

# 建信优化配置混合型证券投资基金 2013 年年度报告摘要

2013 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

送出日期：2014 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2014 年 3 月 25 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 2013 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	建信优化配置混合
基金主代码	530005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 3 月 1 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	7,522,589,554.93 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过合理的资产配置和积极的证券选择，在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。
投资策略	基金管理人从宏观经济、行业及上市公司、债券、货币市场工具等进行定性与定量相结合的研究，运用自上而下和自下而上相结合的投资策略，在大类资产配置这一宏观层面与个股个券选择这一微观层面优化投资组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准： $60\% \times$ 富时中国 A600 指数 $+40\% \times$ 中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	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

### 2.4 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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	597,600,140.93	-859,206,322.40	-188,361,375.30
本期利润	1,056,825,641.36	174,567,594.97	-1,903,941,074.08
加权平均基金份额本期利润	0.1289	0.0193	-0.1966
本期基金份额净值增长率	16.64%	2.61%	-21.77%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1448	-0.2520	-0.2710
期末基金资产净值	6,563,670,976.74	6,564,839,853.85	6,779,509,425.09
期末基金份额净值	0.8725	0.7480	0.7290

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、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、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、所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。

#### 3.2 基金净值表现

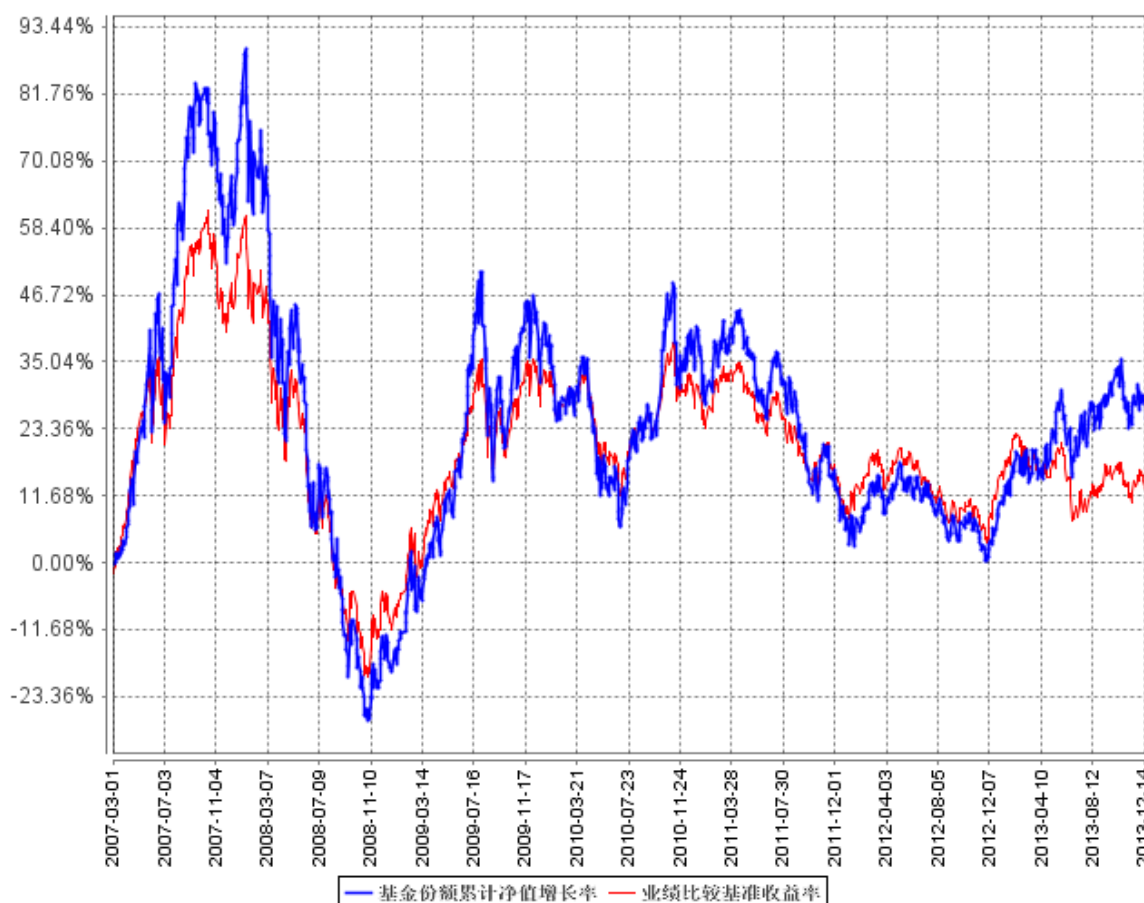
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.59%	1.08%	-2.69%	0.70%	1.10%	0.38%
过去六个月	8.80%	1.12%	3.30%	0.76%	5.50%	0.36%
过去一年	16.64%	1.17%	-2.70%	0.82%	19.34%	0.35%
过去三年	-6.37%	1.08%	-13.33%	0.79%	6.96%	0.29%
过去五年	59.19%	1.36%	26.90%	0.93%	32.29%	0.43%
自基金合同生效起至今	28.92%	1.62%	12.27%	1.16%	16.65%	0.46%

