

# 建信全球资源股票型证券投资基金 2014 年半年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 25 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。

基金托管人中国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。

## 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 主要财务指标和基金净值表现</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
<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.....	12
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.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	39
7.4 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.....	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	43
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	45
7.7 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.....	45
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
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金融衍生品投资明细.....	45
7.10 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.....	45
7.11 投资组合报告附注.....	46

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>47</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	51
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>51</b>
11.1 备查文件目录.....	51
11.2 存放地点.....	51
11.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信全球资源股票型证券投资基金
基金简称	建信全球资源股票(QDII)
基金主代码	539003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月26日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,409,946.57份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过全球化的资产配置和组合管理，优选资源类相关行业的股票进行投资，在控制风险的同时，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	50%×MSCI 全球能源行业净总收益指数收益率（MSCI ACWI Energy Net Total Return Index）+50%×MSCI 全球原材料行业净总收益指数收益率（MSCI ACWI Material Net Total Return Index）。
风险收益特征	本基金是主动管理的全球配置型股票基金，其风险和预期收益高于债券型基金和混合型基金，本基金主要投资方向为资源类相关行业，属于具有较高风险和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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	王永民
	联系电话	010-66228888	010-66594896
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95566
传真		010-66228001	010-66594942

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 1 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 1 号
邮政编码	100033	100818
法定代表人	杨文升	田国立

## 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.	Deutsche Bank AG, Singapore Branch
	中文	信安环球投资有限公司	德意志银行新加坡分行
注册地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	One Raffles Quay, Level 17, South Tower, Singapore
办公地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	One Raffles Quay, #16-00, South Tower, Singapore
邮政编码		IA 50392-0490	048583

## 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。

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	1,210,764.90
本期利润	882,883.55

加权平均基金份额本期利润	0.0903
本期加权平均净值利润率	8.53%
本期基金份额净值增长率	10.38%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2014年6月30日)</b>
期末可供分配利润	1,853,462.51
期末可供分配基金份额利润	0.1382
期末基金资产净值	15,263,409.08
期末基金份额净值	1.138
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2014年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	17.41%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

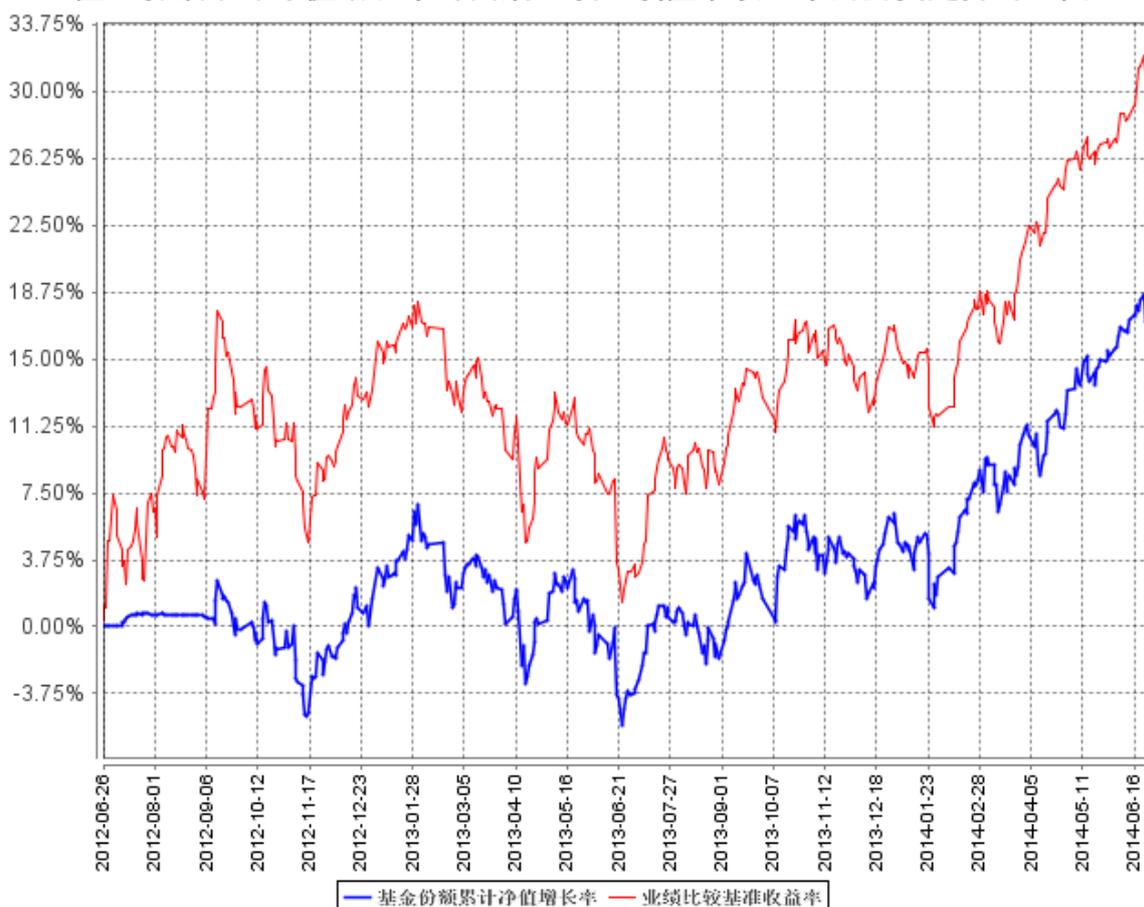
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.97%	0.42%	3.08%	0.40%	-1.11%	0.02%
过去三个月	5.96%	0.55%	7.87%	0.43%	-1.91%	0.12%
过去六个月	10.38%	0.67%	11.87%	0.56%	-1.49%	0.11%
过去一年	22.05%	0.68%	26.84%	0.60%	-4.79%	0.08%
自基金合同生效起至今	17.41%	0.70%	30.79%	0.81%	-13.38%	-0.11%

