

# 建信全球机遇股票型证券投资基金 2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 26 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 2013 年 8 月 22 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 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	38
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.....	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	59
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细.....	62
7.11 投资组合报告附注.....	62

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>63</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>63</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	66
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>66</b>
11.1 备查文件目录.....	66
11.2 存放地点.....	67
11.3 查阅方式.....	67

## § 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
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	243,376,153.12 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	蒋松云
	联系电话	010-66228888	010-66106912
	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	010-66106904
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	北京市西城区复兴门内大街 55

	号英蓝国际金融中心 16 层	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, IA 50392-0490	140 Broadway New York
办公地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	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	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
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(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	14,523,055.05
本期利润	-118,877.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0005
本期加权平均净值利润率	-0.05%
本期基金份额净值增长率	-0.77%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末 ( 2013 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	-34,467,768.64
期末可供分配基金份额利润	-0.1416
期末基金资产净值	218,985,687.32
期末基金份额净值	0.900
3.1.3 累计期末指标	报告期末 ( 2013 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	-10.00%

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	-4.36%	1.19%	-4.01%	1.15%	-0.35%	0.04%
过去三个月	-4.26%	0.89%	-2.81%	0.88%	-1.45%	0.01%
过去六个月	-0.77%	0.77%	0.87%	0.78%	-1.64%	-0.01%
过去一年	7.40%	0.72%	11.14%	0.74%	-3.74%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-10.00%	0.90%	7.84%	1.00%	-17.84%	-0.10%

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。

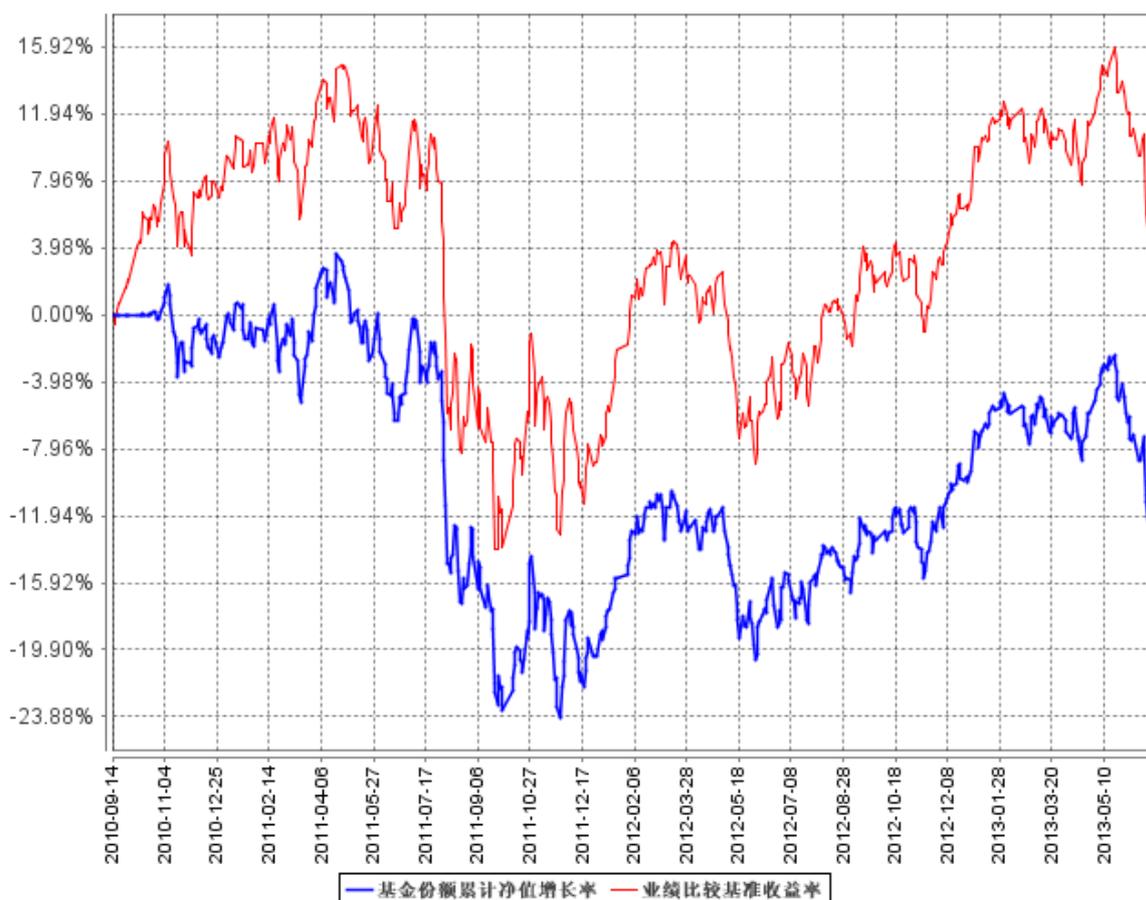
标准普尔 BMI 中国 (除 A、B 股) 指数 (S&P BMI China ex-A-B-Shares) 是由标准普尔指数公司

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外币计价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 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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。

## § 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。在上海设立了子公司—建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“最可信赖、持续领先的综合性、专业化资产管理公司”。

截至 2013 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（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、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金 31 只开放式基金和建信信用增强债券型证券投资基金 1 只封闭式基金，管理的基金资产规模共计为 483.16 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵英楷	海外投资部总监、本基金的基金经理	2011 年 4 月 20 日	-	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、

					<p>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；</p> <p>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、总监。</p> <p>2011 年 4 月 20 日起任建信全球机遇股票基金基金经理，</p> <p>2011 年 6 月 21 日起任建信新兴市场股票基金基金经理，</p> <p>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。</p>
--	--	--	--	--	--

#### 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	证券从业年限	说明
----	---------	--------	----

	所任职位		
Christopher Ibach	投资组合经理	19	<p>Christopher Ibach 负责监督支持所有股票策略的全球研究&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。他作为共同基金经理, 专精于主动核心、机会型的和专业全球组合。</p> <p>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 年成为基金经理。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	22	<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 在 2000 年加入公司。他从 2002 年开始就担任全球股票组合的主管基金经理, 而在 2006 年开始担任首席投资官。他之前也担任公司资产配置策略团队的成员。Mustafa 的职</p>