注：本基金业绩比较基准： $60\% \times$ 富时中国 A600 指数 $+40\% \times$ 中国债券总指数。其中：富时中国 A600 指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准，中国债券总指数收益率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。富时中国 A600 指数由新华富时指数公司发布，该指数包含中国沪深两个市场流通市值最大的六百家上市公司，涵盖了几乎所有行业。该指数在市场代表性、市场相关度、流动性等方面具备作为基准指数的可行性。中债系列指数由一个总指数（即中国债券总指数），若干个分指数构成。中国债券总指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债券等），理论上能客观反映中国债券总体情况。

### 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

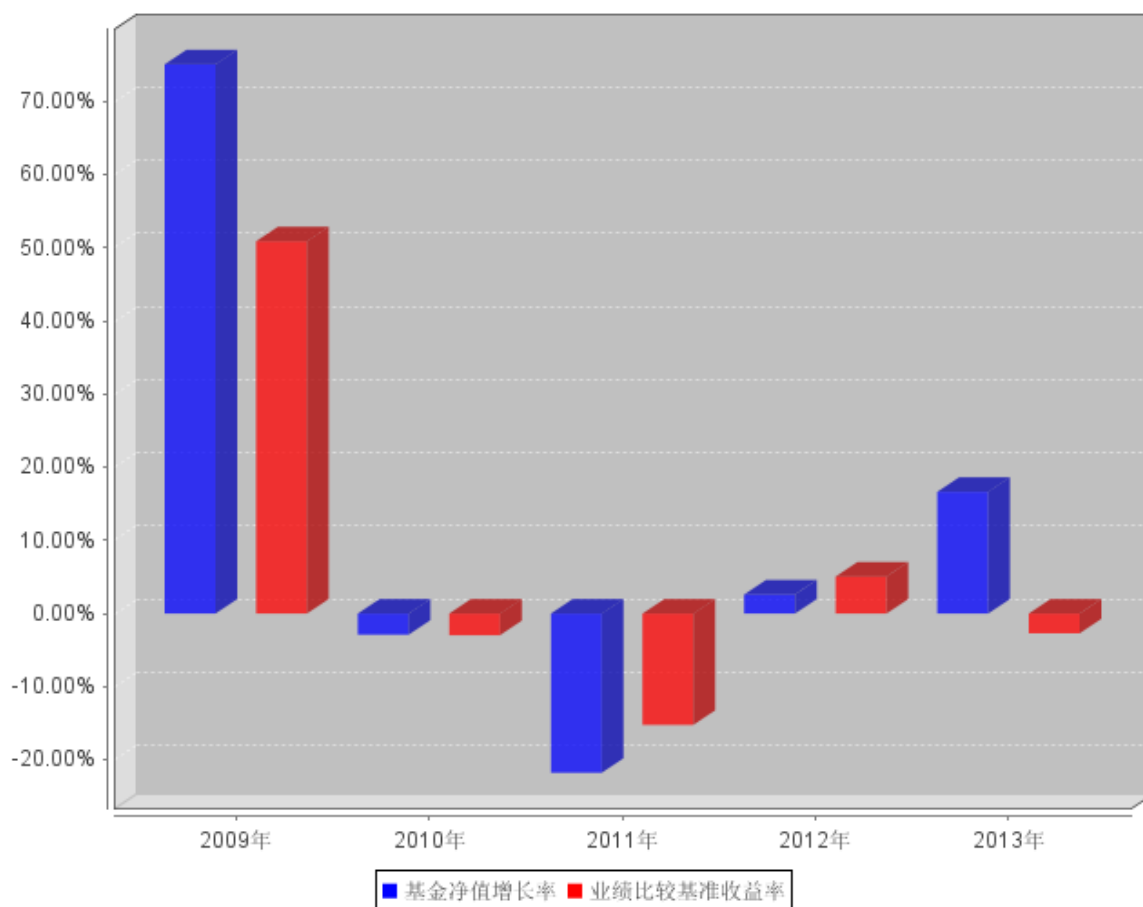
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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 过去五年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