注：本基金的业绩比较基准为：50%×MSCI 全球能源行业净总收益指数收益率（MSCI ACWI Energy Net Total Return Index）+50%×MSCI 全球原材料行业净总收益指数收益率（MSCI ACWI Material Net Total Return Index）。MSCI 是全球领先的指数公司，具有超过 40 年的计算编制国际股票指数的丰富经验，MSCI 全球指数系列自编制以来，已经成为国际大型机构投资者及各种媒体广泛使

用的业绩比较基准。MSCI 全球能源行业净总收益指数和 MSCI 全球原材料行业净总收益指数是 MSCI 全球指数系列中的两个行业指数，MSCI 全球指数系列的编制方法遵循客观、规则为本和自由流通市值加权的原则，从而使该指数系列能够捕捉到更为广泛的投资机会，指数的维护和调整公开透明，满足了投资者在使用该指数系列时的不同需求；MSCI 全球指数系列具有全面翔实的历史数据，包括指数层面数据、成份股层面数据和各种估值数据，为分析研究全球市场提供了有力支持；MSCI 全球指数系列能及时反映公司事件和市场变化，每年 4 次的指数审核及每日的公司事件审议保证了指数及时准确反映市场变化。

### 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、本基金业绩比较基准计价货币为人民币。

2、本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

## § 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		
赵英楷	海外投资部总监、本基金的基金经理	2012 年 6 月 26 日	-	16	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。
李博涵	本基金的基金经理	2013年8月5日	-	9	李博涵先生，硕士，加拿大籍华人。曾就职于美国联邦快递北京分公司、美国联合航空公司北京分公司和美国万事达卡国际组织北京分公司。2005年2月起加入加拿大蒙特利尔银行，任全球资本市场投资助理；2006年8月起加入加拿大帝国商业银行，任全球资本市场投资顾问；2008年8月加入我公司海外投资部，任高

					级研究员兼基金经理助理，2013年8月5日起任建信全球资源股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

#### 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
Christopher Ibach	投资组合经理	19	Christopher Ibach 负责监督支持所有股票策略的全球研究&发展，包括全球量化研究、股票选择模型发展、投资组合构建和风险管理。他作为共同基金经理，专精于主动核心、机会型的和专业全球组合。Chris 也监督公司的系统策略团队，负责被动增强和被动股票组合。他在 2000 年作为股票研究分析师加入公司，专精于分析国际科技公司并在 2002 年成为基金经理。在此之前，Chris 在 Motorola, Inc 取得了 6 年的相关行业经验。Chris 从 University of Iowa 获得了金融学 MBA 学位和电子工程学士学位。Chris 获得了使用特许金融分析师称

			号的权利并且是 CFA Institute 的成员。
Mustafa Sagun	首席投资官	22	Mustafa Sagun 是信安环球股票的首席投资官。他负责监督所有国际、国内和全球股票策略的投资组合管理和研究。Mustafa 在 2000 年加入公司。他从 2002 年开始就担任全球股票组合的主管基金经理，而在 2006 年开始担任首席投资官。他之前也担任公司资产配置策略团队的成员。Mustafa 的职业生涯开始于 1991 年，曾担任过投资管理，研究和风险管理的职位。在加入信安之前，他是 PNC 金融服务集团的副总裁和分析师和 Salomon Brothers 的股票衍生品专家。Mustafa 从 University of South Florida 取得金融学 Ph.D. 学位和国际经济学 MA 学位。他从土耳其的 Bogazici University 取得电子和工程的学士学位。Mustafa 获得了使用特许金融分析师称号的权利。他是 CFA Institute 和 CFA Society of Iowa 的成员。
李晓西	投资组合经理	14	李晓西是信安环球股票定量研究部总经理，负责所有股票策略的量化研究。他的研究职责包括为公司专属的全球研究平台 (GRP) 股票选择模

