000002L3	香港证券交易所	中国香港	111,000	1,806,168.82	0.69
40	ATCO LTD -CLASS I	ATCO 有限公司	CA0467894006	多伦多证券交易所	加拿大	4,000	1,793,854.31	0.69
41	UNY CO LTD	UNY 株式会社	JP3949600005	东京证券交易所	日本	24,900	1,727,397.86	0.66



42	SUMITOMO CORP	住友商事	JP3404600003	东京证券交易所	日本	19,400	1,712,049.69	0.66
43	MCKESSON CORP	麦卡逊	US58155Q1031	纽约证券交易所	美国	2,872	1,702,979.33	0.65
44	KBR INC	KBR 股份有限公司	US48242W1062	纽约证券交易所	美国	10,776	1,684,162.49	0.65
45	WELLS FARGO & CO	富国银行	US9497461015	纽约证券交易所	美国	7,800	1,649,736.32	0.63
46	TELSTRA CORP LTD	澳大利亚电信股份有限公司	AU000000TLS2	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	68,064	1,628,886.45	0.62
47	US BANCORP	美国银行公司	US9029733048	纽约证券交易所	美国	7,963	1,619,744.15	0.62
48	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORPLT	中国铁建	CNE100000981	香港证券交易所	中国香港	301,500	1,575,506.40	0.60

				所				
49	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	恒大地产集团	KYG3225A1031	香港证券交易所	中国香港	487,000	1,560,257.71	0.60
50	SUEDZUCKER AG	苏扎克糖业股份有限公司	DE0007297004	柏林证券交易所	德国	7,047	1,549,746.22	0.59
51	CISCO SYSTEMS INC	思科	US17275R1023	纳斯达克交易所	美国	14,143	1,535,909.05	0.59
52	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	东风集团股份	CNE100000312	香港证券交易所	中国香港	156,000	1,513,374.41	0.58
53	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	澳大利亚国民银行股份有限公司	AU000000NAB4	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	9,651	1,473,417.25	0.57
54	FREEMPORT-MCMORAN COPPER	自由港迈克墨伦	US35671D8570	纽约证券交易所	美国	6,621	1,426,754.94	0.55
55	KIA MOTORS CORPORATION	起亚汽车公司	KR7000270009	韩国证券交	韩国	3,372	1,390,915.87	0.53

				易所				
56	EXXON MOBIL CORP	艾克索美孚	US30231G1022	纽约证券交易所	美国	2,559	1,384,986.31	0.53
57	CHINA EVERBRIGHT LTD	中国光大	HK0165000859	香港证券交易所	中国香港	154,000	1,370,939.17	0.53
58	SAFEWAY INC	喜互惠	US7865142084	纽约证券交易所	美国	11,833	1,358,392.13	0.52
59	ORIX CORP	ORIX 公司	JP3200450009	东京证券交易所	日本	2,300	1,350,113.25	0.52
60	BASF SE	巴斯夫欧洲公司	DE000BASF111	柏林证券交易所	德国	3,089	1,329,949.49	0.51
61	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	US0028241000	纽约证券交易所	美国	3,214	1,310,560.90	0.50
62	IDEMITSU KOSAN CO LTD	-	JP3142500002	东京证券交易所	日本	2,300	1,300,651.84	0.50

				所				
63	GUANGDONG INVESTMENT LTD	粤海投资	HK0270001396	香港证券交易所	中国香港	284,000	1,291,895.44	0.50
64	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通银行	US46625H1005	纽约证券交易所	美国	5,711	1,290,621.33	0.50
65	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	世茂房地产	KYG810431042	香港证券交易所	中国香港	133,000	1,283,743.24	0.49
66	PICC PROPERTY & CASUALTY -H	中国财险	CNE100000593	香港证券交易所	中国香港	180,200	1,273,645.92	0.49
67	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	瑞声科技	KYG2953R1065	香港证券交易所	中国香港	68,000	1,236,199.61	0.47
68	IAC/INTERACTIVECORP	-	US44919P5089	纳斯达克交易所	美国	4,255	1,227,207.70	0.47
69	PRUDENTIAL PLC	保诚	GB0007099541	英国伦敦交易所	英国	16,736	1,212,501.81	0.47