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同自 2007 年 3 月 1 日生效，2007 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

过去三年，本基金未实施利润分配。

## § 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，并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 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、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、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信创新中国股票型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金 37 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 730.45 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		
陶灿	本基金的基金经理	2011 年 7 月 11 日	-	6	硕士。2007 年 7 月加入本公司，从事行业研究，历任研究员、基金经理助理。

					2011 年 7 月 11 日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理。
乔林建	本基金的基金经理	2013 年 1 月 5 日	-	11	硕士。2002 年 6 月起就职于新华人寿保险公司，历任研究员、投资经理；2006 年 6 月起就职于新华资产管理公司，任高级投资经理。2008 年 2 月加入我公司，历任高级投资经理、资深投资经理、基金经理助理，2013 年 1 月 5 日至 2014 年 3 月 6 日任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理；2013 年 9 月 24 日起任建信创新中国股票型



					证券投资基金基金经理； 2013年11月13日起任建信核心精选基金经理。
马志强	本基金的基金经理	2013年11月13日	-	10	博士。曾就职于东北证券公司、北京高汇投资管理有限公司、北京蓝巢投资有限公司，2004年11月起就职于天弘基金管理公司，2008年12月2日至2011年3月23日任天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理。2011年3月加入本公司，2011年8月2日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理； 2013年11月13日起

					任建信优化配置基金经理。
顾中汉	研究部副 总监、本 基金的基 金经理	2011年12月 13日	2013年5月3日	9	硕士。曾任北京市房管局科员，2004年4月起就职于易方达基金管理有限公司，历任交易员、研究员、基金经理助理、投资经理，2010年1月至2011年5月任社保109组合的投资经理。顾中汉于2011年6月加入本公司，2011年10月11日起任建信恒久价值股票型证券投资基金基金经理；2011年12月13日至2013年5月3日任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理。

注：乔林建自2014年3月6日起不再担任本基金的基金经理。

## 4.2 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。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 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。

### 4.3.2 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 1984 对投资组合，有 496 对投资组合未通过 T 检验，其中 190 对投资组合的正溢价率占优频率小于 55%，其它 306 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中，有 29 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 2454 对投资组合，有 558 对投资组合未通过 T 检验，其中 78 对投资组合的溢价率占优频率小于 55%，其它 480 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合，有 9 对投

投资组合的平均溢价率超过 5%，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 5 日时，配了 2548 对投资组合，有 673 对投资组合未通过 T 检验，其中 92 对投资组合的溢价率占优频率小于 55%，其它 581 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合，有 1 对投资组合的平均溢价率超过 10%，但其组合贡献率低于 5%，同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

