

# 建信中证 500 指数增强型证券投资基金 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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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 27 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       | 建信中证 500 指数增强    |
| 基金主代码      | 000478           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2014 年 1 月 27 日  |
| 基金管理人      | 建信基金管理有限责任公司     |
| 基金托管人      | 中信银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 148,587,015.67 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 投资策略   | <p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> <p>在资产配置策略方面，本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置。本基金将参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金进行股指期货投资的目的是对股票组合进行套期保值，控制组合风险，达到在有效跟踪标的指数的基础上，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。</p> |
| 业绩比较基准 | $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率（税前）}$ 。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

## 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                 | 中信银行股份有限公司              |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 路彩营                          | 朱义明                     |
|         | 联系电话 | 010-66228888                 | 010-65558812            |
|         | 电子邮箱 | xinxipilu@ccbfund.cn         | zhuyiming@citicbank.com |
| 客户服务电话  |      | 400-81-95533<br>010-66228000 | 95558                   |
| 传真      |      | 010-66228001                 | 010-65550832            |

## 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 27 日 - 2014 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|-----------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,377,217.71                            |
| 本期利润          | 4,043,951.57                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0178                                  |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.67%                                   |
| 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  | 0.0093                                  |
| 期末基金资产净值      | 151,063,907.86                          |
| 期末基金份额净值      | 1.0167                                  |

注：1、本基金基金合同自 2014 年 1 月 27 日起生效，至 2014 年 6 月 30 日未满六个月；

2、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；

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、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。

## 3.2 基金净值表现

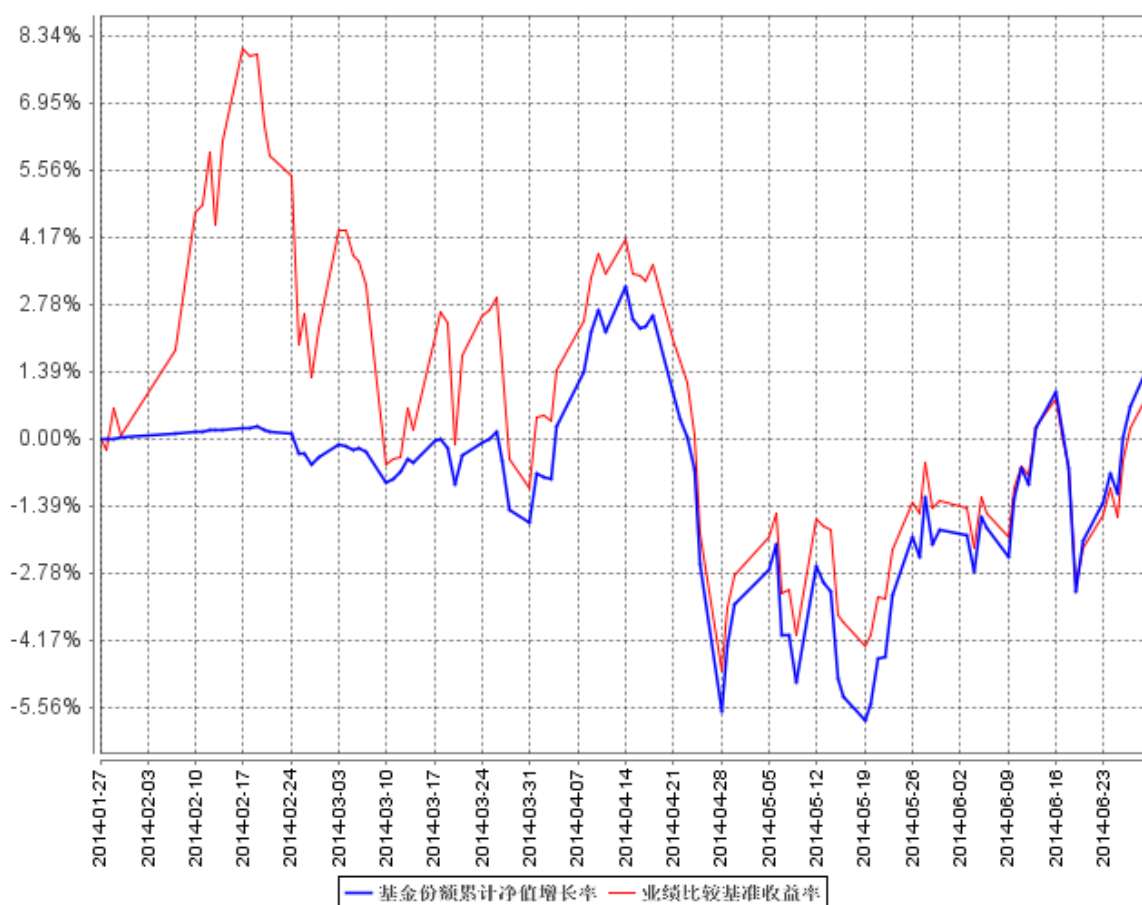
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去一个月          | 3.62%        | 0.99%               | 2.38%              | 0.93%                 | 1.24% | 0.06%  |
| 过去三个月          | 3.48%        | 1.07%               | 2.11%              | 1.01%                 | 1.37% | 0.06%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 1.67%        | 0.85%               | 1.08%              | 1.17%                 | 0.59% | -0.32% |