70	BURBERRY GROUP PLC	博柏利集团公共股份有限公司	GB0031743007	英国伦敦交易所	英国	9,300	1,209,687.50	0.46
71	HAIER ELECTRONICS GROUP CO	海尔电器	BMG423131256	香港证券交易所	中国香港	158,000	1,190,155.98	0.46
72	LANCASHIRE HOLDINGS LTD	兰开夏郡股份有限公司	BMG5361W1047	英国伦敦交易所	英国	15,099	1,180,615.15	0.45
73	CITIC RESOURCES HOLDINGS LTD	中信资源	BMG2155Y1075	香港证券交易所	中国香港	1,132,000	1,171,992.88	0.45
74	GRAINCORP LTD	GrainCorp 有限公司	AU000000GNC9	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	18,981	1,169,471.58	0.45
75	LOOMIS AB-B	-	SE0002683557	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	14,938	1,166,850.50	0.45
76	AMERISOURCEBERGEN CORP	美国资源柏根健保	US03073E1055	纽约证	美国	4,600	1,144,870.15	0.44

				券交易所				
77	PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	巴西石油 公司	US71654V1017	纽约证 券交易 所	美国	9,966	1,143,435.91	0.44
78	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	统一企业 中国	KYG9222R1065	香港证 券交易 所	中国 香港	194,000	1,138,699.30	0.44
79	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	卡尔蔡司 医疗技术 公司	DE0005313704	柏林证 券交易 所	德国	7,536	1,127,001.26	0.43
80	HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	汉诺威再 保险股份 公司	DE0008402215	柏林证 券交易 所	德国	3,006	1,109,428.00	0.43
81	SASOL LTD-SPONSORED ADR	Sasol 有限 公司	US8038663006	纽约证 券交易 所	美国	4,100	1,100,817.22	0.42
82	DIGITAL CHINA HOLDINGS LTD	神州数码	BMG2759B1072	香港证 券交易 所	中国 香港	99,000	1,091,155.67	0.42
83	CONTINENTAL AG	德国大陆 股份公司	DE0005439004	柏林证 券	德国	2,108	1,088,771.50	0.42

				交易所				
84	DUERR AG	-	DE0005565204	柏林证券交易所	德国	2,797	1,069,938.09	0.41
85	WALGREEN CO	华尔格林	US9314221097	纽约证券交易所	美国	5,700	1,066,416.09	0.41
86	KROGER CO	Kroger 公司	US5010441013	纽约证券交易所	美国	7,260	1,064,856.37	0.41
87	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	新奥能源	KYG3066L1014	香港证券交易所	中国香港	48,000	1,060,438.18	0.41
88	SHENGUAN HOLDINGS GROUP LTD	神冠控股	KYG8116M1087	香港证券交易所	中国香港	284,000	1,025,644.59	0.39
89	NOVO-NORDISK A/S-SPONS ADR	诺和诺德公司	US6701002056	纽约证券交易所	美国	1,108	1,018,541.15	0.39
90	SYMANTEC CORP	赛门铁克	US8715031089	纳斯达克交	美国	10,879	1,005,293.46	0.39

				易所				
91	NATIONAL GRID PLC	英国国家电网	GB00B08SNH34	英国伦敦交易所	英国	15,111	1,002,058.20	0.38
92	ADVANTEST CORP	爱德万测试	JP3122400009	东京证券交易所	日本	10,200	1,000,076.22	0.38
93	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	海通证券	CNE1000019K9	香港证券交易所	中国香港	112,800	991,294.48	0.38
94	DRAX GROUP PLC	Drax 集团公司	GB00B1VNSX38	英国伦敦交易所	英国	17,921	986,080.22	0.38
95	SMITHFIELD FOODS INC	史密斯菲尔德食品公司	US8322481081	纽约证券交易所	美国	7,200	985,014.63	0.38
96	AIR CHINA LTD-H	中国国航	CNE1000001S0	香港证券交易所	中国香港	264,000	977,090.08	0.37
97	FIFTH THIRD BANCORP	五三银行	US3167731005	纳斯达克交易	美国	11,500	974,667.09	0.37



