

# 建信新兴市场优选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

<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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	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.....	15
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
注：1、该股票为韩国上市交易股票，期末估值单价和复牌开盘单价为韩元折算为人民币的金 额，折算采用当日汇率。.....	37
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
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.....	45
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.....	59
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	62
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
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.....	63
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>63</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>63</b>
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.....	64
11.4 基金投资策略的改变.....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
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.....	70
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>70</b>
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信新兴市场优选股票型证券投资基金
基金简称	建信新兴市场股票（QDII）
基金主代码	539002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 21 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	95,646,248.95 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于注册地或主要经济活动在新兴市场国家或地区的上市公司股票，在分散投资风险的同时追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在投资策略方面，将采取自上而下的资产配置与自下而上的证券选择相结合、定量研究与定性研究相结合、组合构建与风险控制相结合等多种方式进行投资组合的构建。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：摩根士丹利资本国际新兴市场指数（MSCI Emerging Markets Index（Net Total Return））。
风险收益特征	本基金为股票型基金，一般情况下基金投资风险收益水平高于债券型基金和混合型基金。同时，由于本基金主要投资于新兴市场上公司股票，预期风险-收益水平高于一般的境外投资股票型基金。

### 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
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	<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

## 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（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 6 月 21 日 (基金合同生效日)-2011 年 12 月 31 日

本期已实现收益	-1,034,492.70	860,056.30	-20,178,409.94
本期利润	-8,937,912.32	20,775,781.68	-26,830,563.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0810	0.1416	-0.1303
本期加权平均净值利润率	-8.79%	15.27%	-13.73%
本期基金份额净值增长率	-7.82%	16.02%	-15.10%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2013 年末</b>	<b>2012 年末</b>	<b>2011 年末</b>
期末可供分配利润	-11,392,995.91	-13,894,246.87	-24,961,743.76
期末可供分配基金份额利润	-0.1191	-0.1065	-0.1514
期末基金资产净值	86,876,799.02	128,450,497.37	139,862,320.82
期末基金份额净值	0.908	0.985	0.849
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2013 年末</b>	<b>2012 年末</b>	<b>2011 年末</b>
基金份额累计净值增长率	-9.20%	-1.50%	-15.10%

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

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

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

4、本基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，合同生效当期未满一年。

## 3.2 基金净值表现

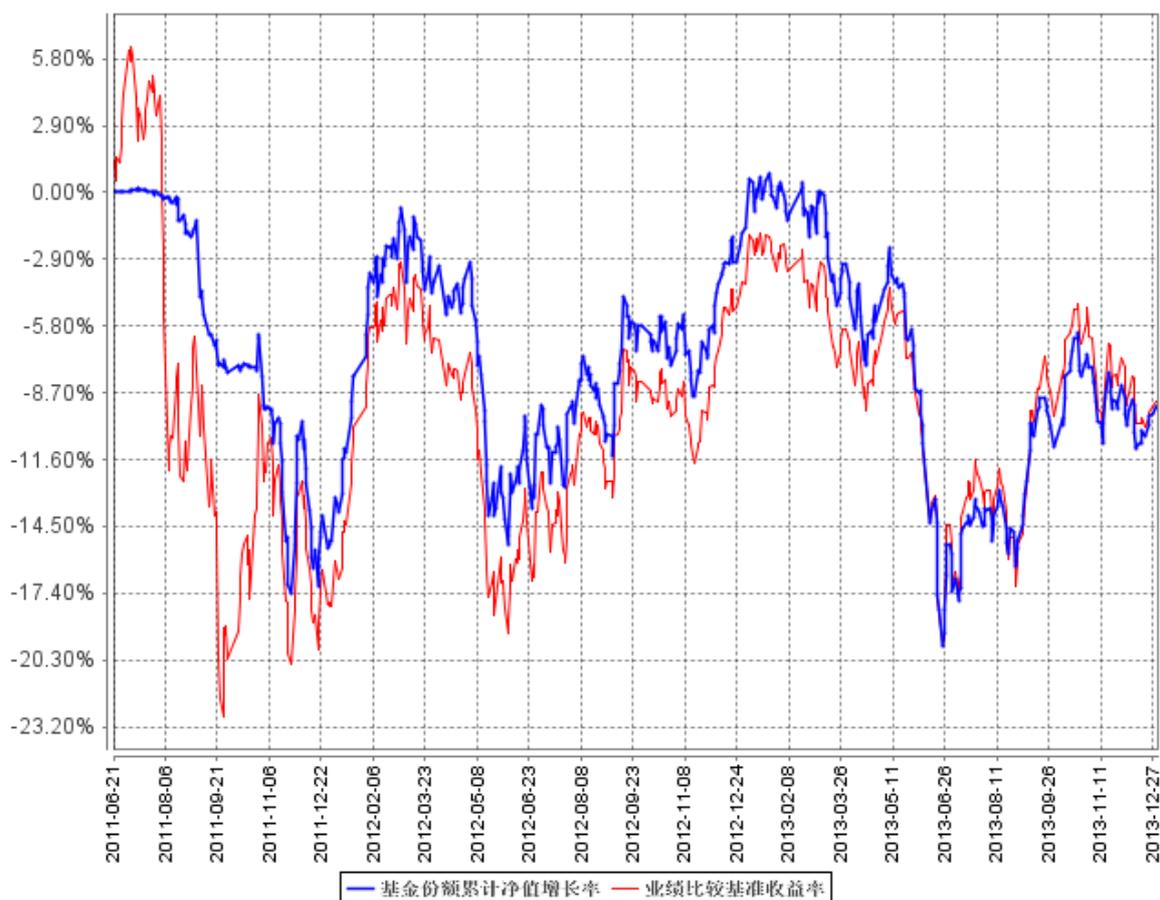
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.02%	0.65%	0.70%	0.77%	1.32%	-0.12%
过去六个月	7.20%	0.72%	6.24%	0.87%	0.96%	-0.15%
过去一年	-7.82%	0.84%	-5.36%	0.90%	-2.46%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-9.20%	0.86%	-9.09%	1.14%	-0.11%	-0.28%

