

# 建信双利策略主题分级股票型 证券投资基金 2014 年半年度报告摘要

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 21 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	建信双利分级股票		
场内简称	建信双利		
基金主代码	165310		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 5 月 6 日		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	567,803,543.89 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2011-06-08		
下属分级基金的基金简称	建信双利	建信稳健	建信进取
下属分级基金的交易代码	165310	150036	150037
报告期末下属分级基金份额总额	559,967,981.89 份	3,134,224.00 份	4,701,338.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用主题策略筛选和个股精选相结合的方法筛选上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过自上而下的方式，通过对经济发展过程中制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘上述趋势得以产生和持续的内在驱动因素以及潜在的投资主题，在前述主题筛选和主题配置的基础上，本基金综合运用建信股票研究分析方法和其他投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+5\% \times$ 商业银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金属于采用高仓位操作的股票型基金，其风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金和普通股票型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高预期收益的品种。 从本基金所分离的两类基金份额来看，建信稳健份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其风险和预期收益要低于普通的股票型基金份额；建信进取份额则表现出高风险、高预期收益的显著特征，其风险和预期收益要高于普通的股票型基金份额。

## 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	张燕
	联系电话	010-66228888	0755-83199084
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95555
传真		010-66228001	0755-83195201

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	26,340,610.92
本期利润	-54,628,484.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0896
本期基金份额净值增长率	-9.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0318
期末基金资产净值	507,577,103.71
期末基金份额净值	0.894

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

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

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

所列数字。

## 3.2 基金净值表现

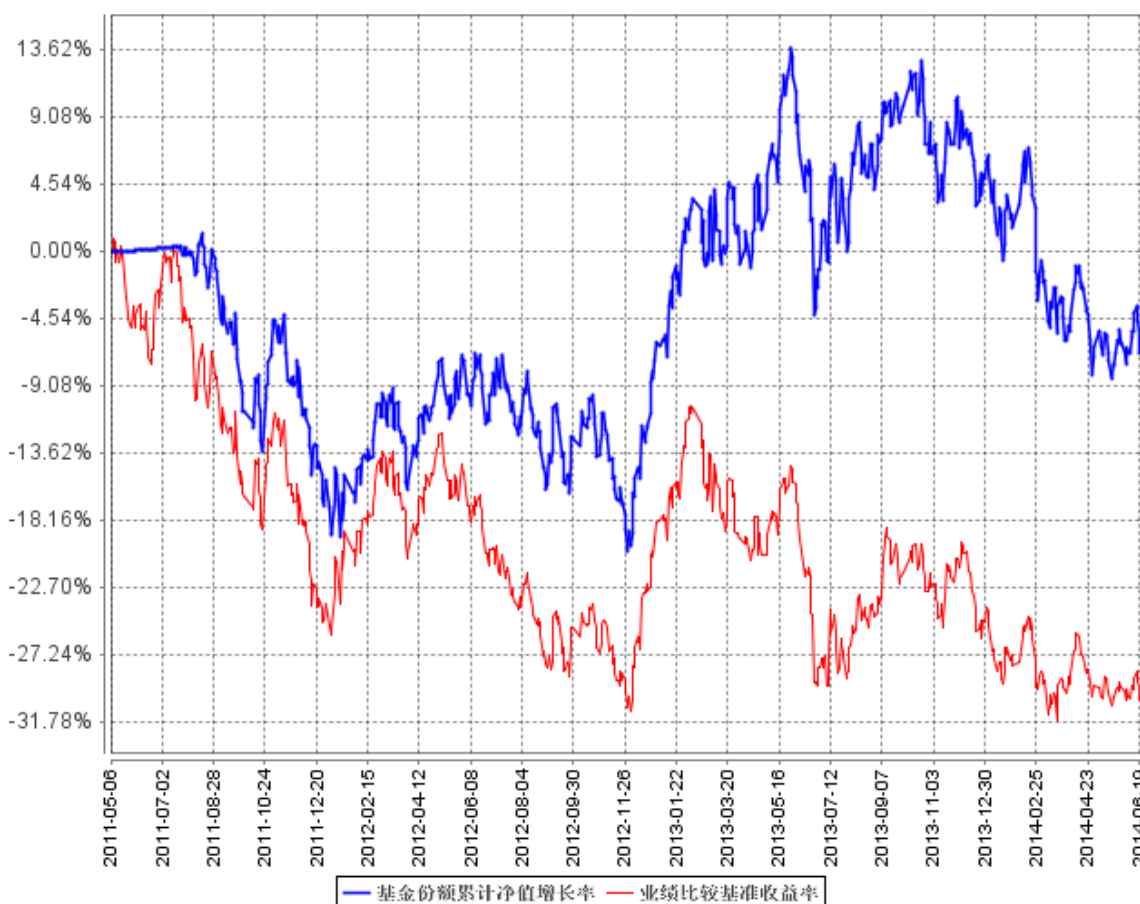
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.88%	0.86%	0.39%	0.74%	2.49%	0.12%
过去三个月	2.64%	0.91%	0.85%	0.83%	1.79%	0.08%
过去六个月	-9.06%	1.12%	-6.70%	0.99%	-2.36%	0.13%
过去一年	-2.28%	1.18%	-1.44%	1.11%	-0.84%	0.07%
过去三年	-3.67%	1.24%	-27.40%	1.23%	23.73%	0.01%
自基金合同生效起至今	-3.48%	1.21%	-29.20%	1.22%	25.72%	-0.01%

