

---

# 建信全球资源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 6 月 26 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	建信全球资源股票(QDII)
基金主代码	539003
交易代码	539003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月26日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,927,937.71 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过全球化的资产配置和组合管理，优选资源类相关行业的股票进行投资，在控制风险的同时，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	50%×MSCI 全球能源行业净总收益指数收益率（MSCI ACWI Energy Net Total Return Index）+50%×MSCI 全球原材料行业净总收益指数收益率（MSCI ACWI Material Net Total Return Index）。
风险收益特征	本基金是主动管理的全球配置型股票基金，其风险和预期收益高于债券型基金和混合型基金，本基金主要投资方向为资源类相关行业，属于具有较高风险和较高预期收益的证券投资基金品种。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	唐州徽
	联系电话	010-66228888	010-66594855
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tgxxpl@bank-of-china.com

客户服务电话	400-81-95533 010-66228000	95566
传真	010-66228001	010-66594942

## 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.	Deutsche Bank AG, Singapore Branch
	中文	信安环球投资有限公司	德意志银行新加坡分行
注册地址		801 Grand Avenue, Des Moines	One Raffles Quay, Level 17, South Tower, Singapore
办公地址		801 Grand Avenue, Des Moines	One Raffles Quay, #16-00, South Tower, Singapore
邮政编码		IA 50392-0490	048583

## 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6月26日（基金合同生效日） 至2012年12月31日
本期已实现收益	67,443.03
本期利润	1,069,555.00
加权平均基金份额本期利润	0.0126
本期基金份额净值增长率	1.60%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0109
期末基金资产净值	34,474,078.47
期末基金份额净值	1.016

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）。

4、本基金合同自 2012 年 6 月 26 日生效，截至报告日未满一年。

### 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	1.80%	0.80%	0.81%	0.84%	0.99%	-0.04%
过去六个月	1.60%	0.60%	7.98%	0.99%	-6.38%	-0.39%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.58%	13.22%	1.02%	-11.62%	-0.44%

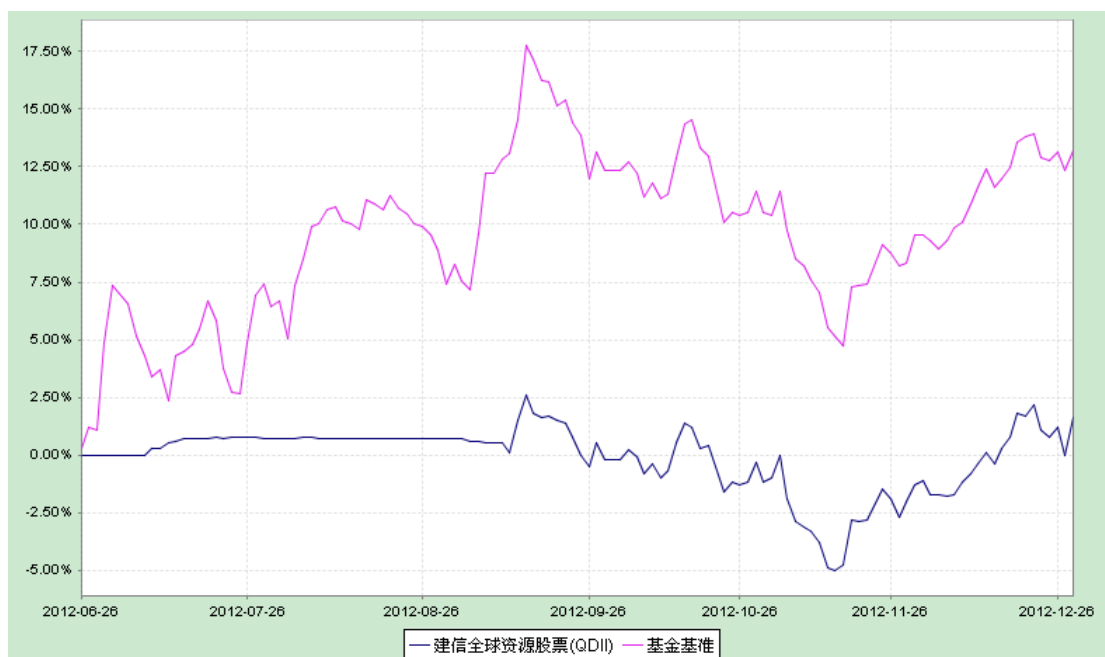
注：本基金的业绩比较基准为：50%×MSCI 全球能源行业净总收益指数收益率（MSCI ACWI Energy Net Total Return Index）+50%×MSCI 全球原材料行业净总收益指数收益率（MSCI ACWI Material Net Total Return Index）。MSCI 是全球领先的指数公司，具有超过 40 年的计算编制国际股票指数的丰富经验，MSCI 全球指数系列自编制以来，已经成为国际大型机构投资者及各种媒体广泛使用的业绩比较基准。MSCI 全球能源行业净总收益指数和 MSCI 全球原材料行业净总收益指数是 MSCI 全球指数系列中的两个行业指数，MSCI 全球指数系列的编制方法遵循客观、规则为本和自由流通市值加权的原则，从而使该指数系列能够捕捉到更为广泛的投资机会，指数的维护和调整公开透明，满足了投资者在使用该指数系列时的不同需求；MSCI 全球指数系列具有全面翔实的历史数据，包括指数层面数据、成份股层面数据和各种估值数据，为分析研究全球市场提供了有力支持；MSCI 全球指数系列能及时反映公司事件和市场变化，每年 4 次的指数审核及每日的公司事件审议保证了指数及时准确反映市场变化。