			<p>业生涯开始于 1991 年，曾担任过投资管理，研究和风险管理的职位。在加入信安之前，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。</p>
王曦	投资组合经理	13	<p>王曦在信安担任香港和中国投资组合的基金经理，他也是我们的高级投资分析师和大中华区研究团队负责人。王曦的金融职业生涯开始于中国银行总行，担任财务总监执行助理超过 3 年时间，也为该行 IPO 准备工作提供支持。王曦在 2003 年加入信安，担任香港和中国股票市场的基金经理以及亚洲和新兴市场策略的助理基金经理。作为全球研发团队的资深成员，王曦也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。他也在建设银行和信安</p>

			<p>的中国合资公司成立之初时任高级顾问。王曦在 2008 年离开信安，曾在中国平安资产管理公司（香港）担任股票投资总监，也曾任贝莱德亚洲的基金经理。王曦持有爱荷华大学 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。他执有特许金融分析师（CFA）资格。</p>
李晓西	投资组合经理	14	<p>李晓西是信安环球股票定量研究部总经理，负责所有股票策略的量化研究。他的研究职责包括为公司专属的全球研究平台（GRP）股票选择模型，投资组合构建和风险管理进行全球股票量化研究并实施模型开发。他也担任全球核心、全球全部国家、全球机遇、全球价值&amp;收入和其它专门的全球基金的基金经理。晓西在 2006 年加入公司。此前，晓西是 Hantang Securities Co., Ltd., Beijing 的高级经理。他的经历还包括 Yinjian Industrial Co., Ltd., Beijing 的投资组合经理。他从杜克大学获得 MBA 学位，从北京工商大学获得会计学硕士学位并从对外经济贸易大学会计学专业毕业。晓西是金融风险管理师持</p>

			证人和 Global Association of Risk Professionals 成员。他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

2013 年上半年，全球市场表现良好，结构上成熟市场表现突出，新兴市场有较大幅度回落。其中美国市场不断创出历史新高，在全球主要市场中表现较好，总体表现好于预期。虽然 GDP、工业 PMI 数据偏弱，但就业状况持续改善，收入和消费温和增长，房地产市场上升趋势确立，房

价涨幅创近几年新高，特别是企业利润持续超越市场预期，对市场产生较大推动作用。

日本市场一季度大幅上涨，虽然二季度经历了大幅震荡，但最终上涨幅度依然超过 30%。从目前的经济状况看，日本的量宽政策促进了短期日本经济，但日本国债收益率的上升也引发了市场担忧，我们认为日本未来经济制度改革的成败将决定日本未来的经济增长的长期方向。

欧洲经济依然停留在低位，GDP、工业 PMI、消费和失业率等数据均表明欧洲经济低迷，但由于市场对欧洲经济表现的期望值较低，而欧债危机短期再次爆发风险在充裕流动性的环境下大幅降低，欧洲总体表现平稳。

2013 年上半年，美国货币政策对市场方向起到了很大作用，一季度，成熟市场的量宽压低利率水平，增加了市场流动性，进而为全球股市提供了动力；另外由于股票市场的“挣钱”效益逐渐显现，流入股票市场的资金明显加速。进入二季度，鉴于美国较好的经济数据，美联储对 QE 退出的时间和方式进行了多次讨论，6 月下旬伯南克发表观点认为美联储可能在今年年底前开始退出 QE，并在 2014 年年中结束 QE，伯南克对于 QE 退出时间的陈述早于市场预期，引发股市和债市的大幅波动，成熟市场在二季度的上涨幅度也大幅低于一季度，预计美国 QE 退出仍将是主导下半年市场走势的重要因素。

新兴市场经历了去年下半年的大幅上涨后，今年上半年整体呈下跌态势。美国 QE 退出预期压制风险资产，资金从新兴市场回流成熟市场。另外，新兴市场主要国家正面临经济结构的制约，经济增长速度低迷，对市场造成下行压力。巴西、印度、俄罗斯均出现了不同程度回落，几个国家的经济数据均偏弱，GDP、工业 PMI 和零售等数据均处于历史较低水平；另外近期中国的主要经济指标，如固定资产投资、工业生产、工业 PMI，零售等数据均显示经济呈弱复苏状态，而中国针对地产和银行表外资产的调控超市场预期，六月底更是出现了“钱荒”，对市场造成较大冲击。中国经济弱复苏也对全球大宗商品市场产生压力，俄罗斯、巴西等与大宗商品相关度较高的市场也因此受到影响。同时，韩国和台湾对出口依赖较大，日元大幅贬值极大地增强了短期日本出口产品的价格竞争力，对韩国、台湾的出口和股票市场都形成了压力。另外巴西出现反政府示威游行，埃及近期出现的政治动荡表明新兴市场在经历了前十年的高速增长后需要一定的时间化解前期积累下来的社会和经济问题。新兴市场大幅下跌后可能会迎来技术性反弹，但中短期看，需要经济、政治基本面的改善才能帮助新兴市场走出目前的困局。

#### 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-0.77%，波动率 0.77%，业绩比较基准收益率 0.87%，波动率 0.78%。

#### 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，我们认为市场仍将维持震荡格局。虽然发达国家经济复苏较弱，但基本面处于向上周期，美国企业盈利能力在增强，欧洲经济有企稳迹象，全球估值偏低，对全球市场形成较好的长期支持。短期市场的最大不确定因素是美国 QE 的退出政策，鉴于美国 QE 操作史无前例，投资人较难估计 QE 退出对美国和全球经济和市场的影响。另外近期的埃及动荡和巴西反政府游行等事件增加了局部区域的不确定性。在未来可能的震荡市场环境下，需要投资人精选行业、各股，严格控制风险，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》

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

本报告期内，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

本报告期内，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2013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：2013年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	22,034,942.37	18,745,366.80
结算备付金		-	9,090.91