注：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

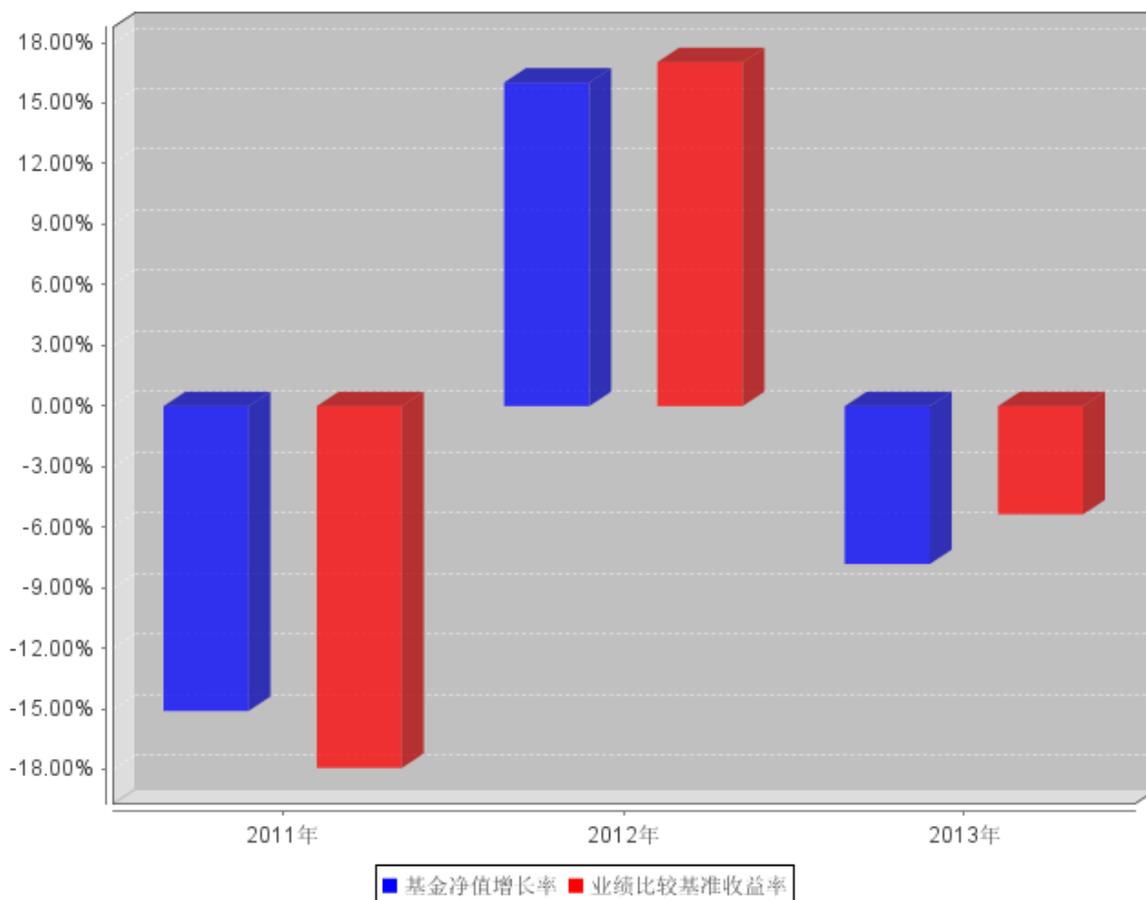


注：1、同期业绩比较基准以人民币计价。

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 2011 年 6 月 21 日生效，2011 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 6 月 21 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、高盛证券公司研究

					<p>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	在境外投资顾问所任职位	证券从业年限	说明
Mohammed Zaidi	投资组合经理	16	Mohammed Zaidi 是信

			<p>安环球股票的基金经理。他在新加坡办公，担任全球新兴市场股票策略的共同基金经理及新兴亚洲股票策略负责人。Mohammed 的职业生 涯开始于 1997 年，在全球宏观对冲基金管理人 VZB Capital 担任新兴市场分析师及基金经理。他在 2001 年作为新兴市场股票分析师加入信安，专注于基础选股工作，并且是负责信安内部研发的全球研究平台（GRP）初始搭建的核心分析师之一。他专注于将 GRP 调整适用于新兴市场和亚洲股票。在 2006 年离开公司后，他曾经担任 Martin Currie 投资管理公司的新兴市场基金经理和分析师。在那之前服务于该团队的前任雇主 Scottish Widows 投资合伙公司。他持有麻省理工学院斯隆管理学院 MBA 学位，宾夕法尼亚大学沃顿学院经济学学士学位。</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。</p>

			<p>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。他也曾在建设银行和信安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>
Mihail Dobrinov	投资组合经理	18	<p>Mihail Dobrinov 是信安环球股票的基金经理。他领导新兴市场团队，包括亚洲、拉丁美洲、东欧、中东和非洲的股票市场。他负责监督分散化新兴市场组合和专门的亚洲地区股票策略。在 1995 年，Mihail 最初以国际和新兴市场债务和货币专家身份加入信安。他在 2002 年加入股票团队，并且在 2007 年被任命为新兴市场股票的基金经理。Mihail 的基本研究经验包括许多不同的经济板块，特别</p>

			<p>专注于工业、原材料和能源公司。他的覆盖领域包括工业和电信板块的公司。Mihail 从 University of Iowa 取得金融 MBA 学位，并从 Sofia University, Bulgaria 取得一个法学学位。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。</p>
--	--	--	--

### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.4.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

#### 4.4.2 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人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 年新兴市场震荡走势，全年略有下跌。新兴市场主要国家经济基本面较弱是新兴市场表现欠佳的主要原因。其中，中国市场相对于其它市场表现略好，但总体看，中国经济增速仍然略有下行。2013 年中国经济的主要特点是主要经济指标在经历了近十年的高速增长后，近期均有所回落，例如固定资产投资增速下降至 20%，消费增速也回落至 13—14%水平，GDP 增速降至 7.7%；其它反映实体经济的高频数据，如发电量增速、铁路运输增速以及煤炭和水泥等价格也不尽人意。

另外中国整体流动性处于紧平衡状态，资金价格维持在近几年的高位，6 月底还出现了短暂的“钱荒”。上半年由于经济增速下滑，海外投资人一度担心中国经济会出现“硬着陆”，但随着年中经济刺激政策的实施，经济出现了回暖，另外中国三中全会决议中对改革的承诺，坚定了全球投资人对中国新一届领导人的信心和中国经济在未来持续发展的信心，所以下半年中国市场表现相对较好。新兴市场的其它主要国家，如印度、巴西和俄罗斯也都面临经济增速下降问题，三个国家的经济先行指标在 50 分位波动，GDP 增长也处于近十年的较低位置，而通货膨胀均较高，例如印度超过 10%，巴西和俄罗斯超过 5%，新兴市场主要国家在经历了多年的高增长后面临经济转型的挑战，我们预计经济转型需要较长时间，市场可能继续呈现震荡走势。

#### 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-7.82%，波动率 0.84%，业绩比较基准收益率-5.36%，波动率 0.90%。

#### 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，我们认为新兴市场将延续震荡行情。目前新兴市场整体估值水平处于历史较低水平，市场 2014 年“自下而上”的平均盈利预测仍然有双位数的增长，某些与“新经济”相关的高成长、低杠杆公司呈现出较好的投资价值，我们认为市场仍然有一定的支持力量。目前市场的最大不确定性来自未来经济的发展方向。例如中国当前较高的社会资金成本是否会造成经济增长的减速，印度、巴西的高通胀是否会触发宏观经济政策的紧缩等，我们认为新兴市场的长期增长前景仍然值得期待，许多国家已经认识到过去十年的增长动力正在逐渐减弱，而新的增长引擎需要制度改革的配合。我们看到，十八大三中全会通过深化改革决议后，大大增强了全球投资者对中国市场进行长期战略配置的信心。在经济转型的过程中，我们认为市场更多的是结构性的机会，与消费、高科技、环保等相关的产业链可能继续受到投资者青睐，我们将继续加强对行业、个股的研究，在控制风险的前提下为投资人创造超额收益。

#### 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。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）。

#### 4.9 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。

## § 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新兴市场优选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，建信新兴市场优选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新兴市场优选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对建信基金管理有限公司编制和披露的建信新兴市场优选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 20236 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	建信新兴市场优选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新兴市场优选股票型证券投资基金（以下简称“建信新兴市场股票基金”）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新兴市场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：

