

建信全球机遇股票型证券投资基金 2013 年年度报告

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 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
4.10 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	21
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.....	21
§6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	45
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	46
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	46
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	58

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	60
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	60
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	61
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	61
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	61
8.11 投资组合报告附注	61
§9 基金份额持有人信息.....	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
§10 开放式基金份额变动.....	62
§11 重大事件揭示.....	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	67
§12 备查文件目录.....	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 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	191,013,739.30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

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
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、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	20,487,659.88	-4,500,140.63	-48,508,308.88
本期利润	26,416,022.00	34,477,772.99	-61,095,229.69
加权平均基金份额本期利润	0.1091	0.1106	-0.1523
本期加权平均净值利润率	11.48%	12.88%	-16.44%
本期基金份额净值增长率	12.13%	13.80%	-13.80%

3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配利润	-17,112,476.22	-48,990,823.69	-68,305,991.67
期末可供分配基金份额利润	-0.0896	-0.1721	-0.2031
期末基金资产净值	194,232,035.81	258,033,955.04	267,977,433.82
期末基金份额净值	1.017	0.907	0.797
3.1.3 累计期末指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	1.70%	-9.30%	-20.30%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、汇兑损益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.94%	0.50%	5.48%	0.53%	0.46%	-0.03%
过去六个月	13.00%	0.57%	15.88%	0.59%	-2.88%	-0.02%
过去一年	12.13%	0.67%	16.88%	0.69%	-4.75%	-0.02%
过去三年	3.35%	0.88%	16.08%	0.96%	-12.73%	-0.08%
自基金合同生效起至今	1.70%	0.86%	24.96%	0.95%	-23.26%	-0.09%

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。

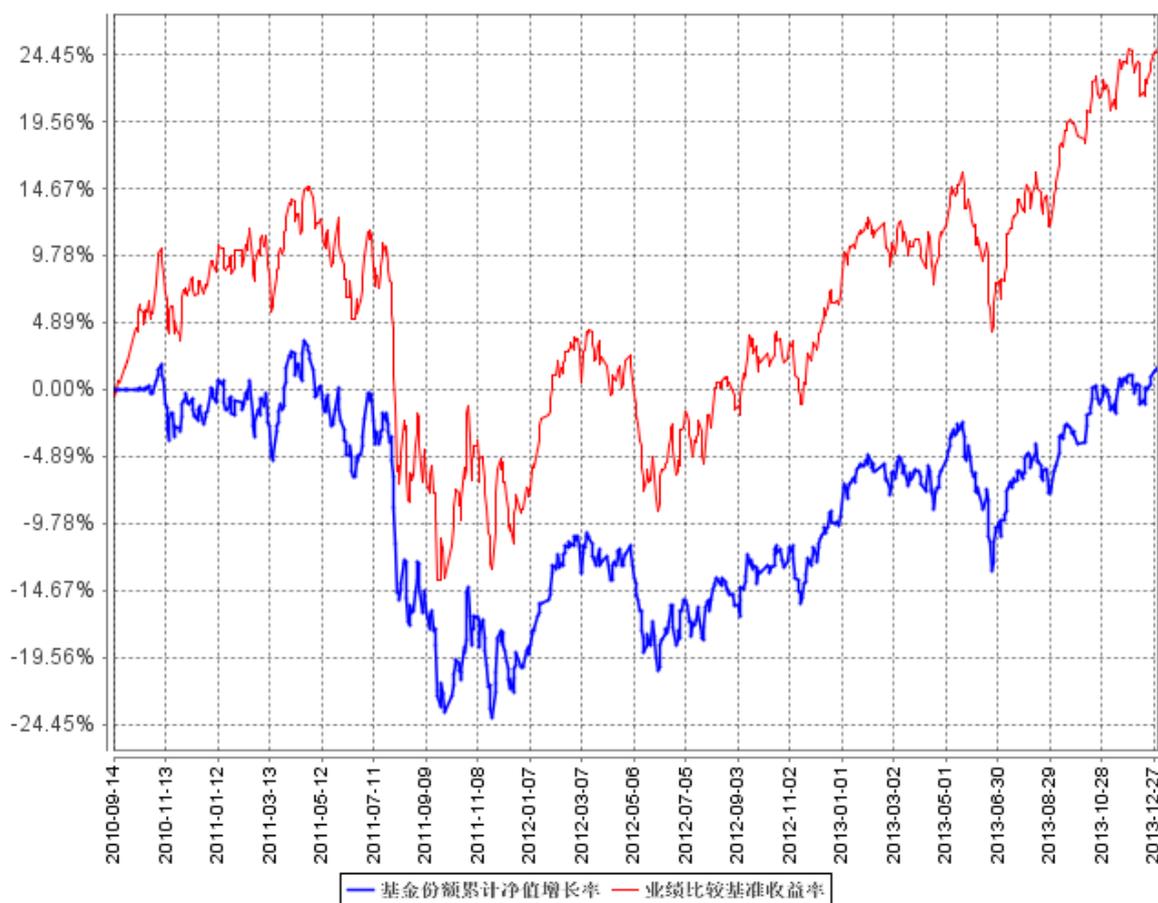
标准普尔 BMI 中国（除 A、B 股）指数（S&P BMI China ex-A-B-Shares）是由标准普尔指数公司

