

---

# 建信全球机遇股票型证券投资基金 2012 年年度报告摘要

2012 年 12 月 31 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：二〇一三年三月二十八日

## §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 2013 年 3 月 26 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	284,626,066.31 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

### 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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所。

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2012 年	2011 年	2010 年 9 月 14 日 (基金合同生效日) 至 2010 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-4,500,140.63	-48,508,308.88	-11,579,933.04
本期利润	34,477,772.99	-61,095,229.69	-9,339,850.76
加权平均基金份额本期利润	0.1106	-0.1523	-0.0150
本期基金份额净值增长率	13.80%	-19.00%	-1.60%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1721	-0.2031	-0.0196
期末基金资产净值	258,033,955.04	267,977,433.82	548,603,397.82
期末基金份额净值	0.907	0.797	0.984

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
过去三个月	4.73%	0.62%	4.90%	0.60%	-0.17%	0.02%
过去六个月	8.23%	0.67%	10.18%	0.70%	-1.95%	-0.03%
过去一年	13.80%	0.75%	17.13%	0.80%	-3.33%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-9.30%	0.93%	6.91%	1.04%	-16.21%	-0.11%

注：1、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%。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 个发展中国家；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的中国公司股票价格走势。

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

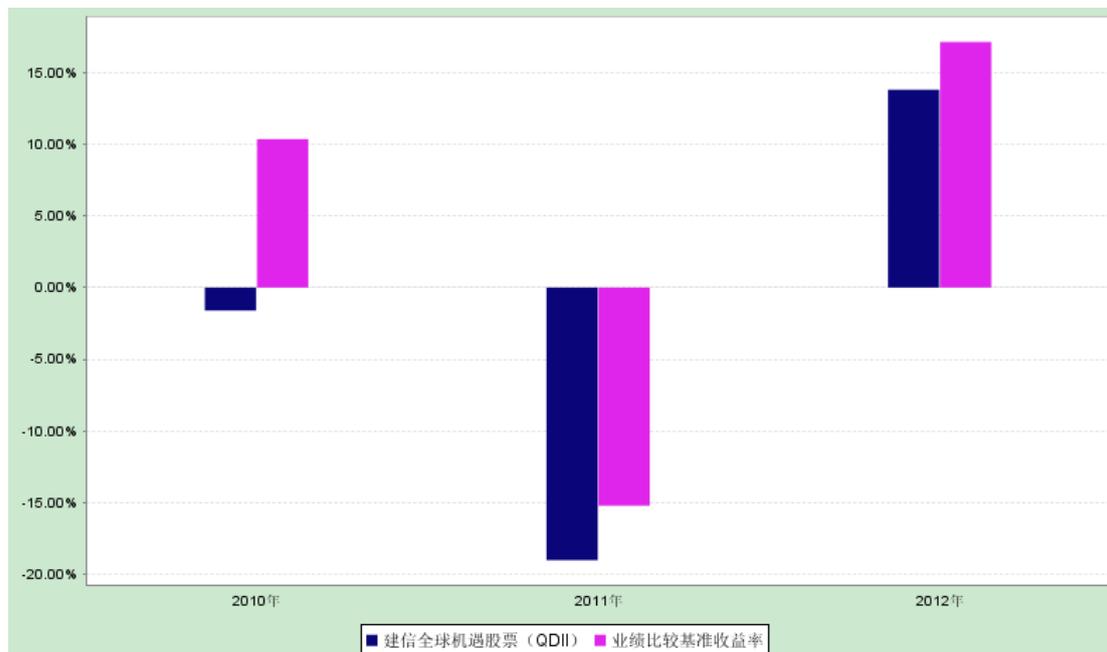
建信全球机遇股票型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2010 年 9 月 14 日至 2012 年 12 月 31 日）



- 注：1、同期业绩比较基准以人民币计价。  
2、本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

### 3.2.3 合同生效日以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信全球机遇股票型证券投资基金  
合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：本基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，2010 年净值增长率以实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

自基金合同生效以来未进行利润分配。

## §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、持续领先的综合性、专业化资产管理公司”。

截至 2012 年 12 月 31 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金

(LOF)、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信保本混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、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、建信社会责任股票型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债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 26 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 952.17 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股票型证券投资基金基金经理。
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、投资风险管理顾问等职。高茜于 2007 年 12 月加入我公司, 2012 年 4 月因个人原因离职。