				所				
98	AGRIUM INC	-	CA0089161081	多伦多 证券交易所	加拿大	1,700	951,719.38	0.37
99	SICHUAN EXPRESSWAY CO-H	四川成渝	CNE100000494	香港 证券交易所	中国香港	446,400	949,816.08	0.36
100	ENI SPA	埃尼	IT0003132476	意大利 证券交易所	意大利	7,151	944,471.04	0.36
101	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江西铜业	CNE1000003K3	香港 证券交易所	中国香港	68,000	939,068.22	0.36
102	LUNDIN PETROLEUM AB	-	SE0000825820	斯德哥尔摩 证券交易所	瑞典	7,934	937,073.13	0.36
103	DEUTSCHE POST AG-REG	德国邮政 有限公司	DE0005552004	柏林 证券交易所	德国	8,496	932,195.90	0.36
104	SINO BIOPHARMACEUTICAL	中国生物 制药	KYG8167W1380	香港	中国	408,000	927,981.23	0.36

				证券交易所	香港			
105	KWG PROPERTY HOLDING LTD	合景泰富	KYG532241042	香港证券交易所	中国香港	233,500	927,023.35	0.36
106	NISSAN MOTOR CO LTD	日产汽车	JP3672400003	东京证券交易所	日本	15,400	917,481.24	0.35
107	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	中海石油化学	CNE1000002D0	香港证券交易所	中国香港	254,000	911,089.87	0.35
108	TOWERS WATSON & CO-CLA	-	US8918941076	纽约证券交易所	美国	2,404	910,783.07	0.35
109	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公司	US9581021055	纽约证券交易所	美国	4,657	897,790.21	0.34
110	AETNA INC	安泰金融保险集团	US00817Y1082	纽约证券交易所	美国	3,660	897,491.93	0.34
111	HUMANA INC	Humana 公司	US4448591028	纽约证	美国	1,782	872,824.06	0.33

				券交易所				
112	BHP BILLITON LTD	必和必拓公司	AU000000BHP4	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	4,245	865,855.30	0.33
113	HARBIN ELECTRIC CO LTD-H	哈尔滨电气	CNE1000003C0	香港证券交易所	中国香港	169,000	858,320.68	0.33
114	TYSON FOODS INC-CLA	泰森食品	US9024941034	纽约证券交易所	美国	7,077	842,855.60	0.32
115	CHINA COAL ENERGY CO-H	中国中煤能源	CNE100000528	香港证券交易所	中国香港	160,000	826,959.17	0.32
116	AUST AND NZ BANKING GROUP	澳盛银行集团	AU000000ANZ3	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	5,763	823,398.54	0.32
117	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	GB0005405286	英国伦敦交易所	英国	14,700	809,714.60	0.31

118	ELECTRIC POWER DEVELOPMENT C	-	JP3551200003	东京证券交易所	日本	4,800	798,646.43	0.31
119	MARUBENI CORP	丸红	JP3877600001	东京证券交易所	日本	19,000	796,002.11	0.31
120	RICOH CO LTD	理光	JP3973400009	东京证券交易所	日本	15,000	795,683.52	0.31
121	MARATHON OIL CORP	马拉松石油	US5658491064	纽约证券交易所	美国	4,900	792,465.70	0.30
122	DAPHNE INTERNATIONAL HOLDING	达夫妮国际控股	KYG2830J1031	香港证券交易所	中国香港	122,000	777,752.49	0.30
123	EMC CORP/MA	EMC 公司	US2686481027	纽约证券交易所	中国香港	4,694	760,931.14	0.29
124	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中国神华能源	CNE1000002R0	香港证券交易所	中国香港	34,500	760,783.68	0.29
125	MIE HOLDINGS CORPORATION	MI 能源	KYG611571061	香	中	486,000	736,926.27	0.28

				港 证 券 交 易 所	国 香 港			
126	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石 油公司	US56585A1025	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,496	709,149.81	0.27
127	KONINKLIJKE DSM NV	Koninklijke DSM 公 共 有 限 公 司	NL0000009827	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	2,312	706,072.78	0.27
128	NATIONAL BANK OF CANADA	加拿大 国 家 银 行	CA6330671034	多 伦 多 证 券 交 易 所	加 拿 大	1,400	632,105.32	0.24
129	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF 工 业 控 股 股 份 有 限 公 司	US1252691001	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	500	612,693.06	0.24
130	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	宝 马 汽 车	DE0005190003	柏 林 证 券 交 易 所	德 国	1,340	600,448.68	0.23
131	mitsubishi UFJ FINANCIAL GRO	东 京 三 菱 金 融 集 团	JP3902900004	东 京 证 券 交 易 所	日 本	19,400	584,074.71	0.22

