

建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金 2014 年年度报告摘要

2014 年 12 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 31 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	建信潜力新蓝筹股票
基金主代码	000756
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 10 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	603,314,497.79 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于股票市场，通过股票精选和组合投资，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值，力争创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势等因素对各个行业及上市公司的影响以及核心股票资产的估值水平，综合分析证券市场的走势，主动判断市场时机，通过稳健的资产配置，合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	85%×沪深 300 指数收益率+15%×中债总财富（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	汤嵩彦
	联系电话	010-66228888	95559
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95559
传真		010-66228001	021-62701216

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年9月10日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	90,618,102.94
本期利润	139,247,276.78
加权平均基金份额本期利润	0.1066
本期基金份额净值增长率	14.10%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.1023
期末基金资产净值	688,590,722.32
期末基金份额净值	1.141

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

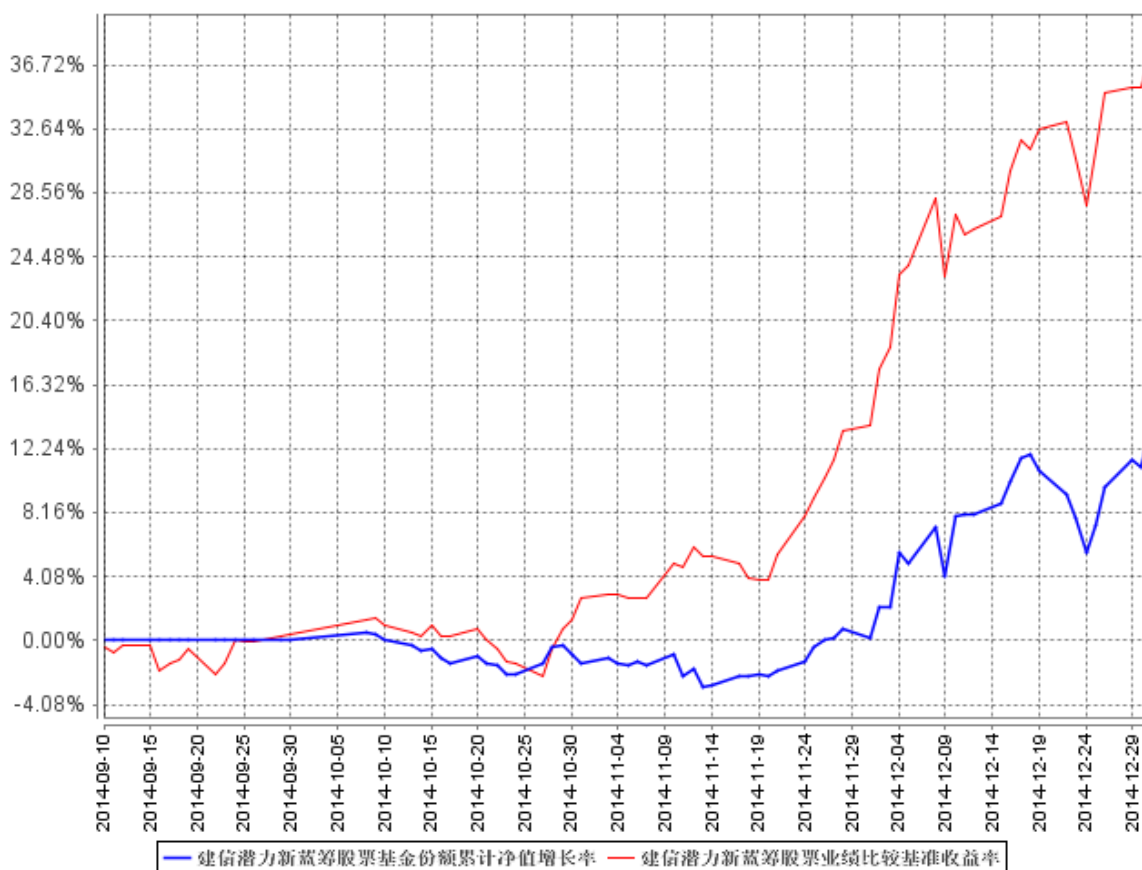
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	13.99%	1.16%	37.29%	1.40%	-23.30%	-0.24%
自基金合同生效起至今	14.10%	1.05%	37.86%	1.32%	-23.76%	-0.27%

注：本基金业绩比较基准为： $85\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+15\% \times$ 中债总财富（总值）指数收益率。沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制的，从上海和深圳股票市场中选取的 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。该指数为具有良好的市场代表性、能够反映 A 股市场整体走势的指数。中债总财富（总值）指数是由中央国债登记结算有限责任公司推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中债总财富（总值）指数为掌握我国债券市场价格波动幅度和变动趋势、测算债券投资回报率水平提供了很好的依据。