			<p>型，投资组合构建和风险管理进行全球股票量化研究并实施模型开发。他也担任全球核心、全球全部国家、全球机遇、全球价值&amp;收入和其它专门的全球基金的基金经理。晓西在 2006 年加入公司。此前，晓西是 Hantang Securities Co., Ltd., Beijing 的高级经理。他的经历还包括 Yinjian Industrial Co., Ltd., Beijing 的投资组合经理。他从杜克大学获得 MBA 学位，从北京工商大学获得会计学硕士学位并从对外经济贸易大学会计学专业毕业。晓西是金融风险管理师持证人和 Global Association of Risk Professionals 成员。他获得了使用特许金融分析师称号的权利并且是 CFA Institute 的成员。</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。

#### 4.4.2 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。

### 4.5 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

2014 年上半年全球资源市场表现良好，石油和原材料相关股票均有不错涨幅。乌克兰危机和之后的伊拉克战争增加了地域政治风险，推动石油价格上涨，另外美国经历了近几十年来少有的寒冬，以及之后美国经济的上行都增加了石油需求，令石油价格上升至近期历史高位，石油相关股票也有较大幅度上涨。主要原材料品种的价格在上半年总体处于下行趋势，但在 6 月底、7 月初有所反弹，主要原因是中国政府对影子银行的管控和中国经济增长的放缓造成原材料需求下降，但随着中国“保增长”政策的持续推出，原材料价格在 6、7 月份出现了反弹；另外由于地域政治风险的上升，贵金属价格也出现了一定程度的上涨。二季度全球股票市场表现较好，反映了成熟市场经济基本面的好转以及投资人风险偏好的提升，全球资源相关股票也反映了投资人的乐观情绪，石油、化工、工业品、贵金属等板块表现比较突出。

#### 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 10.38%，波动率 0.67%，业绩比较基准收益率 11.87%，波动率 0.56%。

### 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，我们认为全球资源市场可能呈现震荡行情。我们的基本假设是美国经济继续走强，欧洲经济维持复苏趋势，地缘政治风险仍然可能持续，这些因素可能导致石油价格维持在高位，进而有利于股票估值的提升。原材料方面，铁矿石趋势性上涨的可能性依然较低，但随着中国经济数据的企稳和流动性的好转，铁矿石价格可能会出现短暂的恢复性调整；铜、工业品、化工原

料相关股票与全球经济的联动性较高，我们认为未来仍然具备投资价值。展望未来，我们认为短期可能引发市场震荡的因素包括：一、如果美国经济数据继续大幅超预期，美联储提前加息的可能性将会显著增加，造成市场的短期震荡；二、全球资源市场近期表现较好，技术性获利回吐的压力在增加。总体看，市场下行压力是暂时性的扰动因素，我们认为下半年全球资源市场基本面良好，在经历可能的短期震荡之后，仍有一定的上行空间。我们会根据上述市场判断，在资产类别和行业配置方面加以取舍、力争为投资人带来超额收益。

#### 4.7 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）。

#### 4.8 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基金合同中关于利润分配条款的规定。

### § 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对建信全球资源股票型证券投资基金证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：建信全球资源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	6.4.7.1	1,973,034.52	1,206,122.39
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	11,613,541.95	12,629,312.66

其中：股票投资		10,577,732.83	12,055,800.45
基金投资		1,035,809.12	573,512.21
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	223.13	56.08
应收股利		16,359.76	18,767.83
应收申购款		2,252,629.13	13,189.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		15,855,788.49	13,867,448.30
<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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		178,932.78	-
应付赎回款		111,145.34	189,486.49
应付管理人报酬		15,281.74	20,904.90
应付托管费		2,971.51	4,064.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	284,048.04	315,774.85
负债合计		592,379.41	530,231.08
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	13,409,946.57	12,939,360.18
未分配利润	6.4.7.10	1,853,462.51	397,857.04
所有者权益合计		15,263,409.08	13,337,217.22
负债和所有者权益总计		15,855,788.49	13,867,448.30

注：1、报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.138 元，基金份额总额 13,409,946.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：建信全球资源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>		1,188,481.53	-1,653,033.69
1.利息收入		2,450.02	15,404.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,450.02	15,404.23
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,492,559.66	-231,052.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,373,143.16	-656,763.07
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	119,416.50	425,710.08
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-327,881.35	-1,440,836.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		13,456.02	-41,310.82
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	7,897.18	44,762.38
<b>减：二、费用</b>		305,597.98	640,282.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	92,623.11	325,660.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	18,010.12	63,322.81
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	15,634.07	71,459.47
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
<b>6. 其他费用</b>	6.4.7.21	179,330.68	179,839.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		882,883.55	-2,293,316.06
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		882,883.55	-2,293,316.06