### 4.3.3 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。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年市场分化剧烈，风格演绎极致。以大盘蓝筹为代表的沪深 300 下跌 7.7%，而以小盘为主的创业板上涨 82.7%，这种分化在某种程度上反映了经济转型、新兴产业的兴起，但也在较大程度上体现为估值泡沫化。这种泡沫化，比较集中地体现为以下形式：在潜力较大、景气上行的行业，即使缺乏竞争力、增长前景较差的小公司，也获得了相当高的估值溢价。

本基金在 13 年紧密跟踪行业景气趋势变化以及个股的基本面情况，在风险与收益间寻求较为合理的平衡，积极进行组合管理，以理性态度参与市场风格的演绎。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为 16.64%，波动率为 1.17%，业绩比较基准收益率为-2.70%，波动率为 0.82%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 14 年，经济工作会议宏观定调为 14 年经济增长托底，但同时也应注意到实现增长的路径问题。监管层对影子银行的规范与清理，对相应的基建投资、地产投资的确将产生较大的负面影响。增长的传统引擎缺乏动力，稳增长难度因此加大，但从金融体系的安全、经济增长的健康稳健角度来看，投融资体系的规范又势在必行，这是改革赋予经济结构转型，增长方式转变的必由之路。2014 年是改革的落实年，在流动性偏紧的预期下，我们将紧紧围绕人的需求“衣食住行文教卫”，筛选相对高增长、高确定性的子行业，同时密切跟踪估值压缩的传统产业，寻求合理的布局时机。本基金将在控制下行风险的同时，追求个股和行业的超额收益，为持有人创造回报。

#### 4.6 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）。

#### 4.7 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，本报告期内本基金未达到进行利润分配的条件，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优化配置混合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，建信优化配置混合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优化配置混合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，建信优化配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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优化配置混合型证券投资基金 2013 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（特殊普通合伙）审计了后附的建信优化配置混合型证券投资基金(以下简称“建信优化配置基金”)的财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表、2013 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(2014)第 20212 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：建信优化配置混合型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		822,267,946.49	1,176,169,225.78

结算备付金		12,880,398.44	21,550,029.87
存出保证金		2,334,574.09	3,117,719.20
交易性金融资产		5,354,831,798.50	4,387,426,059.50
其中：股票投资		5,282,499,176.50	4,265,523,484.50
基金投资		-	-
债券投资		72,332,622.00	121,902,575.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		436,180,774.53	-
应收证券清算款		-	1,000,603,864.10
应收利息		693,949.42	1,309,053.28
应收股利		-	-
应收申购款		428,069.44	460,195.71
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		6,629,617,510.91	6,590,636,147.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年12月31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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		26,370,849.62	-
应付赎回款		7,312,934.85	4,545,608.67
应付管理人报酬		8,343,902.75	7,940,520.56
应付托管费		1,390,650.46	1,323,420.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		21,037,162.57	8,743,065.98
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,491,033.92	3,243,678.26
负债合计		65,946,534.17	25,796,293.59
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		7,522,589,554.93	8,776,172,978.59
未分配利润		-958,918,578.19	-2,211,333,124.74
所有者权益合计		6,563,670,976.74	6,564,839,853.85
负债和所有者权益总计		6,629,617,510.91	6,590,636,147.44

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8725 元，基金份额总额 7,522,589,554.93 份。

## 7.2 利润表

会计主体：建信优化配置混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		1,233,921,487.90	315,957,255.21
1. 利息收入		14,272,757.77	36,524,533.86
其中：存款利息收入		8,850,395.73	7,680,689.38
债券利息收入		2,045,140.75	9,787,616.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,377,221.29	19,056,227.58
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		760,059,827.06	-754,469,099.48
其中：股票投资收益		735,418,493.02	-810,256,939.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-24,498,625.91	-8,421,433.55
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		49,139,959.95	64,209,273.51
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		459,225,500.43	1,033,773,917.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		363,402.64	127,903.46
<b>减：二、费用</b>		177,095,846.54	141,389,660.24
1. 管理人报酬		102,081,276.80	100,444,434.55
2. 托管费		17,013,546.11	16,740,739.13
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		57,491,241.01	23,730,687.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		509,782.62	473,799.53
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,056,825,641.36	174,567,594.97
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,056,825,641.36	174,567,594.97



### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信优化配置混合型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	8,776,172,978.59	-2,211,333,124.74	6,564,839,853.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,056,825,641.36	1,056,825,641.36
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）	-1,253,583,423.66	195,588,905.19	-1,057,994,518.47
其中：1. 基金申购款	127,251,384.53	-20,889,347.96	106,362,036.57
2. 基金赎回款	-1,380,834,808.19	216,478,253.15	-1,164,356,555.04
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）	7,522,589,554.93	-958,918,578.19	6,563,670,976.74
项目	上年度可比期间 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）	9,299,547,798.55	-2,520,038,373.46	6,779,509,425.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	174,567,594.97	174,567,594.97
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）	-523,374,819.96	134,137,653.75	-389,237,166.21
其中：1. 基金申购款	137,745,655.96	-35,878,797.64	101,866,858.32
2. 基金赎回款	-661,120,475.92	170,016,451.39	-491,104,024.53
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）	8,776,172,978.59	-2,211,333,124.74	6,564,839,853.85

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：

<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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

建信优化配置混合型基金(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”)证监基金字[2007]第 36 号《关于同意建信优化配置混合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》和《建信优化配置混合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 9,658,460,290.75 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(2007)第 018 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》于 2007 年 3 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 9,658,655,708.23 份基金份额,其中认购资金利息折合 195,417.48 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信优化配置混合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国内依法公开发行上市股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证以及经国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票占基金资产的 30%-90%;债券、现金、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 10%-70%,其中,基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为富时中国 A600 指数 X60% + 中国债券总指数 X40%。

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 2014 年 3 月 25 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信优化配置混合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 2013 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 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致的说明

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》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

### 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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构
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
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

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

无。

#### 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	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	102,081,276.80	100,444,434.55
其中：支付销售机构的客户维护费	15,862,872.96	15,583,922.60

注：1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 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	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付	17,013,546.11	16,740,739.13

的托管费		
------	--	--

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.25%/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

无。

#### 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

无。

##### 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

无。

#### 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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	822,267,946.49	8,538,123.49	1,176,169,225.78	7,446,838.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2013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

无。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

000625	长安汽车	2013年12月31日	重大事项	11.45	2014年1月3日	11.72	11,677,540	109,300,218.93	133,707,833.00	-
300071	华谊嘉信	2013年11月25日	重大资产重组	29.00	-	-	245,012	6,658,478.94	7,105,348.00	-
300010	立思辰	2013年12月5日	重大资产重组	11.88	2014年3月5日	13.07	396,054	4,657,338.78	4,705,121.52	-
300032	金龙机电	2013年11月18日	重大资产重组	16.79	2014年2月18日	18.47	271,748	4,704,375.71	4,562,648.92	-

注：本基金截至 2013 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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

无。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 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 2013 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 5,204,750,847.06 元，属于第二层级的余额为 150,080,951.44 元，无属于

第三层级的余额(2012年12月31日：第一层级 4,029,932,419.55 元，第二层级 357,493,639.95 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(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	5,282,499,176.50	79.68
	其中：股票	5,282,499,176.50	79.68
2	固定收益投资	72,332,622.00	1.09
	其中：债券	72,332,622.00	1.09
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	436,180,774.53	6.58
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	835,148,344.93	12.60
7	其他各项资产	3,456,592.95	0.05
8	合计	6,629,617,510.91	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	177,884,204.96	2.71
B	采矿业	96,356,945.92	1.47

C	制造业	3,552,321,948.91	54.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,048,644.70	0.23
E	建筑业	49,891,447.18	0.76
F	批发和零售业	72,116,707.32	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	379,994,430.85	5.79
J	金融业	284,197,904.20	4.33
K	房地产业	231,917,010.87	3.53
L	租赁和商务服务业	275,690,474.38	4.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	147,079,457.21	2.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,282,499,176.50	80.48