#### 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
Christopher Ibach	投资组合经理	18	Christopher Ibach 负责监督支持所有股票策略的全球

			<p>研究&amp;发展,包括全球量化研究、股票选择模型发展、投资组合构建和风险管理。他作为共同投资组合经理,专精于主动核心、机会型的和专业全球组合。Chris 也监督公司的系统策略团队,负责被动增强和被动股票组合。他在 2000 年作为股票研究分析师加入公司,专精于分析国际科技公司并在 2002 年成为投资组合经理。在此之前,Chris 在 Motorola, Inc 取得了 6 年的相关行业经验。Chris 从 University of Iowa 获得了金融学 MBA 学位和电子工程学士学位。Chris 获得了使用特许金融分析师称号的权利并且是 CFA Institute 的成员。</p>
Mustafa Sagun	首席投资官	21	<p>Mustafa Sagun 是信安环球股票的首席投资官.他负责监督所有国际、国内和全球股票策略的投资组合管理和研究.Mustafa 从 2002 年开始就担任全球股票组合的主管投资经理。他之前也担任公司资产配置策略团队的成员。他 2000 年加入公司,并且有超过 19 年投资和风险管理经验。之前,他是 PNC 金融服务集团的副总裁和分析师和 Salomon Brothers 的股票衍生品专家。Mustafa 从 University of South Florida 取得金融学 Ph.D.学位和国际经济学 MA 学位。他从土耳其的 Bogazici University 取得电子和工程的学士学位。Mustafa 获得了使用特许金融分析师称号的权利。他是 CFA Institute 和 CFA</p>

			Society of Iowa 的成员。
Alan Wang	投资组合经理	12	<p>Alan Wang 担任香港和中国策略主管。作为全球新兴市场团队的成员，还担任大中华区研究团队负责人。他的职业生涯开始于中国银行，担任财务总监执行顾问超过 3 年时间，也为该行 IPO 准备工作提供支持。他最初加入信安时，是全球研发团队的高级成员，负责我们全球研究平台（GRP）的模型搭建，特别是亚洲和大中华选股模型。自 2003 至 2008 年他曾是信安组合经理和高级研究员，不仅是香港和中国股票组合经理，还是研究员及亚洲和新兴市场策略的助理组合经理。</p> <p>Alan Wang 曾任中国平安资产管理公司（香港）的股票投资总监，也曾任贝莱德亚洲的组合经理。持有爱荷华大学 Tippie 管理学院的 MBA 学位，中国人民大学经济学和国际金融学士学位。他具有特许金融分析师（CFA）资格。</p>

#### 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 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）管理的不同投资组合（包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下：

当时间窗为 1 日时，配了 1278 对投资组合，有 73 对投资组合未通过 T 检验，其中 5 对投资组合的正溢价率占优频率小于 55%，其它 68 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中，67 对投资组合的平均溢价率低于 2%，组合贡献率低于 5%，有 1 对投资组合的平均溢价率超过 2%，但其组合贡献率低于 5%，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为 3 日时，配了 1514 对投资组合，有 276 对投资组合未通过 T 检验，但其中 29 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 247 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合，其平均溢价率均低于 5%，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为 5 日时，配了 1579 对投资组合，有 410 对投资组合未通过 T 检验，但其中 47 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 363 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合，其平均溢价率均低于 10%，同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

#### 4.4.3 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 年全球市场表现靓丽，MSCI 全球指数上涨 16.85%，中国海外股票、新兴市场、成熟市场出现普涨现象。推动 2012 年全球市场上涨的主要原因是欧债风险大幅降低、美国经济持续复苏、全球货币流动性宽松。

欧债危机已经持续 3 年，2011 年下半年引起市场的极度恐慌，全球市场因此大幅下跌。2012 年欧盟做出了巨大努力，比较成功的化解了欧债危机的短期风险。首先欧央行推出两轮 LTRO 操作，向欧洲银行提供约 1 万亿欧元的三年期贷款，LTRO 操作极大地降低了银行流动性风险；其次，欧央行推出无上限购买欧元区主权债务，从而在中近期消除了欧元区的尾部风险；另外，年中的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，为未来欧盟制度改革制定出改革蓝图。欧债危机是左右全球市场的最重要力量之一，虽然 2012 年欧债风险总体可控，但 2 季度西班牙银行体系的坏账问题和希腊大选也令市场出现较大幅度的震荡。我们认为欧债危机的彻底解决仍需若干年的时间，未来欧债危机还将阶段性地干扰市场。