#### 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

建信全球资源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

（2012 年 6 月 26 日至 2012 年 12 月 31 日）



注：1、本基金基金合同于 2012 年 6 月 26 日生效，截止报告期末未满一年。

2、本基金业绩比较基准计价货币为人民币。

3、本基金投资于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普通股、优先股、存托凭证、公募股票型基金等；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，以及中国证监会认可的金融衍生产品等。

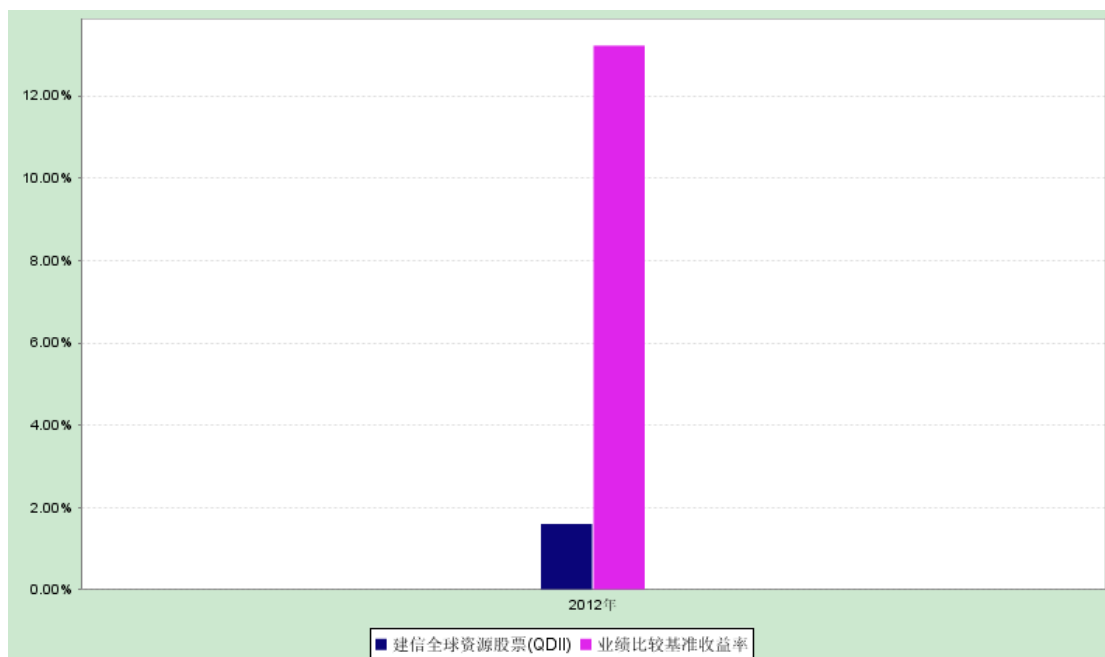
本基金为股票型基金，投资于股票的比例不低于基金资产的 60%，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，股票资产中投资于资源类相关行业的比例不低于 80%。基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