注：本基金业绩比较基准为 95%×中证 500 指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税前）。中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场中小市值公司的整体情况。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2014 年 1 月 27 日生效，截止报告期末仍处于建仓期。

## § 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 |        |                                                                                                                                                                       |
| 叶乐天 | 本基金的基金经理 | 2014 年 1 月 27 日 | —    | 6      | 硕士。曾就职于中国国际金融有限公司，先后担任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资；2011 年 9 月加入我公司，担任基金经理助理。2012 年 3 月 21 日起任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投 |

|  |  |  |  |  |                                                                        |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 资基金的<br>基 金 经<br>理；2014<br>年 1 月 27<br>日起任中<br>证 500 指<br>数增强基<br>金经理。 |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------|

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金成立于一月末，于三月末开放申购赎回，于四月初基本完成建仓。完成建仓后，本基金管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型进行指数增强和风险管理，量化增强策略获得了

较好的表现，每月均跑赢业绩比较基准。

在 6 月份，本基金积极应对指数成份股的调整，较好的控制了跟踪误差及交易成本。

#### 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 1.67%，波动率 0.85%，业绩比较基准收益率 1.08%，波动率 1.17%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年，投资者一直在关注“经济是否企稳回升”和“刺激政策是否会从弱刺激转为强刺激”这两个问题，但这两个问题的答案实际上是互斥的，这决定了上半年大盘指数“难上难下”的格局。但在看似波澜不惊的大盘指数的掩护下，成长股的走势却大不相同，分化十分严重。预计这样“蓝筹搭台，成长唱戏”的局面还将持续到下半年，精选个股尤为重要。

本基金管理人将坚持量化分析研究，进一步改进指数增强策略，努力克服市场的波动，持续获取稳健的超额收益。

#### 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**

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

## **§ 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**

自 2014 年 1 月 27 日建信中证 500 指数增强型证券投资基金（以下称“建信中证 500 指数基金”或“本基金”）成立以来，作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### **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**

报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——建信基金管理有限责任公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本基金本年度无分红。

### **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**

由建信中证 500 指数基金管理人——建信基金管理有限责任公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

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<br>2014 年 6 月 30 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |
| 银行存款            |            | 7,891,890.38                   |
| 结算备付金           |            | 354,053.43                     |
| 存出保证金           |            | 152,283.20                     |
| 交易性金融资产         |            | 143,008,851.42                 |
| 其中：股票投资         |            | 143,008,851.42                 |
| 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         |            | 1,496,601.91                   |
| 应收利息            |            | 2,006.96                       |
| 应收股利            |            | -                              |
| 应收申购款           |            | 1,773.41                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              |
| 其他资产            |            | -                              |
| 资产总计            |            | 152,907,460.71                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2014 年 6 月 30 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         |            | 116.85                         |
| 应付赎回款           |            | 1,018,992.13                   |
| 应付管理人报酬         |            | 125,428.74                     |
| 应付托管费           |            | 25,085.72                      |
| 应付销售服务费         |            | -                              |
| 应付交易费用          |            | 465,259.57                     |
| 应交税费            |            | -                              |
| 应付利息            |            | -                              |

|               |  |                |
|---------------|--|----------------|
| 应付利润          |  | -              |
| 递延所得税负债       |  | -              |
| 其他负债          |  | 208,669.84     |
| 负债合计          |  | 1,843,552.85   |
| <b>所有者权益：</b> |  |                |
| 实收基金          |  | 148,587,015.67 |
| 未分配利润         |  | 2,476,892.19   |
| 所有者权益合计       |  | 151,063,907.86 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 152,907,460.71 |