注：本基金投资业绩比较基准为： $95\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+5\% \times$  商业银行活期存款利率。其中：沪深 300 指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准，商业银行活期存款利率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准。沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，它是反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”。指数样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值。成份股为市场中市场代表性好，流动性高，交易活跃的主流投资股票，能够反映市场主流投资的收益情况。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

## § 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，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 2014 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）、建信创新中国股票型证券投资基金、建信改革红利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、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、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇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、建信全球资源股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、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、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财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、建信嘉薪宝货币市场基金和建信货币市场基金，共计 42 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 551.21 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		
马志强	本基金的基金经理	2011年8月2日	-	10	博士。曾就职于东北证券公司、北京高汇投资管理有限公司、北

					<p>京蓝巢投资有限公司，2004年11月起就职于天弘基金管理公司，2008年12月2日至2011年3月23日任天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理。2011年3月加入本公司，2011年8月2日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金经理；2013年11月13日起任建信优化配置基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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



### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 上半年上证 A 股指数呈现波动收窄的走势，指数大部分时间都在 100 个点的幅度内波动。而代表新兴成长股的创业板指数则先是年初开始大幅调整，二季度又大幅反弹。指数走势差异背后是个股走势的悬殊。总体看，小市值股票走势强于大市值。本组合在上半年减持了部分大市值的白马成长股，对地产、保险等低估值价值股进行了增持，对基本面反转的养殖行业及个股进行了增持。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率-9.06%，波动率 1.12%，业绩比较基准收益率-6.7%，波动率 0.99%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度开始，央行和银监会相继扩大了“定向宽松”的覆盖范围，一些地方政府也出台了稳增长措施。受此影响，统计局和汇丰 PMI 均继续改善，经济呈现温和复苏景象。预计三季度上半段“微刺激”会保持延续，流动性也保持适当宽松，市场活跃度有望维持重心上移的局面。三季度后期乃至四季度，随着通胀有所抬头，回收流动性的必要性则越来越强，市场的活跃度可能会逐渐降低。本组合将逐步加大对于低估值行业的配置，对于基本面率先触底的行业保持积极关注。

本基金属于高仓位、主动投资的股票型基金，将会通过吸收投研团队的研究成果，优化组合

配置并精选个股，力争给持有人带来超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中关于收益分配条款的规定，本基金不进行收益分配，也不单独对建信稳健份额与建信进取份额进行收益分配。

## § 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		34,229,548.72	44,090,517.73
结算备付金		1,037,646.42	1,044,539.28
存出保证金		160,335.82	226,547.56
交易性金融资产		475,661,147.12	630,971,497.66
其中：股票投资		475,661,147.12	630,971,497.66
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-

应收证券清算款		2,521,218.02	-
应收利息		7,143.50	10,173.84
应收股利		-	-
应收申购款		3,448.28	212,713.82
递延所得税资产		-	-
其他资产		30,247.08	-
资产总计		513,650,734.96	676,555,989.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,538,392.31	-
应付赎回款		264,409.64	1,320,995.39
应付管理人报酬		615,886.89	895,783.11
应付托管费		102,647.81	149,297.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,156,444.02	1,370,199.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		395,850.58	397,278.81
负债合计		6,073,631.25	4,133,554.37
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		525,656,714.15	633,167,230.50
未分配利润		-18,079,610.44	39,255,205.02
所有者权益合计		507,577,103.71	672,422,435.52
负债和所有者权益总计		513,650,734.96	676,555,989.89