4、本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

### 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

建信全球资源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：本基金基金合同于 2012 年 6 月 26 日生效，2012 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

本基金自 2012 年 6 月 26 日（基金合同生效日）起至 2012 年 12 月 31 日未实施利润分配。

## §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	2012-06-26	-	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；2011 年 6 月 21 日起任建信新兴市场优选基金的基金经理。

#### 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
Mustafa Sagun	首席投资官	21	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 Society of Iowa 的成员。
Christopher Ibach	投资组合经理	18	Christopher 负责监督支持所有股票策略的全球研究&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。
--	--	---

#### 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

本年度全球资源板块主题先是欧洲经济危机再出波折，然后是下半年美国、中国的政治、经济和政策的演变。2012 年上半年全球主要市场先扬后抑，其中美国市场表现较好，而欧洲以及新兴市场表现不佳，使资源行业整体表现在上半年依然落后于大势。虽然欧洲央行推出 LTRO 为银行体系注入了流通性，但是欧洲实体经济疲软，再加上西班牙银行体系危机、希腊大选一波三折，投资者在一季度的乐观情绪很快被逆转。同时，美国经济指标在 2012 年上半年的走势也比较波动，美联储迟迟未推出新的量化宽松政策也使得大宗商品表现不佳。由于避险情绪的变化，资金在二季度回流美国使得美金走强，压制了大宗商品价格，也是上半年资源行业表现弱于市场的原因之一。

在下半年推出本只全球资源股票型基金后不久，即是九月下旬，本板块带领市场进行了一轮二季度大跌后的修复性反弹，形成技术性超买。但在 QE3 的利

多出尽后，市场处于多重政治经济不确定性的包围，面临技术性调整压力。先是美国大选，市场担忧连任后的总统是否会携胜选民意推出更强硬的税收政策。同时，市场的焦点开始集中在即将到来的“财政悬崖”问题上，共和、民主两党是否能够顺利谈判解决，经济是否会因谈判破裂而受到巨大的负面冲击，从而从根本上动摇对大宗商品、能源和原材料的需求。在太平洋的另一边，作为全球大宗商品最重要需求国的中国也面临十八大领导换届、经济周期性放缓和结构性问题呈现的多重不确定性。在这样的情况下，全球资源类股票连同相关的大宗商品都在 9 月的技术超买高位显著回调。

市场的悲观情绪在 11 月中旬开始好转：首先，美国两党都在“财政悬崖”问题上表现出愿意与对方妥协，并相继提出有交集谈判方案，由此市场开始对该问题“去风险”。同时美联储出乎市场预期又推出 QE4 量化宽松政策，为美国经济和房地产复苏提供进一步支持。另一方面，中国十八大在 11 月顺利召开并胜利闭幕，从而为这个全球最大资源消费国消除了前期高度炒作的政治风险。与此同时，中国、美国和欧洲在第四季度的宏观经济数据相继发生了周期性见底、反弹的信号，从而为全球资源这一强周期板块收复失地亮起绿灯。