经济基本面方面，美国经济持续复苏，明显好于欧洲经济，新兴市场主要国家在 12 年一度出现增长乏力，但在四季度出现了经济增长复苏的势头。我们始终认为美国经济基本面良好，有较好弹性，经历了 08 年的金融危机，地产泡沫被挤出，美国经济得以缓慢但持续的复苏。2012 年，美国真实经济增长超过 2%，房地产价格触底上升趋势基本确认，失业率下降到 8% 以下，制造业 PMI 指数恢复至历史平均水平，产能利用率接近 80%，企业利润达到历史最高水平。我们认为美国经济未来将持续复苏，但同时需要注意的是本次经济复苏的力度较弱，并且会伴随一些短期的回调。目前美国的失业率虽然有所改善，但依然远高于其历史平均水平，较高的失业率将拖累消费增长，进而导致企业对投资持谨慎态度，最终影响经济反弹的力度。另外美国虽然有惊无险的度过了“财政悬崖”，但未来美国财政开支的削减和税收的增加也将对短期的经济复苏力度产生压力。2012

年欧洲经济不佳，欧洲（包括经济状况较好的德国）PMI 指数一直处于 50 以下，表明经济处于收缩状态；就业数据持续恶化，超过 11%，一些边缘国家的失业率甚至超过 20%；某些国家的经济也出现了负增长。由于 2011 年欧洲股票市场的下跌已经比较充分地反映了投资人对经济的悲观预期，所以尽管经济状况不佳，但市场在欧债危机风险缓和的氛围下仍旧上涨了 14%。我们预计欧洲经济将在 2013 年触底，但增长趋势可能长期弱于美国。新兴市场主要国家 2012 年经济增速有所放缓，中国、印度、巴西等国在前三个季度中的经济增速、工业 PMI 指数、消费等数据均出现增速下降情况，进入四季度中国、印度经济增速下滑趋势出现稳定迹象，尤其是中国，十八大后经济政策日趋明朗，企业盈利增速触底回升，经济开始新一轮周期性增长。

2012 年是全球货币宽松年，美国的扭转操作、QE3 和 QE4，欧洲的 LTRO 操作和无上限购买欧元区主权债务的承诺，日本超过 100 万亿日元的量宽措施等等都极大地降低了全球利率水平，提高了全球货币流动性。2012 年全球股市的良好表现与全球的货币宽松政策息息相关。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本年度本基金净值增长率 13.80%，波动率 0.75%，业绩比较基准收益率 17.13%，波动率 0.80%。

#### 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 2013 年，我们对市场持谨慎乐观态度。我们认为主要推动市场上涨的因素包括：全球经济增速将好于 2012 年、全球市场估值比较合理、企业盈利增速提高等。不利于市场的因素包括：欧债危机可能阶段性干扰市场，美国削减财政开支并增加税收，以及量化宽松的退出，一些新兴市场国家潜在的通胀风险等。我们认为：一、美国经济将继续缓慢复苏。美国就业市场、消费、美国房地产、能源等相关产业的增长将推动美国经济复苏；但美国削减财政开支和增加税收，美国量化宽松的退出将压制美国经济增长的力度。二、全球市场估值合理，盈利增长可能加快。目前全球市场的估值依然处于历史较低水平，同时预计欧洲、美国企业盈利增速水平将有所提高。三、主要新兴市场国家经济进一步改善，但需要密切关注通货膨胀，如果通胀上升，将对新兴市场带来较大风险。四、欧洲经济可能在 2013 年触底，但复苏力度较弱。另外欧盟的制度改革任重道远，欧债

危机将持续较长时间，未来某些政治事件、财政制度的改革仍将阶段性干扰市场。综上所述，我们认为 2013 年欧债危机、美国和欧洲经济复苏的起伏仍将造成市场较大的波动，但经济基本面和企业盈利的改善为市场提供上行动力。我们将继续遵循一贯的价值投资理念，挑选具有核心竞争力、估值合理的投资标的，力争为投资人带来良好的超额收益。

#### 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，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，建信全球机遇股票型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任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。