注：1. 报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0167 元，基金份额总额 148,587,015.67 份。

2. 本基金基金合同自 2014 年 1 月 27 日起生效，至 2014 年 6 月 30 日未满六个月。

## 6.2 利润表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号 | 本期<br>2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)<br>至 2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|-----|-----------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |     | 6,123,619.59                                        |
| 1.利息收入                |     | 1,941,846.49                                        |
| 其中：存款利息收入             |     | 68,187.84                                           |
| 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            |     | 1,873,658.65                                        |
| 其他利息收入                |     | -                                                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |     | 2,314,590.38                                        |
| 其中：股票投资收益             |     | 1,224,137.73                                        |
| 基金投资收益                |     | -                                                   |
| 债券投资收益                |     | -                                                   |
| 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                  |     | 1,090,452.65                                        |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） |     | 1,666,733.86                                        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |     | -                                                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     |     | 200,448.86                                          |
| <b>减：二、费用</b>         |     | 2,079,668.02                                        |

|                     |  |              |
|---------------------|--|--------------|
| 1. 管理人报酬            |  | 951,885.64   |
| 2. 托管费              |  | 190,377.09   |
| 3. 销售服务费            |  | -            |
| 4. 交易费用             |  | 717,568.24   |
| 5. 利息支出             |  | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |  | -            |
| 6. 其他费用             |  | 219,837.05   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |  | 4,043,951.57 |
| 减：所得税费用             |  | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |  | 4,043,951.57 |

注：本基金基金合同自 2014 年 1 月 27 日起生效，至 2014 年 6 月 30 日未满六个月。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)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）                        | 308,165,342.91                                  | -             | 308,165,342.91  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                               | 4,043,951.57  | 4,043,951.57    |
| 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）      | -159,578,327.24                                 | -1,567,059.38 | -161,145,386.62 |
| 其中：1.基金申购款                             | 985,987.12                                      | -16,366.54    | 969,620.58      |
| 2.基金赎回款                                | -160,564,314.36                                 | -1,550,692.84 | -162,115,007.20 |
| 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）                        | 148,587,015.67                                  | 2,476,892.19  | 151,063,907.86  |

注：本基金基金合同自 2014 年 1 月 27 日起生效，至 2014 年 6 月 30 日未满六个月。

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

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信中证 500 指数增强型证券投资基金(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[2013]第 615 号《关于核准建信中证 500 指数增强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《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2014 年 1 月 2 日至 2014 年 1 月 23 日止。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 308,106,805.84 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(2014)第 039 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2014 年 1 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 308,165,342.91 份基金份额,其中认购资金利息折合 58,537.07 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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数增强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、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为不低于 90%,其中投资于中证 500 成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金投资股指期货以套期保值为目的,股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金业绩比较基准为  $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行活期存款利率(税 前)}$ 。

### 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实

务操作的有关规定编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日止期间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 27 日(基金合同生效日)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 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 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、债券投资和衍生工具(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。

#### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 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由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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；于处置时，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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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。

#### **6.4.4.12 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。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 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。

#### **6.4.5.2 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。

#### **6.4.5.3 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。

### **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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中信银行股份有限公司(“中信银行”)     | 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<br>2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日 |
|------------|-------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付 | 951,885.64                                      |

|                     |            |
|---------------------|------------|
| 的管理费                |            |
| 其中：支付销售机构的客<br>户维护费 | 493,215.72 |

注：1、本基金基金合同自 2014 年 1 月 27 日起生效，至 2014 年 6 月 30 日未满六个月。

2、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 1.0%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 1.0% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目                 | 本期                                        |
|--------------------|-------------------------------------------|
|                    | 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付<br>的托管费 | 190,377.09                                |