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	193,550,886.90	241,230,126.81
其中：股票投资		174,642,100.07	224,125,546.51
基金投资		18,908,786.83	17,104,580.30
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		4,354,656.98	-
应收利息	6.4.7.5	1,458.03	1,378.22
应收股利		1,441,594.76	187,782.85
应收申购款		4,442.84	60,051.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	4,416,607.11	13,465.30
资产总计		225,804,588.99	260,247,262.78
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,225,594.64	-
应付赎回款		639,457.48	1,467,744.07
应付管理人报酬		307,129.62	393,440.52
应付托管费		59,719.62	76,502.35
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	4,587,000.31	275,620.80
负债合计		6,818,901.67	2,213,307.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	243,376,153.12	284,626,066.31
未分配利润	6.4.7.10	-24,390,465.80	-26,592,111.27
所有者权益合计		218,985,687.32	258,033,955.04
负债和所有者权益总计		225,804,588.99	260,247,262.78

注：1、报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.900 元，基金份额总额 243,376,153.12 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：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至 2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012 年6月30日
<b>一、收入</b>		3,286,182.81	17,852,249.57
1.利息收入		18,070.51	25,516.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18,070.51	25,516.10
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		18,607,271.33	3,620,190.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	15,139,656.33	-962,231.17
基金投资收益	6.4.7.13	-	801,106.90
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	17,885.20	-
股利收益	6.4.7.16	3,449,729.80	3,781,314.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-14,641,932.28	14,079,198.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-697,947.71	110,071.25
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	720.96	17,273.73
<b>减：二、费用</b>		3,405,060.04	3,561,897.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,185,523.32	2,488,848.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	424,962.70	483,942.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	607,538.65	382,783.62
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
<b>6. 其他费用</b>	6.4.7.20	187,035.37	206,322.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-118,877.23	14,290,352.33
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-118,877.23	14,290,352.33

### 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：2013 年 1 月 1 日 至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	284,626,066.31	-26,592,111.27	258,033,955.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-118,877.23	-118,877.23
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）	-41,249,913.19	2,320,522.70	-38,929,390.49
其中：1.基金申购款	893,261.87	-60,731.60	832,530.27
2.基金赎回款	-42,143,175.06	2,381,254.30	-39,761,920.76
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）	243,376,153.12	-24,390,465.80	218,985,687.32
项目	上年度可比期间 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

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：

<u>孙志晨</u>	<u>何斌</u>	<u>秦绪华</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定 (以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信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。

#### 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 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 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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	22,034,942.37
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	22,034,942.37

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	164,659,660.88	174,642,100.07	9,982,439.19
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	14,902,083.21	18,908,786.83	4,006,703.62
其他	-	-	-
合计	179,561,744.09	193,550,886.90	13,989,142.81

### 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 2013年6月30日
应收活期存款利息	1,458.03
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	1,458.03

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
应收未起息外汇交易款	4,416,607.11
合计	4,416,607.11

**6.4.7.7 应付交易费用****6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	32.23
应付外汇未起息	4,412,878.76
预提费用	174,089.32
合计	4,587,000.31

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	284,626,066.31	284,626,066.31
本期申购	893,261.87	893,261.87
本期赎回(以“-”号填列)	-42,143,175.06	-42,143,175.06
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	243,376,153.12	243,376,153.12

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-48,990,823.69	22,398,712.42	-26,592,111.27
本期利润	14,523,055.05	-14,641,932.28	-118,877.23
本期基金份额交易产生的变动数	6,026,695.97	-3,706,173.27	2,320,522.70
其中：基金申购款	-128,659.09	67,927.49	-60,731.60
基金赎回款	6,155,355.06	-3,774,100.76	2,381,254.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,441,072.67	4,050,606.87	-24,390,465.80

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	18,065.89
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	2.44
其他	2.18
合计	18,070.51

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	212,074,233.25
减：卖出股票成本总额	196,934,576.92
买卖股票差价收入	15,139,656.33

**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**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出权证成交总额	17,885.20
减：卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	17,885.20

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,293,553.15
基金投资产生的股利收益	156,176.65
合计	3,449,729.80

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	-14,641,932.28
——股票投资	-16,446,138.81
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	1,804,206.53
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-14,641,932.28

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	720.96
合计	720.96

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 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	607,538.65
银行间市场交易费用	-
合计	607,538.65

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	35,704.06
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	2,563.79
合计	187,035.37

### 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

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	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,185,523.32	2,488,848.02
其中：支付销售机构的客户维护费	616,260.13	694,725.56

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 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	424,962.70	483,942.61

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		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 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	14,921,608.83	1,502.66	20,247,976.80	2,617.39
中国工商银行	7,113,333.54	16,563.23	5,096,741.75	22,897.89

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**

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.10.7 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

#### 6.4.11.1 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（2013 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

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

本基金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同时追求基金资产长期增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均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产品投资流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除 6.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.4 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

性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013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	22,034,942.37	-	-	-	22,034,942.37
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	193,550,886.90	193,550,886.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	4,354,656.98	4,354,656.98
应收利息	-	-	-	1,458.03	1,458.03
应收股利	-	-	-	1,441,594.76	1,441,594.76
应收申购款	-	-	-	4,442.84	4,442.84
其他资产	-	-	-	4,416,607.11	4,416,607.11
资产总计	22,034,942.37	-	-	203,769,646.62	225,804,588.99
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,865,692.94	2,865,692.94
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	145,322.15	145,322.15
应付托管费	-	-	-	29,064.39	29,064.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	211,109.64	211,109.64
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	337,450.50	337,450.50
负债总计	-	-	-	3,588,639.62	3,588,639.62
利率敏感度缺口	22,034,942.37	-	-	200,181,007.00	222,215,949.37
上年度末 2012 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	18,745,366.80	-	-	-	18,745,366.80
结算备付金	9,090.91	-	-	-	9,090.91
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	241,230,126.81	241,230,126.81
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	-	-	-	1,378.22	1,378.22
应收股利	-	-	-	187,782.85	187,782.85
应收申购款	-	-	-	60,051.89	60,051.89
其他资产	-	-	-	13,465.30	13,465.30
资产总计	18,754,457.71	-	-	241,492,805.07	260,247,262.78
负债					
卖出回购金融资产 款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,467,744.07	1,467,744.07
应付管理人报酬	-	-	-	393,440.52	393,440.52
应付托管费	-	-	-	76,502.35	76,502.35
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	-	-	-	275,620.80	275,620.80
负债总计	-	-	-	2,213,307.74	2,213,307.74
利率敏感度缺口	18,754,457.71	-	-	239,279,497.33	258,033,955.04

