
建信新兴市场优选股票型证券投资基金

2012 年半年度报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信新兴市场股票（QDII）
基金主代码	539002
交易代码	539002
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2011年6月21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	147,196,360.55份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于注册地或主要经济活动在新兴市场国家或地区的上市公司股票，在分散投资风险的同时追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在投资策略方面，将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等多种方式进行投资组合的构建。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：摩根士丹利资本国际新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index（Net Total Return））。
风险收益特征	本基金为股票型基金，一般情况下基金投资风险收益水平高于债券型基金和混合型基金。同时，由于本基金主要投资于新兴市场上市公司股票，预期风险-收益水平高于一般的境外投资股票型基金。

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	xinzipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	010-66105798

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

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

§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	1,053,131.38
本期利润	8,496,712.40
加权平均基金份额本期利润	0.0547
本期基金份额净值增长率	5.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
期末可供分配基金份额利润	-0.1057
期末基金资产净值	131,732,733.09
期末基金份额净值	0.895

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	3.11%	1.30%	3.62%	1.37%	-0.51%	-0.07%
过去三个月	-6.87%	1.12%	-8.08%	1.17%	1.21%	-0.05%
过去六个月	5.42%	1.02%	4.92%	1.08%	0.50%	-0.06%
过去一年	-10.50%	0.93%	-17.38%	1.46%	6.88%	-0.53%
成立至今	-10.50%	0.91%	-13.88%	1.45%	3.38%	-0.54%

注：1、本基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，截至报告日未滿三年。

2、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

建信新兴市场优选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

(2011 年 6 月 21 日至 2012 年 6 月 30 日)



注：1、本基金为股票型基金，投资组合中股票投资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%。本基金不低于 80% 的股票资产投资于注册地或主要经济活动在新兴市场国家或地区的公司或组织发行的证券，“主要经济活动在新兴市场国家或地区”指主营业务收入的至少 50% 来自于新兴市场国家或地区；“新兴市场国家或地区”指本基金业绩比较基准指数包含的国家或地区。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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	2011-06-21	-	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 4 月 20 日起任建信全球机遇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。
--	--	--	--	--	----------------------

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
Michael L. Reynal	在信安环球担任投资组合经理	21	达特茅斯学院 Amos Tuck 商学院 MBA 毕业。1991 年-1993 年，在 Barclays de Zoete Wedd 先后担任兼并与收购部门分析师，拉丁美洲股票销售。1993 年-1997 年，在 Paribas Capital Markets 担任股票销售总监。1998 年在花旗集团参加暑期实习。1999 年-2001 年，在 Wafra 投资顾问集团担任副总裁，投资组合经理和分析师。2001 年至今，在信安环球投资担任投资组合经理。负责领导新兴市场团队，同时分管分散投资的新兴市场组合和专门的亚洲区域股票策略。此外，进行公司研究，主要侧重于全球制药公司以及拉美/东欧/中东/非洲的消费品和不动产。

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 年上半年新兴市场经历了较大幅度的震荡。一季度以美国为首的发达国家经济一度表现良好；新兴市场，如中国、巴西等主要国家通胀显著下行。欧债危机在欧盟去年年底推出的一系列救助方案的作用下阶段性缓和，市场在多重利好因素刺激下大幅上涨。但是进入二季度后，希腊选举和西班牙银行坏账问题使得刚刚缓和的欧洲局势急转直下，欧债危机再次成为市场焦点，投资人去风险意愿急剧上升。另外全球经济也出现了较大程度的转变，美国为首的发达国家复苏力度明显放缓，新兴市场的中国、巴西等国在去通胀调控的同时，经济增速也出现较为明显的下滑，总体经济增长状况不容乐观。巴西、印度的 GDP、PMI、工业生产的数据下滑，中国 GDP、固定资产投资增速、PMI 等经济数据也都处于近几年的低位；相比而言，俄罗斯经济表现稍好，其中消费、收入增长、工业生长、PMI 等数据较好。这些都构成了市场在二季度产生焦虑，急于去风险的宏观基本面因素。

进入六月，欧债危机出现了一些缓和迹象，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政党获胜，并将主持组建新政府，短期内希腊退出欧盟的风险大幅下降。同时欧洲峰会取得阶段性成果，在财政联盟和银行体系监管等方面取得了较大进展，欧债危机风险有所降低，市场在六月中下旬有所反弹。