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信全球资源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)	12,939,360.18	397,857.04	13,337,217.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	882,883.55	882,883.55
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)	470,586.39	572,721.92	1,043,308.31
其中：1.基金申购款	9,297,067.16	1,200,109.52	10,497,176.68
2.基金赎回款	-8,826,480.77	-627,387.60	-9,453,868.37
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)	13,409,946.57	1,853,462.51	15,263,409.08
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)	33,927,937.71	546,140.76	34,474,078.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-2,293,316.06	-2,293,316.06
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)	237,306.53	453,008.12	690,314.65
其中：1.基金申购款	32,494,215.94	1,007,392.84	33,501,608.78
2.基金赎回款	-32,256,909.41	-554,384.72	-32,811,294.13
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)	34,165,244.24	-1,294,167.18	32,871,077.06
-----------------	---------------	---------------	---------------

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：

<u>孙志晨</u>	<u>何斌</u>	<u>秦绪华</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

建信全球资源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[2012]第 322 号《关于核准建信全球资源股票型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《建信全球资源股票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 2012 年 5 月 28 日起至 2012 年 6 月 21 日止。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 498,213,122.75 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 211 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信全球资源股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 498,237,044.50 份基金份额,其中认购资金利息折合 23,921.75 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,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外资产托管人为境外资产托管人为摩根大通银行香港分行(JPMorgan Chase Bank, National Association, Hong Kong Branch),境外投资顾问为信安环球投资有限公司(Principal Global Investors, LLC)。根据建信基金于 2012 年 10 月 17 日发布的公告及中国银行股份有限公司托管及投资者服务部《关于变更建信全球资源股票型基金境外托管人的函》(中银托(函) 2012]81 号),中国银行股份有限公司决定自 2012 年 10 月 15 日起将本基金的境外托管人由摩根大通银行香港分行(JPMorgan Chase Bank, National Association, Hong Kong Branch)变更为德意志银行新加坡分行(Deutsche Bank AG, Singapore Branch)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信全球资源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全球证券市场中具有良好流动性的金融工具,包括股票和其他权益类证券、现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具。其中,股票及其他权益类证券包括普通股、优先股、存托凭证、公募股票型基金等;现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具,中长期政府债

券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币市场基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券，以及中国证监会认可的金融衍生产品等。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%，股票资产中投资于资源类相关行业的比例不低于 80%。本基金的业绩比较基准为 50%×MSCI 全球能源行业净总收益指数收益率(MSCI ACWI Energy Net Total Return Index) +50%×MSCI 全球原材料行业净总收益指数收益率(MSCI ACWI Material Net Total Return Index)。

#### 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”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信全球资源股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 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》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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	1,973,034.52
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	1,973,034.52

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,519,191.74	10,577,732.83	1,058,541.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	972,273.10	1,035,809.12	63,536.02
其他	-	-	-
合计	10,491,464.84	11,613,541.95	1,122,077.11

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	223.13
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	223.13

**6.4.7.6 其他资产**

无

**6.4.7.7 应付交易费用**

无

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	185.71
预提费用	283,862.33
合计	284,048.04

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	12,939,360.18	12,939,360.18
本期申购	9,297,067.16	9,297,067.16
本期赎回(以“-”号填列)	-8,826,480.77	-8,826,480.77
- 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	13,409,946.57	13,409,946.57

#### 6.4.7.10 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	20,827.64	377,029.40	397,857.04
本期利润	1,210,764.90	-327,881.35	882,883.55
本期基金份额交易产生的变动数	714,260.49	-141,538.57	572,721.92
其中：基金申购款	1,347,082.41	-146,972.89	1,200,109.52
基金赎回款	-632,821.92	5,434.32	-627,387.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,945,853.03	-92,390.52	1,853,462.51

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	2,450.01
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	-
其他	0.01
合计	2,450.02

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	12,575,704.22

减：卖出股票成本总额	11,202,561.06
买卖股票差价收入	1,373,143.16

#### 6.4.7.13 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

无。

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

无

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无

##### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

##### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

##### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

无

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	112,498.79
基金投资产生的股利收益	6,917.71

合计	119,416.50
----	------------

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-327,881.35
——股票投资	-381,683.67
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	53,802.32
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-327,881.35

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	7,897.18
合计	7,897.18

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。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	15,634.07
银行间市场交易费用	-
合计	15,634.07

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	29,752.78

信息披露费	148,768.56
银行汇划费	809.34
合计	179,330.68

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至报表批准报出日，本基金未存在资产负债表日后发生的利润分配、基金拆分、基金转型等非调整事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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、注册登记机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
德意志银行新加坡分行（Deutsche Bank AG, Singapore Branch）	境外资产托管人

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
德意志银行	39,523.12	0.17%	2,462,606.74	3.25%