				所				
132	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中国电讯	CNE1000002V2	香港证券交易所	中国香港	206,000	565,942.03	0.22
133	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	德意志银行	DE0005140008	柏林证券交易所	德国	2,286	512,803.52	0.20
134	TIM PARTICIPACOES SA-ADR	-	US88706P2056	纽约证券交易所	美国	2,855	495,861.41	0.19
135	CHINA QINFA GROUP LTD	中国秦发	KYG2159E1070	香港证券交易所	中国香港	586,000	487,273.30	0.19
136	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS	三菱化学控股	JP3897700005	东京证券交易所	日本	17,000	472,551.58	0.18
137	TOTAL SA	道达尔	FR0000120271	法国交易所	法国	1,679	469,147.02	0.18
138	LUKOIL OAO-SPON ADR	卢克石油公司	US6778621044	伦敦国际交易所	英国	1,263	445,350.44	0.17

注：所用证券代码采用 ISIN 代码。

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	2,931,271.07	1.09
2	ELI LILLY & CO	US5324571083	2,084,597.34	0.78
3	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	CNE100000312	2,042,574.43	0.76
4	DATANG INTL POWER GEN CO-H	CNE1000002Z3	1,994,657.52	0.74
5	DONGYUE GROUP	KYG2816P1072	1,832,186.58	0.68
6	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	KYG3225A1031	1,760,108.95	0.66
7	BASF SE	DE000BASF111	1,719,766.25	0.64
8	HOME DEPOT INC	US4370761029	1,698,226.37	0.63
9	AMGEN INC	US0311621009	1,668,676.28	0.62
10	KWG PROPERTY HOLDING LTD	KYG532241042	1,569,820.79	0.59
11	KIA MOTORS CORPORATION	KR7000270009	1,490,713.26	0.56
12	IDEMITSU KOSAN CO LTD	JP3142500002	1,490,082.82	0.56
13	WELLS FARGO & CO	US9497461015	1,462,981.64	0.55
14	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	CNE1000002D0	1,422,830.35	0.53
15	CNOOC LTD	HK0883013259	1,393,383.69	0.52
16	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	JP3902900004	1,331,059.89	0.50
17	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	GB00B03MM408	1,328,241.41	0.50
18	PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	US71654V1017	1,326,747.97	0.50
19	DOLLARAMA INC	CA25675T1075	1,280,455.42	0.48
20	ORIX CORP	JP3200450009	1,265,772.00	0.47

注：1、买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)，不包括相关交易费用。

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	JP3902900004	2,502,821.90	0.93
2	ASTRAZENECA	GB0009895292	2,343,289.41	0.87

	PLC			
3	TOTAL SA	FR0000120271	2,166,047.19	0.81
4	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	HK0000049939	2,165,381.62	0.81
5	BANK OF CHINA LTD-H	CNE1000001Z5	2,152,397.86	0.80
6	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	CNE1000002R0	2,149,232.30	0.80
7	SIEMENS AG-REG	DE0007236101	1,990,034.10	0.74
8	REPSOL YPF SA -SPONSORED ADR	US76026T2050	1,957,156.38	0.73
9	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	GB00B03MM408	1,866,285.54	0.70
10	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	CNE1000002Q2	1,837,924.08	0.69
11	DONGYUE GROUP	KYG2816P1072	1,806,225.03	0.67
12	DOLLARAMA INC	CA25675T1075	1,760,798.15	0.66
13	HOME DEPOT INC	US4370761029	1,759,682.63	0.66
14	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	1,755,541.19	0.66
15	TYCO INTERNATIONAL LTD	CH0100383485	1,727,966.35	0.64
16	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	KYG245241032	1,601,401.86	0.60
17	HUBBELL INC -CL B	US4435102011	1,542,651.46	0.58
18	CHINA MENGNIU DAIRY CO	KYG210961051	1,513,329.67	0.56
19	AXA SA	FR0000120628	1,436,237.07	0.54
20	SAFRAN SA	FR0000073272	1,416,188.09	0.53