本基金基于对市场的判断，在 11 年四季度末期大幅上调了基金仓位，并将高仓位延续至一季度，充分地参与了上涨行情。进入二季度后我们在调整仓位的同时，在行业 and 个股方面也进行了积极轮换，使基金在市场总体下行过程中较好地控制了风险，力图为投资人带来较好相对收益。

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 5.42%，波动率 1.02%，业绩比较基准收益率 4.92%，波动率 1.08%。

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，我们认为新兴市场面临比较复杂的经济形势，市场仍然以震荡行情为主。对市场的积极因素包括：欧盟应对欧债危机更加积极，对欧债危机的反应速度和反映力度比前期有明显改善。新兴市场主要国家政策继续放松，中国、巴西连续降息，对市场产生了较为正面的影响；另外新兴市场国家较低的政府债务水平，较高的居民储蓄率、和较低的市场估值都表明新型市场的系统风险较低，市场有中长期的上涨基础。但是从短期看，负面因素仍然较为明显：成熟市场疲软的经济状况较大程度地影响了主要新兴市场国家的出口需求，从而造成短期的产能过剩。中国经济增长的放缓也对全球大宗商品的需求带来压力，并进而影响巴西、俄罗斯等国家的经济状况。总体而言，新兴市场国家的经济增速在放缓，并且这种趋势可能还将延续一定时间。另外关于欧债问题需要指出的是，欧洲危机将长期困扰全球市场，目前的救助行为很难立竿见影地彻底解决欧盟现有制度的核心缺陷，市场未来若干年的走势将随着欧盟制度改革的进展而上下起伏。总之，我们认为短期市场有向上动力，但鉴于经济依然处于向下趋势，市场未来的震荡格局不可避免。我们未来将着重关注欧盟应对欧债危机政策实施方案和全球经济趋势。在投资管理上加强调研深度和广度，在控制风险的前提下为投资人创造超额收益。

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新兴市场优选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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 年上半年，建信新兴市场优选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新兴市场优选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，建信新兴市场优选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新兴市场优选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：建信新兴市场优选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
资产：			
银行存款		13,201,656.80	14,572,618.22
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		118,225,423.57	125,962,456.11
其中：股票投资		116,663,824.73	124,456,402.43
基金投资		1,561,598.84	1,506,053.68
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		985,405.78	-
应收利息		1,044.02	2,617.70
应收股利		526,219.73	54,523.35
应收申购款		11,319.02	31,599.25
递延所得税资产		-	-
其他资产		815,468.72	-

资产总计		133,766,537.64	140,623,814.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
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		-	-
应付赎回款		624,058.83	264,079.99
应付管理人报酬		191,028.60	218,430.44
应付托管费		37,144.44	42,472.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,181,572.68	236,510.79
负债合计		2,033,804.55	761,493.81
所有者权益:			
实收基金		147,196,360.55	164,824,064.58
未分配利润		-15,463,627.46	-24,961,743.76
所有者权益合计		131,732,733.09	139,862,320.82
负债和所有者权益总计		133,766,537.64	140,623,814.63

注: 报告截止日 2012 年 6 月 30 日, 基金份额净值 0.895 元, 基金份额总额 147,196,360.55

份。

6.2 利润表

会计主体: 建信新兴市场优选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6月21日 (基金合同生效 日)至2011年6月 30日
一、收入		10,499,174.45	406,033.26
1.利息收入		28,689.84	406,033.26
其中: 存款利息收入		28,689.84	57,329.40
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		-	348,703.86
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		3,042,604.61	-
其中: 股票投资收益		1,008,962.40	-
基金投资收益		-	-

债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		72,514.11	-
股利收益		1,961,128.10	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		7,443,581.02	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-38,798.01	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		23,096.99	-
减：二、费用		2,002,462.05	263,260.82
1.管理人报酬		1,295,089.90	210,434.88
2.托管费		251,823.11	40,917.92
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		255,171.54	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		200,377.50	11,908.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,496,712.40	142,772.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,496,712.40	142,772.44

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至 2011 年 6 月 30 日未满半年。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信新兴市场优选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）	164,824,064.58	-24,961,743.76	139,862,320.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,496,712.40	8,496,712.40
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）	-17,627,704.03	1,001,403.90	-16,626,300.13
其中：1.基金申购款	2,339,295.34	-113,437.19	2,225,858.15
2.基金赎回款	-19,966,999.37	1,114,841.09	-18,852,158.28
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）	147,196,360.55	-15,463,627.46	131,732,733.09
项目	上年度可比期间		