#### 5.3 托管人对本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全球机遇股票型证券投资基金 2012 年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 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司审计了后附的建信全球机遇股票型证券投资基金(以下简称“建信全球机遇股票基金”)的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注，并出具了普华永道中天审字(2013)第 20337 号标准无保留意见的

审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

编制和公允列报财务报表是建信全球机遇股票基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司 管理层的责任。这种责任包括：

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

我们认为，上述建信全球机遇股票基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了建信全球机遇股票基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 薛竞，金毅

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		18,745,366.80	35,662,974.99
结算备付金		9,090.91	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		241,230,126.81	233,158,443.71
其中：股票投资		224,125,546.51	208,571,859.93
基金投资		17,104,580.30	24,586,583.78
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		-	955,398.20
应收利息		1,378.22	2,323.26
应收股利		187,782.85	209,581.99
应收申购款		60,051.89	9,973.95
递延所得税资产		0.00	-
其他资产		13,465.30	4,119.34
资产总计		260,247,262.78	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 12 月 31 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,467,744.07	1,057,808.32
应付管理人报酬		393,440.52	414,577.78
应付托管费		76,502.35	80,612.35
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		275,620.80	472,383.17
负债合计		2,213,307.74	2,025,381.62
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		284,626,066.31	336,283,425.49
未分配利润		-26,592,111.27	-68,305,991.67
所有者权益合计		258,033,955.04	267,977,433.82
负债和所有者权益总计		260,247,262.78	270,002,815.44

注：1、报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.907 元，基金份额总额 284,626,066.31 份。

2、股票投资所列金额中包括存托凭证。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		41,424,562.59	-48,941,913.10
1.利息收入		49,502.85	294,742.89
其中：存款利息收入		41,458.39	123,139.48
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		8,044.46	171,603.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,519,248.08	-35,376,059.58
其中：股票投资收益		-4,659,454.73	-44,318,523.35
基金投资收益		801,106.90	1,043,629.15
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资		-	-
投资收益		-	-

衍生工具收益		-	109,685.03
股利收益		6,377,595.91	7,789,149.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		38,977,913.62	-12,586,920.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-148,444.89	-1,545,592.58
5.其他收入（损失以“-”号填列）		26,342.93	271,916.98
<b>减：二、费用</b>		6,946,789.60	12,153,316.59
1.管理人报酬		4,824,440.20	6,722,343.16
2.托管费		938,085.50	1,307,122.20
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		784,532.43	3,572,536.79
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		399,731.47	551,314.44
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		34,477,772.99	-61,095,229.69
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		34,477,772.99	-61,095,229.69

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 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）	-	34,477,772.99	34,477,772.99
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）	-51,657,359.18	7,236,107.41	-44,421,251.77
其中：1.基金申购款	3,516,128.81	-474,080.84	3,042,047.97
2.基金赎回款	-55,173,487.99	7,710,188.25	-47,463,299.74
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)	284,626,066.31	-26,592,111.27	258,033,955.04
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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)	-	-61,095,229.69	-61,095,229.69
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)	-221,344,364.04	1,813,629.73	-219,530,734.31
其中: 1.基金申购款	2,521,195.66	-190,035.38	2,331,160.28
2.基金赎回款	-223,865,559.70	2,003,665.11	-221,861,894.59
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)	336,283,425.49	-68,305,991.67	267,977,433.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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 (BrownBrothersHarriman&Co.)，境外投资顾问为信安环球投资有限公司 (PrincipalGlobalInvestors,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&PGlobalBMI)×70%+标准普尔 BMI 中国(除 A、B 股)指数总收益率(S&PBMIChinaex-A-B-Shares)×30%。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2013 年 XX 月 XX 日批准报出。

#### 7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 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

本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 7.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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) 目前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) 目前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，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

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
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)	境外资产托管人
信安环球投资有限公司(Principal Global Investors, LLC.)(“信安环球”)	境外投资顾问

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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 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内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

## 7.4.8.2 关联方报酬

## 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31 日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,824,440.20	6,722,343.16
其中：支付销售机构的客户维护费	1,345,627.18	3,566,202.90

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。

## 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31 日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	938,085.50	1,307,122.20

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。

## 7.4.8.3 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未通过关联方进行银行间同业市场的债

券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

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。

##### 7.4.8.4.2 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。

#### 7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	5,314,064.35	37,008.77	11,596,642.44	114,092.77
布朗兄弟 哈里曼银行	13,431,302.45	4,072.28	24,066,332.55	8,388.58