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

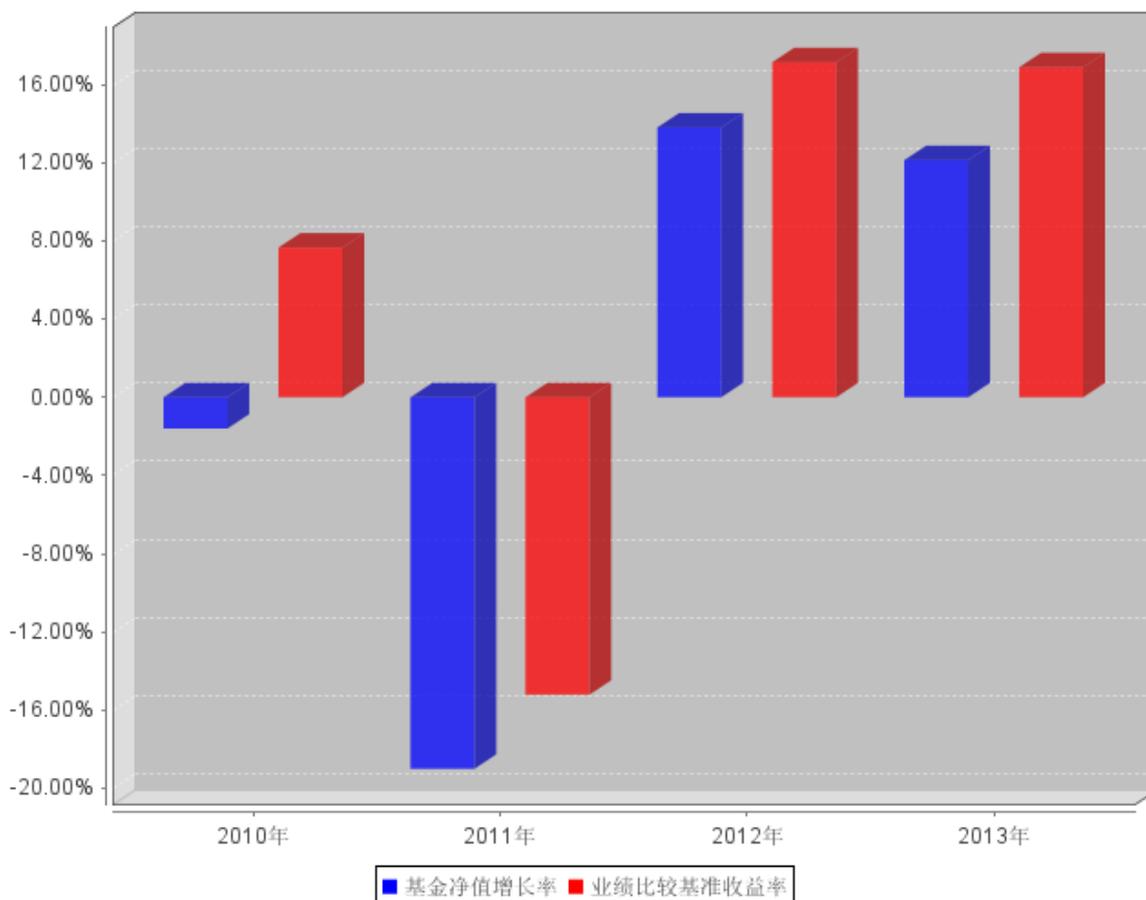


注：1、同期业绩比较基准以人民币计价。

2、本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

3.2.3 自基金合同生效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

自基金合同生效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对比图



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

自基金合同生效以来未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展

部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司，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		
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；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。2011年4月20日起任建信全球机遇股票基金基金经理，2011年6月21日起任建信新兴市场股票基金基金经理，2012年6月26日起任建信全球资源股票型证券投资基金基金经理。</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	Christopher Ibach 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。他作为共同基金经理, 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。
Mustafa Sagun	首席投资官	22	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>业生涯开始于 1991 年，曾担任过投资管理的职位。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>

			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。
李晓西	投资组合经理	14	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&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

			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 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。

4.4.3 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

2013 年，全球市场总体表现良好，但也伴随强烈的结构分化特征。结构上欧美发达国家为代表的成熟市场表现突出，新兴市场有较大幅度回落。发达国家中，美国市场如我们年初预期，表现强劲，在全年不断创出历史新高，在全球主要市场中表现优异，全年上涨 32.4%。美国宏观基本面不断改善，全年的 GDP、工业 PMI、出口数据等都呈现加速走强的趋势，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。企业利润持续超越市场预期，维持温和增长态势，现金流强劲，并积极以分红和股份回购的方式回馈投资人，对市场产生较大推动作用。

在“安倍经济学”的驱动下，日本市场一季度大幅上涨，然而二季度在美联储逐步退出“量宽”的政策指引发布后，经历了大幅震荡，在下半年逐步收复后最终上涨幅度依然达到 27%。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，但我们看到日本国债收益率的上升也引发了市场对波动率加剧的担忧，同时，日元的大幅贬值虽有利于扩大出口，同时也加剧了能源、食品、原材料的进口价格，从而对消费和企业利润产生抵消效应。我们认为市场在经历了最初的

乐观情绪后，目前仍未确认“安倍经济学”对日本经济结构性改革的长期效应。同时日本企业的资本回报和盈利增长是否能顺利走出过去 20 年的低谷，将根本性地影响市场对日本股市的配置态度。

欧洲经济在本年度也发生了可喜的变化，欧元区先行指标如制造业 PMI 在年中突破 50 分位后，GDP 也在第三、四季度转为正增长，从而宣布欧元区总体经济正式走出低谷。虽然欧元区周边国家的失业率仍然高企，部分国家的 GDP 仍在萎缩，但在欧央行的政策支持下，欧元区周边国家的国债利率已大幅下降，流动性充足，市场尾部风险基本消失，企业盈利预期稳定，消费缓慢恢复，欧洲股市也在经历第二季度的震荡后，表现强劲，全年上涨 27%。

2013 年全年，美国经济复苏、美联储货币政策两大主题主导了全球资本市场。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，资金从债市大规模转移到股市的“Great Rotation”进一步加速；进入二季度，随着美国较好的经济数据，6 月下旬伯南克首次发布了美联储可能在今年年底前开始退出 QE 的政策指引，引发全球股市和债市的大幅波动，美国 10 年期国债利率大幅上升，引发全球流动性的大规模回流发达国家市场，对新兴市场形成重创。在三、四季度，随着美国、欧洲复苏的进一步确认，市场逐步消化了对联储未来货币政策的过分担忧，发达国家市场继续强势上涨。

新兴市场经历了 2012 年下半年的大幅上涨后，今年全年整体呈大幅震荡下跌态势。在经历了 2008 年全球金融危机后的强势反弹后，新兴市场主要国家开始出现经济结构问题，经济增长速度明显下降，企业盈利总体受压，资本回报前景暗淡，对市场造成下行压力。巴西、印度、南非、土耳其等国家国际收支逆差扩大，通胀居高不下，国内利率攀升，经济复苏的前景不明朗。几个主要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；另外近年中国的主要经济指标，如固定资产投资、工业生产、工业 PMI 和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。这些问题在美国经济加速复苏，欧洲走出衰退、QE 退出预期下全球资金从新兴市场回撤成熟市场的大背景下，新兴市场在二季度股市和货币都受到重挫，在下半年全球流动性和风险偏好平稳后，新兴市场大幅下跌后有一定技术性反弹，但中长期

看，新兴市场需要各自国家在经济、政治基本上做出一系列结构性改革后，才能根本性走出目前的困局。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本年度本基金净值增长率 12.13%，波动率 0.67%，业绩比较基准收益率 16.88%，波动率 0.69%。