注：1、卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)，不包括相关交易费用。

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	114,194,765.30
卖出收入（成交）总额	116,023,682.69

注：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。



**7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 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**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.8 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。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细**

本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

**7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	SPDR S&P 500 ETF TRUST	ETF 基金	交易型开 放式指数	SSGA FUNDS MANAGEMENT INC	9,308,456.53	3.57
2	ISHARES DOW JONES US INDEX FUND	ETF 基金	交易型开 放式指数	BLACKROCK FUND	7,113,131.18	2.73

**7.11 投资组合报告附注**

**7.11.1** 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。

**7.11.2** 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。

**7.11.3 期末其他各项资产构成**

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	3,263,018.55
3	应收股利	1,604,621.59
4	应收利息	757.78
5	应收申购款	11,658.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	3,362,813.55
9	合计	8,242,870.17

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

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。

### §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
14,018	22,187.17	4,113,369.37	1.32%	306,906,402.59	98.68%

#### 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	4,926.16	0.00%

注：本公司高级管理人员未持有该只基金；基金投资和研究部门负责人未持有该只基金；该只基金的基金经理未持有该只基金。

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年9月14日）基金份额总额	681,944,805.65
本报告期期初基金份额总额	336,283,425.49
本报告期基金总申购份额	1,329,302.77
减：本报告期基金总赎回份额	26,592,956.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	311,019,771.96

### §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

2012年3月28日，公司2012年度第一次临时股东会审议通过了《关于选举建信基金管理有限责任公司第三届董事会董事的议案》，同意江先周、孙志晨、马梅琴、俞斌、袁时奋、殷红军、顾建国、王建国、伏军为公司第三届董事会董事，第二届董事会成员关启昌、沈四宝不再担任公司独立董事。

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	
BANK OF NEW YORK	-	10,282,785.76	4.48%	7,144.26	2.78%	-
BARCLAYS CAPITAL INC	-	4,280,443.05	1.87%	1,580.97	0.62%	-
BLAYLOCK ROBETR VAN	-	4,414,024.09	1.93%	2,716.68	1.06%	-
BMO CAPITAL MARKETS	-	1,812,975.16	0.79%	1,146.92	0.45%	-
CCB INTERNATIONAL	-	27,253,683.22	11.89%	54,507.37	21.20%	-
CITIGROUP	-	24,260,439.14	10.58%	19,136.92	7.45%	-
CREDIT AGRICOLE	-	2,420,472.12	1.06%	12,689.77	4.94%	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC ASIA	-	15,712,727.27	6.85%	31,425.45	12.24%	-
CREDIT SUISSE	-	8,712,936.90	3.80%	8,123.84	3.16%	-

FIRST BOSTON						
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.	-	2,344,363.34	1.02%	4,688.73	1.83%	-
DEUTSCHE BANK	-	14,633,867.94	6.38%	9,672.62	3.77%	-
INSTINET	-	15,161,745.42	6.61%	9,945.39	3.87%	-
ITG	-	23,539,005.74	10.27%	19,379.13	7.55%	-
J.P. MORGAN SECURITIES	-	2,769,358.16	1.21%	4,334.86	1.69%	-
KNIGHT SECURITIES	-	1,957,156.38	0.85%	2,132.64	0.83%	-
MACQUARIE	-	1,952,969.78	0.85%	3,905.97	1.52%	-
MERRILL LYNCH	-	27,930,015.20	12.18%	32,129.71	12.51%	-
MORGAN STANLEY	-	9,860,055.96	4.30%	7,423.68	2.89%	-
MOMURA	-	4,392,408.74	1.92%	7,211.80	2.81%	-
PACIFIC CREST SECURITIES	-	973,594.08	0.42%	857.17	0.33%	-
REDBURN PARTNERS	-	1,990,034.10	0.87%	995.02	0.39%	-
ROYAL BANK OF CANADA	-	619,322.78	0.27%	228.17	0.09%	-
SANDLER ONEIL&PARTNERS	-	983,285.18	0.43%	2,899.24	1.13%	-
UBS	-	21,025,409.88	9.17%	12,565.43	4.89%	-
ABN AMRO SECURITIES	-	-	-	-	-	-
BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC.	-	-	-	-	-	-
CARNEGIE	-	-	-	-	-	-
CIBC WORLD MARKETS	-	-	-	-	-	-
FIDELITY	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS	-	-	-	-	-	-
GRIFFITHS MCBURNEY	-	-	-	-	-	-
HANDELSBANKEN	-	-	-	-	-	-
ING	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-
MIZUHO	-	-	-	-	-	-
NBF SECURITIES CORP	-	-	-	-	-	-
PIPER JAFFRAY CO	-	-	-	-	-	-
ROYAL BANK OF SCOTLAND	-	-	-	-	-	-
SCOTIA	-	-	-	-	-	-
STANDARD CHARTERED	-	-	-	-	-	-
STIFEL NICOLAUS	-	-	-	-	-	-
T D NEWCREST	-	-	-	-	-	-
WILLIAM BLAIR	-	-	-	-	-	-
HSBC	-	-	-	-	-	-
ICHIYOSHI	-	-	-	-	-	-