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

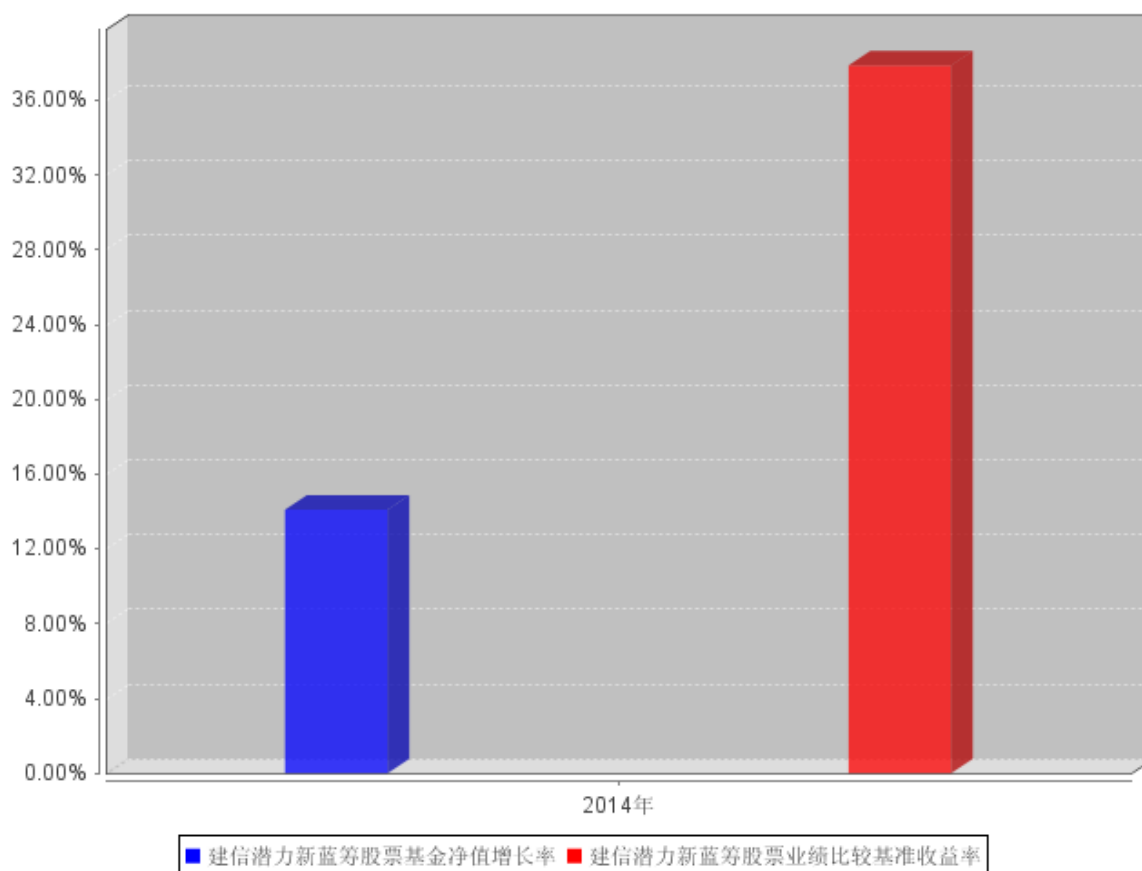
建信潜力新蓝筹股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2014 年 9 月 10 日生效，截止报告期末仍处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信潜力新蓝筹股票自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2014 年 9 月 10 日生效，成立当年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2014 年 9 月 10 日(基金合同生效日)起至 2014 年 12 月 31 日止期间，未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

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

部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司，并在上海设立了子公司—建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“最可信赖、持续领先的综合性、专业化资产管理公司”。

截至 2014 年 12 月 31 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金（LOF）、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信创新中国股票型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金共 46 只开放式基金，管理的基金资产规模共计为 1215.98 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		
许杰	本基金的基金经理	2014 年 9 月 10 日	-	12	硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任青岛市纺织

				<p>品进出口公司部门经理、美国迪斯尼公司金融分析员，2002 年 3 月加入泰达宏利基金管理有限公司，历任研究员、研究部副总经理、基金经理等职，2006 年 12 月 23 日至 2011 年 9 月 30 日任泰达宏利风险预算混合基金基金经理，2010 年 2 月 8 日至 2011 年 9 月 30 日任泰达宏利首选企业股票基金基金经理，2008 年 9 月 26 日至 2011 年 9 月 30 日任泰达宏利集利债券基金基金经理。2011 年 10 月加入我公司，2012 年 3 月 21 日起任建信恒稳价值混合型证券投资基金基金经理，2012 年 8 月 14 日起任建信社会责任股票型证券投资基金基金经理；2014 年 9 月 10 日起任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金经理；2015 年 2 月 3 日起任建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</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》、《公开募集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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下（日内、3日内、5日内）管理的不同投资组合（包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下：