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 2014 年，我们认为全球经济，尤其美国、欧洲发达国家经济仍将继续复苏，为全球市场带来活力。虽然美国、欧洲股市在去年的强势上涨已推高估值水平，市场积累了较大技术回调压力，但总体看，经济基本面仍处于向上周期，美国经济增长进一步复苏会继续增强企业盈利能力；欧洲经济复苏目前仍较脆弱，但趋势已基本形成，企业盈利有望恢复增长，估值水平也较合理。全球经济预期较明朗，目前市场总体估值处于较低水平，这将对全球市场形成较好的长期支持。2014 年主要的不确定因素还是新兴市场各国的结构性改革能否有效扭转经济下滑的趋势，并改善国际收支。尤其国际收支不平衡的经济体，在美国 QE 退出，流动性回流发达市场的背景下，有可能继续受到市场的冲击，并为全球市场带来连带风险。因此，在未来可能的震荡市场环境下，需要投资人精选行业、个股，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2013 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司监察稽核部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总经理和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施：

- 1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

- 2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明

确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备季度监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由监察稽核部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司 2013 年度监察稽核工作计划，实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发“三条底线”违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与外方股东信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的核心价值观，树立并坚持诚信、规范、专业、创新的经营理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.8 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。

4.9 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。

4.10 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

§ 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

2013 年，本基金托管人在对建信全球机遇股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2013 年，建信全球机遇股票型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限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全球机遇股票型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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2014)第 20227 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信全球机遇股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的建信全球机遇股票型证券投资基金（以下简称“建信全球机遇股票基金”）的财务报表，包括 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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是建信全球机遇股票基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错

	<p>报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述建信全球机遇股票基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了建信全球机遇股票基金 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。
注册会计师的姓名	薛竞 陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2014 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信全球机遇股票型证券投资基金

报告截止日：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	7.4.7.1	13,134,115.84	18,745,366.80
结算备付金		-	9,090.91
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	183,656,079.20	241,230,126.81
其中：股票投资		172,230,101.46	224,125,546.51
基金投资		11,425,977.74	17,104,580.30
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

应收证券清算款		76,857.19	-
应收利息	7.4.7.5	1,035.72	1,378.22
应收股利		126,555.46	187,782.85
应收申购款		4,838.09	60,051.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	307,447.54	13,465.30
资产总计		197,306,929.04	260,247,262.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,137,152.84	1,467,744.07
应付管理人报酬		308,626.14	393,440.52
应付托管费		60,010.62	76,502.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	569,103.63	275,620.80
负债合计		3,074,893.23	2,213,307.74
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	191,013,739.30	284,626,066.31
未分配利润	7.4.7.10	3,218,296.51	-26,592,111.27
所有者权益合计		194,232,035.81	258,033,955.04
负债和所有者权益总计		197,306,929.04	260,247,262.78

注：1、报告截止日2013年12月31日，基金份额净值1.017元，基金份额总额191,013,739.30份。

7.2 利润表

会计主体：建信全球机遇股票型证券投资基金

本报告期：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
一、收入		33,295,745.12	41,424,562.59

1. 利息收入		35,792.49	49,502.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	35,790.25	41,458.39
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	8,044.46
其他利息收入		2.24	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		28,395,454.71	2,519,248.08
其中：股票投资收益	7.4.7.12	20,620,258.51	-4,659,454.73
基金投资收益	7.4.7.13	2,782,872.17	801,106.90
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.1	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	32,061.66	-
股利收益	7.4.7.16	4,960,262.37	6,377,595.91
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,928,362.12	38,977,913.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-1,065,427.99	-148,444.89
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,563.79	26,342.93
减：二、费用		6,879,723.12	6,946,789.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,149,501.65	4,824,440.20
2. 托管费	7.4.10.2.2	806,847.27	938,085.50
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,545,524.48	784,532.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	377,849.72	399,731.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,416,022.00	34,477,772.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,416,022.00	34,477,772.99

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信全球机遇股票型证券投资基金

本报告期：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)	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(本期净利润)	-	26,416,022.00	26,416,022.00
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)	-93,612,327.01	3,394,385.78	-90,217,941.23
其中: 1. 基金申购款	1,370,507.44	-76,098.32	1,294,409.12
2. 基金赎回款	-94,982,834.45	3,470,484.10	-91,512,350.35
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)	191,013,739.30	3,218,296.51	194,232,035.81
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)	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(本期净利润)	-	34,477,772.99	34,477,772.99
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-51,657,359.18	7,236,107.41	-44,421,251.77
其中: 1. 基金申购款	3,516,128.81	-474,080.84	3,042,047.97
2. 基金赎回款	-55,173,487.99	7,710,188.25	-47,463,299.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	284,626,066.31	-26,592,111.27	258,033,955.04

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:

孙志晨
基金管理人负责人

何斌
主管会计工作负责人

秦绪华
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信全球机遇股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 982 号《关于核准建信全球机遇股票型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 681,859,858.00 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 232 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 9 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 681,944,805.65 份基金份额,其中认购资金利息折合 84,947.65 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman&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 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》、《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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 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。

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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资和衍生工具（主要为权证投资）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、基金投资和衍生工具(主要为权证投资)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；处置时其处置价格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也可按直线法计算。

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》及其他境内外相关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，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
活期存款	13,134,115.84	18,745,366.80
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	13,134,115.84	18,745,366.80

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	141,175,184.26	172,230,101.46	31,054,917.20
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	7,921,457.73	11,425,977.74	3,504,520.01
其他	-	-	-
合计	149,096,641.99	183,656,079.20	34,559,437.21
项目	上年度末 2012 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	197,696,968.51	224,125,546.51	26,428,578.00
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	17,104,580.30	2,202,497.09
其他	-	-	-
合计	212,599,051.72	241,230,126.81	28,631,075.09

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,035.72	1,373.71
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	-	4.51
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	1,035.72	1,378.22

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应收未起息外汇交易	307,447.54	13,465.30
合计	307,447.54	13,465.30

7.4.7.7 应付交易费用

无。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	29.27	535.03
预提费用	261,589.28	261,617.74
应付未起息外汇交易	307,485.08	13,468.03
合计	569,103.63	275,620.80

7.4.7.9 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12月31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	1,370,507.44	1,370,507.44
本期赎回(以“-”号填列)	-94,982,834.45	-94,982,834.45
- 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	191,013,739.30	191,013,739.30

7.4.7.10 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	20,487,659.88	5,928,362.12	26,416,022.00
本期基金份额交易产生的变动数	11,390,687.59	-7,996,301.81	3,394,385.78
其中：基金申购款	-179,488.19	103,389.87	-76,098.32
基金赎回款	11,570,175.78	-8,099,691.68	3,470,484.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,112,476.22	20,330,772.73	3,218,296.51

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
活期存款利息收入	35,787.81	41,081.03
定期存款利息收入	-	-

其他存款利息收入	-	-
其他	-	-
结算备付金利息收入	2.24	377.36
合计	35,790.25	41,458.39

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	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
卖出股票成交总额	330,647,006.75	233,648,661.16
减：卖出股票成本总额	310,026,748.24	238,308,115.89
买卖股票差价收入	20,620,258.51	-4,659,454.73