	2011 年 6 月 21 日 (基金合同生效日) 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)	426,647,075.13	-	426,647,075.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	142,772.44	142,772.44
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)	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	426,647,075.13	142,772.44	426,789,847.57

注: 本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效, 至 2011 年 6 月 30 日未满半年。

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

建信新兴市场优选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[2011]第 316 号《关于核准建信新兴市场优选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《建信新兴市场优选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 2011 年 5 月 23 日起至 2011 年 6 月 17 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 426,628,617.18 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(2011)第 258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 21 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 426,647,075.13 份基金份额, 其中认购资金利息折合 18,457.95 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《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为新兴市场经济体证券市场及其他证券市场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投资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%。本基金不低于 80% 的股票资产投资于注册地或主要经济活动在新兴市场国家或地区的公司或组织发行的证券，“主要经济活动在新兴市场国家或地区”指主营业务收入的至少 50% 来自于新兴市场国家或地区；“新兴市场国家或地区”指本基金业绩比较基准指数包含的国家或地区。本基金的业绩比较基准为摩根士丹利资本国际新兴市场指数(MSCI Emerging Markets Index (Net Total Return))。

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》、《建信新兴市场优选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 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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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6月21日（基金合同生 效日）至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,295,089.90	210,434.88
其中：支付销售机构的客户维护费	562,505.53	37,810.44

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。

3、本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至 2011 年 6 月 30 日未半年。

6.4.8.2.2 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6月21日（基金合同生 效日）至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	251,823.11	40,917.92

注：1、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。

2、本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至 2011 年 6 月 30 日未半年。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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6月21日（基金合同生 效日）至2011年6月30日
基金合同生效日（2011 年 6 月 21 日）持有的基金份额	-	9,999,138.89
期初持有的基金份额	9,999,138.89	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,138.89	9,999,138.89
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	6.79%	2.34%

注：本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司在 2011 年度认购本基金的交易委托中国建设银行办理，认购费为 1,000 元。

6.4.8.4.2 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末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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6月21日（基金合同生效日） 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
中国工商银行	4,862,696.25	27,731.71	76,647,075.13	57,329.40
布朗兄弟哈里曼银行	8,338,960.55	957.90	-	-

注：1、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。

2、本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至 2011 年 6 月 30 日未满半年。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他需要说明的关联交易事项。

6.4.9 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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 118,225,423.57 元, 无属于第二层级和第三层级的余额(本基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效, 截止 2011 年 6 月 30 日未持有以公允价值计量的金融工具)。

(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	116,663,824.73	87.21
	其中：普通股	84,877,373.06	63.45
	存托凭证	29,087,681.40	21.75
	优先股	2,698,770.27	2.02
	房地产信托	-	-
2	基金投资	1,561,598.84	1.17
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	13,201,656.80	9.87
8	其他各项资产	2,339,457.27	1.75
9	合计	133,766,537.64	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(%)
美国	28,732,627.46	21.81
香港	23,435,921.74	17.79
韩国	22,487,790.68	17.07
南非	12,922,727.56	9.81
巴西	9,008,598.33	6.84
印尼	5,732,028.63	4.35
泰国	4,135,466.85	3.14
英国	3,785,264.54	2.87
马来西亚	3,534,889.35	2.68

墨西哥	2,888,509.59	2.19
合计	116,663,824.73	88.56

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	32,156,553.94	24.41
信息技术	18,069,222.03	13.72
能源	16,035,647.19	12.17
非必需消费品	13,868,051.18	10.53
必需消费品	9,464,498.06	7.18
材料	10,272,186.71	7.80
电信服务	7,046,785.65	5.35
工业	6,847,164.66	5.20
保健	1,397,597.97	1.06
公用事业	1,506,117.34	1.14
合计	116,663,824.73	88.56

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前十名权益投资明细

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	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	三星电子有限公司	KR7005930003	韩国证券交易所	韩国	1,096	7,268,524.43	5.52
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	台积电	US8740391003	纽约证券交易所	美国	46,400	4,096,916.03	3.11
3	CNOOC LTD	中国海洋石油	HK0883013259	香港证券交易所	中国香港	249,000	3,126,042.61	2.37
4	LUKOIL OAO-SPON ADR	卢克石油公司	US6778621044	美国OTC市场	美国	8,300	2,944,013.25	2.23
5	GAZPROM OAO-SPON ADR	俄罗斯天然气工业公司	US3682872078	美国OTC市场	美国	45,000	2,703,894.75	2.05
6	CHINA MOBILE LTD	中国移动有限公司	HK0941009539	香港证券交易所	中国香港	37,000	2,556,326.12	1.94