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，按约定利率计息。

#### 7.4.8.6 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。

#### 7.4.8.7 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未发生其他需要说明的关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 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。

#### 7.4.9.3.2 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。

#### 7.4.10 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) 各层级金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 241,230,126.81 元,无属于第二层级和第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日: 第一层级 233,158,443.71 元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

##### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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) 第三层级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。

## §8 投资组合报告

## 8.1 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	224,125,546.51	86.12
	其中：普通股	210,992,685.04	81.07
	存托凭证	13,132,861.47	5.05
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	17,104,580.30	6.57
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	18,754,457.71	7.21
8	其他各项资产	262,678.26	0.10
9	合计	260,247,262.78	100.00

## 8.2 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 (%)
香港	91,982,629.45	35.65
美国	72,237,775.82	28.00
日本	13,485,553.98	5.23
英国	15,515,210.98	6.01

德国	9,397,835.49	3.64
法国	8,435,775.79	3.27
加拿大	7,891,158.97	3.06
瑞典	1,508,300.67	0.58
韩国	1,125,047.81	0.44
意大利	1,090,847.75	0.42
荷兰	880,555.03	0.34
瑞士	574,854.77	0.22
合计	224,125,546.51	86.86

## 8.3 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 (%)
能源	27,521,289.70	10.67
金融	55,190,005.38	21.39
保健	12,553,680.75	4.87
工业	27,863,360.94	10.80
非必需消费品	24,144,269.41	9.36
必需消费品	14,496,892.43	5.62
信息技术	27,436,662.02	10.63
材料	13,515,699.51	5.24
电信服务	15,106,577.04	5.85
公用事业	6,297,109.33	2.44
合计	224,125,546.51	86.86

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

## 8.4 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	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	CNE1000001Z5	香港证券交易所	中国香港	3,615,000	10,142,030.72	3.93
2	CHINA	中国移动	HK09410	香港证	中国香港	83,000	6,073,874.64	2.35

	MOBILE LTD	动	09539	券交易所				
3	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国农业银行	CNE100000Q43	香港证券交易所	中国香港	1,402,000	4,353,988.81	1.69
4	PETROCHINA CO LTD-H	中国石油天然气	CNE1000003W8	香港证券交易所	中国香港	472,000	4,202,278.78	1.63
5	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	KYG875721485	香港证券交易所	中国香港	20,000	4,038,033.00	1.56
6	CNOOC LTD	中国海洋石油	HK0883013259	香港证券交易所	中国香港	270,000	3,673,637.01	1.42
7	CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION-H	中国交建	CNE1000002F5	香港证券交易所	中国香港	596,000	3,614,834.17	1.40
8	BAIDU INC - SPONSORED ADR	百度股份	US0567521085	纳斯达克交易所	美国	4,960	3,126,649.06	1.21
9	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国石化	CNE1000002Q2	香港证券交易所	中国香港	414,000	2,947,374.88	1.14
10	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	CNE100000338	香港证券交易所	中国香港	147,000	2,914,316.53	1.13

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。

## 8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.5.1 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	BANK OF CHINA LTD-H	CNE1000001Z5	4,460,720.83	1.66
2	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	3,317,369.14	1.24
3	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	JP3902900004	2,893,080.77	1.08
4	DONGYUE GROUP	KYG2816P1072	2,570,761.94	0.96
5	HOME DEPOT INC	US4370761029	2,481,159.31	0.93
6	DATANG INTL POWER GEN CO-H	CNE1000002Z3	2,480,795.36	0.93
7	FOOT LOCKER INC	US3448491049	2,427,100.35	0.91
8	LOWE'S COS INC	US5486611073	2,425,555.54	0.91
9	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	CNE100000312	2,229,970.40	0.83
10	ELI LILLY & CO	US5324571083	2,084,597.34	0.78
11	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	US1252691001	1,984,534.08	0.74
12	HSBC HOLDINGS PLC	GB0005405286	1,973,665.59	0.74
13	CANADIAN NATL RAILWAY CO	CA1363751027	1,889,359.81	0.71
14	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	AU000000NAB4	1,870,397.92	0.70
15	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	CNE1000002N9	1,857,547.76	0.69