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额（简称“建信双利基金份额”）份额净值 0.894 元，建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健收益类份额（简称“建信稳健份额”）份额净值 1.032 元，建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额（简称“建信进取份额”）份额净值 0.802 元。基金份额总额为 567,803,543.89 份，其中建信双利基金份额 559,967,981.89 份，建信稳健份额 3,134,224.00 份，建信进取份额 4,701,338.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-47,231,426.51	134,729,951.96
1.利息收入		151,196.48	350,263.92
其中：存款利息收入		150,976.42	349,289.06
债券利息收入		220.06	974.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		33,475,858.64	179,782,624.15
其中：股票投资收益		29,253,283.65	173,063,182.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益		76,847.94	316,907.74
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		4,145,727.05	6,402,533.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-80,969,095.15	-45,807,863.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		110,613.52	404,927.66
<b>减：二、费用</b>		7,397,057.72	15,495,769.18
1. 管理人报酬		4,138,815.99	9,927,421.65
2. 托管费		689,802.67	1,654,570.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		2,323,349.91	3,661,197.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		245,089.15	252,579.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-54,628,484.23	119,234,182.78
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-54,628,484.23	119,234,182.78

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信双利策略主题分级股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	633,167,230.50	39,255,205.02	672,422,435.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-54,628,484.23	-54,628,484.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-107,510,516.35	-2,706,331.23	-110,216,847.58
其中：1.基金申购款	53,339,674.14	1,382,935.07	54,722,609.21
2.基金赎回款	-160,850,190.49	-4,089,266.30	-164,939,456.79
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)	525,656,714.15	-18,079,610.44	507,577,103.71
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,637,480,583.11	-98,132,057.73	1,539,348,525.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	119,234,182.78	119,234,182.78
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)	-654,903,928.38	-32,815,801.99	-687,719,730.37
其中：1.基金申购款	204,342,006.01	10,437,942.12	214,779,948.13
2.基金赎回款	-859,245,934.39	-43,253,744.11	-902,499,678.50
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)	982,576,654.73	-11,713,676.94	970,862,977.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信双利策略主题分级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 355 号《关于核准建信双利策略主题分级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》和《建信双利策略主题分级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 2,973,543,800.59 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 161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 5 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,974,508,248.97 份基金份额,其中认购资金利息折合 964,448.38 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》和《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金份额包括建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之基础份额(简称“建信双利基金份额”)、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之稳健收益类份额(简称“建信稳健份额”)与建信双利策略主题分级股票型证券投资基金之积极收益类份额(简称“建信进取份额”)。其中,建信稳健份额、建信进取份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变。

建信双利基金份额只接受场外与场内申购和赎回,不上市交易;建信稳健份额、建信进取份额只上市交易,不接受申购和赎回。场内建信双利基金份额可按照 4:6 的比例分拆成预期收益与风险不同的两类基金份额,即建信稳健份额与建信进取份额,而建信稳健份额与建信进取份额也可按照 4:6 的比例合并成场内建信双利基金份额。

本基金定期进行基金份额折算。在建信稳健份额、建信双利基金份额存续期内的每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)第一个工作日,本基金将进行基金的定期份额折算。基金份额折算对象为基金份额折算基准日登记在册的建信稳健份额、建信双利基金份额。

本基金还不定期进行基金份额折算。不定期折算情形一：当建信双利基金份额的基金份额净值达到 2.000 元，基金管理人即可确定折算基准日；本基金将按照相关规则进行份额折算。基金份额折算对象为基金份额折算基准日登记在册的建信稳健份额、建信进取份额和建信双利基金份额。不定期折算情形二：当建信进取份额的基金份额净值达到 0.200 元，基金管理人即可确定折算基准日，本基金将按照相关规则进行份额折算。基金份额折算对象为基金份额折算基准日登记在册的建信稳健份额、建信进取份额、建信双利基金份额。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[2011]第 168 号文审核同意，37,344,064.00 份建信稳健份额、56,016,098.00 份建信进取份额于 2011 年 6 月 8 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

建信稳健份额约定年基准收益率为“一年期同期银行定期存款利率+3.5%”，一年期同期银行定期存款利率以当年 1 月 1 日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。在进行建信稳健份额和建信进取份额各自的基金份额参考净值计算时，本基金净资产优先确保建信稳健份额的本金及建信稳健份额累计约定日收益，之后的剩余净资产计为建信进取份额的净资产。基金管理人按照基金合同约定的规则，定期及不定期的在基金份额折算日对本基金进行份额折算。折算后基金运作方式及建信稳健份额与建信进取份额配比不变。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信双利策略主题分级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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票投资比例范围为基金资产的 90%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0-3%；固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的 5%-10%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95% + 商业银行活期存款利率×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公颁布的《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》、《建信双利策略主题分级股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的