7	KIA MOTORS CORPORATION	起亚汽车公司	KR7000270009	韩国证券交易所	韩国	5,953	2,455,552.24	1.86
8	HYUNDAI MOTOR CO	现代汽车公司	KR7005380001	韩国证券交易所	韩国	1,890	2,426,484.13	1.84
9	SBERBANK-SPONSORED ADR	俄罗斯联邦储蓄银行	US80585Y3080	伦敦国际证券交易所	英国	33,271	2,262,184.29	1.72
10	SASOL LTD	沙索有限公司	ZAE000006896	南非证券交易所	南非	8,507	2,253,072.49	1.71

注：1、所用证券代码采用 ISIN 代码。

2、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站 www.ccbfund.cn 的年度报告正文。

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	ICICI BANK LTD-SPON ADR	US45104G1040	2,445,853.16	1.75
2	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	US8765685024	2,135,925.45	1.53
3	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	KR7000210005	1,905,540.77	1.36
4	BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	US05968L1026	1,838,262.94	1.31
5	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	KR7000810002	1,575,569.35	1.13
6	DOCTOR REDDY'S LAB-ADR	US2561352038	1,572,825.88	1.12
7	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	KR7009150004	1,506,588.35	1.08
8	UNITED MICROELECTRON-SP ADR	US9108734057	1,491,832.57	1.07
9	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	MXP370711014	1,380,882.79	0.99
10	CHINA EVERBRIGHT LTD	HK0165000859	1,358,067.11	0.97
11	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	ID1000057003	1,278,057.22	0.91

12	HYUNDAI HYSCO	KR7010520005	1,132,747.67	0.81
13	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	US71654V4086	1,119,615.27	0.80
14	BANK NEGARA INDONESIA PT	ID1000096605	1,112,653.39	0.80
15	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	KYG3225A1031	1,047,248.19	0.75
16	THAI UNION FROZEN PROD-FOREI	TH0450A10Z16	964,669.60	0.69
17	HYUNDAI MOBIS	KR7012330007	956,221.23	0.68
18	AU OPTRONICS CORP-SPON ADR	US0022551073	885,159.79	0.63
19	SIME DARBY BERHAD	MYL419700009	833,997.50	0.60
20	EVRAZ PLC	GB00B71N6K86	831,465.04	0.59

注：1、买入金额接买入成交金额(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	ICICI BANK LTD-SPON ADR	US45104G1040	3,510,432.74	2.51
2	BANCO DO BRASIL S.A.	BRBBASACNOR3	2,544,123.09	1.82
3	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	2,052,910.89	1.47
4	MTN GROUP LTD	ZAE000042164	1,834,144.58	1.31
5	LENOVO GROUP LTD	HK0992009065	1,828,633.90	1.31
6	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	US8765685024	1,720,613.86	1.23
7	INFOSYS LTD-SP ADR	US4567881085	1,587,880.75	1.14
8	CJ CHEILJEDANG CORP	KR7097950000	1,449,575.78	1.04
9	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	ZAE000063863	1,392,061.00	1.00
10	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	KYG2953R1065	1,349,982.85	0.97
11	CIELO SA	BRCIELACNOR3	1,335,826.31	0.96
12	CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	TH0101A10Z19	1,335,533.32	0.95
13	UNITED MICROELECTRON-SP ADR	US9108734057	1,332,029.89	0.95
14	ASIANA AIRLINES	KR7020560009	1,265,614.24	0.90
15	HON HAI PRECISION-GDR REG S	US4380902019	1,226,601.62	0.88
16	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	US8740391003	1,210,437.71	0.87
17	GS HOLDINGS	KR7078930005	1,206,033.40	0.86
18	SEVERSTAL - GDR REG S	US8181503025	1,157,937.24	0.83

19	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	CNE1000001Q4	1,135,535.03	0.81
20	KOREA ZINC CO LTD	KR7010130003	1,083,336.05	0.77

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	40,230,632.08
卖出收入（成交）总额	56,420,208.04