**6.4.10.1.2 权证交易**

无

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
德意志银行	6.76	0.05%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
德意志银行	2,219.20	3.26%	-	-

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 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	92,623.11
其中：支付销售机构的客户维护费	26,915.93	132,806.98

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。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	18,010.12	63,322.81

注：支付基金托管人中国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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

##### 6.4.10.4.2 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

无

#### 6.4.10.5 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,471,047.32	2,450.01	6,516,324.48	15,160.89
德意志银行新加坡分行	501,987.20	-	2,527,344.96	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人德意志银行新加坡分行保管，存放于中国银行的存款按约定利率计息。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

## 6.4.11 利润分配情况

### 6.4.11.1 利润分配情况

无

## 6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程  
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督  
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金通过全球化的资产配置和组合管理，优选资源类相关行业的股票进行投资，在控制投  
资风险的同时追求基金资产长期增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、  
监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的  
督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

### 6.4.13.2 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。

本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的如附注 6.4.13.4.3.1 所示，与债券投资相关的信用风险不重大（上年末：同）。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

无

#### **6.4.13.3 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 6.4.12 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 6.4.13.4.1.1 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。

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无

#### **6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,973,034.52	-	-	-	1,973,034.52
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	11,613,541.95	11,613,541.95
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	-	-	-	223.13	223.13
应收股利	-	-	-	16,359.76	16,359.76
应收申购款	-	-	-	2,252,629.13	2,252,629.13
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,973,034.52	-	-	13,882,753.97	15,855,788.49
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	-	-	-	178,932.78	178,932.78
应付赎回款	-	-	-	111,145.34	111,145.34
应付管理人报酬	-	-	-	15,281.74	15,281.74
应付托管费	-	-	-	2,971.51	2,971.51
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	-	-	-	284,048.04	284,048.04
负债总计	-	-	-	592,379.41	592,379.41
利率敏感度缺口	1,973,034.52	-	-	-13,290,374.56	15,263,409.08
上年度末 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	1,206,122.39	-	-	-	1,206,122.39
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	12,629,312.66	12,629,312.66
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	-	-	-	56.08	56.08
应收股利	-	-	-	18,767.83	18,767.83
应收申购款	-	-	-	13,189.34	13,189.34
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,206,122.39	-	-	-12,661,325.91	13,867,448.30
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	-	-	-	189,486.49	189,486.49
应付管理人报酬	-	-	-	20,904.90	20,904.90
应付托管费	-	-	-	4,064.84	4,064.84
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	-	-	-	315,774.85	315,774.85
负债总计	-	-	-	530,231.08	530,231.08
利率敏感度缺口	1,206,122.39	-	-	-12,131,094.83	13,337,217.22

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大

影响（上年末：同）。

#### 6.4.13.4.2 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30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	520,695.47	-	-	520,695.47
交易性金融资产	11,613,541.95	-	-	11,613,541.95
应收股利	15,309.03	-	1,050.73	16,359.76
资产合计	12,149,546.45	-	1,050.73	12,150,597.18
以外币计价的负债				
应付证券清算款	178,932.78	-	-	178,932.78
负债合计	178,932.78	-	-	178,932.78
资产负债表外汇风险敞口净额	11,970,613.67	-	1,050.73	11,971,664.40
项目	上年度末 2013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	787,176.61	-	-	787,176.61
交易性金融资产	12,629,312.66	-	-	12,629,312.66
应收股利	13,716.56	-	5,051.27	18,767.83
应收利息	8.54	-	-	8.54
资产合计	13,430,214.37	-	5,051.27	13,435,265.64
以外币计价的负债				
-	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	13,430,214.37	-	5,051.27	13,435,265.64

##### 6.4.13.4.2.2 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（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	所有外币相对人民币 贬值 5%	-598,582.22	-671,763.28
	所有外币相对人民币 升值 5%	598,582.22	671,763.28

#### 6.4.13.4.3 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。本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 60%，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%，股票资产中投资于资源类相关行业的比例不低于 80%。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013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	10,577,732.83	69.30	12,055,800.45	90.39
交易性金融资产—基金投资	1,035,809.12	6.79	573,512.21	4.30
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	11,613,541.95	76.09	12,629,312.66	94.69

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

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（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	700,623.42	546,825.91
业绩比较基准下降 5%	-700,623.42	-546,825.91	

**6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

无

**6.4.14 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) 各层次金融工具公允价值

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 11,613,541.95 元，无属于第二层级或第三层级的余额(2013 年 6 月 30 日：第一层级 29,473,244.73 元，无属于第二层级或第三层级的余额)。

## (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本会计期间及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级

未发生重大变动。

(iv) 第三层次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	10,577,732.83	66.71
	其中：普通股	7,561,185.72	47.69
	存托凭证	3,016,547.11	19.02
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	1,035,809.12	6.53
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	1,973,034.52	12.44
8	其他各项资产	2,269,212.02	14.31
9	合计	15,855,788.49	100.00