#### 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 1.60%，波动率 0.59%，业绩比较基准收益率 13.22%，波动率 1.03%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对 2013 年全球资源市场谨慎乐观，认为全球经济增长将带动大宗商品的总体需求，全球低利率环境和较好的流动性支持大宗商品价格，与大宗商品相关的股票市场公司盈利增长较高并且股指水平比较合理将支持公司股价提升。我们认为主要风险来自欧债危机对市场的扰动和新兴市场主要国家的通胀威胁。我们预计 2013 年全球经济增长预期好于 2012 年。美国房地产市场复苏，欧洲经济 2013 年可能触底回升、新兴市场主要国家 2013 年经济增长可能明显好于 2012 年，这些都将增加对大宗商品的需求。作为全球大宗商品需求的又一最重要支柱的中国，也将在 13 年一季度末确立新的领导集体，为未来十年中国经济的平稳增长提供了政治基础。同时，新的领导集体提出的深化市场体制改革和城镇化发展的理念，也为未来十年中国经济发展确定了方向，重新明确了中国经济未来十

年增长的确定性。中国经济重新回到增长轨道对全球大宗商品、原材料和能源市场都具有深刻意义，已成为世界第二大经济体的中国，已经是推动全球经济成长，尤其是新兴市场经济成长的最重要引擎。

我们预期 2013 年全球流动性比较充裕，美联储每月购买 850 亿美元债券计划，欧央行无上限购买欧元区主权债的承诺、以及日本央行超过 100 万亿日元（约合 1.1 万亿美元）债券购买计划等措施将全球利率水平推至历史低位，2013 年全球流动性可能会比较宽松，从而为大宗商品价格提供支撑。目前，能源和原材料相关板块总体估值水平低于历史平均水平，比较合理；另外我们预计大宗商品相关公司 2013 年的平均盈利增速也可能高于 2012 年。我们认为全球资源的基本面相对乐观，但需要注意的是，欧债危机不可能在短期得到解决，2013 年很可能阶段性的干扰市场。美联储逐渐退出量化宽松的时间点和方式有较大不确定性，在 2013 年可能形成对大宗商品市场形成压力。同时，在全球发达国家大幅度输出流动性的情况下，中国、巴西和印度等主要新兴市场国家是否会进入新一轮通胀周期，进而提前扼杀本轮复苏。综上所述，我们相对看好 2013 年市场，认为全球资源的稀缺性决定了它在资产配置中应具有长期战略地位。在机会与风险并存的市场环境中，我们将遵循审慎进取的理念，以把握宏观趋势与精选个股相结合的方式，力争为投资人带来良好的收益。

#### 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(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金和理财类基金)。

#### 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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对建信全球资源股票型证券投资基金证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金

合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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资源股票型证券投资基金(以下简称“建信全球资源股票基金”)的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间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 20294 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。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：建信全球资源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
<b>资产：</b>		
银行存款		9,384,998.30
结算备付金		72,727.27
存出保证金		-
交易性金融资产		29,168,119.18
其中：股票投资		29,168,119.18
基金投资		-
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		-
应收利息		420.85
应收股利		36,909.91
应收申购款		66,642.37
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		38,729,817.88
<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>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		3,950,526.55
应付管理人报酬		62,774.88
应付托管费		12,206.27
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		230,231.71
负债合计		4,255,739.41
<b>所有者权益：</b>		
实收基金		33,927,937.71
未分配利润		546,140.76
所有者权益合计		34,474,078.47
负债和所有者权益总计		38,729,817.88

注：1、报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.016 元，基金份额总额 33,927,937.71 份。



2、本财务报表的实际编制期间为 2012 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：建信全球资源股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 6 月 26 日（基金合同生效日） 至 2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		2,233,443.38
1.利息收入		1,027,335.60
其中：存款利息收入		102,664.25
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		924,671.35
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-343,222.30
其中：股票投资收益		-573,589.78
基金投资收益		4,512.74
债券投资收益		-
资产支持证券投资		-
投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		225,854.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		1,002,111.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-95,990.49
5.其他收入（损失以“-”号填列）		643,208.60
<b>减：二、费用</b>		1,163,888.38
1.管理人报酬		751,439.72
2.托管费		146,113.36
3.销售服务费		-
4.交易费用		42,678.21

5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用		223,657.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,069,555.00
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,069,555.00