注：以上行业分类以 2013 年 12 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	5,212,316	203,697,309.28	3.10
2	300202	聚龙股份	5,257,802	203,371,781.36	3.10
3	002344	海宁皮城	8,839,371	183,682,129.38	2.80
4	000998	隆平高科	6,520,682	177,884,204.96	2.71
5	600570	恒生电子	7,656,681	159,718,365.66	2.43
6	601318	中国平安	3,595,061	150,021,895.53	2.29
7	300070	碧水源	3,588,179	147,079,457.21	2.24
8	603008	喜临门	12,925,429	137,785,073.14	2.10
9	002241	歌尔声学	3,820,080	134,008,406.40	2.04
10	000625	长安汽车	11,677,540	133,707,833.00	2.04



注：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。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	384,853,431.49	5.86
2	000001	平安银行	333,737,305.26	5.08
3	601166	兴业银行	286,054,872.13	4.36
4	601318	中国平安	284,108,138.66	4.33
5	601299	中国北车	244,157,353.53	3.72
6	600030	中信证券	243,305,873.11	3.71
7	000625	长安汽车	225,797,025.25	3.44
8	600837	海通证券	198,412,943.59	3.02
9	601288	农业银行	183,093,963.96	2.79
10	000671	阳光城	161,777,635.47	2.46
11	002146	荣盛发展	158,466,353.84	2.41
12	000998	隆平高科	149,282,723.61	2.27
13	601766	中国南车	141,869,156.27	2.16
14	600570	恒生电子	141,711,836.75	2.16
15	300202	聚龙股份	141,353,673.05	2.15
16	600036	招商银行	139,193,047.71	2.12
17	600383	金地集团	138,555,212.28	2.11
18	600329	中新药业	137,968,500.13	2.10
19	002410	广联达	133,112,490.02	2.03
20	002456	欧菲光	132,798,369.51	2.02

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	403,776,172.87	6.15
2	000002	万科A	399,381,503.63	6.08

3	000001	平安银行	349,488,453.76	5.32
4	601166	兴业银行	323,752,329.58	4.93
5	601318	中国平安	309,481,760.26	4.71
6	600519	贵州茅台	295,465,525.47	4.50
7	000024	招商地产	251,470,249.55	3.83
8	601299	中国北车	249,543,146.98	3.80
9	600030	中信证券	234,107,152.86	3.57
10	600048	保利地产	223,950,239.35	3.41
11	600887	伊利股份	201,076,486.18	3.06
12	600837	海通证券	199,823,550.89	3.04
13	002410	广联达	174,366,409.12	2.66
14	600422	昆明制药	174,149,996.50	2.65
15	601601	中国太保	173,149,206.14	2.64
16	601288	农业银行	171,886,849.19	2.62
17	601766	中国南车	163,127,003.17	2.48
18	000895	双汇发展	157,324,861.64	2.40
19	000671	阳光城	151,438,509.55	2.31
20	600036	招商银行	150,827,280.09	2.30
21	601888	中国国旅	148,171,401.24	2.26
22	600108	亚盛集团	145,661,697.96	2.22
23	000625	长安汽车	137,902,959.40	2.10
24	002146	荣盛发展	133,406,409.80	2.03
25	600329	中新药业	131,563,343.93	2.00

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	18,968,354,102.12
卖出股票收入（成交）总额	19,126,498,333.47

注：上述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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	44,325,000.00	0.68
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	28,007,622.00	0.43
8	其他	-	-
9	合计	72,332,622.00	1.10

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	122280	13 海通 01	450,000	44,325,000.00	0.68
2	110015	石化转债	250,410	23,879,097.60	0.36
3	128002	东华转债	29,400	4,128,524.40	0.06

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 本基金本报告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中，由中国石油化工股份有限公司发行的石化转债（110015）于 2013 年 11 月 25 日公告，由于原油管道破裂致使排水暗渠爆炸，从而引发人员伤亡事故，中国政府已派出事故调查组进行全面调查。目前该公司生产经营稳定，成品油市场供应稳定。**