注：1、本基金基金合同自 2014 年 1 月 27 日起生效，至 2014 年 6 月 30 日未满六个月。

2、支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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 0.20% / 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<br>名称 | 本期                                        |           |
|-----------|-------------------------------------------|-----------|
|           | 2014 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日 |           |
|           | 期末余额                                      | 当期利息收入    |
| 中信银行      | 7,891,890.38                              | 41,335.19 |

注：1、本基金基金合同自 2014 年 1 月 27 日起生效，至 2014 年 6 月 30 日未满六个月。

2、本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，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

无

#### 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 |
|--------|------|-----------------|-----------|--------|-----------------|--------|---------|------------|--------------|----|
| 601012 | 隆基股份 | 2014 年 6 月 19 日 | 筹划非公开发行股票 | 15.50  | 2014 年 7 月 1 日  | 15.60  | 67,320  | 923,951.20 | 1,043,460.00 | -  |
| 002340 | 格林美  | 2014 年 6 月 26 日 | 筹划重大收购事项  | 11.19  | 2014 年 7 月 24 日 | 11.77  | 45,405  | 478,252.83 | 508,081.95   | -  |
| 002252 | 上海莱士 | 2014 年 6 月 13 日 | 筹划重大资产重组  | 63.30  | -               | -      | 7,400   | 498,632.00 | 468,420.00   | -  |
| 600755 | 厦门国贸 | 2014 年 6 月 27 日 | 重大事项      | 4.85   | 2014 年 7 月 7 日  | 4.74   | 75,420  | 393,344.32 | 365,787.00   | -  |
| 600507 | 方大特钢 | 2014 年 6 月 30 日 | 重大事项      | 3.16   | 2014 年 7 月 2 日  | 3.03   | 100,572 | 348,176.96 | 317,807.52   | -  |
| 002019 | 鑫富药业 | 2014 年 6 月 25 日 | 重大资产重组    | 23.76  | 2014 年 7 月 4 日  | 26.14  | 9,033   | 216,902.33 | 214,624.08   | -  |
| 002100 | 天康生物 | 2014 年 5 月 27 日 | 重大资产重组    | 9.82   | -               | -      | 18,157  | 183,884.97 | 178,301.74   | -  |
| 600490 | 鹏欣资源 | 2014 年 4 月      | 重大资产      | 6.11   | 2014 年 7 月      | 6.11   | 26,520  | 174,176.00 | 162,037.20   | -  |

|  |  |     |    |  |      |  |  |  |  |
|--|--|-----|----|--|------|--|--|--|--|
|  |  | 1 日 | 重组 |  | 15 日 |  |  |  |  |
|--|--|-----|----|--|------|--|--|--|--|

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 139,750,331.93 元，属于第二层级的余额为 3,258,519.49 元，无属于第三层级的余额。

##### (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              | 143,008,851.42 | 93.53         |
|    | 其中：股票             | 143,008,851.42 | 93.53         |
| 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      | 8,245,943.81   | 5.39          |
| 7  | 其他各项资产            | 1,652,665.48   | 1.08          |
| 8  | 合计                | 152,907,460.71 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资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         | 970,581.12    | 0.64          |
| B  | 采矿业              | 2,375,192.09  | 1.57          |
| C  | 制造业              | 73,722,021.21 | 48.80         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,722,882.86  | 1.80          |
| E  | 建筑业              | 3,581,163.56  | 2.37          |
| F  | 批发和零售业           | 9,076,987.74  | 6.01          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,333,642.86  | 2.21          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 522,379.53    | 0.35          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,960,277.75  | 2.62          |
| J  | 金融业              | 2,044,268.02  | 1.35          |
| K  | 房地产业             | 9,099,417.34  | 6.02          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,555,267.63  | 1.03          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —             | —             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 2,362,700.20  | 1.56          |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| 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     | 585,849.39     | 0.39  |
| S | 综合            | 1,377,891.51   | 0.91  |
|   | 合计            | 117,290,522.81 | 77.64 |