	<p>(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;</p> <p>(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。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</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	<p>我们认为, 上述建信新兴市场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, 公允反映了建信新兴市场股票基金 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。</p>
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：建信新兴市场优选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	5, 501, 866. 15	9, 233, 094. 22

结算备付金		-	13,636.36
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	82,238,150.17	120,126,755.47
其中：股票投资		79,830,219.29	118,370,555.34
基金投资		2,407,930.88	1,756,200.13
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		-	243,436.14
应收利息	7.4.7.5	343.70	900.35
应收股利		31,104.28	104,053.07
应收申购款		4,822.89	13,779.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	7,536.01	258,391.44
资产总计		87,783,823.20	129,994,046.76
<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	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		403,382.59	718,249.83
应付管理人报酬		137,806.59	194,130.13
应付托管费		26,795.76	37,747.56
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	339,039.24	593,421.87
负债合计		907,024.18	1,543,549.39
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	95,646,248.95	130,406,284.31
未分配利润	7.4.7.10	-8,769,449.93	-1,955,786.94
所有者权益合计		86,876,799.02	128,450,497.37
负债和所有者权益总计		87,783,823.20	129,994,046.76

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.908 元，基金份额总额 95,646,248.95 份。

## 7.2 利润表

会计主体：建信新兴市场优选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
<b>一、收入</b>		-5,784,764.31	24,657,493.53
1. 利息收入		28,268.02	54,890.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	28,268.02	46,899.99
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		-	7,990.16
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,581,613.59	4,754,067.60
其中：股票投资收益	7.4.7.12	216,292.39	1,324,935.29
基金投资收益	7.4.7.13	-29,960.20	-
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	28,356.56	72,514.11
股利收益	7.4.7.16	2,366,924.84	3,356,618.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-7,903,419.62	19,915,725.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-507,517.74	-103,185.56
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	16,291.44	35,995.96
<b>减：二、费用</b>		3,153,148.01	3,881,711.85
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,836,401.75	2,454,300.25
2. 托管费	7.4.10.2.2	357,078.20	477,225.14
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	567,453.91	555,401.81
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	392,214.15	394,784.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-8,937,912.32	20,775,781.68
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-8,937,912.32	20,775,781.68

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信新兴市场优选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）	130,406,284.31	-1,955,786.94	128,450,497.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-8,937,912.32	-8,937,912.32
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）	-34,760,035.36	2,124,249.33	-32,635,786.03
其中：1. 基金申购款	1,721,066.60	-138,884.67	1,582,181.93
2. 基金赎回款	-36,481,101.96	2,263,134.00	-34,217,967.96
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）	95,646,248.95	-8,769,449.93	86,876,799.02
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）	164,824,064.58	-24,961,743.76	139,862,320.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	20,775,781.68	20,775,781.68
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）	-34,417,780.27	2,230,175.14	-32,187,605.13
其中：1. 基金申购款	3,315,146.59	-185,862.39	3,129,284.20
2. 基金赎回款	-37,732,926.86	2,416,037.53	-35,316,889.33
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）	130,406,284.31	-1,955,786.94	128,450,497.37

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	_____ 何斌	_____ 秦绪华
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

建信新兴市场优选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[2011]第 316 号《关于核准建信新兴市场优选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《建信新兴市场优选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 426,628,617.18 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(2011)第 258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 426,647,075.13 份基金份额,其中认购资金利息折合 18,457.95 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(Principal Global Investors, LLC.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为新兴市场经济体证券市场及其他证券市场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投资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%。本基金不低于 80%的股票资产投资于注册地或主要经济活动在新兴市场国家或地区的公司或组织发行的证券，“主要经济活动在新兴市场国家或地区”指主营业务收入的至少 50%来自于新兴市场国家或地区；“新兴市场国家或地区”指本基金业绩比较基准指数包含的国家或地区。本基金的业绩比较基准为摩根士丹利资本国际新兴市场指数 (MSCI Emerging Markets Index (Net Total Return))。

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》、《建信新兴市场优选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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以

衍生金融资产列示外，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 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则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内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	5,501,866.15	9,233,094.22
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	5,501,866.15	9,233,094.22

### 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		74,694,592.28	79,830,219.29	5,135,627.01
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		2,183,405.56	2,407,930.88	224,525.32
其他		-	-	-
合计		76,877,997.84	82,238,150.17	5,360,152.33
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		105,351,774.46	118,370,555.34	13,018,780.88
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		1,511,409.06	1,756,200.13	244,791.07
其他		-	-	-
合计		106,863,183.52	120,126,755.47	13,263,571.95

#### 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

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。

#### 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	343.70	893.64
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	-	6.71
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	343.70	900.35

#### 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	7,536.01	258,391.44
合计	7,536.01	258,391.44

#### 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	47.58	1,667.79
预提费用	331,450.54	331,452.05
应付未起息外汇交易	7,541.12	260,302.03
合计	339,039.24	593,421.87

#### 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	130,406,284.31	130,406,284.31
本期申购	1,721,066.60	1,721,066.60
本期赎回（以“-”号填列）	-36,481,101.96	-36,481,101.96
- 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	95,646,248.95	95,646,248.95
-----	---------------	---------------

#### 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	-13,894,246.87	11,938,459.93	-1,955,786.94
本期利润	-1,034,492.70	-7,903,419.62	-8,937,912.32
本期基金份额交易产生的变动数	3,535,743.66	-1,411,494.33	2,124,249.33
其中：基金申购款	-167,939.67	29,055.00	-138,884.67
基金赎回款	3,703,683.33	-1,440,549.33	2,263,134.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,392,995.91	2,623,545.98	-8,769,449.93

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	28,264.01	46,352.84
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	3.72	546.84
其他	0.29	0.31
合计	28,268.02	46,899.99

#### 7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	129,417,417.16	117,687,016.76
减：卖出股票成本总额	129,201,124.77	116,362,081.47
买卖股票差价收入	216,292.39	1,324,935.29

#### 7.4.7.13 基金投资收益

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
卖出/赎回基金成交总额	11,435,207.77	-
减：卖出/赎回基金成本总额	11,465,167.97	-
基金投资收益	-29,960.20	-

#### 7.4.7.14 债券投资收益

无。

##### 7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	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
卖出权证成交总额	28,356.56	72,514.11
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	28,356.56	72,514.11

#### 7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	2,329,209.83	3,330,016.65
基金投资产生的股利收益	37,715.01	26,601.55
合计	2,366,924.84	3,356,618.20

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-7,903,419.62	19,915,725.38
——股票投资	-7,883,153.87	19,665,578.93
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-

——基金投资	-20,265.75	250,146.45
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-7,903,419.62	19,915,725.38

#### 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	16,291.44	35,995.96
合计	16,291.44	35,995.96

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	567,453.91	555,401.81
银行间市场交易费用	-	-
合计	567,453.91	555,401.81

#### 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	299,998.49	300,436.50
银行划款手续费	4,252.77	4,373.58
债券托管账户维护费	-	12,000.00
其他	15,962.89	5,974.57
合计	392,214.15	394,784.65

### 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

本基金本报告期及上年度可比期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

#### 7.4.10.2 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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,836,401.75	2,454,300.25
其中：支付销售机构的客户维护费	510,596.71	883,317.26

注：1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 1.8%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的管理人报酬，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人建信基金管理有限责任公司。其计算公式为：  
日管理人报酬=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 X 1.8%/ 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支