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例如附注 6.4.13.4.3.1 所示，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2013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	9,968,902.60	4,608,534.55	344,942.56	14,922,379.71
交易性金融资产	89,070,531.89	59,362,837.42	45,117,517.59	193,550,886.90
应收股利	174,456.09	756,817.41	86,289.56	1,017,563.06
应收证券清算款	195,794.23	201,844.79	3,957,017.96	4,354,656.98
其它资产	4,416,607.11	-	-	4,416,607.11
资产合计	103,826,291.92	64,930,034.17	49,505,767.67	218,262,093.76
以外币计价的负债				
应付证券清算款	1,225,594.64	-	-	1,225,594.64
其它负债	-	201,844.79	4,211,033.97	4,412,878.76
负债合计	1,225,594.64	201,844.79	4,211,033.97	5,638,473.40
资产负债表外汇风险敞口净额	102,600,697.28	64,728,189.38	45,294,733.70	212,623,620.36
项目	上年度末 2012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	9,163,242.25	4,285,288.36	109,074.00	13,557,604.61
交易性金融资产	92,619,316.95	91,982,629.45	56,628,180.41	241,230,126.81
应收股利	116,167.16	10,189.14	61,426.55	187,782.85
应收利息	2.07	-	-	2.07
其他资产	13,465.30	-	-	13,465.30
资产合计	101,912,193.73	96,278,106.95	56,798,680.96	254,988,981.64
以外币计价的负债				
以外币计价的负债	-	-	13,468.03	13,468.03
负债合计	-	-	13,468.03	13,468.03
资产负债表外汇风险敞口净额	101,912,193.73	96,278,106.95	56,785,212.93	254,975,513.61

#### 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（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币贬值 5%	-10,631,331.02	-12,748,775.68
	所有外币相对人民币升值 5%	10,631,331.02	12,748,775.68

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票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%。

##### 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 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	174,642,100.07	79.75	224,125,546.51	86.86
交易性金融资产—基金投资	18,908,786.83	8.63	17,104,580.30	6.63
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	193,550,886.90	88.38	241,230,126.81	93.49

**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（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	10,422,623.79	8,903,332.94
业绩比较基准下降 5%	-10,422,623.79	-8,903,332.94	

**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 2013 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 193550886.90 元，无属于第二层级和第三层级的余额(2012 年 6 月 30 日：第一层级 235,062,076.48 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	174,642,100.07	77.34
	其中:普通股	171,992,191.27	76.17
	存托凭证	2,649,908.80	1.17
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	18,908,786.83	8.37
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	22,034,942.37	9.76
8	其他各项资产	10,218,759.72	4.53
9	合计	225,804,588.99	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	70,161,745.06	32.04
中国香港	59,362,837.42	27.11
英国	10,170,885.01	4.64
澳大利亚	5,822,444.75	2.66
日本	5,894,949.91	2.69
瑞士	2,168,867.70	0.99
德国	5,258,155.17	2.40
瑞典	1,760,905.24	0.80

意大利	1,026,130.44	0.47
加拿大	6,036,429.99	2.76
法国	6,978,749.38	3.19
合计	174,642,100.07	79.75

### 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 (%)
非必需消费品	23,519,701.69	10.74
必需消费品	10,238,459.38	4.68
能源	16,203,923.91	7.40
金融	46,897,557.21	21.42
保健	15,294,344.91	6.98
工业	16,299,651.15	7.44
信息技术	25,301,176.26	11.55
材料	6,403,548.92	2.92
电信服务	7,413,080.90	3.39
公用事业	7,070,655.74	3.23
合计	174,642,100.07	79.75

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	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	CNE1000001Z5	香港证券交易所	中国香港	1,885,000	4,789,774.63	2.19
2	CHINA MOBILE LTD	中国移动	HK0941009539	香	中国	74,000	4,774,520.70	2.18

				港 证 券 交 易 所	香 港			
3	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	KYG875721485	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	16,700	4,046,585.52	1.85
4	US BANCORP	美国银行公 司	US9029733048	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	15,563	3,476,151.76	1.59
5	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	Discover 金融服务公 司	US2547091080	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	10,706	3,151,346.09	1.44
6	MICROSOFT CORP	微软	US5949181045	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	14,239	3,037,897.93	1.39
7	WELLS FARGO & CO	富国银行	US9497461015	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	11,832	3,017,100.24	1.38
8	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特公 司	US20030N1019	纳 斯 达 克	美 国	11,346	2,935,935.84	1.34

				交易所				
9	CNOOC LTD	中国海洋石油	HK0883013259	香港证券交易所	中国香港	275,000	2,882,714.45	1.32
10	TYSON FOODS INC-CL A	泰森食品公司	US9024941034	纽约证券交易所	美国	16,890	2,679,919.68	1.22
11	ABBVIE INC	-	US00287Y1091	纽约证券交易所	美国	10,056	2,568,578.52	1.17
12	GUANGDONG INVESTMENT LTD	粤海投资	HK0270001396	香港证券交易所	中国香港	456,000	2,440,884.10	1.11
13	FIFTH THIRD BANCORP	五三银行	US3167731005	纳斯达克交易所	美国	21,659	2,415,531.56	1.10
14	AMGEN INC	安进	US0311621009	纳斯达克交易所	美国	3,929	2,395,081.24	1.09