有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

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

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

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

### 6.4.7 关联方关系

#### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

**6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.8.1.1 股票交易**

无

**6.4.8.1.2 权证交易**

无

**6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金**

无

**6.4.8.2 关联方报酬****6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,138,815.99	9,927,421.65
其中：支付销售机构的客户维护费	1,469,031.84	3,777,265.25

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

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

**6.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	689,802.67		1,654,570.31	

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

**6.4.8.2.3 销售服务费**

无

**6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无

**6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无

**6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	34,229,548.72	140,347.89	94,275,944.39	329,463.72

注：本基金的银行存由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.9 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002581	万昌科技	2014年4月21日	重大资产重组	16.65	2014年8月21日	18.32	336,800	5,335,554.64	5,607,720.00	-

注：本基金截至 2014 年 6 月 30 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。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

无

**6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

## (1) 公允价值

## (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## (b) 以公允价值计量的金融工具

## (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

## (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2014 年 6 月 30 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 470,053,427.12 元，属于第二层级的余额为 5,607,720.00 元，无属于第三层级的余额(2013 年 6 月 30 日：第一层级 848,197,738.90 元，第二层级 40,307,583.61 元，无第三层级)。

## (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	475,661,147.12	92.60
	其中：股票	475,661,147.12	92.60
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	35,267,195.14	6.87
7	其他各项资产	2,722,392.70	0.53
8	合计	513,650,734.96	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	46,326,896.77	9.13
B	采矿业	15,371,662.16	3.03
C	制造业	239,133,225.14	47.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,078,070.00	1.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	23,270,016.81	4.58

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,319,564.70	3.22
J	金融业	72,504,881.98	14.28
K	房地产业	24,520,996.47	4.83
L	租赁和商务服务业	13,886,471.48	2.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,327,899.21	2.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,921,462.40	1.76
S	综合	-	-
	合计	475,661,147.12	93.71

注：以上行业分类以 2014 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	415,069	16,328,814.46	3.22
2	300202	聚龙股份	569,531	15,924,086.76	3.14
3	000998	隆平高科	564,585	15,514,795.80	3.06
4	601166	兴业银行	1,514,382	15,189,251.46	2.99
5	002714	牧原股份	334,528	14,735,958.40	2.90
6	000002	万科A	1,727,460	14,286,094.20	2.81
7	000001	平安银行	1,424,262	14,114,436.42	2.78
8	002111	威海广泰	786,720	11,997,480.00	2.36
9	600511	国药股份	514,614	11,681,737.80	2.30
10	600351	亚宝药业	1,237,924	11,388,900.80	2.24

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn) 网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	21,308,852.28	3.17
2	600109	国金证券	16,340,326.17	2.43
3	600016	民生银行	15,963,561.64	2.37
4	600976	武汉健民	14,921,744.96	2.22
5	002111	威海广泰	14,238,440.52	2.12
6	600584	长电科技	14,064,404.65	2.09
7	600028	中国石化	13,568,763.89	2.02
8	002202	金风科技	13,271,960.84	1.97
9	000024	招商地产	13,034,355.71	1.94
10	601377	兴业证券	12,482,437.69	1.86
11	002169	智光电气	12,236,167.81	1.82
12	600499	科达洁能	12,017,252.05	1.79
13	002714	牧原股份	11,961,372.93	1.78
14	600690	青岛海尔	10,832,382.45	1.61
15	600351	亚宝药业	10,688,826.43	1.59
16	600858	银座股份	10,274,969.97	1.53
17	600580	卧龙电气	10,267,095.00	1.53
18	002304	洋河股份	10,139,094.15	1.51
19	600570	恒生电子	10,127,588.24	1.51
20	601088	中国神华	10,109,153.99	1.50

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002241	歌尔声学	25,990,422.58	3.87
2	000002	万科A	18,867,222.52	2.81
3	300202	聚龙股份	18,453,006.55	2.74
4	600584	长电科技	18,270,131.92	2.72
5	002353	杰瑞股份	17,320,122.82	2.58