的费用项目。

#### 7.4.10.2.2 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	357,078.20	477,225.14

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 0.35%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的托管费，逐日累计至每月月底，按月支付给基金托管人中国工商银行。其计算公式为：

日托管费=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 X 0.35% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2011 年 6 月 21 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	9,999,138.89	9,999,138.89
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,138.89	9,999,138.89
期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.45%	7.67%

注：本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司在**认购期间**认购本基金的交易委托中国建设银行办理，认购费为 1,000 元。

##### 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 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	2,582,954.24	26,837.45	4,851,470.54	44,606.34
布朗兄弟哈里曼银行	2,918,911.91	1,426.56	4,381,623.68	1,746.50

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**

本基金本报告期未进行利润分配。

**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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

**7.4.12.2 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
KR7010520005	HYUNDAI HYSCO	2013年12月27日	公司分立	241.02	2014年1月24日	212.99	1,360	340,489.33	327,785.33	-

注：1、该股票为韩国上市交易股票，期末估值单价和复牌开盘单价为韩元折算为人民币的金额，折算采用当日汇率。

2、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。

### 7.4.12.3 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

截止本报告期末，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 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，将风险控制可在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制上述风  
险，追求基金资产长期稳定增值。

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 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 7.4.13.4.1.1 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。

#### 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。

##### 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	5,501,866.15	-	-	-	5,501,866.15
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-

交易性金融资产				82,238,150.17	82,238,150.17
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				343.70	343.70
应收股利				31,104.28	31,104.28
应收申购款				4,822.89	4,822.89
其他资产				7,536.01	7,536.01
资产总计	5,501,866.15			82,281,957.05	87,783,823.20
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				403,382.59	403,382.59
应付管理人报酬				137,806.59	137,806.59
应付托管费				26,795.76	26,795.76
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				339,039.24	339,039.24
负债总计				907,024.18	907,024.18
利率敏感度缺口	5,501,866.15			81,374,932.87	86,876,799.02
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	9,233,094.22				9,233,094.22
结算备付金	13,636.36				13,636.36
存出保证金					
交易性金融资产				120,126,755.47	120,126,755.47
衍生金融资产					
买入返售金融资产					
应收证券清算款				243,436.14	243,436.14
应收利息				900.35	900.35
应收股利				104,053.07	104,053.07
应收申购款				13,779.71	13,779.71
其他资产				258,391.44	258,391.44
资产总计	9,246,730.58			120,747,316.18	129,994,046.76

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	-	-	-	718,249.83	718,249.83
应付管理人报酬	-	-	-	194,130.13	194,130.13
应付托管费	-	-	-	37,747.56	37,747.56
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	-	-	-	593,421.87	593,421.87
负债总计	-	-	-	1,543,549.39	1,543,549.39
利率敏感度缺口	9,246,730.58	-	-	-119,203,766.79	128,450,497.37

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	4,734,852.06	1.11	49,353.17	4,784,206.34
交易性金融资产	37,435,402.98	15,286,450.85	29,516,296.34	82,238,150.17
应收股利	13,240.21	1,597.62	12,746.45	27,584.28
应收利息	28.17	-	-	28.17
其它资产	7,536.01	-	-	7,536.01

资产合计	42,191,059.43	15,288,049.58	29,578,395.96	87,057,504.97
以外币计价的负债				
其它负债	-	-	7,541.12	7,541.12
负债合计	-	-	7,541.12	7,541.12
资产负债表外汇风险敞口净额	42,191,059.43	15,288,049.58	29,570,854.84	87,049,963.85
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	4,376,572.28	0.50	42,175.14	4,418,747.92
交易性金融资产	39,805,431.56	26,326,184.00	53,995,139.91	120,126,755.47
应收股利	48,044.29	-	56,008.78	104,053.07
应收利息	18.98	-	-	18.98
应收证券清算款	-	-	243,436.14	243,436.14
其它资产	258,391.44	-	-	258,391.44
资产合计	44,488,458.55	26,326,184.50	54,336,759.97	125,151,403.02
以外币计价的负债				
其它负债	-	-	260,302.03	260,302.03
负债合计	-	-	260,302.03	260,302.03
资产负债表外汇风险敞口净额	44,488,458.55	26,326,184.50	54,076,457.94	124,891,100.99

#### 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%	-4,352,498.19	-6,244,555.05
	所有外币相对人民币升值5%	4,352,498.19	6,244,555.05

#### 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投资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 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	79,830,219.29	91.89	118,370,555.34	92.15
交易性金融资产—基金投资	2,407,930.88	2.77	1,756,200.13	1.37
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	82,238,150.17	94.66	120,126,755.47	93.52

#### 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%	3,779,140.76	5,861,196.77
业绩比较基准下降 5%	-3,779,140.76	-5,861,196.77	

#### 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 81,910,364.84 元, 属于第二层级的余额为 327,785.33 元, 无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日: 第一层级 120,126,755.47 元, 无第二层级和第三层级)。

(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, 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	79,830,219.29	90.94
	其中: 普通股	52,742,890.40	60.08
	存托凭证	26,007,388.80	29.63
	优先股	1,079,940.09	1.23
	房地产信托凭证	-	-

2	基金投资	2,407,930.88	2.74
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	5,501,866.15	6.27
8	其他各项资产	43,806.88	0.05
9	合计	87,783,823.20	100.00

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	28,355,369.17	32.64
中国香港	15,149,709.73	17.44
韩国	12,286,428.41	14.14
英国	6,808,844.05	7.84
南非	5,784,390.39	6.66
巴西	3,544,666.31	4.08
马来西亚	3,437,629.16	3.96
墨西哥	1,678,086.15	1.93
泰国	1,573,738.67	1.81
波兰	837,345.42	0.96
印尼	374,011.83	0.43
合计	79,830,219.29	91.89

## 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	8,485,720.06	9.77
必需消费品	3,740,983.81	4.31
能源	10,931,655.48	12.58
金融	17,085,096.66	19.67
医疗保健	2,620,649.51	3.02

工业	3,496,620.25	4.02
信息技术	18,524,125.06	21.32
材料	8,766,201.48	10.09
电信服务	4,631,022.24	5.33
公用事业	1,548,144.74	1.78
合计	79,830,219.29	91.89

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	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	台积电	US8740391003	纽约证券交易所	美国	36,992	3,933,356.99	4.53
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	三星电子有限公司	KR7005930003	韩国证券交易所	韩国	423	3,370,520.57	3.88
3	HON HAI PRECISION-GDR REG S	鸿海	US4380902019	伦敦国际交易所	英国	79,470	2,577,649.82	2.97
4	CNOOC LTD	中国海洋石油	HK0883013259	香港证券交易所	中国香港	184,000	2,086,088.33	2.40
5	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	CNE1000001Z5	香港证券交易所	中国香港	741,000	2,079,869.26	2.39
6	GAZPROM OAO-SPON ADR	俄罗斯天然气工业公司	US3682872078	美国OTC市场	美国	32,571	1,717,735.42	1.98
7	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	KYG875721485	香港证券交易所	中国香港	4,300	1,672,138.24	1.92
8	TENAGA NASIONAL BHD	马来西亚国家	MYL534700009	马来西亚	马来西亚	73,100	1,548,144.74	1.78