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。

## 7.2.2 期末积极投资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         | -             | -            |
| B  | 采掘业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 18,847,323.35 | 12.48        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 872,753.00    | 0.58         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 929,048.55    | 0.62         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,137,036.32  | 2.08         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | 1,608,937.97  | 1.07         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 171,603.50    | 0.11         |
| 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        | 151,625.92    | 0.10         |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 25,718,328.61 | 17.02        |

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（前五名）股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资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  | 600398 | 海澜之家  | 220,902 | 2,032,298.40 | 1.35         |
| 2  | 600366 | 宁波韵升  | 127,902 | 1,898,065.68 | 1.26         |
| 3  | 000848 | 承德露露  | 92,010  | 1,828,238.70 | 1.21         |
| 4  | 002573 | 国电清新  | 101,547 | 1,785,196.26 | 1.18         |
| 5  | 000540 | 中天城投  | 343,111 | 1,749,866.10 | 1.16         |
| 6  | 002025 | 航天电器  | 110,290 | 1,730,450.10 | 1.15         |
| 7  | 000050 | 深天马 A | 136,749 | 1,709,362.50 | 1.13         |
| 8  | 000860 | 顺鑫农业  | 117,626 | 1,651,469.04 | 1.09         |
| 9  | 002663 | 普邦园林  | 136,736 | 1,635,362.56 | 1.08         |
| 10 | 000631 | 顺发恒业  | 331,490 | 1,498,334.80 | 0.99         |

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。

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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  | 300294 | 博雅生物 | 23,343  | 1,134,469.80 | 0.75         |
| 2  | 002675 | 东诚药业 | 59,635  | 1,106,825.60 | 0.73         |
| 3  | 002540 | 亚太科技 | 100,100 | 1,055,054.00 | 0.70         |
| 4  | 002415 | 海康威视 | 52,075  | 882,150.50   | 0.58         |
| 5  | 002658 | 雪迪龙  | 37,850  | 778,574.50   | 0.52         |

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末基金资产净值 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     | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 600499 | 科达洁能 | 2,540,279.13 | 1.68           |
| 2  | 600388 | 龙净环保 | 2,416,829.12 | 1.60           |
| 3  | 002465 | 海格通信 | 2,394,907.09 | 1.59           |
| 4  | 002400 | 省广股份 | 2,333,721.56 | 1.54           |
| 5  | 000848 | 承德露露 | 2,235,178.28 | 1.48           |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 6  | 002022 | 科华生物  | 2,229,971.90 | 1.48 |
| 7  | 002573 | 国电清新  | 2,219,155.61 | 1.47 |
| 8  | 002410 | 广联达   | 2,187,222.10 | 1.45 |
| 9  | 002663 | 普邦园林  | 2,037,934.17 | 1.35 |
| 10 | 600872 | 中炬高新  | 2,013,674.19 | 1.33 |
| 11 | 000997 | 新大陆   | 2,011,438.84 | 1.33 |
| 12 | 002152 | 广电运通  | 1,967,799.20 | 1.30 |
| 13 | 000540 | 中天城投  | 1,967,512.89 | 1.30 |
| 14 | 600398 | 海澜之家  | 1,965,630.12 | 1.30 |
| 15 | 000050 | 深天马 A | 1,943,278.00 | 1.29 |
| 16 | 600151 | 航天机电  | 1,929,025.96 | 1.28 |
| 17 | 000553 | 沙隆达 A | 1,893,989.65 | 1.25 |
| 18 | 000501 | 鄂武商 A | 1,888,417.49 | 1.25 |
| 19 | 002340 | 格林美   | 1,885,089.17 | 1.25 |
| 20 | 600511 | 国药股份  | 1,883,480.87 | 1.25 |