6	300070	碧水源	17,113,674.31	2.55
7	600887	伊利股份	16,446,451.70	2.45
8	601318	中国平安	14,865,472.50	2.21
9	002508	老板电器	14,635,927.71	2.18
10	600109	国金证券	13,979,450.95	2.08
11	002202	金风科技	12,798,636.76	1.90
12	600028	中国石化	12,751,067.59	1.90
13	600837	海通证券	12,632,377.86	1.88
14	600570	恒生电子	12,458,475.49	1.85
15	002169	智光电气	12,428,401.93	1.85
16	000001	平安银行	12,131,324.44	1.80
17	000024	招商地产	12,109,955.00	1.80
18	000661	长春高新	12,082,840.96	1.80
19	600030	中信证券	11,997,661.11	1.78
20	601633	长城汽车	11,941,177.70	1.78

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	699,000,251.94
卖出股票收入（成交）总额	802,594,790.98

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

无

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所前十名资产支持证券投资明细

无

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

无

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无



**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

无

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

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

**7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。**

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	160,335.82
2	应收证券清算款	2,521,218.02
3	应收股利	-
4	应收利息	7,143.50
5	应收申购款	3,448.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.08
8	其他	-
9	合计	2,722,392.70

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
建信双利	11,473	48,807.46	58,928,100.17	10.52%	501,039,881.72	89.48%
建信稳健	254	12,339.46	-	0.00%	3,134,224.00	100.00%
建信进取	334	14,075.86	-	0.00%	4,701,338.00	100.00%
合计	12,061	47,077.65	58,928,100.17	10.38%	508,875,443.72	89.62%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

建信稳健

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	刘丹	282,498.00	9.01%
2	李丽	160,000.00	5.10%
3	孟凯	114,544.00	3.65%
4	赵翼翔	105,919.00	3.38%
5	王林娣	92,351.00	2.95%
6	齐全胜	80,306.00	2.56%
7	杨德珍	80,019.00	2.55%
8	吴清妹	76,003.00	2.42%
9	颜裕发	73,700.00	2.35%
10	鲁萍	59,300.00	1.89%

建信进取

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	吴美莲	669,774.00	14.25%

2	刘静	144,000.00	3.06%
3	王广军	133,200.00	2.83%
4	魏基绵	132,324.00	2.81%
5	杨德珍	120,028.00	2.55%
6	高其铭	118,223.00	2.51%
7	吴清妹	114,004.00	2.42%
8	林翠	100,000.00	2.13%
9	鲁萍	88,950.00	1.89%
10	吴海晏	87,343.00	1.86%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信双利	0
	建信稳健	0
	建信进取	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	建信双利	0
	建信稳健	0
	建信进取	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信双利	建信稳健	建信进取
基金合同生效日（2011年5月6日） 基金份额总额	2,881,148,086.97	37,344,064.00	56,016,098.00
本报告期期初基金份额总额	658,126,414.53	3,281,112.00	4,921,670.00
本报告期基金总申购份额	57,625,922.00	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	173,714,572.30	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少）	17,930,217.66	-146,888.00	-220,332.00

以“-”填列)			
本报告期末基金份额总额	559,967,981.89	3,134,224.00	4,701,338.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

我公司于 2014 年 3 月 21 日召开 2014 年度第一次临时股东会，会议决定请解聘江先周先生董事职务、解聘罗中涛女士监事职务，并聘任杨文升先生为董事、聘任张涛女士为公司监事。2014 年 3 月 21 日公司召开第三届董事会第六次会议，会议决定选举杨文升先生为公司董事长，公司分别于 2014 年 3 月 27 日和 2014 年 6 月 21 日在指定媒体和公司网站公开披露了原董事长的离任公告和现董事长的任职公告。上述事项符合《证券投资基金管理公司管理办法》的相关规定，并已在中国证监会备案。公司已于 2014 年 7 月 7 日完成公司法定代表人变更手续，杨文升先生为法定代表人。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	439,583,267.09	29.28%	386,531.69	28.76%	-
广发证券	1	286,420,890.16	19.08%	260,758.74	19.40%	-
中投证券	1	266,571,744.82	17.75%	242,687.55	18.06%	-
中信证券	1	245,290,388.58	16.34%	215,562.53	16.04%	-
国泰君安	1	199,780,366.37	13.30%	181,880.26	13.53%	-
中信建投	1	55,185,406.21	3.68%	48,854.68	3.64%	-
银河证券	1	8,711,729.69	0.58%	7,674.78	0.57%	-
天源证券	1	-	-	-	-	-

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

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

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

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

（4）佣金费率合理。

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

3、本基金本报告期内剔除了中航证券一个交易单元，无新增交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	1,081,068.00	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司

2014 年 8 月 25 日