		能源有限公司		证券交易所				
9	NASPERS LTD-N SHS	纳斯派斯有限公司	ZAE000015889	南非证券交易所	南非	2,323	1,482,168.39	1.71
10	SBERBANK-SPONSORED ADR	俄罗斯联邦储蓄银行	US80585Y3080	伦敦国际交易所	英国	16,653	1,277,268.48	1.47
11	LUKOIL OAO-SPON ADR	卢克石油	US6778621044	美国 OTC 市场	美国	3,312	1,274,577.92	1.47
12	WIPRO LTD-ADR	-	US97651M1099	纽约证券交易所	美国	15,434	1,184,713.39	1.36
13	CHINA MOBILE LTD	中国移动	HK0941009539	香港证券交易所	中国香港	18,500	1,169,438.50	1.35
14	MTN GROUP LTD	-	ZAE000042164	南非证券交易所	南非	9,014	1,138,809.64	1.31
15	VALE SA-SP ADR	淡水河谷公司	US91912E1055	纽约证券交易所	美国	12,031	1,118,615.01	1.29
16	AU OPTRONICS CORP-SPON ADR	友达光电	US0022551073	纽约证券交易所	美国	56,835	1,081,134.01	1.24
17	SASOL LTD	沙索有限公司	ZAE000006896	南非证券交易所	南非	3,298	987,801.89	1.14
18	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	长城汽车	CNE100000338	香港证券交易所	中国香港	28,500	959,043.35	1.10
19	HYUNDAI MOTOR CO	现代汽车公司	KR7005380001	韩国证券交易所	韩国	659	905,146.89	1.04

				所				
20	AMBEV SA-ADR	-	US02319V1035	纽约 证券 交易 所	美国	19,312	865,413.50	1.00
21	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	塔塔汽 车有限 公司	US8765685024	纽约 证券 交易 所	美国	4,597	863,245.44	0.99
22	MALAYAN BANKING BHD	马来西 亚银行 有限公 司	MYL115500000	马来 西亚 证券 交易 所	马来 西 亚	46,500	860,183.80	0.99
23	PETROLEO BRASILEIRO S. A. -ADR	巴西石 油公司	US71654V4086	纽约 证券 交易 所	美国	10,134	851,410.87	0.98
24	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	-	PLPZU0000011	波兰 证券 交易 所	波兰	923	837,345.42	0.96
25	SK HOLDINGS CO LTD	SK 控股 公司	KR7003600004	韩国 证券 交易 所	韩国	749	830,840.56	0.96
26	SK HYNIX INC	海力士 半导体 公司	KR7000660001	韩国 证券 交易 所	韩国	3,850	822,831.77	0.95
27	SK TELECOM	SK 电信 集团公 司	KR7017670001	韩国 证券 交易 所	韩国	593	792,109.16	0.91
28	POSCO-ADR	浦项制 铁公司	US6934831099	纽约 证券 交易 所	美国	1,601	761,368.68	0.88
29	HANA FINANCIAL GROUP	韩亚金 融集团 公司	KR7086790003	韩国 证券 交易 所	韩国	2,950	752,123.29	0.87
30	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国石 化	CNE1000002Q2	香港 证券 交易 所	中国香 港	150,000	746,525.39	0.86

				所				
31	SANLAM LTD	桑勒姆有限公司	ZAE000070660	南非证券交易所	南非	23,144	717,315.62	0.83
32	MONDI LTD	蒙迪有限公司	ZAE000156550	南非证券交易所	南非	6,806	711,989.92	0.82
33	INFOSYS LTD-SP ADR	-	US4567881085	纽约证券交易所	美国	2,060	710,874.15	0.82
34	MAGNIT OJSC-SPON GDR REGS	-	US55953Q2021	伦敦国际交易所	英国	1,748	705,518.64	0.81
35	HYUNDAI MOBIS CO LTD	现代精工	KR7012330007	韩国证券交易所	韩国	413	703,980.55	0.81
36	BANCO DO BRASIL S. A.	巴西银行股份有限公司	BRBBASACN0R3	巴西证券交易所	巴西	11,100	699,074.72	0.80
37	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	-	BRITUBACNPR1	巴西证券交易所	巴西	8,480	686,189.69	0.79
38	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	碧桂园	KYG245241032	香港证券交易所	中国香港	183,000	673,358.82	0.78
39	MAIL.RU GROUP-GDR REGS	-	US5603172082	伦敦国际交易所	英国	2,475	673,006.31	0.77
40	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中国电信	CNE1000002V2	香港证券交易所	中国香港	210,000	647,224.54	0.74
41	LG CHEM LTD	LG 化学有限公司	KR7051910008	韩国证券交易所	韩国	364	633,141.40	0.73

42	PETROCHINA CO LTD-H	中国石 油	CNE1000003W8	香港 证券 交易 所	中国香 港	94,000	628,197.77	0.72
43	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	中国铁 建	CNE100000981	香港 证券 交易 所	中国香 港	101,000	613,039.26	0.71
44	CHINA MERCHANTS BANK-H	招商银 行	CNE1000002M1	香港 证券 交易 所	中国香 港	47,070	611,369.62	0.70
45	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	农业银 行	CNE100000Q43	香港 证券 交易 所	中国香 港	199,000	596,111.72	0.69
46	ICICI BANK LTD-SPON ADR	ICICI 银行有 限公司	US45104G1040	纽约 证券 交易 所	美国	2,489	564,061.59	0.65
47	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-FOR	PTT 全 球化工 股份有 限公司	TH1074010014	泰国 证券 交易 所	泰国	36,600	538,918.92	0.62
48	WUXI PHARMATECH CAYMAN-ADR	药明康 德新药 开发有 限公司	US9293521020	纽约 证券 交易 所	美国	2,286	534,921.76	0.62
49	SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	搜房资 讯控股 有限公 司	US8360341080	纽约 证券 交易 所	美国	1,033	519,026.23	0.60
50	KROTON EDUCACIONAL SA	-	BRKROTACN0R9	巴西 证券 交易 所	巴西	4,800	486,409.81	0.56
51	US BANCORP	美国合 众银行	US9029733048	纽约 证券 交易 所	美国	1,955	481,545.36	0.55
52	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	盘谷银 行	TH0001010014	泰国 证券 交易 所	泰国	14,000	464,476.01	0.53
53	DISCOVER FINANCIAL	-	US2547091080	纽约	美国	1,358	463,243.07	0.53

	SERVICES			证券交易所				
54	ROSNEFT OJSC-REG S GDR	俄罗斯石油公司	US67812M2070	伦敦国际交易所	英国	9,856	457,593.32	0.53
55	AMMB HOLDINGS BHD	AMMB 控股有限公司	MYL101500006	马来西亚证券交易所	马来西亚	33,900	456,762.23	0.53
56	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	US20030N1019	纳斯达克证券交易所	美国	1,424	451,159.38	0.52
57	ALFA S. A. B. -A	阿尔法可变动资本股份公司	MXP000511016	墨西哥证券交易所	墨西哥	26,100	444,934.51	0.51
58	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	新韩金融集团	KR7055550008	韩国证券交易所	韩国	1,610	442,272.08	0.51
59	HDFC BANK LTD-ADR	HDFC 银行有限公司	US40415F1012	纽约证券交易所	美国	2,092	439,272.38	0.51
60	CIA SIDERURGICA NACL-SP ADR	-	US20440W1053	纽约证券交易所	美国	11,582	437,808.63	0.50
61	GRUPO TELEVISA SA-SPON ADR	墨西哥电视集团股份公司	US40049J2069	纽约证券交易所	美国	2,350	433,556.66	0.50
62	TYSON FOODS INC-CLASS A	泰森食品公司	US9024941034	纽约证券交易所	美国	2,120	432,484.82	0.50
63	JBS SA	JBS 股份公司	BRJBSSACN0R8	巴西证券交易所	巴西	18,500	418,776.32	0.48