15	DUERR AG	杜尔有限公司	DE0005565204	柏林 证 券 交 易 所	德国	6,266	2,339,252.12	1.07
16	OMNICARE INC	omnicare 股份有限公 司	US6819041087	纽 约 证 券 交 易 所	美国	7,540	2,222,684.76	1.01
17	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	KYG5264Y1089	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	214,000	2,185,318.99	1.00
18	SEAGATE TECHNOLOGY	希捷科技公 司	IE00B58JVZ52	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	7,749	2,146,404.20	0.98
19	CHINA WIRELESS TECH LTD	中国无限科 技	KYG211651081	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	884,000	2,070,201.59	0.95
20	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDIN	三井住友信 托控股株式 会社	JP3892100003	东 京 交 易 所	日本	71,000	2,058,079.91	0.94
21	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村商 业银行	CNE100000X44	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	780,000	2,044,106.61	0.93

				易所				
22	MCKESSON CORP	麦卡逊	US58155Q1031	纽约 证券 交易 所	美国	2,872	2,031,828.42	0.93
23	LOWES COS INC	劳氏	US5486611073	纽约 证券 交易 所	美国	7,861	1,986,544.11	0.91
24	HESS CORP	阿美拉达赫 斯	US42809H1077	纽约 证券 交易 所	美国	4,825	1,982,215.01	0.91
25	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际	CNE1000006Z4	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	320,000	1,957,601.28	0.89
26	KROGER CO	克罗格公司	US5010441013	纽约 证 券 交 易 所	美国	9,134	1,949,307.93	0.89
27	CANADIAN NATL RAILWAY CO	加拿大国家 铁路公司	CA1363751027	多伦 多 证 券 交 易 所	加拿 大	3,200	1,919,268.57	0.88

28	PERSIMMON PLC	柿子公司	GB0006825383	英国 伦敦 交易所	英国	17,038	1,895,742.49	0.87
29	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通银行	US46625H1005	纽约 证券 交易所	美国	5,711	1,862,777.28	0.85
30	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公司	US9581021055	纳斯 达克 交易所	美国	4,832	1,853,726.65	0.85
31	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷兰皇家壳牌	GB00B03MLX29	英国 伦敦 交易所	英国	9,246	1,829,296.14	0.84
32	CA INC	冠群国际	US12673P1057	纳斯 达克 交易所	美国	10,159	1,797,088.30	0.82
33	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国石化	CNE1000002Q2	香港 证券 交易所	中国 香港	406,600	1,768,369.68	0.81
34	LOOMIS AB-B	-	SE0002683557	斯德 哥	瑞典	14,938	1,760,905.24	0.80

				尔摩 证 券 交 易 所				
35	HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	汉诺威再保 险股份公司	DE0008402215	柏 林 证 券 交 易 所	德 国	3,900	1,737,548.09	0.79
36	INTERMEDIATE CAPITAL GROUP	ICG 集团	GB0004564430	英 国 伦 敦 交 易 所	英 国	42,279	1,732,307.34	0.79
37	CHEVRON CORP	雪佛龙德士 古	US1667641005	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,299	1,680,999.74	0.77
38	MARATHON OIL CORP	马拉松石油	US5658491064	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	7,867	1,680,858.86	0.77
39	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	CNE100000338	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	61,000	1,625,320.45	0.74
40	ALLSTATE CORP	全州保险	US0200021014	纽 约 证	美 国	5,412	1,609,090.67	0.73

				券 交 易 所				
41	NOVO-NORDISK A/S-SPONS ADR	诺和诺德公 司	US6701002056	纽 约 证 券 交 易 所	美国	1,661	1,590,429.32	0.73
42	JAPAN TOBACCO INC	日本烟草产 业	JP3726800000	东 京 交 易 所	日本	7,200	1,579,950.25	0.72
43	SYMANTEC CORP	赛门铁克	US8715031089	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	10,879	1,510,390.20	0.69
44	TYCO INTERNATIONAL LTD	泰科国际	CH0100383485	纽 约 证 券 交 易 所	美国	7,412	1,508,995.48	0.69
45	LYONDELLBASELL INDU-CL A	利安德巴塞 尔工业公司	NL0009434992	纽 约 证 券 交 易 所	美国	3,684	1,508,232.04	0.69
46	FLIGHT CENTRE LTD	福莱森特有 限公司	AU000000FLT9	澳 大 利 亚 证 券 交 易	澳大 利亚	6,619	1,472,073.34	0.67

				所				
47	AGRIUM INC	-	CA0089161081	多 伦 多 证 券 交 易 所	加 拿 大	2,700	1,441,946.57	0.66
48	PETROCHINA CO LTD-H	中国石油天 然气	CNE1000003W8	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	218,000	1,432,595.18	0.65
49	SYNOPSYS INC	新思科技公 司	US8716071076	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	6,355	1,403,746.58	0.64
50	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	CNE1000003X6	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	33,500	1,392,926.99	0.64
51	METRO INC	卖德龙股份 有限公司	CA59162N1096	多 伦 多 证 券 交 易 所	加 拿 大	3,300	1,362,277.71	0.62
52	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	农业银行	CNE100000Q43	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	533,000	1,358,595.68	0.62

53	HUSKY ENERGY INC	赫斯基能源公司	CA4480551031	多伦多证券交易所	加拿大	8,000	1,312,937.14	0.60
54	BAE SYSTEMS PLC	英国宇航系统	GB0002634946	英国伦敦交易所	英国	36,376	1,312,576.27	0.60
55	PRIMARY HEALTH CARE LTD	PRIMARY 医疗保健有限公司	AU000000PRY5	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	47,671	1,288,532.21	0.59
56	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	KYG8586D1097	香港证券交易所	中国香港	172,000	1,282,381.78	0.59
57	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	三井住友金融集团	JP3890350006	东京交易所	日本	4,500	1,281,878.33	0.59
58	PROTECTIVE LIFE CORP	PROTECTIVE LIFE 公司	US7436741034	纽约证券交易所	美国	5,357	1,271,343.96	0.58
59	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中国电信	CNE1000002V2	香港	中国香港	430,000	1,267,311.05	0.58