**8.12.2 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。**

**8.12.3 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	2,334,574.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	693,949.42
5	应收申购款	428,069.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,456,592.95

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	23,879,097.60	0.36

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	--------------	----------

1	000625	长安汽车	133,707,833.00	2.04	重大事项
---	--------	------	----------------	------	------

## § 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
299,481	25,118.75	4,513,885.15	0.06%	7,518,075,669.78	99.94%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	4,858.92	0.00%

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、该只基金的基金经理未持有该只基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年3月1日）基金份额总额	9,658,655,708.23
本报告期期初基金份额总额	8,776,172,978.59
本报告期基金总申购份额	127,251,384.53
减：本报告期基金总赎回份额	1,380,834,808.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,522,589,554.93

注：上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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

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。

## 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 138,000.00 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
中信证券	13	527,625,192.25	9.27%	3,180,380.44	9.37%	-
东北证券	22	812,241,689.17	7.39%	2,536,165.92	7.47%	-
长城证券	32	571,270,095.28	6.76%	2,281,643.95	6.72%	-
长江证券	12	473,126,056.29	6.50%	2,179,225.68	6.42%	-
招商证券	12	368,656,361.61	6.23%	2,156,427.56	6.35%	-
上海证券	22	274,296,513.63	5.98%	2,015,216.40	5.94%	-
申银万国	12	250,910,346.46	5.92%	1,991,879.21	5.87%	-
中信万通	12	233,483,859.33	5.87%	1,967,087.63	5.80%	-
中信建投证券	22	077,625,623.68	5.46%	1,872,067.02	5.52%	-
渤海证券	11	969,437,377.28	5.18%	1,773,841.30	5.23%	-
海通证券	21	652,519,258.12	4.34%	1,483,245.90	4.37%	-
东方证券	31	385,748,847.90	3.64%	1,220,880.57	3.60%	-
民生证券	11	185,904,515.99	3.12%	1,079,647.85	3.18%	-
广州证券	1	975,126,913.83	2.56%	855,253.13	2.52%	-
国开证券	1	965,326,004.41	2.54%	856,255.91	2.52%	-
川财证券	1	944,438,390.95	2.48%	829,926.64	2.45%	-
银河证券	2	930,983,613.11	2.45%	819,241.11	2.41%	-
平安证券	1	904,075,280.49	2.38%	823,068.78	2.43%	-
兴业证券	1	886,432,278.79	2.33%	792,197.65	2.33%	-
国信证券	1	729,296,509.02	1.92%	636,463.30	1.88%	-
广发证券	1	678,496,499.97	1.78%	600,283.56	1.77%	-
国元证券	1	559,657,239.92	1.47%	493,158.94	1.45%	-
联合证券	1	545,148,179.66	1.43%	482,402.82	1.42%	-
中投证券	2	483,930,022.35	1.27%	424,886.09	1.25%	-
宏源证券	1	437,818,712.66	1.15%	387,425.31	1.14%	-
国泰君安证券	1	225,885,494.39	0.59%	198,509.33	0.58%	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个股等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

（4）佣金费率合理；

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人；

3、本报告期内新增上海证券有限责任公司、民生证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、川财证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、广发证券股份有限公司各一个交易单元，未剔除交易单元；

4、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
中信证券	363,660.30	0.09%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	15,806,368.60	3.77%	-	-	-	-
长江证券	64,628,960.50	15.40%	110,000,000.00	32.44%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	68,360,156.90	16.29%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信万通	36,182,181.70	8.62%	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-



海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	33,576,510.30	8.00%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	13,541,929.60	3.23%	229,100,000.00	67.56%	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	29,258,775.00	6.97%	-	-	-	-
银河证券	78,942,623.80	18.82%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	41,670,760.00	9.93%	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	9,737,610.60	2.32%	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	27,479,909.60	6.55%	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司  
2014年3月27日