### 7.2 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	10,326,029.29	67.65
英国	251,703.54	1.65

合计	10,577,732.83	69.30
----	---------------	-------

### 7.3 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 (%)
必需消费品	531,118.61	3.48
能源	5,185,869.58	33.98
金融	243,360.66	1.59
医疗保健	256,113.75	1.68
工业	245,491.43	1.61
信息技术	120,588.73	0.79
材料	3,462,223.71	22.68
公用事业	532,966.36	3.49
合计	10,577,732.83	69.30

注: 以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

### 7.4 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	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	US30231G1022	纽约证券交易所	美国	1,078	667,782.09	4.38
2	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	US20825C1045	纽约证券交易所	美国	1,139	600,799.20	3.94
3	BASF SE-SPON ADR	巴斯夫欧洲公司	US0552625057	美国OTC市场	美国	657	470,938.39	3.09
4	BP PLC-SPONS ADR	碧辟公司	US0556221044	纽约证券交易所	美国	1,395	452,761.48	2.97

5	CHEVRON CORP	雪佛龙 德士古	US1667641005	纽约 证券 交易 所	美国	534	428,934.45	2.81
6	ROYAL DUTCH SHELL PLC-ADR	荷兰皇 家壳牌	US7802591070	纽约 证券 交易 所	美国	700	374,748.59	2.46
7	BHP BILLITON LTD-SPON ADR	必和必 拓有限 公司	US0886061086	纽约 证券 交易 所	美国	885	372,725.86	2.44
8	SUNCOR ENERGY INC	森科能 源公司	CA8672241079	纽约 证券 交易 所	美国	1,387	363,801.59	2.38
9	LYONDELLBASELL INDU-CL A	利安德 巴塞尔 工业公 司	NL0009434992	纽约 证券 交易 所	美国	598	359,290.91	2.35
10	DOW CHEMICAL CO/THE	陶氏化 学	US2605431038	纽约 证券 交易 所	美国	1,133	358,733.96	2.35
11	SASOL LTD-SPONSORED ADR	沙索有 限公司	US8038663006	纽约 证券 交易 所	美国	927	337,199.53	2.21
12	CANADIAN NATURAL RESOURCES	加拿大 自然资 源有限 公司	CA1363851017	纽约 证券 交易 所	美国	1,163	328,518.48	2.15
13	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	杜邦	US2635341090	纽约 证券 交易 所	美国	757	304,797.90	2.00
14	TOTAL SA-SPON ADR	道达尔	US89151E1091	纽约 证券 交易 所	美国	579	257,210.42	1.69
15	CIMAREX ENERGY CO	-	US1717981013	纽约 证券 交易 所	美国	288	254,212.04	1.67
16	TATA STEEL LTD-GDR REG S	塔塔钢	US87656Y4061	伦敦	英国	4,686	251,703.54	1.65

		铁有限公司		国际交易所				
17	FLOTEK INDUSTRIES INC	Flotek 工业公司	US3433891021	纽约证券交易所	美国	1,180	233,491.38	1.53
18	MARATHON OIL CORP	马拉松石油	US5658491064	纽约证券交易所	美国	821	201,653.84	1.32
19	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	US6745991058	纽约证券交易所	美国	315	198,910.49	1.30
20	FREEPORT-MCMORAN COPPER	自由港迈克墨伦铜矿公司	US35671D8570	纽约证券交易所	美国	875	196,505.05	1.29
21	PATTERSON-UTI ENERGY INC	-	US7034811015	纳斯达克证券交易所	美国	858	184,451.84	1.21
22	EASTMAN CHEMICAL CO	伊士曼化工	US2774321002	纽约证券交易所	美国	327	175,745.20	1.15
23	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF 工业控股股份有限公司	US1252691001	纽约证券交易所	美国	114	168,712.36	1.11
24	VECTREN CORPORATION	-	US92240G1013	纽约证券交易所	美国	636	166,310.18	1.09
25	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	国际香料	US4595061015	纽约证券交易所	美国	255	163,611.57	1.07
26	AVISTA CORP	-	US05379B1070	纽约证券交易所	美国	781	161,074.89	1.06
27	BAKER HUGHES INC	贝克休	US0572241075	纽约	美国	343	157,120.05	1.03