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	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
卖出/赎回基金成交总额	16,588,903.23	10,185,523.92
减：卖出/赎回基金成本总额	13,806,031.06	9,384,417.02
基金投资收益	2,782,872.17	801,106.90

7.4.7.14 债券投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	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
卖出权证成交总额	32,061.66	-
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	32,061.66	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	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
股票投资产生的股利收益	4,703,509.00	6,053,554.54
基金投资产生的股利收益	256,753.37	324,041.37

合计	4,960,262.37	6,377,595.91
----	--------------	--------------

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012 年12月31日
1. 交易性金融资产	5,928,362.12	38,977,913.62
——股票投资	4,626,339.20	37,075,500.08
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	1,302,022.92	1,902,413.54
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	5,928,362.12	38,977,913.62

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	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
基金赎回费收入	1,563.79	26,342.93
合计	1,563.79	26,342.93

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	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
交易所市场交易费用	1,545,524.48	784,532.43
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,545,524.48	784,532.43

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	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
审计费用	72,000.00	72,000.00
信息披露费	299,971.54	300,245.25

其他	434.58	10,717.83
银行汇划费	5,443.60	4,768.39
账户维护费	-	12,000.00
合计	377,849.72	399,731.47

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
布朗兄弟哈里曼银行 (Brown Brothers Harriman & Co.)	境外资产托管人
信安环球投资有限公司 (Principal Global Investors, LLC.)（“信安环球”）	境外投资顾问
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	4,149,501.65	4,824,440.20
其中：支付销售机构的客	1,158,667.46	1,345,627.18

户维护费		
------	--	--

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬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 1.80%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 X1.80%/当年天数。

7.4.10.2.2 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的托管费	806,847.27	938,085.50

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 X0.35%/当年天数。

7.4.10.3 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未通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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12月31日		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	3,663,629.47	32,760.07	5,314,064.35	37,008.77
布朗兄弟哈里曼银行	9,470,486.37	3,027.74	13,431,302.45	4,072.26

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保

管，按约定利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间未发生其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%（2012 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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，本基金的基金管理人通过风险管理委员会设定流动性比例要求，独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。除附注 7.4.12 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，其余均能及时变现。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投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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均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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 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	13,134,115.84	-	-	-	13,134,115.84
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	183,656,079.20	183,656,079.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	76,857.19	76,857.19
应收利息	-	-	-	1,035.72	1,035.72
应收股利	-	-	-	126,555.46	126,555.46
应收申购款	-	-	-	4,838.09	4,838.09
其他资产	-	-	-	307,447.54	307,447.54
资产总计	13,134,115.84	-	-	184,172,813.20	197,306,929.04
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	-	-	-	2,137,152.84	2,137,152.84
应付管理人报酬	-	-	-	308,626.14	308,626.14
应付托管费	-	-	-	60,010.62	60,010.62
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	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	569,103.63	569,103.63
负债总计	-	-	-	3,074,893.23	3,074,893.23
利率敏感度缺口	13,134,115.84	-	-	-181,097,919.97	194,232,035.81
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公允价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资 (2012 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2012 年 12 月 31 日：同)。。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	4,221,517.82	5,147,668.91	102,174.80	9,471,361.53
交易性金融资产	81,842,034.15	53,412,764.72	48,401,280.33	183,656,079.20
应收股利	79,548.75	5,325.92	41,680.79	126,555.46
应收证券清算款	-	76,857.19	-	76,857.19
其它资产	195,493.68	111,953.86	-	307,447.54
资产合计	86,338,594.40	58,754,570.60	48,545,135.92	193,638,300.92
以外币计价的负债				
其它负债	111,962.56	188,811.05	6,711.47	307,485.08
负债合计	111,962.56	188,811.05	6,711.47	307,485.08
资产负债表外汇风险敞口净额	86,226,631.84	58,565,759.55	48,538,424.45	193,330,815.84
项目	上年度末 2012 年 12 月 31 日			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	
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
其它资产	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				
其它负债	-	-	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

7.4.13.4.2.2 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 12 月 31 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)
	所有外币相对人民币贬值 5%	-9,666,540.79	-12,748,775.68
	所有外币相对人民币升值 5%	9,666,540.79	12,748,775.68

7.4.13.4.3 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%。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	172,230,101.46	88.67	224,125,546.51	86.86
交易性金融资产-基金投资	11,425,977.74	5.88	17,104,580.30	6.63
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	183,656,079.20	94.55	241,230,126.81	93.49

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准 (附注 7.4.1) 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 12 月 31 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	9,128,905.68	8,903,332.94
	业绩比较基准下降 5%	-9,128,905.68	-8,903,332.94

7.4.14 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 183,656,079.20 元, 无属于第二层级或第三层级的余额 (2012 年 12 月 31 日: 第一层级 241,230,126.81 元, 无第二层级或第三层级)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	172,230,101.46	87.29
	其中：普通股	163,953,405.34	83.10
	存托凭证	8,276,696.12	4.19
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	11,425,977.74	5.79
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,134,115.84	6.66
8	其他各项资产	516,734.00	0.26
9	合计	197,306,929.04	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	70,433,149.05	36.26

中国香港	53,395,672.08	27.49
日本	11,019,280.99	5.67
德国	9,477,578.44	4.88
英国	8,886,773.67	4.58
澳大利亚	4,891,258.56	2.52
法国	4,780,370.03	2.46
加拿大	3,599,173.65	1.85
瑞士	2,258,126.65	1.16
瑞典	2,030,632.72	1.05
意大利	1,458,085.62	0.75
合计	172,230,101.46	88.67

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 (%)
非必需消费品	23,263,832.89	11.98
必需消费品	10,566,915.81	5.44
能源	12,721,938.80	6.55
金融	44,242,153.17	22.78
保健	18,625,726.67	9.59
工业	20,114,488.98	10.36
信息技术	21,956,092.91	11.30
材料	6,859,719.10	3.53
电信服务	6,236,889.24	3.21
公用事业	7,642,343.89	3.93
合计	172,230,101.46	88.67

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	KYG875721485	香港证券交易所	中国香港	12,800	4,977,527.78	2.56
2	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	CNE1000001Z5	香港证券	中国香港	1,412,000	3,963,259.63	2.04