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末基金资产净值 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     | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|--------------|----------------|
| 1  | 002465 | 海格通信  | 2,630,413.93 | 1.74           |
| 2  | 600499 | 科达洁能  | 2,313,455.92 | 1.53           |
| 3  | 002400 | 省广股份  | 2,290,237.90 | 1.52           |
| 4  | 600158 | 中体产业  | 2,123,602.54 | 1.41           |
| 5  | 600388 | 龙净环保  | 1,977,883.09 | 1.31           |
| 6  | 002410 | 广联达   | 1,783,971.16 | 1.18           |
| 7  | 600312 | 平高电气  | 1,740,832.57 | 1.15           |
| 8  | 002049 | 同方国芯  | 1,722,342.80 | 1.14           |
| 9  | 600525 | 长园集团  | 1,715,448.45 | 1.14           |
| 10 | 000553 | 沙隆达 A | 1,704,935.20 | 1.13           |
| 11 | 600269 | 赣粤高速  | 1,673,358.27 | 1.11           |
| 12 | 600325 | 华发股份  | 1,665,815.85 | 1.10           |
| 13 | 600064 | 南京高科  | 1,641,724.58 | 1.09           |
| 14 | 600521 | 华海药业  | 1,638,946.47 | 1.08           |
| 15 | 600790 | 轻纺城   | 1,602,097.81 | 1.06           |
| 16 | 000501 | 鄂武商 A | 1,577,005.28 | 1.04           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 17 | 002041 | 登海种业 | 1,558,883.22 | 1.03 |
| 18 | 002470 | 金正大  | 1,557,759.06 | 1.03 |
| 19 | 002048 | 宁波华翔 | 1,552,506.62 | 1.03 |
| 20 | 600438 | 通威股份 | 1,548,641.30 | 1.03 |

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 | 330,207,028.47 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 190,089,048.64 |

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

无

### 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 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

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

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   | 152,283.20   |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,496,601.91 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 2,006.96     |
| 5  | 应收申购款   | 1,773.41     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,652,665.48 |

**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****7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无

**7.12.5.2 期末积极投资前五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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 2,821        | 52,671.75     | 3,468,468.82 | 2.33%      | 145,118,546.85 | 97.67%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无

### 8.3 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                             | 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 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2014 年 1 月 27 日）基金份额总额     | 308,165,342.91 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 985,987.12     |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 160,564,314.36 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 148,587,015.67 |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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。

本基金托管人中信银行于 2014 年 2 月 27 日公告，因工作需要，刘勇先生不再担任中信银行资产托管部总经理，任命刘泽云先生为中信银行资产托管部副总经理，并主持资产托管部相关工作。

## 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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
|------|------|------|-----------|----|

|      | 数量 | 成交金额           | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 | 佣金         | 占当期佣金<br>总量的比例 |   |
|------|----|----------------|----------------------|------------|----------------|---|
| 东兴证券 | 1  | 141,762,347.24 | 27.25%               | 129,061.24 | 27.74%         | - |
| 上海证券 | 1  | 138,696,084.73 | 26.66%               | 121,446.93 | 26.10%         | - |
| 民生证券 | 1  | 138,000,263.69 | 26.52%               | 125,636.21 | 27.00%         | - |
| 招商证券 | 1  | 86,188,788.57  | 16.57%               | 75,377.98  | 16.20%         | - |
| 中信证券 | 1  | 12,673,015.21  | 2.44%                | 11,075.92  | 2.38%          | - |
| 中金公司 | 2  | 2,975,577.67   | 0.57%                | 2,661.29   | 0.57%          | - |

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

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

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

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个股、个债等进行深入、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、本基金合同于 2014 年 1 月 27 日正式生效，本期新增东兴证券、上海证券、民生证券、招商证券和中信证券各一个交易单元，以及中金证券两个交易单元。

4、本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 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<br>成交总额的比<br>例 | 成交金额             | 占当期债<br>券回购<br>成交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 |
| 东兴证券 | -    | -                    | -                | -                          | -    | -                    |
| 上海证券 | -    | -                    | 2,104,000,000.00 | 68.01%                     | -    | -                    |
| 民生证券 | -    | -                    | 30,000,000.00    | 0.97%                      | -    | -                    |

|      |   |   |                |        |   |   |
|------|---|---|----------------|--------|---|---|
| 招商证券 | - | - | -              | -      | - | - |
| 中信证券 | - | - | 1,500,000.00   | 0.05%  | - | - |
| 中金公司 | - | - | 958,000,000.00 | 30.97% | - | - |

建信基金管理有限公司  
2014 年 8 月 25 日