16	SANOFI	FR0000120578	1,816,007.12	0.68
17	EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	KYG3225A1031	1,760,108.94	0.66
18	TENCENT HOLDINGS LTD	KYG875721485	1,757,148.70	0.66
19	BASF SE	DE000BASF111	1,719,766.25	0.64
20	GENERAL DYNAMICS CORP	US3695501086	1,715,241.19	0.64

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。

### 8.5.2 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	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	6,793,541.96	2.54
2	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	GB00B03MM408	4,307,757.75	1.61
3	CNOOC LTD	HK0883013259	3,569,415.01	1.33
4	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	CNE1000003X6	3,201,328.33	1.19
5	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	AU000000NAB4	3,095,849.08	1.16
6	BANK OF CHINA LTD-H	CNE1000001Z5	3,087,731.13	1.15
7	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	JP3902900004	3,071,138.81	1.15
8	BAIDU INC - SPON ADR	US0567521085	2,938,288.30	1.10
9	SIMON PROPERTY GROUP INC	US8288061091	2,807,727.93	1.05
10	CHINA MINSHENG BANKING-H	CNE100000HF9	2,745,063.50	1.02
11	TOTAL SA	FR0000120271	2,611,781.47	0.97
12	CHINA	HK0165000859	2,563,458.45	0.96

	EVERBRIGHT LTD			
13	FOOT LOCKER INC	US3448491049	2,481,631.79	0.93
14	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	CNE1000002R0	2,418,227.82	0.90
15	SHIRE PLC	JE00B2QKY057	2,388,470.77	0.89
16	ASTRAZENECA PLC	GB0009895292	2,343,289.40	0.87
17	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	CNE1000002Q2	2,327,294.34	0.87
18	CHINA MERCHANTS BANK-H	CNE1000002M1	2,297,446.88	0.86
19	HUTCHISON TELECOMM HONG KONG	KYG4672G1064	2,255,346.96	0.84
20	DATANG INTL POWER GEN CO-H	CNE1000002Z3	2,250,654.78	0.84

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。

### 8.5.3 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	216,776,231.67
卖出收入（成交）总额	233,648,661.16

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。

### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

8.9 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。

8.10 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	9,674,742.17	3.75
2	ISHARES DOW JONES US INDEX FUND	ETF 基金	交易型开放式指数	BLACKROCK FUND ADVISORS	7,429,838.13	2.88
3	-	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	应收证券清算款	-
3	应收股利	187,782.85
4	应收利息	1,378.22
5	应收申购款	60,051.89

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	13,465.30
9	合计	262,678.26

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 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。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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
13,073	21,772.05	3,867,043.45	1.36%	280,759,022.86	98.64%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截止到本期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### §10 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	3,516,128.81
减：本报告期基金总赎回份额	55,173,487.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	284,626,066.31

### §11 重大事件揭示

#### 11.1 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。

## 11.2 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基金托管部门未发生重大的人事变动。

## 11.3 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。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为人民币 72,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
BARCLAYS	-	14,064,962.74	3.13%	20,196.65	3.97%	-

CAPITAL IN						
BLAYLO CK ROBETR VAN	-	4,414,024.09	0.98%	2,716.68	0.53%	-
BMO CAPITAL MARKE TS	-	1,812,975.16	0.40%	1,146.92	0.23%	-
BNY CONVER GX	-	21,555,442.50	4.79%	14,583.66	2.86%	-
CCB INTERN ATIONA L SECURIT IES LTD.	-	34,420,973.48	7.65%	68,841.94	13.52%	-
CITIGRO UP	-	62,042,417.80	13.80%	49,307.69	9.68%	-
CREDIT AGRICO LE	-	2,453,784.93	0.55%	2,766.16	0.54%	-
CREDIT LYONNA IS SEC.INC	-	29,728,621.63	6.61%	53,327.66	10.47%	-
CREDIT SUISSE	-	16,610,017.08	3.69%	30,546.47	6.00%	-
DAIWA	-	2,370,268.51	0.53%	4,740.53	0.93%	-
DEUTSC HE BANK SECURIT IES INC.	-	11,754,273.17	2.61%	8,952.92	1.76%	-
DEUTSC HE BANK-E URO ALGORI THMS	-	4,574,522.30	1.02%	2,287.35	0.45%	-
GOLDM	-	6,706,505.07	1.49%	12,988.82	2.55%	-