64	FIRSTRAND LTD	第一兰特有限公司	ZAE000066304	南非证券交易所	南非	19,785	413,374.17	0.48
65	ABBVIE INC	-	US00287Y1091	纽约证券交易所	美国	1,282	412,774.88	0.48
66	WELLS FARGO & CO	富国银行	US9497461015	纽约证券交易所	美国	1,489	412,154.10	0.47
67	COMPARTAMOS SAB DE CV	-	MX01C00P0009	墨西哥证券交易所	墨西哥	34,921	403,645.98	0.46
68	MICROSOFT CORP	微软	US5949181045	纳斯达克证券交易所	美国	1,766	403,013.50	0.46
69	MEGAFON-GDR	-	US58517T2096	伦敦国际交易所	英国	1,961	400,526.70	0.46
70	TATA STEEL LTD-GDR REG S	塔塔钢铁有限公司	US87656Y4061	伦敦国际交易所	英国	9,499	399,609.73	0.46
71	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	吉利汽车	KYG3777B1032	香港证券交易所	中国香港	135,000	398,028.94	0.46
72	E-MART CO LTD	易买得有限公司	KR7139480008	韩国证券交易所	韩国	256	396,223.00	0.46
73	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	-	BRUGPAACNOR8	巴西证券交易所	巴西	2,700	389,919.22	0.45
74	KIA MOTORS CORPORATION	起亚汽车公司	KR7000270009	韩国证券交易所	韩国	1,128	367,514.49	0.42

75	MCKESSON CORP	-	US58155Q1031	纽约 证券 交易 所	美国	362	356,222.36	0.41
76	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	大林工 程有限 公司	KR7000210005	韩国 证券 交易 所	韩国	640	349,761.58	0.40
77	FIFTH THIRD BANCORP	五三银 行	US3167731005	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,721	348,880.65	0.40
78	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	-	MX01PI000005	墨西 哥证 券交 易所	墨西哥	4,800	348,625.18	0.40
79	OMNICARE INC	-	US6819041087	纽约 证券 交易 所	美国	943	347,032.38	0.40
80	AMGEN INC	安进	US0311621009	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	494	343,834.92	0.40
81	PICC PROPERTY & CASUALTY -H	中国财 险	CNE100000593	香港 证券 交易 所	中国香 港	38,000	343,582.51	0.40
82	CHINA OILFIELD SERVICES-H	中海油 服	CNE1000002P4	香港 证券 交易 所	中国香 港	18,000	340,358.97	0.39
83	MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	-	ZAE000074142	南非 证券 交易 所	南非	7,525	332,930.76	0.38
84	SEAGATE TECHNOLOGY	希捷科 技公司	IE00B58JVZ52	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	966	330,760.24	0.38
85	HYUNDAI HYSKO	现代海 斯克	KR7010520005	韩国 证券	韩国	1,360	327,785.33	0.38

				交易所				
86	GERDAU SA -SPON ADR	-	US3737371050	纽约证券交易所	美国	6,752	322,743.55	0.37
87	HYUNDAI WIA CORP	现代威亚公司	KR7011210002	韩国证券交易所	韩国	292	322,209.96	0.37
88	TERNIUM SA-SPONSORED ADR	特尔尼翁钢铁公司	US8808901081	纽约证券交易所	美国	1,682	320,981.06	0.37
89	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	诺里尔斯克镍业公司	US46626D1081	伦敦国际交易所	英国	3,135	317,671.05	0.37
90	HYUNDAI STEEL CO	现代制铁株式会社	KR7004020004	韩国证券交易所	韩国	623	312,249.21	0.36
91	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据公司	US9581021055	纳斯达克证券交易所	美国	602	307,941.01	0.35
92	HESS CORP	阿美拉达赫斯	US42809H1077	纽约证券交易所	美国	608	307,673.96	0.35
93	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	CNE1000003X6	香港证券交易所	中国香港	5,500	300,320.20	0.35
94	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	PTT 勘探与生产股份公司	TH0355A10Z12	泰国证券交易所	泰国	9,600	297,920.73	0.34
95	TAL EDUCATION GROUP- ADR	学而思教育集团	US8740801043	纽约证券交易所	美国	2,216	297,100.96	0.34
96	LOWES COS INC	劳氏	US5486611073	纽约证券交易所	美国	983	296,965.67	0.34

				交易所				
97	TELEKOM MALAYSIA BHD	马亚西亚电信有限公司	MYL486300006	马来西亚证券交易所	马来西亚	28,500	294,367.44	0.34
98	DOCTOR REDDYS LAB-ADR	-	US2561352038	纽约证券交易所	美国	1,171	292,932.45	0.34
99	GRUMA S. A. B. -B	-	MXP4948K1056	墨西哥证券交易所	墨西哥	6,300	289,698.88	0.33
100	HYOSUNG CORPORATION	晓星株式会社	KR7004800009	韩国证券交易所	韩国	692	282,529.58	0.33
101	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	马来西亚国油化学集团公司	MYL518300008	马来西亚证券交易所	马来西亚	21,600	278,170.95	0.32
102	PORTO SEGURO SA	-	BRPSSAACNOR7	巴西证券交易所	巴西	3,600	276,439.60	0.32
103	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	大宇造船海事工程公司	KR7042660001	韩国证券交易所	韩国	1,350	274,412.77	0.32
104	KROGER CO	克罗格公司	US5010441013	纽约证券交易所	美国	1,134	273,305.86	0.31
105	SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	暹罗水泥股份有限公司	TH0003010Z12	泰国证券交易所	泰国	3,600	272,423.01	0.31
106	CA INC	冠群国际	US12673P1057	纳斯达克证券交易所	美国	1,266	259,733.43	0.30

107	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	US46625H1005	纽约证券交易所	美国	712	253,861.26	0.29
108	BANCO BRADESCO SA-PREF	巴西布拉德斯科银行股份有限公司	BRBBDACNPR8	巴西证券交易所	巴西	3,370	253,037.22	0.29
109	SESA GOA LTD ADR	-	US78413F1030	纽约证券交易所	美国	3,135	251,537.36	0.29
110	YAHOO! INC	雅虎	US9843321061	纳斯达克证券交易所	美国	988	243,599.93	0.28
111	SOUTHERN COPPER CORP	南方铜业公司	US84265V1052	纽约证券交易所	美国	1,382	241,908.04	0.28
112	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	BMG653181005	香港证券交易所	中国香港	44,000	233,510.31	0.27
113	TYCO INTERNATIONAL LTD	泰科国际	CH0100383485	纽约证券交易所	美国	933	233,452.25	0.27
114	LYONDELLBASELL INDU-CL A	利安德巴塞尔工业公司	NL0009434992	纽约证券交易所	美国	472	231,024.71	0.27
115	ALLSTATE CORP	全州保险	US0200021014	纽约证券交易所	美国	679	225,784.42	0.26
116	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建材	CNE1000002N9	香港证券交易所	中国香港	34,000	222,943.38	0.26
117	CHEVRON CORP	雪佛龙德士古	US1667641005	纽约证券交易所	美国	289	220,091.93	0.25