				交易所				
3	CHINA MOBILE LTD	中国移动	HK0941009539	香港 证券 交易 所	中国香 港	61,500	3,887,592.86	2.00
4	BAIDU INC - SPON ADR	百度	US0567521085	纳斯 达克 交易 所	美国	3,434	3,724,229.91	1.92
5	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	Discover 金融服 务公 司	US2547091080	纽约 证券 交易 所	美国	10,706	3,652,047.37	1.88
6	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特公 司	US20030N1019	纳斯 达克 交易 所	美国	11,346	3,594,701.08	1.85
7	DUERR AG	杜尔有限公 司	DE0005565204	柏林 证券 交易 所	德国	6,266	3,418,910.74	1.76
8	WELLS FARGO & CO	富国银行	US9497461015	纽约 证券 交易 所	美国	11,832	3,275,088.84	1.69
9	ABBVIE INC	-	US00287Y1091	纽约 证券 交易 所	美国	10,056	3,237,803.62	1.67
10	MCKESSON CORP	麦卡逊	US58155Q1031	纽约 证券 交易 所	美国	2,872	2,826,161.90	1.46
11	FIFTH THIRD BANCORP	五三银行	US3167731005	纳斯 达克 交易 所	美国	21,659	2,777,069.48	1.43
12	OMNICARE INC	omnicare 股份有 限公 司	US6819041087	纽约 证券 交易 所	美国	7,540	2,774,786.99	1.43
13	AMGEN INC	安进	US0311621009	纳斯 达克 交易 所	美国	3,929	2,734,670.85	1.41

				所				
14	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	农业银行	CNE100000Q43	香港 证券 交易 所	中国香 港	846,000	2,534,223.71	1.30
15	HESS CORP	阿美拉达赫 斯	US42809H1077	纽约 证券 交易 所	美国	4,825	2,441,656.03	1.26
16	LOWES COS INC	劳氏	US5486611073	纽约 证券 交易 所	美国	7,861	2,374,819.07	1.22
17	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	6,400	2,224,057.31	1.15
18	KROGER CO	克罗格公司	US5010441013	纽约 证券 交易 所	美国	9,134	2,201,389.51	1.13
19	PERSIMMON PLC	柿子公司	GB0006825383	英国 伦敦 交易 所	英国	17,038	2,122,745.41	1.09
20	MICROSOFT CORP	微软	US5949181045	纳斯 达克 交易 所	美国	9,279	2,117,532.45	1.09
21	CA INC	冠群国际	US12673P1057	纳斯 达克 交易 所	美国	10,159	2,084,227.40	1.07
22	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	2,048,166.83	1.05
23	WAL-MART STORES INC	沃尔玛百货	US9311421039	纽约 证券 交易 所	美国	4,174	2,002,539.36	1.03
24	UNS ENERGY CORP	UNS 能源公 司	US9031191052	纽约 证券 交易 所	美国	5,267	1,921,925.48	0.99

25	YAHOO! INC	雅虎	US9843321061	纳斯达克交易所	美国	7,787	1,919,952.10	0.99
26	GUANGDONG INVESTMENT LTD	粤海投资	HK0270001396	香港证券交易所	中国香港	320,000	1,907,079.49	0.98
27	CHINA MERCHANTS BANK-H	招商银行	CNE1000002M1	香港证券交易所	中国香港	144,829	1,881,114.31	0.97
28	CNOOC LTD	中国海洋石油	HK0883013259	香港证券交易所	中国香港	164,000	1,859,339.60	0.96
29	OMRON CORP	-	JP3197800000	东京交易所	日本	6,900	1,851,589.44	0.95
30	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	1,803,167.44	0.93
31	ALLSTATE CORP	全州保险	US0200021014	纽约证券交易所	美国	5,412	1,799,624.90	0.93
32	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国石化	CNE1000002Q2	香港证券交易所	中国香港	356,600	1,774,739.68	0.91
33	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	中信银行	CNE1000001Q4	香港证券交易所	中国香港	530,000	1,754,315.00	0.90
34	CHEVRON CORP	雪佛龙德士 古	US1667641005	纽约证券交易所	美国	2,299	1,750,835.13	0.90
35	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	CNE100000338	香港证券交易所	中国香港	51,500	1,733,008.17	0.89
36	AXA SA	安盛集团	FR0000120628	法国交易	法国	10,133	1,724,089.10	0.89

				所				
37	PICC PROPERTY & CASUALTY -H	中国财险	CNE100000593	香港 证券 交易 所	中国香 港	190,162	1,719,377.30	0.89
38	FLIGHT CENTRE LTD	福莱森特有限公司	AU000000FLT9	澳大利 亚证 券交 易所	澳大利 亚	6,619	1,716,646.48	0.88
39	PROTECTIVE LIFE CORP	PROTECTIVE LIFE 公司	US7436741034	纽约 证 券交 易所	美国	5,357	1,654,610.99	0.85
40	PRUDENTIAL PLC	保诚	GB0007099541	英国 伦 敦 交 易 所	英国	12,163	1,638,903.92	0.84
41	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	CNE1000003X6	香港 证 券交 易 所	中国香 港	30,000	1,638,110.21	0.84
42	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村商业 银行	CNE100000X44	香港 证 券交 易 所	中国香 港	550,000	1,625,923.64	0.84
43	CARDINAL HEALTH INC	-	US14149Y1082	纽约 证 券交 易 所	美国	3,945	1,606,932.19	0.83
44	VINCI SA	万喜公司	FR0000125486	法国 交 易 所	法国	3,979	1,598,562.88	0.82
45	BRITVIC PLC	britvic 股 份有限公司	GB00B0N8QD54	英国 伦 敦 交 易 所	英国	22,930	1,596,731.24	0.82
46	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	统一互联网 公司	DE0005089031	柏林 证 券交 易 所	德国	6,115	1,591,810.25	0.82
47	SYNOPSIS INC	新思科技公 司	US8716071076	纳斯 达 克 交 易 所	美国	6,355	1,571,917.09	0.81

48	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	1,458,085.62	0.75
49	SAFRAN SA	赛峰公司	FR0000073272	法国交易所	法国	3,428	1,457,718.05	0.75
50	JAPAN TOBACCO INC	日本烟草产业	JP372680000	东京交易所	日本	7,200	1,422,553.10	0.73
51	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	三井住友金融集团	JP3890350006	东京交易所	日本	4,500	1,409,034.69	0.73
52	GENERAL MOTORS CO	通用汽车公司	US37045V1008	纽约证券交易所	美国	5,637	1,404,629.37	0.72
53	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	-	CA01626P4033	多伦多证券交易所	加拿大	3,000	1,375,116.34	0.71
54	EXTRA SPACE STORAGE INC	-	US30225T1025	纽约证券交易所	美国	4,970	1,276,606.11	0.66
55	NIPPON YUSEN	日本邮船	JP3753000003	东京交易所	日本	65,000	1,261,718.64	0.65
56	DEUTSCHE POST AG-REG	德国邮政有限公司	DE0005552004	柏林证券交易所	德国	5,577	1,244,233.44	0.64
57	LLOYDS BANKING GROUP PLC	劳埃德银行集团	GB0008706128	英国伦敦交易所	英国	155,676	1,234,799.83	0.64
58	NOVARTIS AG-REG	诺华	CH0012005267	瑞士证券交易所	瑞士	2,529	1,234,634.59	0.64
59	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	1,229,803.12	0.63