		斯		证券交易所				
28	CNOOC LTD-ADR	中国海洋石油	US1261321095	纽约证券交易所	美国	137	151,129.57	0.99
29	WESTLAKE CHEMICAL CORP	韦斯特莱克化学公司	US9604131022	纽约证券交易所	美国	293	151,000.05	0.99
30	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	-	US0394831020	纽约证券交易所	美国	541	146,827.40	0.96
31	AMGEN INC	安进公司	US0311621009	纳斯达克证券交易所	美国	194	141,291.55	0.93
32	HOST HOTELS & RESORTS INC	HOST 酒店及度假酒吧公司	US44107P1049	纽约证券交易所	美国	1,003	135,829.40	0.89
33	WHITING PETROLEUM CORP	怀汀石油公司	US9663871021	纽约证券交易所	美国	274	135,290.84	0.89
34	CVS CAREMARK CORP	-	US1266501006	纽约证券交易所	美国	286	132,628.65	0.87
35	MOLSON COORS BREWING CO -B	莫尔胜-康胜酿造公司	US60871R2094	纽约证券交易所	美国	288	131,411.99	0.86
36	APERAM-NY REGISTRY SHARES	-	US03754H1041	美国 OTC 市场	美国	622	128,933.03	0.84
37	CANADIAN NATL RAILWAY CO	加拿大国家铁路公司	CA1363751027	纽约证券交易所	美国	317	126,817.45	0.83
38	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	宣威威廉斯公司	US8243481061	纽约证券	美国	99	126,034.51	0.83

		司		交易 所				
39	MICROSOFT CORP	微软	US5949181045	纳斯达克 证券交易 所	美国	470	120,588.73	0.79
40	ALTRIA GROUP INC	高特利 集团公 司	US02209S1033	纽约 证券交 易所	美国	466	120,250.57	0.79
41	AECOM TECHNOLOGY CORP	-	US00766T1007	纽约 证券交 易所	美国	599	118,673.98	0.78
42	HCA HOLDINGS INC	-	US40412C1018	纽约 证券交 易所	美国	331	114,822.20	0.75
43	NATIONAL GRID PLC-SP ADR	英国国 家电网	US6362743006	纽约 证券交 易所	美国	244	111,665.44	0.73
44	AVIVA PLC - SPON ADR	英杰华 保险	US05382A1043	纽约 证券交 易所	美国	993	107,531.26	0.70
45	NISOURCE INC	-	US65473P1057	纽约 证券交 易所	美国	388	93,915.85	0.62
46	VERMILION ENERGY INC	-	CA9237251058	纽约 证券交 易所	美国	213	91,345.08	0.60

注：所用证券代码采用 ISIN 代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 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	PATTERSON-UTI ENERGY INC	US7034811015	289,610.76	2.17
2	EXXON MOBIL CORP	US30231G1022	287,960.65	2.16
3	BP PLC-SPONS ADR	US0556221044	285,972.76	2.14
4	SUNCOR ENERGY INC	CA8672241079	265,178.74	1.99
5	BHP BILLITON LTD-SPON ADR	US0886061086	263,802.44	1.98
6	TATA STEEL LTD-GDR REG S	US87656Y4061	262,707.75	1.97
7	DOW CHEMICAL CO/THE	US2605431038	256,786.34	1.93
8	CONOCOPHILLIPS	US20825C1045	237,386.23	1.78
9	FREEMPORT-MCMORAN COPPER	US35671D8570	222,004.08	1.66
10	ROYAL DUTCH SHELL PLC-ADR	US7802591070	221,431.01	1.66
11	LYONDELLBASELL INDU-CL A	NL0009434992	217,030.14	1.63
12	VECTREN CORPORATION	US92240G1013	211,570.45	1.59
13	BAYTEX ENERGY CORP	CA07317Q1054	211,205.17	1.58
14	BASF SE-SPON ADR	US0552625057	203,077.90	1.52
15	CANADIAN NATL RAILWAY CO	CA1363751027	197,974.83	1.48
16	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	US4595061015	183,403.70	1.38
17	CHEVRON CORP	US1667641005	181,125.73	1.36
18	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	US0394831020	176,863.82	1.33
19	EASTMAN CHEMICAL CO	US2774321002	176,102.33	1.32
20	CNOOC LTD-ADR	US1261321095	173,546.03	1.30

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。

## 7.5.2 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	BASF SE-SPON ADR	US0552625057	475,953.18	3.57
2	EXXON MOBIL CORP	US30231G1022	431,674.99	3.24
3	CHEVRON CORP	US1667641005	409,751.38	3.07
4	CONOCOPHILLIPS	US20825C1045	371,516.21	2.79
5	TECK RESOURCES LTD-CLS B	CA8787422044	366,862.27	2.75
6	FLOTEK INDUSTRIES INC	US3433891021	351,757.98	2.64
7	WESTLAKE CHEMICAL CORP	US9604131022	345,313.54	2.59
8	VINCI S. A.-UNSPONS ADR	US9273201015	342,948.71	2.57
9	REPSOL SA-SPONSORED ADR	US76026T2050	331,575.19	2.49
10	CNOOC LTD-ADR	US1261321095	324,790.51	2.44
11	HESS CORP	US42809H1077	322,607.37	2.42
12	AXA -SPONS ADR	US0545361075	317,590.29	2.38
13	LYONDELLBASELL INDU-CL A	NL0009434992	310,332.52	2.33
14	CIMAREX ENERGY CO	US1717981013	295,070.34	2.21