注：本财务报表的实际编制期间为 2012 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信全球资源股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 6 月 26 日（基金合同生效日）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）	498,237,044.50	-	498,237,044.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,069,555.00	1,069,555.00
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）	-464,309,106.79	-523,414.24	-464,832,521.03
其中：1.基金申购款	49,487,247.28	245,335.91	49,732,583.19
2.基金赎回款	-513,796,354.07	-768,750.15	-514,565,104.22
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）	33,927,937.71	546,140.76	34,474,078.47
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）	-	-	-

注：本财务报表的实际编制期间为 2012 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2012 年 12

月 31 日。

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

建信全球资源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[2012]第 322 号《关于核准建信全球资源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《建信全球资源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 2012 年 5 月 28 日起至 2012 年 6 月 21 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 498,213,122.75 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 211 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信全球资源股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 498,237,044.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 23,921.75 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，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为境外资产托管人为摩根大通银行香港分行(JPMorgan Chase Bank, National Association, Hong Kong Branch)，境外投资顾问为信安环球投资有限公司(Principal Global Investors, LLC.)。根据建信基金于 2012 年 10 月 17 日发布的公告及中国银行股份有限公司托管及投资者服务部《关于变更建信全球资源股票型基金境外托管人的函》(中银托(函)[2012]81 号)，中国银行股份有限公司决定自 2012 年 10 月 15 日起将本基金的境外托管人由摩根大通银行香港分行(JPMorgan Chase Bank, National Association, Hong Kong Branch)变更为德意志银行新加坡分行(Deutsche Bank AG, Singapore Branch)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信全球资源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普通股、优先股、存托凭证、公募股票型基金等；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，以及中国证监会认可的金融衍生产品等。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%，股票资产中投资于资源类相关行业的比例不低于 80%。本基金的业绩比较基准为  $50\% \times \text{MSCI 全球能源行业净总收益指数收益率}(\text{MSCI ACWI Energy Net Total Return Index}) + 50\% \times \text{MSCI 全球原材料行业净总收益指数收益率}(\text{MSCI ACWI Material Net Total Return Index})$ 。

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 3 月 15 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》、《建信全球资源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 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间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 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编

制期间为 2012 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易为目的持有的股票投资和基金投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和基金投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分

后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

### 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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
摩根大通银行香港分行 (JPMorgan Chase Bank, National Association, Hong Kong Branch)	境外资产托管人 (2012 年 10 月 15 日前)
德意志银行新加坡分行 (Deutsche Bank AG, Singapore Branch)	境外资产托管人 (2012 年 10 月 15 日起)
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：1、根据建信基金管理有限责任公司（以下简称“我公司”）收到的中国银行股份有限公司托管及投资者服务部《关于变更建信全球资源股票型基金境外托管人的函》（中银托（函）【2012】81号），中国银行股份有限公司决定自2012年10月15日起将建信全球资源股票型证券投资基金的境外托管人由摩根大通银行香港分行变更为德意志银行新加坡分行。上述事件我公司已报中国证监会和国家外汇管理局备案，并于2012年10月17日在指定媒体和公司公开披露。

2、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6月26日（基金合同生效日）至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	751,439.72
其中：支付销售机构的客户维护费	351,446.46

注：1、支付基金管理人建信基金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6月26日（基金合同生效日）至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	146,113.36

注：支付基金托管人中国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

本基金本报告期末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

本报告期末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

本报告期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6月26日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,170,440.21	68,106.03
德意志银行新加坡分行	5,214,558.09	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人德意志银行新加坡分行保管，存放于中国银行的存款按约定利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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 29,168,119.18 元，无属于第二层级或第三层级的余额。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

本基金本会计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)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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	29,168,119.18	75.31
	其中：普通股	16,357,825.94	42.24
	存托凭证	12,810,293.24	33.08

	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
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	9,457,725.57	24.42
8	其他各项资产	103,973.13	0.27
9	合计	38,729,817.88	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（%）
美国	28,575,284.40	82.89
英国	592,834.78	1.72
合计	29,168,119.18	84.61