60	PETROCHINA CO LTD-H	中国石油天然气	CNE1000003W8	香港证券交易所	中国香港	184,000	1,229,663.72	0.63
61	SHIRE PLC	Shire 公司	JE00B2QKY057	英国伦敦交易所	英国	4,142	1,187,866.42	0.61
62	SIEMENS AG-REG	西门子	DE0007236101	柏林证券交易所	德国	1,405	1,174,457.18	0.60
63	NISOURCE INC	NISOURCE 公司	US65473P1057	纽约证券交易所	美国	5,851	1,172,926.99	0.60
64	STATOIL ASA-SPON ADR	挪威国家石油公司	US85771P1021	纽约证券交易所	美国	7,874	1,158,408.68	0.60
65	MANPOWERGROUP INC	万宝盛华集团	US56418H1005	纽约证券交易所	美国	2,178	1,140,139.08	0.59
66	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国人寿	CNE1000002L3	香港证券交易所	中国香港	59,000	1,124,898.57	0.58
67	NCC AB-B SHS	-	SE0000117970	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	5,596	1,115,086.68	0.57
68	TAYLOR WIMPEY PLC	泰勒温佩公司	GB0008782301	英国伦敦交易所	英国	98,620	1,105,726.85	0.57
69	STANLEY ELECTRIC CO LTD	-	JP3399400005	东京交易所	日本	7,900	1,098,989.29	0.57
70	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	US20825C1045	纽约证券交易所	美国	2,544	1,095,817.79	0.56
71	CTrip.COM	CTrip.COM	US22943F1003	纳斯达克	美国	3,607	1,091,219.14	0.56

	INTERNATIONAL-ADR	国际有限公司		达克交易所				
72	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	-	BMG0692U1099	纽约证券交易所	美国	3,664	1,062,668.21	0.55
73	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药控股集团有限公司	BMG8162K1137	香港证券交易所	中国香港	190,000	1,057,636.60	0.54
74	FUJI HEAVY INDUSTRIES LTD	富士重工	JP3814800003	东京交易所	日本	6,000	1,045,077.39	0.54
75	WESTLAKE CHEMICAL CORP	韦斯特莱克化学公司	US9604131022	纽约证券交易所	美国	1,389	1,033,761.28	0.53
76	DAI NIPPON PRINTING CO LTD	大日本印刷	JP3493800001	东京交易所	日本	16,000	1,031,558.98	0.53
77	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	罗氏	CH0012032048	瑞士证券交易所	瑞士	599	1,023,492.06	0.53
78	APOLLO EDUCATION GROUP INC	阿波罗教育集团	US0376041051	纳斯达克交易所	美国	6,004	1,000,070.12	0.51
79	TOYOTA MOTOR CORP	丰田汽车	JP3633400001	东京交易所	日本	2,600	964,313.53	0.50
80	KDDI CORP	KDDI 株式会社	JP3496400007	东京交易所	日本	2,500	934,445.93	0.48
81	LOOMIS AB-B	-	SE0002683557	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	6,324	915,546.04	0.47
82	SANTOS LTD	桑托斯有限公司	AU000000ST06	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	11,425	911,671.76	0.47

83	CSR LTD	CSR 有限公司	AU000000CSR5	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	62,123	897,917.14	0.46
84	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	碧桂园	KYG245241032	香港证券交易所	中国香港	231,000	849,977.53	0.44
85	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VERIZON 通讯股份有限公司	US92343V1044	纽约证券交易所	美国	2,825	846,374.71	0.44
86	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育用品	KYG040111059	香港证券交易所	中国香港	107,000	807,615.46	0.42
87	LABIXIAOXIN SNACKS GROUP LTD	蜡笔小新休闲食品集团	BMG5546K1080	香港证券交易所	中国香港	195,000	797,237.22	0.41
88	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	唯品会控股有限公司	US92763W1036	纽约证券交易所	美国	1,550	790,792.32	0.41
89	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	246,000	787,189.20	0.41
90	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	340,000	783,242.33	0.40
91	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORPLT	中国铁建	CNE100000981	香港证券交易所	中国香港	126,000	764,781.65	0.39
92	SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	搜房资讯控股有限公司	US8360341080	纽约证券交易所	美国	1,520	763,717.20	0.39
93	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电福新能源股份有限公司	CNE100001F60	香港证券交易所	中国香港	312,000	753,082.54	0.39

94	WUXI PHARMATECH CAYMAN-ADR	药明康德新 药开发有限 个 i	US9293521020	纽约 证券 交易 所	美国	3,198	748,328.87	0.39
95	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	银河娱乐	HK0027032686	香港 证券 交易 所	中国香 港	13,000	710,869.85	0.37
96	TRULY INTERNATIONAL HOLDINGS	信利国际	KYG910191363	香港 证券 交易 所	中国香 港	194,000	636,044.35	0.33
97	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	浙江沪杭甬 高速公路	CNE1000004S4	香港 证券 交易 所	中国香 港	108,000	622,411.12	0.32
98	CHINA FIBER OPTIC NETWORK SY	中国光纤网 络	KYG211521060	香港 证券 交易 所	中国香 港	484,000	586,024.39	0.30
99	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	576,507.86	0.30
100	MGM CHINA HOLDINGS LTD	美高梅中国	KYG607441022	香港 证券 交易 所	中国香 港	21,200	551,713.32	0.28
101	CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	中国粮油控 股	HK0606037437	香港 证券 交易 所	中国香 港	169,000	514,218.01	0.26
102	DALIAN PORT (PDA) CO LTD-H	大连港	CNE1000002Y6	香港 证券 交易 所	中国香 港	330,000	513,722.68	0.26
103	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	雅居乐地产 控股有限公 司	KYG011981035	香港 证券 交易 所	中国香 港	78,000	509,618.56	0.26
104	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中国神华	CNE1000002R0	香港 证券 交易 所	中国香 港	26,000	499,806.41	0.26
105	CHINA BLUECHEMICAL	中海石油化	CNE1000002D0	香港	中国香	120,000	457,585.86	0.24