15	CANADIAN NATURAL RESOURCES	CA1363851017	268,699.99	2.01
16	ROCHE HOLDINGS LTD-SPONS ADR	US7711951043	248,471.00	1.86
17	UNS ENERGY CORP	US9031191052	231,406.19	1.74
18	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	US2635341090	227,072.41	1.70
19	BAYTEX ENERGY CORP	CA07317Q1054	218,522.77	1.64
20	OM GROUP INC	US6708721005	215,346.64	1.61

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。

### 7.5.3 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	10,106,177.11
卖出收入（成交）总额	12,575,704.22

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。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

### 7.7 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。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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金融衍生品投资明细

无。

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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	ISHARES S&P GLBL ENERGY SECT	ETF	交易型开放 式指数	BlackRock Fund Advisors	626,921.10	4.11
2	ISHARES S&P GLOBAL	ETF	交易型开放 式指数	BlackRock Fund	408,888.02	2.68

	MATERIALS			Advisors		
--	-----------	--	--	----------	--	--

### 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

#### 7.11.3 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	16,359.76
4	应收利息	223.13
5	应收申购款	2,252,629.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,269,212.02

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.11.5 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

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
750	17,879.93	-	-	13,409,946.57	100.00%

## 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（2012年6月26日）基金份额总额	498,237,044.50
本报告期期初基金份额总额	12,939,360.18
本报告期基金总申购份额	9,297,067.16
减：本报告期基金总赎回份额	8,826,480.77
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	13,409,946.57

## § 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

<p>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。</p>
--

<p>2014年2月14日本基金的托管银行中国银行股份有限公司公告，自2014年2月13日起，</p>
---

陈四清先生担任该行行长。报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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	
JP MORGAN SECURITIES, INC	-	636,163.69	2.80%	288.98	1.99%	-
BARCLAYS CAPITAL INC	-	2,587,337.36	11.41%	1,160.42	7.99%	-
KNIGHT SECURITIES	-	216,803.12	0.96%	437.96	3.02%	-
JEFFERIES & CO., INC	-	234,983.81	1.04%	96.20	0.66%	-
RBC CAPITAL MARKETS-ALGORITHMS	-	578,485.84	2.55%	98.88	0.68%	-
ING BANK	-	170,607.72	0.75%	508.00	3.50%	-
CITIGROUP-PROGRAM	-	2,890,924.96	12.75%	1,173.44	8.08%	-
MERRILL LYNCH	-	5,423,505.73	23.91%	6,024.13	41.50%	-
BANK OF NEW YORK	-	3,086,757.16	13.61%	1,212.66	8.35%	-

MACQUARIE CAPITAL	-	305,346.36	1.35%	365.86	2.52%	-
MORGAN STANLEY	-	4,307,265.13	18.99%	1,411.03	9.72%	-
ITG-CSA	-	33,236.69	0.15%	10.75	0.07%	-
UBS ALGORITHMS	-	231,238.19	1.02%	142.36	0.98%	-
STIFEL NICOLAUS-PROGRAM	-	1,916,411.28	8.45%	1,570.15	10.82%	-
DEUTSCHE BANK-ALGORITHMS	-	39,523.12	0.17%	6.76	0.05%	-
CREDIT SUISSE	-	23,291.18	0.10%	6.76	0.05%	-
NOMURA-PROGRAMS	-	-	-	-	-	-
FIDELITY-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS&CO., INC	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-
WELLS FARGO SECURITIES, LLC	-	-	-	-	-	-
Longbow SECURITIES, LLC	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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、本报告期内新增的服务券商 RBC CAPITAL MARKETS-ALGORITHMS，本报告期无剔除的服务券商。

### 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		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
JP MORGAN SECURITIES, INC	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC	-	-	-	-	-	-	-	-
KNIGHT SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO., INC	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC CAPITAL MARKETS-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
ING BANK	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	-	-
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPITAL	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG-CSA	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
STIFEL NICOLAUS-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	408,494.60	100.00%
DEUTSCHE BANK-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA-PROGRAMS	-	-	-	-	-	-	-	-
FIDELITY-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS&CO., INC	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
WELLS FARGO SECURITIES, LLC	-	-	-	-	-	-	-	-

LONGBOW SECURITIES, LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 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	2013 年第四季度基金产品风险评 价结果	指定媒体和/或公司 网站	2014 年 2 月 18 日
2	2013 年第三季度基金产品风险评 价结果	指定媒体和/或公司 网站	2014 年 2 月 18 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信全球资源股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信全球资源股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信全球资源股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信全球资源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。

### 11.2 存放地点

本基金管理人的住所。

### 11.3 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 8 月 25 日