## 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	13,894,773.99	40.30
材料	13,673,567.03	39.66
必需消费品	811,679.36	2.35
公用事业	788,098.80	2.29
合计	29,168,119.18	84.61

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	CHEVRON CORP	雪佛龙德士古	US1667641005	纽约证券交易所	美国	2,512	1,707,441.49	4.95
2	EXXON MOBIL CORP	艾克森美孚石油	US30231G1022	纽约证券交易所	美国	2,953	1,606,461.60	4.66
3	BASF SE-SPON ADR	巴斯夫欧洲公司	US0552625057	美国 OTC 市场	美国	2,419	1,444,439.33	4.19
4	BHP BILLITON PLC-ADR	必和必拓	US05545E2090	纽约证券交易所	美国	2,805	1,240,681.33	3.60
5	TOTAL SA-SPON ADR	道达尔	US89151E1091	纽约证券交易所	美国	3,445	1,126,201.01	3.27
6	BHP BILLITON LTD-SPON ADR	必和必拓有限公司	US0886061086	纽约证券交易所	美国	2,048	1,009,734.90	2.93
7	STATOIL ASA-SPON ADR	挪威国家石油公司	US85771P1021	纽约证券交易所	美国	5,598	881,063.17	2.56
8	TRANSCANADA CORP	横加公司	CA89353D1078	纽约证券交易所	美国	2,962	880,987.25	2.56
9	RIO TINTO	力拓公司	US7672041008	纽约证券交易所	美国	2,399	875,934.14	2.54

	PLC-S PON ADR			所				
10	MONS ANTO CO	孟山都	US61166 W1018	纽约证 券交易 所	美国	1,464	870,966.65	2.53

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](http://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末基金资产净值 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	占期末基金 资产净值比 例（%）
1	CHEVRON CORP	US1667641005	2,325,837.51	6.75
2	EXXON MOBIL CORP	US30231G1022	2,190,682.80	6.35
3	BASF SE-SPON ADR	US0552625057	1,665,525.34	4.83
4	MOSAIC CO/THE	US61945C1036	1,645,461.92	4.77
5	TOTAL SA-SPON ADR	US89151E1091	1,471,492.67	4.27
6	FREEMPORT-MCM ORAN COPPER	US35671D8570	1,463,857.61	4.25
7	BHP BILLITON PLC-ADR	US05545E2090	1,408,097.94	4.08
8	STATOIL ASA-SPON ADR	US85771P1021	1,174,243.70	3.41
9	BHP BILLITON LTD-SPON ADR	US0886061086	1,143,643.64	3.32
10	TRANSCANADA CORP	CA89353D1078	1,111,792.75	3.23
11	AGRIUM INC	CA0089161081	1,094,783.76	3.18
12	MONSANTO CO	US61166W1018	1,052,643.91	3.05
13	RIO TINTO PLC-SPON ADR	US7672041008	977,019.91	2.83

14	LYONDELLBASE LL INDU-CL A	NL0009434992	972,718.68	2.82
15	SYNGENTA AG-ADR	US87160A1007	939,575.62	2.73
16	GAZPROM OAO-SPON ADR	US3682872078	848,662.61	2.46
17	TECK RESOURCES LTD-CLS B	CA8787422044	846,266.06	2.45
18	HESS CORP	US42809H1077	821,714.48	2.38
19	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	CA73755L1076	785,274.55	2.28
20	LAFARGE S.A.-SPONSORED ADR	US5058614018	783,018.35	2.27
21	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	US1252691001	770,363.97	2.23
22	ENI SPA-SPONSORED ADR	US26874R1086	724,430.88	2.10
23	DEVON ENERGY CORPORATION	US25179M1036	711,427.11	2.06