				所				
118	ANGANG STEEL CO LTD-H	鞍钢国际	CNE1000001V4	香港证券交易所	中国香港	48,000	217,376.87	0.25
119	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	哥伦比亚国家石油公司	US2791581091	纽约证券交易所	美国	926	217,078.30	0.25
120	MARATHON OIL CORP	马拉松石油	US5658491064	纽约证券交易所	美国	997	214,574.91	0.25
121	KCC CORP	金钢化工集团	KR7002380004	韩国证券交易所	韩国	78	212,229.96	0.24
122	PROTECTIVE LIFE CORP	-	US7436741034	纽约证券交易所	美国	668	206,324.46	0.24
123	CIA BRASILEIRA DE DIS-SP PRF	-	US20440T2015	纽约证券交易所	美国	753	205,078.44	0.24
124	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	印尼国家银行股份有限公司	ID1000096605	印度尼西亚证券交易所	印尼	100,000	197,869.98	0.23
125	SYNOPSIS INC	新思科技公司	US8716071076	纳斯达克证券交易所	美国	794	196,396.88	0.23
126	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育用品	KYG040111059	香港证券交易所	中国香港	26,000	196,243.01	0.23
127	SYMANTEC CORP	赛门铁克	US8715031089	纳斯达克证券交易所	美国	1,354	194,657.68	0.22
128	COSAN SA INDUSTRIA	-	BRCSANACN0R6	巴西	巴西	1,900	194,106.55	0.22

	COMERCIO			证券交易所				
129	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	墨西哥集团公司	MXP370841019	墨西哥证券交易所	墨西哥	9,500	191,181.60	0.22
130	CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	中海发展	CNE1000002S8	香港证券交易所	中国香港	40,000	189,324.18	0.22
131	LG UPLUS CORP	-	KR7032640005	韩国证券交易所	韩国	3,020	188,546.26	0.22
132	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	KYG9828G1082	香港证券交易所	中国香港	34,000	182,845.65	0.21
133	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	印尼人民银行股份公司	ID1000118201	印度尼西亚证券交易所	印尼	48,500	176,141.85	0.20
134	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	US38141G1040	纽约证券交易所	美国	159	171,837.10	0.20
135	WAL-MART STORES INC	沃尔玛百货	US9311421039	纽约证券交易所	美国	322	154,484.35	0.18
136	SUZANO PAPEL E CELULO-PREF A	-	BRSUZBACNPA3	巴西证券交易所	巴西	5,900	140,713.18	0.16
137	GAP INC/THE	-	US3647601083	纽约证券交易所	美国	588	140,100.91	0.16
138	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	信义光能	KYG9829N1025	香港证券交易所	中国香港	34,000	42,770.91	0.05

注：所用证券代码采用 ISIN 代码。

## 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 PETROLEUM & CHEMICAL-H	CNE1000002Q2	2,290,441.70	1.78
2	INFOSYS LTD-SP ADR	US4567881085	1,795,165.36	1.40
3	BANK OF CHINA LTD-H	CNE1000001Z5	1,629,593.14	1.27
4	MALAYAN BANKING BHD	MYL115500000	1,596,153.87	1.24
5	CNOOC LTD	HK0883013259	1,380,220.48	1.07
6	BANCO BRADESCO SA-PREF	BRBBDACACNPR8	1,376,709.03	1.07
7	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	TH0001010014	1,367,429.57	1.06
8	BANCO DO BRASIL S. A.	BRBBASACNOR3	1,364,730.38	1.06
9	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	CNE1000003X6	1,306,069.94	1.02
10	KROTON EDUCACIONAL SA	BRKROTACNOR9	1,303,890.28	1.02
11	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	CNE100000X44	1,290,866.42	1.00
12	TENCENT HOLDINGS LTD	KYG875721485	1,271,300.99	0.99
13	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	US8765685024	1,168,193.31	0.91
14	JBS SA	BRJBSSACNOR8	1,099,322.84	0.86
15	MTN GROUP LTD	ZAE000042164	1,093,635.60	0.85
16	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	PLPZU0000011	1,052,990.90	0.82
17	NASPERS LTD-N SHS	ZAE000015889	1,052,628.12	0.82
18	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	KYG245241032	1,047,449.67	0.82

19	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	TH0355A10Z12	1,041,152.12	0.81
20	WIPRO LTD-ADR	US97651M1099	1,023,091.95	0.80

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

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	KR7005930003	3,223,711.19	2.51
2	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	CNE100000338	3,125,879.11	2.43
3	ICICI BANK LTD-SPON ADR	US45104G1040	2,608,940.90	2.03
4	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	ID1000129000	2,406,364.87	1.87
5	KRUNG THAI BANK PUB CO-FOREI	TH0150010Z11	1,871,152.52	1.46
6	PICC PROPERTY & CASUALTY -H	CNE100000593	1,794,608.66	1.40
7	JBS SA	BRJBSSACNOR8	1,745,906.31	1.36
8	AMBEV SA-ADR	US02319V1035	1,727,309.62	1.34
9	CHINA EVERBRIGHT LTD	HK0165000859	1,691,864.31	1.32
10	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	US8740391003	1,680,683.75	1.31
11	INFOSYS LTD-SP ADR	US4567881085	1,629,273.64	1.27
12	NEDBANK GROUP LTD	ZAE000004875	1,537,389.92	1.20
13	PETROCHINA CO LTD-H	CNE1000003W8	1,523,542.59	1.19
14	KIA MOTORS CORPORATION	KR7000270009	1,503,399.69	1.17
15	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	CNE1000002F5	1,502,783.42	1.17
16	FIRSTRAND LTD	ZAE000066304	1,435,692.69	1.12
17	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	US8765685024	1,424,763.51	1.11
18	SBERBANK-SPONSORED ADR	US80585Y3080	1,363,792.62	1.06

19	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	KR7010140002	1,352,186.51	1.05
20	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	MXP370711014	1,342,352.54	1.05

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	98,543,942.59
卖出收入（成交）总额	129,417,417.16

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

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	INDUSTRIAL SELECT SECT SPDR	ETF	交易型开放式指数	State Street Bank and Trust Company	1,051,459.18	1.21
2	ISHARES MSCI EMERGING	ETF	交易型开放式指数	BlackRock Fund Advisors	713,069.04	0.82

	MARKET						
3	SPDR S&P 500 ETF TRUST	ETF	交易型开 放式指数	State Street Bank and Trust Company	506,661.54	0.58	
4	HANG SENG H-SHARE INDEX ETF	ETF	交易型开 放式指数	Hang Heng Investment Management Ltd	136,741.12	0.16	

### 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	-
3	应收股利	31,104.28
4	应收利息	343.70
5	应收申购款	4,822.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	7,536.01
9	合计	43,806.88

#### 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
5,100	18,754.17	11,485,770.41	12.01%	84,160,478.54	87.99%

## 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	395,601.51	0.41%

注：公司高级管理人员持有该只基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份(含)；基金投资和研究部门负责人未持有该只基金；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（2011 年 6 月 21 日）基金份额总额	426,647,075.13
本报告期期初基金份额总额	130,406,284.31
本报告期基金总申购份额	1,721,066.60
减：本报告期基金总赎回份额	36,481,101.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	95,646,248.95