AN SACHS						
ING BANK	-	13,510,846.84	3.00%	9,700.59	1.91%	-
INSTINET CORP.	-	24,264,986.52	5.40%	19,048.56	3.74%	-
ITG	-	1,328,928.39	0.30%	1,328.97	0.26%	-
ITG-CSA	-	34,271,796.83	7.62%	41,425.55	8.14%	-
J.P.MORGAN	-	21,698,048.95	4.83%	17,134.35	3.37%	-
KNIGHT SECURITIES	-	1,957,156.38	0.43%	2,132.64	0.42%	-
MACQUARIE CAPITAL-EURO	-	2,402,411.48	0.53%	1,571.58	0.31%	-
MACQUARIE CAPITAL	-	1,952,969.78	0.43%	3,905.97	0.77%	-
MACQUARIE-AUSTRALIA	-	2,987,151.30	0.66%	5,974.30	1.17%	-
MERRILL LYNCH	-	47,487,147.89	10.54%	59,394.57	11.66%	-
MORGAN STANLEY	-	12,394,153.03	2.76%	9,214.21	1.81%	-
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.	-	6,833,880.95	1.52%	10,874.03	2.14%	-
RBC CAPITAL MARKETS-EURO	-	5,032,333.29	1.12%	3,007.07	0.59%	-

REDBURN PARTNERS	-	1,990,034.10	0.44%	995.02	0.20%	-
SANDLER O'CEIL & PARTNERS	-	983,285.13	0.22%	2,899.24	0.57%	-
SANFORD BERNSTEIN	-	9,097,803.55	2.02%	8,846.46	1.74%	-
UBS SECURITIES	-	48,991,534.24	10.89%	39,327.34	7.72%	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
ABN AMRO SECURITIES	-	-	-	-	-	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC.	-	-	-	-	-	-
CARNEGIE	-	-	-	-	-	-
CIBC WORLD MARKETS	-	-	-	-	-	-
FIDELITY	-	-	-	-	-	-
GRIFFITHS MCBURNEY	-	-	-	-	-	-
HANDELSBANKEN	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES	-	-	-	-	-	-

LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-
MIZUHO	-	-	-	-	-	-
NBF SECURITIES CORP	-	-	-	-	-	-
PIPER JAFFRAY CO	-	-	-	-	-	-
ROYAL BANK OF SCOTLAND	-	-	-	-	-	-
SCOTIA	-	-	-	-	-	-
STANDARD CHARTERED	-	-	-	-	-	-
STIFEL NICOLAUS	-	-	-	-	-	-
TD NEWCREST	-	-	-	-	-	-
WILLIAM BLAIR	-	-	-	-	-	-
HSBC	-	-	-	-	-	-

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, SANDLER O'CEIL&PARTNERS, 报告期内无剔除单元。

## 11.7.2 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
BARCLAYS CAPITAL IN	-	-	-	-	-	-	-	-
BLAYLOCK ROBETR VAN	-	-	-	-	-	-	-	-
BMO CAPITAL MARKETS	-	-	-	-	-	-	-	-
BNY CONVERGX	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP	-	-	-	-	-	-	-	-

CREDIT AGRICOLE	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-	-	-	-
DAIWA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK-EURO ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ING BANK	-	-	-	-	-	-	-	-	-
INSTINET CORP.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG-CSA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J. P. MORGAN	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KNIGHT SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPITAL-EURO	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPTIAL	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE-AUSTRALIA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC	-	-	-	-	-	-	-	-	-

CAPITAL MARKETS-EU RO									
REDBURN PARTNERS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANDLER O' CEIL&amp ;PARTNERS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES	-	-	-	-	-	-	10,185,523.92	100.00%	
海通证券	-	-	63,500,000.00	100.00%	-	-	-	-	-
ABN AMRO SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CARNEGIE	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CIBC WORLD MARKETS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FIDELITY	-	-	-	-	-	-	-	-	-
GRIFFITHS MCBURNEY	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HANDELSBAN KEN	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MIZUHO	-	-	-	-	-	-	-	-	-

NBF SECURITIES CORP	-	-	-	-	-	-	-	-	-
PIPER JAFFRAY CO	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ROYAL BANK OF SCOTLAND	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SCOTIA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
STANDARD CHARTERED	-	-	-	-	-	-	-	-	-
STIFEL NICOLAUS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
T D NEWCREST	-	-	-	-	-	-	-	-	-
WILLIAM BLAIR	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC	-	-	-	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司

二〇一三年三月二十八日