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。

#### 8.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金 资产净值比 例（%）
1	FREEPORT-MCM ORAN COPPER	US35671D8570	1,209,536.17	3.51
2	MOSAIC CO/THE	US61945C1036	985,005.88	2.86
3	TECK RESOURCES LTD-CLS B	CA8787422044	838,746.83	2.43
4	PHILLIPS 66	US7185461040	731,923.99	2.12
5	GAZPROM OAO-SPON ADR	US3682872078	719,296.80	2.09
6	DEVON ENERGY CORPORATION	US25179M1036	613,582.93	1.78



7	GOLD FIELDS LTD-SPONS ADR	US38059T1060	606,935.11	1.76
8	CHEVRON CORP	US1667641005	463,870.51	1.35
9	ANGLOGOLD ASHANTI-SPON ADR	US0351282068	440,269.15	1.28
10	EXXON MOBIL CORP	US30231G1022	436,673.87	1.27
11	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	US71654V4086	429,995.43	1.25
12	ENBRIDGE INC	CA29250N1050	425,767.10	1.24
13	BASF SE-SPON ADR	US0552625057	389,822.08	1.13
14	CAMPBELL SOUP CO	US1344291091	382,473.78	1.11
15	AMEREN CORPORATION	US0236081024	372,620.88	1.08
16	HARMONY GOLD MNG-SPON ADR	US4132163001	369,526.66	1.07
17	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	US49455U1007	337,753.18	0.98
18	BHP BILLITON PLC-ADR	US05545E2090	331,574.89	0.96
19	TOTAL SA-SPON ADR	US89151E1091	303,071.58	0.88
20	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	US18683K1016	296,226.44	0.86

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	46,150,349.60
卖出收入（成交）总额	17,410,752.61

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

## 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

本基金本报告期末未持有基金。

## 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末没有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	36,909.91
4	应收利息	420.85
5	应收申购款	66,642.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	103,973.13

## 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
1,328	25,548.15	3,566,535.42	10.51%	30,361,402.29	89.49%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截止本报告期末，本基金管理公司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(2012年6月26日)基金份额总额	498,237,044.50
本报告期期初基金份额总额	498,237,044.50
本报告期基金总申购份额	49,487,247.28
减：本报告期基金总赎回份额	513,796,354.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	33,927,937.71

注：本基金基金合同自 2012 年 6 月 26 日生效，至本报告截止日 2012 年 12 月 31 日未  
满一年。

## §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。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

### 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 60,000.00 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	
GOLDMAN SACHS & CO., INC	-	719,296.80	1.13%	1,078.94	2.56%	-
SANFORD BERNSTEIN-ALG	-	6,604,935.63	10.39%	3,908.47	9.26%	-

ORITHM S						
MORGA N STANLE Y	-	5,078,283.54	7.99%	3,601.87	8.54%	-
ITG-CSA	-	-	0.00%	1,613.02	3.82%	-
BANK OF NEW YORK	-	5,310,515.92	8.35%	3,187.16	7.55%	-
MACQU ARIE CAPITAL	-	6,318,367.27	9.94%	2,559.49	6.07%	-
MERRIL L LYNCH	-	4,145,638.54	6.52%	4,143.96	9.82%	-
CITIGRO UP-PRO GRAM	-	25,393,507.23	39.95%	11,555.32	27.38%	-
ING BANK	-	1,556,641.33	2.45%	2,335.01	5.53%	-
UBS ALGORI THMS	-	951,169.06	1.50%	3,244.13	7.69%	-
STIFEL NICOLA US-PRO GRAM	-	6,822,787.16	10.73%	2,715.62	6.44%	-
LONGBO W SECURIT IES,LLC	-	659,959.72	1.04%	2,254.42	5.34%	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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、所有券商均为本报告期内新增的服务券商，本报告期无剔除的服务券商。

## 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
GOLDMAN SACHS&CO., INC	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	1,055,211.26	11.08%
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG-CSA	-	-	-	-	-	-	1,890,453.53	19.85%
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-	1,013,620.52	10.64%

MACQUARIE CAPITAL	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ING BANK	-	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	5,562,990.95	58.42%
STIFEL NICOLAUS-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Longbow Securities, LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	5,098,000,000.00	100.00%	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司

二〇一三年三月二十八日