## § 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。

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	
BANK OF NEW YORK	-	5,147,548.22	2.28%	6,660.23	1.65%	-
BARCLAYS CAPITAL INC.	-	3,400,202.86	1.51%	7,298.78	1.81%	-
BLOOMBERG TRADEBOOK	-	591,359.93	0.26%	591.36	0.15%	-

BRADESCO SECURITIES	-	1,769,860.59	0.78%	3,098.25	0.77%	-
BTIG LLC	-	460,727.06	0.20%	645.92	0.16%	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC	-	198,963.45	0.09%	298.45	0.07%	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.	-	1,205,662.53	0.53%	2,411.33	0.60%	-
CIMB SECURITIES	-	1,502,090.81	0.67%	3,076.06	0.76%	-
CITIGROUP	-	28,836,624.43	12.77%	41,544.35	10.28%	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC	-	15,308,585.22	6.78%	21,220.51	5.25%	-
CREDIT SUISSE	-	13,285,763.01	5.88%	20,030.06	4.96%	-
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.	-	1,551,136.13	0.69%	3,326.97	0.82%	-
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.	-	7,764,335.49	3.44%	10,820.54	2.68%	-
GOLDMAN SACHS & CO. INC	-	9,619,242.47	4.26%	19,936.89	4.94%	-
HSBC ICN	-	1,101,684.17	0.49%	5,489.94	1.36%	-
HYUNDAI SECURITIES	-	200,292.89	0.09%	500.74	0.12%	-
ING BANK	-	4,626,443.96	2.05%	8,724.69	2.16%	-
INSTINET CORP.	-	2,892,247.40	1.28%	4,037.80	1.00%	-
INVESTEC BANK (UK) LIMITED	-	70,204.52	0.03%	175.51	0.04%	-
ITG	-	1,228,578.68	0.54%	1,228.63	0.30%	-
ITG-CSA	-	20,293,999.55	8.99%	39,977.57	9.90%	-
J. P. MORGAN	-	29,524,090.53	13.08%	45,546.43	11.27%	-
JEFFERIES & CO, INC	-	456,859.90	0.20%	2,390.24	0.59%	-
KINIGHT SECURITIES	-	640,926.28	0.28%	370.16	0.09%	-
KOREAN INVESTMENT	-	291,291.64	0.13%	728.15	0.18%	-

LIQUIDNET-CSA	-	42,499.15	0.02%	63.75	0.02%	-
MACQUARIE CAPITAL-EURO	-	51,371.42	0.02%	128.43	0.03%	-
MACQUARIE CAPITAL	-	9,617,001.39	4.26%	31,764.95	7.86%	-
MACQUARIE-ASIA ALGORITHMS	-	355,096.28	0.16%	248.43	0.06%	-
MERRILL LYNCH	-	22,570,554.38	10.00%	41,935.46	10.38%	-
MORGAN STANLEY	-	18,047,602.76	7.99%	38,655.57	9.57%	-
PENSERRA SECURITIES LLC	-	364,485.35	0.16%	364.48	0.09%	-
REDBURN PARTNERS LLP	-	38,215.33	0.02%	19.08	0.00%	-
SAMSUNG SECURITIES INC.	-	802,294.24	0.36%	2,005.38	0.50%	-
SANFORD BERNSTEIN	-	4,553,433.12	2.02%	5,348.28	1.32%	-
SBERBANK CIB(UK) LTD	-	792,445.21	0.35%	1,188.72	0.29%	-
SCOTIA CAPITAL MARKETS INC	-	327,047.45	0.14%	588.31	0.15%	-
STANDARD BANK PLC	-	800,543.24	0.35%	2,001.36	0.50%	-
UBS SECURITIES	-	13,003,876.74	5.76%	26,142.16	6.47%	-
VTB CAPITAL PLC	-	1,600,068.30	0.71%	2,523.97	0.62%	-
WELLS FARGO SECURITIES LLC	-	516,915.11	0.23%	155.98	0.04%	-
WESTMINSTER RESEARCH	-	341,180.76	0.15%	687.91	0.17%	-
WOORI_E SECURITIES	-	8,542.76	0.00%	21.31	0.01%	-
CREDIT AGRICOLE SEC	-	-	-	-	-	-
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.	-	-	-	-	-	-
RENAISSANCE CAPITAL	-	-	-	-	-	-
SANTANDER INVESTMENT	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：1、本基金管理人制定了服务券商的选择标准，具体如下：

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

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

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

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

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

（6）其他有利于基金份额持有人利益的商业合作考虑。

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

## 2、券商的服务评价

（1）海外投资部每半年组织“服务总结”及评分。

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

3、本报告期新增服务券商 BLOOMBERG TRADEBOOK、CANTOR FITZGERALD AND CO., INC、CIMB SECURITIES、HYUNDAI SECURITIES、INVESTEC BANK (UK) LIMITED、KINIGHT SECURITIES、PENSERRA SECURITIES LLC、REDBURN PARTNERS LLP、SANFORD BERNSTEIN、SBERBANK CIB(UK) LTD、SCOTIA CAPITAL MARKETS INC、STANDARD BANK PLC、WELLS FARGO SECURITIES LLC；本报告期无剔除的服务券商

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-	6,447,601.13	27.34%
BARCLAYS	-	-	-	-	-	-	826,804.00	3.51%

CAPITAL INC.									
BLOOMBERG TRADEBOOK									
BRADESCO SECURITIES							371,837.41	1.58%	
BTIG LLC									
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC									
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.									
CIMB SECURITIES									
CITIGROUP							371,177.68	1.57%	
CREDIT LYONNAIS SEC. INC									
CREDIT SUISSE									
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.									
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.									
GOLDMAN SACHS & CO. INC									
HSBC ICN									
HYUNDAI SECURITIES									
ING BANK									
INSTINET CORP.									
INVESTECH BANK (UK) LIMITED									
ITG									
ITG-CSA							1,419,011.32	6.02%	
J. P. MORGAN							954,709.82	4.05%	
JEFFERIES & CO, INC							6,996,438.42	29.67%	
KINIGHT									

SECURITIES									
KOREAN INVESTMENT									
LIQUIDNET-CSA									
MACQUARIE CAPITAL-EURO									
MACQUARIE CAPTIAL									
MACQUARIE-ASIA ALOGRITHMS									
MERRILL LYNCH									
MORGAN STANLEY									
PENSERRA SECURITIES LLC									
REDBURN PARTNERS LLP									
SAMSUNG SECURITIES INC.									
SANFORD BERNSTEIN									
SBERBANK CIB(UK) LTD									
SCOTIA CAPITAL MARKETS INC									
STANDARD BANK PLC									
UBS SECURITIES							6,191,390.75	26.26%	
VTB CAPITAL PLC									
WELLS FARGO SECURITIES LLC									
WESTMINSTER RESEARCH									
WOORI_E SECURITIES									
CREDIT AGRICOLE SEC									
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.									
RENAISSANCE CAPITAL									

SANTANDER INVESTMENT	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	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
4	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
5	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
6	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 年 6 月 22 日
7	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
8	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
9	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
10	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 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信新兴市场优选股票型证券投资基金设立的文件；

- 2、《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信新兴市场优选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信新兴市场优选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