MITSUBISHI SECURITIES	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人制定了服务券商的选择标准，具体如下：

(1) 交易执行能力：能够公平对待所有客户，实现最佳价格成交，可靠、诚信、及时成交，具备充分流动性，交易差错少等；

(2) 研究支持服务：能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务，包括举办推介会、拜访公司、及时沟通市场情况、承接专项研究、协助交易评价等；

(3) 财务实力：净资产、总市值、受托资产等指标处于行业前列，或具有明显的安全边际；

(4) 后台便利性和可靠性：交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

(5) 组织框架和业务构成：具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(6) 其他有利于基金份额持有人利益的商业合作考虑。

海外投资部在根据以上标准进行评估后并结合海外投资顾问提供的建议，列出券商名单报海外投资决策委员会最终确定。

## 2、券商的服务评价

(1) 海外投资部每半年组织“服务总结”及评分。

(2) 若券商提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，经海外投资决策委员会批准，公司将提前终止租用其交易席位。

3、除海通证券的交易席位为与优化配置基金共用的交易席位外，本报告期内新增的服务券商有 BMO CAPITAL MARKETS、CREDIT AGRICOLE、REDBURN PARTNERS 和 SANDLER ONEIL&PARTNERS。报告期内无剔除单元。

## 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		基金交易		股指期货交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期成交总额的比例

						例				
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BLAYLOCK ROETR VAN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BMO CAPITAL MARKETS	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB INTERNATIONAL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT AGRICOLE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE FIRST BOSTON	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
INSTINET	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J. P. MORGAN SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KNIGHT SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MOMURA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
PACIFIC CREST SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
REDBURN PARTNERS	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ROYAL BANK OF CANADA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANDLER ONEIL&PARTNERS	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS	-	-	-	-	-	-	10,185,523.63	100.00%	-	-
ABN AMRO SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CANTOR	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

FITZGERALD AND CO., INC.												
CARNEGIE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CIBC WORLD MARKETS	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FIDELITY	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
GRIFFITHS MCBURNEY	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HANDELSBANKEN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ING	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MIZUHO	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NBF SECURITIES CORP	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
PIPER JAFFRAY CO	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ROYAL BANK OF SCOTLAND	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SCOTIA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
STANDARD CHARTERED	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
STIFEL NICOLAUS	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
T D NEWCREST	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
WILLIAM BLAIR	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ICHIYOSHI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
mitsubishi securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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中国银行网上银行、定投业务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	2012-06-28
2	关于旗下开放式基金通过长城证券开办基金定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2012-06-28
3	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	2012-06-27
4	建信基金管理有限责任公司关于调整中国工商银行借记卡基金网上交易优惠费	指定报刊和/或公司网站	2012-05-23

	率的公告		
5	建信基金管理有限责任公司关于建信全球机遇股票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	2012-04-14
6	关于旗下部分基金参加国泰君安证券开放式基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2012-04-06
7	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	2012-03-30
8	关于新增浙商证券为旗下开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2012-02-13

## § 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全球机遇股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信全球机遇股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信全球机遇股票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

二〇一二年八月二十八日