				证 券 交 易 所				
60	SWATCH GROUP AG/THE-BR	斯沃琪集团	CH0012255151	瑞 士 证 券 交 易 所	瑞 士	372	1,256,011.31	0.57
61	EASYJET PLC	易捷航空公 司	GB00B7KR2P84	英 国 伦 敦 交 易 所	英 国	10,182	1,243,222.69	0.57
62	VINCI SA	万喜公司	FR0000125486	法 国 交 易 所	法 国	3,979	1,235,505.59	0.56
63	AXA SA	安盛集团	FR0000120628	法 国 交 易 所	法 国	10,133	1,231,859.65	0.56
64	PRUDENTIAL PLC	保诚	GB0007099541	英 国 伦 敦 交 易 所	英 国	12,163	1,231,856.17	0.56
65	AMCOR LIMITED	澳大利亚 AMCOR 有 限 公 司	AU000000AMC4	澳 大 利 亚 证 券 交 易 所	澳 大 利 亚	21,372	1,225,451.82	0.56

66	SANOFI	赛诺菲安万特公司	FR0000120578	法国交易所	法国	1,899	1,217,691.27	0.56
67	GAP INC/THE	GAP 公司	US3647601083	纽约证券交易所	美国	4,690	1,209,256.24	0.55
68	YAHOO! INC	雅虎	US9843321061	纳斯达克交易所	美国	7,787	1,208,130.91	0.55
69	WAL-MART STORES INC	沃尔玛百货	US9311421039	纽约证券交易所	美国	2,578	1,186,528.01	0.54
70	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	德国汉莎航空公司	DE0008232125	柏林证券交易所	德国	9,406	1,181,354.96	0.54
71	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	US38141G1040	纽约证券交易所	美国	1,256	1,173,767.64	0.54
72	HOME DEPOT INC	家得宝	US4370761029	纽约证券交	美国	2,406	1,151,665.32	0.53

				易所				
73	CARDINAL HEALTH INC	-	US14149Y1082	纽约 证券 交易 所	美国	3,945	1,150,498.65	0.53
74	ORACLE CORP	甲骨文	US68389X1054	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	5,976	1,134,302.55	0.52
75	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	KYG9828G1082	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	234,000	1,123,947.98	0.51
76	RENAULT SA	雷诺汽车公 司	FR0000131906	法 国 交 易 所	法国	2,686	1,118,372.83	0.51
77	SAFRAN SA	赛峰公司	FR0000073272	法 国 交 易 所	法国	3,428	1,107,760.60	0.51
78	INGENICO	安智集团	FR0000125346	法 国 交 易 所	法国	2,589	1,067,559.44	0.49
79	TELEKOMUNIK INDONESIA-SP ADR	印尼电信股 份有限公司	US7156841063	纽 约 证 券 交 易 所	美国	4,012	1,059,479.48	0.48

80	DELPHI AUTOMOTIVE PLC	-	JE00B783TY65	纽约 证券 交易所	美国	3,362	1,052,972.69	0.48
81	ENSCO PLC-CL A	恩斯克国际 公司	GB00B4VLR192	纽约 证券 交易所	美国	2,925	1,050,385.18	0.48
82	BANCA GENERALI SPA	忠利银行股 份公司	IT0001031084	意大利 证券 交易所	意大利	7,694	1,026,130.44	0.47
83	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国人寿	CNE1000002L3	香港 证券 交易所	中国 香港	70,000	1,025,956.40	0.47
84	MIRVAC GROUP	MIRVIC 集 团	AU000000MGR9	澳大利 亚证 券交 易所	澳大利 亚	110,994	1,007,366.86	0.46
85	TOYOTA MOTOR CORP	丰田汽车	JP3633400001	东京 交易 所	日本	2,600	975,041.42	0.45
86	STANDARD LIFE PLC	标准人寿保 险有限公司	GB00B16KPT44	英国	英国	28,428	925,883.91	0.42

				伦敦交易所				
87	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	瑞士厉峰集团	CH0045039655	瑞士证券交易所	瑞士	1,673	912,856.39	0.42
88	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	碧桂园	KYG245241032	香港证券交易所	中国香港	276,000	892,582.07	0.41
89	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	世茂房地产	KYG810431042	香港证券交易所	中国香港	72,500	889,348.08	0.41
90	MACYS INC	梅西集团	US55616P1049	纽约证券交易所	美国	2,980	883,801.25	0.40
91	RAMSAY HEALTH CARE LTD	拉姆塞医疗保健集团	AU000000RHC8	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	4,094	829,020.52	0.38
92	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	雅居乐地产控股有限公司	KYG011981035	香港证	中国香港	122,000	808,530.11	0.37

				券交易所				
93	BEIJING CAPITAL LAND LTD-H	首创置业	CNE100000239	香港证券交易所	中国香港	350,000	788,982.78	0.36
94	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	海螺水泥	CNE1000001W2	香港证券交易所	中国香港	46,000	769,467.30	0.35
95	TCL MULTIMEDIA TECHNOLOGY	TCL 多媒体	KYG8701T1388	香港证券交易所	中国香港	194,000	707,750.61	0.32
96	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORPLT	中国铁建	CNE100000981	香港证券交易所	中国香港	126,000	676,462.12	0.31
97	CHINA BLUECHEMICAL LTD - H	中海石油化学	CNE1000002D0	香港证券交易所	中国香港	174,000	656,962.58	0.30
98	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	康师傅控股	KYG8878S1030	香港证券交易所	中国香港	40,000	643,612.40	0.29

				所				
99	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	银河娱乐	HK0027032686	香港 证券 交易 所	中国 香港	21,000	635,646.90	0.29
100	WHIRLPOOL CORP	惠而浦	US9633201069	纽约 证 券 交 易 所	美国	887	626,750.77	0.29
101	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	华润电力	HK0836012952	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	42,000	618,250.25	0.28
102	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏信	HK0000077468	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	156,000	608,882.82	0.28
103	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中国神华	CNE1000002R0	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	37,000	583,552.53	0.27
104	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海外发 展	HK0688002218	香港 证 券 交 易 所	中国 香港	36,000	583,552.53	0.27
105	SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	BMG8181C1001	香 港	中国 香港	173,000	540,188.35	0.25