	LTD - H	学		证券 交易 所	港			
106	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上海石化	CNE1000004C8	香港 证券 交易 所	中国香 港	254,000	445,336.40	0.23
107	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	中国交建	CNE1000002F5	香港 证券 交易 所	中国香 港	90,000	442,254.38	0.23
108	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏信	HK0000077468	香港 证券 交易 所	中国香 港	81,000	422,229.10	0.22
109	CHINA MODERN DAIRY HOLDINGS	现代牧业	KYG215791008	香港 证券 交易 所	中国香 港	127,000	419,375.08	0.22
110	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	CNE100000Q35	香港 证券 交易 所	中国香 港	60,000	400,033.82	0.21
111	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥控 股	KYG2113L1068	香港 证券 交易 所	中国香 港	96,000	393,240.80	0.20
112	CHINA GAS HOLDINGS LTD	中国燃气	BMG2109G1033	香港 证券 交易 所	中国香 港	40,000	358,520.88	0.18
113	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	中国联通	HK0000049939	香港 证券 交易 所	中国香 港	38,000	346,570.18	0.18
114	BEIJING CAPITAL LAND LTD-H	首创置业	CNE100000239	香港 证券 交易 所	中国香 港	164,000	340,406.14	0.18
115	CHINA WATER AFFAIRS GROUP	中国水务	BMG210901242	香港 证券 交易 所	中国香 港	132,000	297,855.37	0.15
116	KWG PROPERTY HOLDING LTD	合景泰富	KYG532241042	香港 证券 交易 所	中国香 港	85,000	287,367.07	0.15

				交易所				
117	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	交通银行	CNE100000205	香港证券交易所	中国香港	66,000	283,844.75	0.15
118	WEICHAI POWER CO LTD-H	潍柴动力	CNE1000004L9	香港证券交易所	中国香港	10,000	245,696.88	0.13
119	MAANSHAN IRON & STEEL-H	马钢股份	CNE1000003R8	香港证券交易所	中国香港	148,000	244,360.28	0.13
120	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	237,755.95	0.12
121	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际	CNE1000006Z4	香港证券交易所	中国香港	42,000	231,481.84	0.12
122	SHENZHEN INVESTMENT LTD	深圳控股	HK0604011236	香港证券交易所	中国香港	98,000	224,987.58	0.12
123	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中国电信	CNE1000002V2	香港证券交易所	中国香港	72,000	221,905.56	0.11
124	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团	KYG368441195	香港证券交易所	中国香港	88,000	219,326.72	0.11
125	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	华润燃气	BMG2113B1081	香港证券交易所	中国香港	10,000	212,282.10	0.11
126	SINO BIOPHARMACEUTICAL	中国生物制药	KYG8167W1380	香港证券交易所	中国香港	40,000	193,412.58	0.10
127	TEXHONG TEXTILE GROUP LTD	天虹纺织	KYG876551097	香港证券交易所	中国香港	22,000	174,354.36	0.09

				所				
128	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	中国中铁	CNE1000007Z2	香港 证券 交易 所	中国香 港	51,000	160,390.92	0.08
129	ORORA LTD	-	AU0000000RA8	澳大利 亚 证券 交易 所	澳大利 亚	21,372	135,220.06	0.07
130	ANXIN-CHINA HOLDINGS LTD	中国安芯	KYG0400P1037	香港 证券 交易 所	中国香 港	68,000	131,520.55	0.07
131	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	中国太保	CNE1000009Q7	香港 证券 交易 所	中国香 港	3,000	71,704.18	0.04

注：所用证券代码采用 ISI 所用证券代码采用 ISIN 码。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	CNE1000001Q4	5,661,790.52	2.19
2	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	CNE100000X44	3,964,888.61	1.54
3	BAIDU INC - SPON ADR	US0567521085	3,292,127.49	1.28
4	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	CNE1000002F5	3,207,831.21	1.24
5	MICROSOFT CORP	US5949181045	3,102,918.94	1.20
6	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	CNE1000002N9	2,898,480.47	1.12
7	HUANENG POWER INTL INC-H	CNE1000006Z4	2,691,418.81	1.04
8	TYSON FOODS INC-CL A	US9024941034	2,623,215.09	1.02
9	CHINA WIRELESS	KYG211651081	2,578,146.38	1.00

	TECH LTD			
10	WAL-MART STORES INC	US9311421039	2,502,173.10	0.97
11	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDIN	JP3892100003	2,488,320.96	0.96
12	KINGSOFT CORP LTD	KYG5264Y1089	2,432,552.60	0.94
13	ABBVIE INC	US00287Y1091	2,330,044.51	0.90
14	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	CNE1000003X6	2,294,976.61	0.89
15	DATANG INTL POWER GEN CO-H	CNE1000002Z3	2,272,992.50	0.88
16	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	US9113121068	2,176,330.15	0.84
17	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	CNE100000Q43	2,001,716.10	0.78
18	BANCO DO BRASIL SA-SPON ADR	US0595781040	1,994,924.17	0.77
19	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	GB00B03MLX29	1,914,142.66	0.74
20	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	GB0000031285	1,908,065.19	0.74

注：1、买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)，不包括相关交易费用。

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	BANK OF CHINA LTD-H	CNE1000001Z5	7,164,176.35	2.78
2	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	CNE1000002F5	6,097,674.76	2.36
3	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	CNE1000001Q4	5,565,908.54	2.16
4	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	CNE1000002N9	4,550,992.97	1.76
5	BAIDU INC - SPON ADR	US0567521085	4,200,297.21	1.63
6	US BANCORP	US9029733048	3,570,141.40	1.38

7	SANOFI	FR0000120578	3,460,447.40	1.34
8	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	CNE100000Q43	3,405,270.49	1.32
9	mitsubishi UFJ FINANCIAL GRO	JP3902900004	3,373,760.01	1.31
10	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	CNE100000338	3,373,681.29	1.31
11	TYSON FOODS INC-CL A	KYG875721485	3,085,784.16	1.20
12	TENCENT HOLDINGS LTD	US9024941034	3,078,371.15	1.19
13	FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	HK0688002218	2,941,843.53	1.14
14	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	US3444191064	2,935,685.03	1.14
15	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	2,930,201.77	1.14
16	MICROSOFT CORP	US5949181045	2,856,385.47	1.11
17	WAL-MART STORES INC	US9311421039	2,724,287.37	1.06
18	BT GROUP PLC	GB0030913577	2,662,395.07	1.03
19	KINGSOFT CORP LTD	KYG5264Y1089	2,622,607.10	1.02
20	CNOOC LTD	HK0883013259	2,611,431.85	1.01

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	253,504,963.99
卖出收入(成交)总额	330,647,006.75

注：买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)，不包括相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	ISHARES DJ US INDEX FUND	ETF 基金	交易型开 放式指数	BLACKROCK FUND ADVISORS	8,594,098.79	4.42
2	SPDR S&P 500 ETF TRUST	ETF 基金	交易型开 放式指数	SSGA FUNDS MANAGEMENT INC	2,814,786.31	1.45
3	HANG SENG H-SHARE INDEX ETF	ETF 基金	交易型开 放式指数	HANG SENGINVESTMENT MANAGEMENTLTD	17,092.64	0.01

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 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	76,857.19
3	应收股利	126,555.46
4	应收利息	1,035.72
5	应收申购款	4,838.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	307,447.54
9	合计	516,734.00