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	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUND	ETF	交易型开 放式指数	BlackRock Fund Advisors	1,561,598.84	1.19
2	-	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

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	985,405.78
3	应收股利	526,219.73
4	应收利息	1,044.02
5	应收申购款	11,319.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	815,468.72
9	合计	2,339,457.27

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。

§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
7,859	18,729.66	13,566,480.92	9.22%	133,629,879.63	90.78%

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	826,712.00	0.56%

注：公司高级管理人员持有该只基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）；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（2011 年 6 月 21 日）基金	426,647,075.13
----------------------------	----------------

份额总额	
本报告期期初基金份额总额	164,824,064.58
本报告期基金总申购份额	2,339,295.34
减：本报告期基金总赎回份额	19,966,999.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	147,196,360.55

§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	
GOLDMAN SACHS & CO.INC	-	5,312,745.65	5.51%	12,566.68	6.56%	-
MORGAN STANLEY	-	7,015,248.28	7.27%	10,631.63	5.55%	-
INSTINET CORP.	-	1,942,920.34	2.01%	2,138.96	1.12%	-
ITG	-	14,806,299.83	15.35%	23,773.65	12.42%	-
WOORI_E SECURITIES	-	157,861.42	0.16%	394.63	0.21%	-
BANK OF NEW YORK	-	3,745,246.82	3.88%	9,146.15	4.78%	-
MACQUARIE	-	2,700,320.91	2.80%	8,883.61	4.64%	-
MERRILL LYNCH	-	15,141,759.42	15.70%	21,004.36	10.97%	-
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.	-	161,563.38	0.17%	340.14	0.18%	-
RENAISSANCE CAPITAL	-	174,808.38	0.18%	343.10	0.18%	-
J.P.MORGAN	-	8,848,079.08	9.17%	14,516.25	7.58%	-
CREDIT SUISSE	-	4,366,951.38	4.53%	8,538.61	4.46%	-
CITIGROUP	-	5,558,447.64	5.76%	11,367.75	5.94%	-
ING BANK	-	3,861,790.04	4.00%	9,064.70	4.73%	-
SANTANDER INVESTMENT	-	702,343.51	0.73%	1,755.86	0.92%	-
BTIG LLC	-	176,712.28	0.18%	175.12	0.09%	-
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.	-	1,064,894.86	1.10%	2,662.19	1.39%	-
UBS SECURITIES	-	13,233,896.31	13.72%	34,887.17	18.22%	-
CREDIT LYONNAIS SEC.INC	-	867,069.81	0.90%	1,751.98	0.92%	-
HSBC	-	505,453.33	0.52%	669.47	0.35%	-
VTB CAPITAL PLC	-	316,437.91	0.33%	221.51	0.12%	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.	-	2,848,772.54	2.95%	5,697.54	2.98%	-
CREDIT AGRICOLE SEC	-	558,103.03	0.58%	8,438.53	4.41%	-
BARCLAYS CAPITAL INC.	-	105,723.30	0.11%	240.82	0.13%	-
LIQUIDNET	-	355,860.51	0.37%	172.87	0.09%	-
WEEDEN	-	412,991.89	0.43%	619.52	0.32%	-
BLAYLOCK ROBERT VAN	-	1,269,928.31	1.32%	902.99	0.47%	-
STANDARD CHARTERD	-	226,207.63	0.23%	565.52	0.30%	-
BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-
KEEFE	-	-	-	-	-	-

BRUYETTE							
STIFEL							
NICOLAUS	-	-	-	-	-	-	-
SUSQUEHANNA	-	-	-	-	-	-	-
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、本报告期新增服务券商为 WOORI_E SECURITIES、RENAISSANCE CAPITAL、BTIG LLC、VTB CAPITAL PLC、WEEDEN、STANDARD CHARTERD；本报告期无剔除的服务券商。

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
GOLDMAN SACHS & CO. INC	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

STANLEY										
INSTINET CORP.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
WOORI_E SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
RENAISSANCE CAPITAL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J. P. MORGAN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ING BANK	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER INVESTMENT	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTIG LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
VTB CAPITAL PLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT AGRICOLE SEC	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
WEEDEN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BLAYLOCK ROBERT VAN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

STANDARD CHARTERD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KEEFE BRUYETTE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
STIFEL NICOLAUS	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SUSQUEHANNA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司

二〇一二年八月二十八日