				证 券 交 易 所				
106	SHENZHEN INVESTMENT LTD	深圳控股	HK0604011236	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	220,000	516,960.95	0.24
107	PACIFIC TEXTILES HOLDINGS	互太纺织	KYG686121032	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	73,000	505,888.91	0.23
108	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	南方航空	CNE1000002T6	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	198,000	493,653.90	0.23
109	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股有限公司	BMG5800U1071	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	60,400	468,126.06	0.21
110	CHINA MENGNIU DAIRY CO	蒙牛乳业	KYG210961051	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	19,000	419,980.99	0.19
111	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电力国际发展	HK2380027329	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	180,000	417,232.89	0.19

				易所				
112	CHINA OIL AND GAS GROUP LTD	中油燃气	BMG2155W1010	香港 证券 交易 所	中国 香港	320,000	400,186.72	0.18
113	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	CNE1000002N9	香港 证券 交易 所	中国 香港	72,000	398,593.62	0.18
114	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	广深铁路	CNE100000379	香港 证券 交易 所	中国 香港	158,000	393,925.84	0.18
115	CHINA GAS HOLDINGS LTD	中国燃气	BMG2109G1033	香港 证券 交易 所	中国 香港	62,000	391,631.77	0.18
116	HARBIN ELECTRIC CO LTD-H	哈尔滨电气	CNE1000003C0	香港 证券 交易 所	中国 香港	94,000	384,112.34	0.18
117	PICC PROPERTY & CASUALTY -H	中国财险	CNE100000593	香港 证券 交易 所	中国 香港	54,162	377,498.98	0.17
118	TRULY INTERNATIONAL	信利国际	KYG910191363	香	中国	120,000	367,050.24	0.17

	HOLDINGS			港 证 券 交 易 所	香 港			
119	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	中国交建	CNE1000002F5	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	67,000	323,948.92	0.15
120	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	中国联通	HK0000049939	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	38,000	311,769.67	0.14
121	CHINA WATER AFFAIRS GROUP	中国水务	BMG210901242	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	132,000	305,970.79	0.14
122	SINOFERT HOLDINGS LTD	中化化肥	BMG8403G1033	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	288,000	298,228.32	0.14
123	AIA GROUP LTD	友邦保险	HK0000069689	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	11,000	287,833.34	0.13
124	HAINAN MEILAN INTL AIRPORT-H	海南美兰国 际机场	CNE1000003B2	香 港 证 券	中 国 香 港	46,000	276,641.82	0.13

				交易所				
125	BEIJING JINGNENG CLEAN ENE-H	北京京能清洁能源电力股份	CNE100001336	香港 证券 交易所	中国 香港	118,000	275,399.20	0.13
126	GOODBABY INTERNATIONAL HOLDI	好孩子国际控股有限公司	KYG398141013	香港 证券 交易所	中国 香港	111,000	272,324.51	0.12
127	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	新奥能源	KYG3066L1014	香港 证券 交易所	中国 香港	8,000	263,498.74	0.12
128	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	交通银行	CNE100000205	香港 证券 交易所	中国 香港	66,000	262,861.50	0.12
129	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	中国旺旺控股	KYG9431R1039	香港 证券 交易所	中国 香港	27,000	234,854.80	0.11
130	LENOVO GROUP LTD	联想集团	HK0992009065	香港 证券 交易所	中国 香港	34,000	190,391.38	0.09

131	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	统一企业中国	KYG9222R1065	香港证券交易所	中国香港	29,000	182,027.61	0.08
132	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	CNE100000Q35	香港证券交易所	中国香港	28,000	163,483.92	0.07
133	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运股份有限公司	CNE1000004F1	香港证券交易所	中国香港	123,000	142,064.69	0.06
134	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江西铜业	CNE1000003K3	香港证券交易所	中国香港	10,000	104,666.67	0.05
135	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	中国太保	CNE1000009Q7	香港证券交易所	中国香港	3,000	59,143.84	0.03

注：所用证券代码采用 ISIN 代码。

## 7.5 报告期内权益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 CITIC BANK CORP LTD-H	CNE1000001Q4	4,070,704.27	1.58
2	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	CNE100000X44	3,964,888.61	1.54
3	HUANENG POWER INTL INC-H	CNE1000006Z4	2,691,418.81	1.04
4	TYSON FOODS INC-CL A	US9024941034	2,623,215.09	1.02
5	CHINA WIRELESS TECH LTD	KYG211651081	2,578,146.38	1.00
6	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDIN	JP3892100003	2,488,320.96	0.96
7	KINGSOFT CORP LTD	KYG5264Y1089	2,432,552.60	0.94
8	ABBVIE INC	US00287Y1091	2,330,044.51	0.90
9	DATANG INTL POWER GEN CO-H	CNE1000002Z3	2,272,992.50	0.88
10	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	US9113121068	2,176,330.15	0.84
11	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	GB00B03MLX29	1,914,142.66	0.74
12	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	GB0000031285	1,908,065.19	0.74
13	KT CORP	KR7030200000	1,894,544.98	0.73
14	OMNICARE INC	US6819041087	1,882,809.99	0.73
15	ADT CORP/THE	US00101J1060	1,882,510.02	0.73
16	SEAGATE TECHNOLOGY	IE00B58JVZ52	1,858,604.04	0.72
17	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	JP3890350006	1,846,907.07	0.72
18	SHINSEI BANK LTD	JP3729000004	1,841,886.76	0.71
19	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	CNE1000003X6	1,815,159.97	0.70
20	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	CNE1000002F5	1,797,687.44	0.70

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	BANK OF CHINA LTD-H	CNE1000001Z5	5,653,587.27	2.19
2	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	CNE1000001Q4	5,565,908.54	2.16
3	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	CNE1000002F5	4,839,359.98	1.88
4	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	CNE100000Q43	3,405,270.49	1.32
5	BAIDU INC - SPON ADR	US0567521085	3,399,804.81	1.32