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
9,318	20,499.44	2,866,100.95	1.50%	188,147,638.35	98.50%

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	980.33	0.00%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年9月14日）基金份额总额	681944805.65
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	1,370,507.44
减：本报告期基金总赎回份额	94,982,834.45
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	191,013,739.30

§ 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 72,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
HSBC, INC		1,020,298.23	0.18%	2,040.60	0.35%	-
CIMB SECURITIES		1,536,132.72	0.26%	3,059.68	0.53%	-
PENSERRA SECURITIES LLC		55,968.60	0.01%	55.97	0.01%	-
REDBURN PARTNERS LLP		1,846,939.07	0.32%	923.48	0.16%	-
CREDIT AGRICOLE INDOSUEZ CHEVREAU		7,243,615.17	1.25%	4,094.09	0.70%	-
ITG-CSA		8,856,424.96	1.52%	6,415.48	1.10%	-
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.		8,128,819.01	1.40%	12,192.98	2.10%	-
GOLDMAN SACHS		10,264,740.29	1.77%	16,147.60	2.78%	-
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.		27,525,594.80	4.74%	33,452.67	5.76%	-
MACQUARIE-AUSTRALIA		3,513,866.00	0.60%	4,482.43	0.77%	-
ING BANK		6,477,787.97	1.11%	5,503.84	0.95%	-
SANFORD BERNSTEIN		10,377,195.02	1.79%	10,230.68	1.76%	-
DEUTSCHE BANK-EURO ALGORITHMS		189,734.42	0.03%	94.83	0.02%	-
BNY CONVERGX		57,200,333.96	9.84%	30,081.63	5.18%	-
MORGAN STANLEY		10,433,707.49	1.80%	13,909.36	2.39%	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.		5,665,922.58	0.98%	11,331.84	1.95%	-
MERRILL LYNCH		83,436,960.22	14.36%	128,002.58	22.03%	-
CREDIT SUISSE		47,377,541.87	8.15%	54,542.20	9.39%	-
ITG		1,501,077.84	0.26%	-	0.26%	-
J. P. MORGAN		72,892,636.15	12.54%	53,456.07	9.20%	-
CITIGROUP		77,742,392.42	13.38%	51,652.22	8.89%	-
UBS SECURITIES		32,079,536.74	5.52%	31,662.79	5.45%	-

CREDIT LYONNAIS SEC. INC		34,294,702.73	5.90%	33,405.25	5.75%	-
INSTINET CORP.		33,852,834.48	5.83%	32,938.23	5.67%	-
MACQUARIE CAPTIAL		1,691,652.20	0.29%	3,383.30	0.58%	-
BARCLAYS CAPITAL INC.		3,176,157.56	0.55%	11,939.00	2.05%	-
RBC CAPITAL MARKETS		15,689,524.08	2.70%	11,526.52	1.98%	-
DAIWA		3,774,190.07	0.65%	6,834.67	1.18%	-
ROBERT W. BAIRD&CO.		11,524,670.58	1.98%	5,276.21	0.91%	-
STIFEL NICOLAUS		124,384.75	0.02%	87.03	0.01%	-
HSBC INC		183,485.53	0.03%	275.18	0.05%	-

注：1、本基金管理人制定了服务券商的选择标准，具体如下：

（1）交易执行能力：能够公平对待所有客户，实现最佳价格成交，可靠、诚信、及时成交，具备充分流动性，交易差错少等；

（2）研究支持服务：能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务，包括举办推介会、拜访公司、及时沟通市场情况、承接专项研究、协助交易评价等；

（3）财务实力：净资产、总市值、受托资产等指标处于行业前列，或具有明显的安全边际；

（4）后台便利性和可靠性：交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

（5）组织框架和业务构成：具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

（6）其他有利于基金份额持有人利益的商业合作考虑。

海外投资部在根据以上标准进行评估后并结合海外投资顾问提供的建议，列出券商名单报海外投资决策委员会最终确定。

2、券商的服务评价

（1）海外投资部每半年组织“服务总结”及评分。

（2）若券商提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，经海外投资决策委员会批准，公司将提前终止租用其交易席位。

3、除海通证券的交易席位为与优化配置基金共用的交易席位外，本报告期内新增的服务券商有 BMO CAPITAL MARKETS, ROBERT W. BAIRD&CO., STIFEL NICOLAUS, CREDIT AGRICOLE, REDBURN PARTNERS, SANDLER OCEIL&PARTNERS, 报告期内无剔除单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
HSBC, INC	-	-	-	-	-	-	-	-
CIMB SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
PENSERRA SECURITIES LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
REDBURN PARTNERS LLP	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT AGRICOLE INDOSUEZ CHEVREAU	-	-	-	-	-	-	737,097.27	0.03%
ITG-CSA	-	-	-	-	-	-	-2,312,462.89	0.01%
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS	-	-	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE-AUSTRALIA	-	-	-	-	-	-	-	-
ING BANK	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK-EURO ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
BNY CONVERGX	-	-	-	-	-	-	-5,648,011.91	0.24%
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	-7,955,129.18	0.34%
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-	667,501.40	0.03%
ITG	-	-	-	-	-	-	-	-
J. P. MORGAN	-	-	-	-	-	-	726,840.15	0.03%
CITIGROUP	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC	-	-	-	-	-	-	-	-
INSTINET CORP.	-	-	-	-	-	-	-1,150,414.47	0.05%
MACQUARIE CAPTIAL	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL	-	-	-	-	-	-	-4,237,287.42	0.18%

INC.								
RBC CAPITAL MARKETS								
DAIWA								
ROBERT W. BAIRD&CO.								
STIFEL NICOLAUS								
HSBC INC								

11.8 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	关于公司旗下三只 QDII 基金 2014 年境内外主要市场节假日暂停申购、赎回和定投等业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 12 月 28 日
2	建信基金管理有限责任公司关于新增和讯信息科技有限公司为旗下代销机构并参加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 11 月 29 日
3	2013 年第二季度基金产品风险评价结果	指定报刊和/或公司网站	2013 年 9 月 6 日
4	2013 年第一季度基金产品风险评价结果	指定报刊和/或公司网站	2013 年 9 月 6 日
5	关于建信基金管理有限责任公司旗下 QDII 基金暂停估值及延期办理交易的公告	指定报刊和/或公司网站	2013 年 8 月 15 日
6	建信基金管理有限责任公司关于新增上海天天基金为旗下代销机构并参加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 8 月 7 日
7	关于旗下开放式基金参加交通银行网上银行及手机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 7 月 4 日
8	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
9	关于开通银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
10	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
11	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

12	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
----	----------------------------------	-------------	----------------

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 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
2014 年 3 月 27 日