6	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	JP3902900004	3,373,760.01	1.31
7	FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	US3444191064	2,935,685.03	1.14
8	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	CNE1000002N9	2,834,434.56	1.10
9	WAL-MART STORES INC	US9311421039	2,724,287.37	1.06
10	BT GROUP PLC	GB0030913577	2,662,395.07	1.03
11	DATANG INTL POWER GEN CO-H	CNE1000002Z3	2,338,089.07	0.91
12	SAMSUNG ELECTR-GDR REG S	US7960508882	2,325,497.04	0.90
13	HSBC HOLDINGS PLC	GB0005405286	2,302,853.21	0.89
14	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	US9113121068	2,251,912.10	0.87
15	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	HK0688002218	2,251,351.46	0.87
16	SANOFI	FR0000120578	2,246,056.20	0.87
17	SHINSEI BANK LTD	JP3729000004	2,222,964.00	0.86
18	ELI LILLY & CO	US5324571083	2,214,869.61	0.86
19	ATCO LTD -CLASS I	CA0467894006	2,196,115.78	0.85
20	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	CNE100000338	2,187,922.66	0.85

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	1,638,922,698.03
卖出收入(成交)总额	212,074,233.25

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名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	10,677,460.90	4.88
2	ISHARES DJ US INDEX FUND	ETF 基金	交易型开放式指数	BLACKROCK FUND	8,231,325.93	3.76

**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**

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	4,354,656.98
3	应收股利	1,441,594.76
4	应收利息	1,458.03
5	应收申购款	4,442.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	4,416,607.11
9	合计	10,218,759.72

**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
11,447	21,261.13	3,867,043.45	1.59%	239,509,109.67	98.41%

### 8.2 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。

## § 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	-
本报告期期初基金份额总额	284,626,066.31
本报告期基金总申购份额	893,261.87
减：本报告期基金总赎回份额	42,143,175.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	243,376,153.12

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

我公司于2013年3月28日召开2013年度第一次临时股东会，会议决定与公司控股股东中国建设银行股份有限公司有关联关系的马梅琴女士、俞斌先生不再担任公司董事，增选中国建设银行股份有限公司提名的曹伟先生和美国信安金融集团提名的欧阳伯权先生担任公司董事。公司已将前述董事任免情况报告备案至中国证监会基金部和北京监管局。公司目前现有9名董事，其中与控股股东中国建设银行股份有限公司有关联关系的董事为3名，符合《证券投资基金管理公

司管理办法》第四十一条第三款的监管要求。

2013 年 6 月 20 日我公司第三届董事会第十二次临时会议一致同意副总经理张延明离职，我公司于 2013 年 6 月 20 日正式上报中国证券投资基金业协会和北京证监局备案，并于 2013 年 6 月 21 日获得中国基金业协会的备案文件。我公司于 2013 年 6 月 22 日对外公告，张延明于 2013 年 6 月 20 日正式离职。

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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
CITIGROUP	-	59,926,558.19	15.94%	38,356.44	10.14%	-
MERRILL LYNCH	-	57,093,078.32	15.19%	72,303.60	19.12%	-
J. P. MORGAN	-	47,300,640.19	12.58%	37,148.24	9.82%	-
CREDIT SUISSE	-	32,312,213.61	8.60%	38,442.62	10.17%	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC	-	27,045,250.79	7.19%	26,190.91	6.93%	-

BNY CONVERGX	-	26,523,371.06	7.06%	13,315.76	3.52%	-
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.	-	24,619,133.59	6.55%	28,812.83	7.62%	-
UBS SECURITIES	-	22,420,417.66	5.96%	22,278.85	5.89%	-
SANFORD BERNSTEIN	-	10,365,094.93	2.76%	10,206.48	2.70%	-
RBC CAPITAL MARKETS	-	9,422,086.70	2.51%	9,586.19	2.54%	-
MORGAN STANLEY	-	8,772,978.10	2.33%	13,282.56	3.51%	-
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.	-	8,128,819.01	2.16%	12,192.98	3.22%	-
GOLDMAN SACHS	-	6,875,743.21	1.83%	12,497.21	3.30%	-
ITG-CSA	-	6,101,958.45	1.62%	3,658.83	0.97%	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.	-	5,418,932.31	1.44%	10,837.86	2.87%	-
INSTINET CORP.	-	5,341,524.49	1.42%	5,110.54	1.35%	-
DAIWA	-	3,774,190.07	1.00%	6,834.67	1.81%	-
CREDIT AGRICOLE INDOSUEZ CHEVREAU	-	3,746,097.74	1.00%	2,258.05	0.60%	-
MACQUARIE-AUSTRALIA	-	1,919,219.57	0.51%	1,663.92	0.44%	-
REDBURN PARTNERS LLP	-	1,846,939.07	0.49%	923.48	0.24%	-
MACQUARIE CAPTIAL	-	1,494,029.52	0.40%	2,988.06	0.79%	-
CIMB SECURITIES	-	1,457,999.61	0.39%	2,916.01	0.77%	-
ITG	-	1,227,844.58	0.33%	1,227.88	0.32%	-
BARCLAYS CAPITAL INC.	-	1,146,243.92	0.30%	2,149.57	0.57%	-
ING BANK	-	792,978.98	0.21%	1,585.96	0.42%	-
HSBC, INC	-	614,021.09	0.16%	1,228.04	0.32%	-
PENSERRA SECURITIES LLC	-	55,968.60	0.01%	55.97	0.01%	-
DEUTSCHE BANK-EURO ALGORITHMS	-	189,734.42	0.05%	94.83	0.03%	-

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 PENSERRA SECURITIES LLC, CIMB SECURITIES, 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

本基金本报告期内未使用租用的证券公司交易单元进行其他证券投资。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	建信基金管理有限责任公司关于高级管理人员变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2013-06-22
2	关于继续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	2013年3月26日
3	关于开通通联支付相关银行卡建信基金网上直销业务并实施费率优惠的公告	指定报刊和/或公司网站	2013年1月29日
4	关于开通中国银行借记卡建信基金网上直销业务并实施费率优惠的公告	指定报刊和/或公司网站	2013年1月29日
5	关于暂停招商银行持卡客户网上交易服务的通知	指定报刊和/或公司网站	2013年1月24日
6	关于延长旗下部分基金参加中信建投开放式基金交易费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2013年1月4日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信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  
2013 年 8 月 26 日