当时间窗为 1 日时，配了 4659 对投资组合，有 1083 对投资组合未通过 T 检验，其中 371 对投资组合的正溢价率占优频率小于 55%，其它 712 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中，其中 682 对平均溢价率低于 2%，其它 30 对平均溢价率超过 2%的投资组合中，其中 29 对贡献率未超过 5%，另外 1 对是由于组合规模较小所致，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为 3 日时，配了 5257 对投资组合，有 1290 对投资组合未通过 T 检验，但其中 356 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 934 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合中，

其中 924 对平均溢价率低于 5%，其它 10 对平均溢价率超过 5%的投资组合中，其贡献率均未超过 5%，因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为；

当时间窗为 5 日时，配了 5340 对投资组合，有 1615 对投资组合未通过 T 检验，但其中 484 对投资组合的溢价率占优频率均小于 55%，其它 1131 对正溢价率占优频率大于 55%的投资组合，其中 1129 对平均溢价率低于 10%，其它 2 对平均溢价率超过 10%的投资组合中，其贡献率均未超过 5%，同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 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 9 月份成立后选择了快速建仓的策略。一方面围绕将来引导中国经济发展的创新和服务类行业进行布局，例如创新类的新能源、节能环保、软件、军工等行业以及服务类的医药、医疗、文化等行业，另外一方面，在第四季度尤其是在央行降息后，由于认识到政府稳增长政策力度加大将会促使经济“软着陆”，预计同宏观经济密切相关的蓝筹行业将会有估值修复的机会，因此本基金加大了蓝筹股的配置。

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 14.1%，波动率 1.05%，业绩比较基准收益率 37.86%，波动率 1.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前的各项经济数据来看，中国经济仍处于比较疲弱的阶段。去年底的中央经济工作会议将“努力保持经济稳定增长”放在今年经济工作的首要任务。预计稳增长的政策还会有力度，股市的流动性应该比较充裕，对股票市场形成支撑。

在各地限购等行政政策取消，央行降息以及首套房贷款认定等措施的刺激下，我们跟踪的 30 个大中城市的销量在 14 年 11 月份实现同比转正，12 月份实现 20%以上的正增长。预计房地产销量在连续两年的低迷之后，会进入一个恢复性正常化的过程。中国经济目前处于双引擎推动的状态，一方面，创新和服务为代表的新经济持续处于快速增长状态，另外一方面，房地产的复苏将带动以房地产产业链为代表的旧经济实现恢复性增长。因此，预计 2015 年中国经济进入小周期复苏的概率较大。

从大的经济发展阶段来看，中国经济现在处于“新常态”阶段，即“正从高速增长转向中高

速增长，经济发展方式正从规模速度型粗放增长转向质量效率型集约增长，经济结构正从增量扩能为主转向调整存量、做优增量并存的深度调整，经济发展动力正从传统增长点转向新的增长点”。因此，代表中国经济发展方向的创新类和服务类的行业将继续有表现的机会。

本基金将在 2015 年维持较高的股票资产的配置，一方面，将积极配置受益于经济企稳估值偏低的蓝筹股，另一方面，继续配置战略新兴产业和服务业，挖掘其中最具有竞争力的公司，但是由于此类大多数公司的估值已经处于较高的水平，出现了泡沫化的倾向，因此选择个股的重要性更加突出。

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

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

本基金本报告期内未实施利润分配，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

2014 年度，托管人在建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的托管过程中，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、托管协议，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

2014 年度，建信基金管理有限责任公司在建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2014 年度，由建信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 审计了后附的建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金(以下简称“建信潜力新蓝筹股票基金”)的财务报表,包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了普华永道中天审字(2015)第 20596 号标准无保留意见审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款		540,891.22
结算备付金		101,492,615.09
存出保证金		545,339.16
交易性金融资产		606,313,605.63
其中：股票投资		606,313,605.63
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		24,064,565.51
应收利息		79,989.44
应收股利		-
应收申购款		2,078,874.42
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		735,115,880.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日
负债：		
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		-
应付赎回款		41,051,978.75
应付管理人报酬		1,254,373.21
应付托管费		209,062.17
应付销售服务费		-
应付交易费用		3,730,141.22
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		279,602.80
负债合计		46,525,158.15
所有者权益：		
实收基金		603,314,497.79
未分配利润		85,276,224.53
所有者权益合计		688,590,722.32
负债和所有者权益总计		735,115,880.47

注：1. 报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.141 元，基金份额总额 603,314,497.79 份；

2. 本财务报表的实际编制期间为 2014 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2014 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		152,929,395.00
1. 利息收入		7,709,043.65
其中：存款利息收入		1,530,445.11
债券利息收入		4,935.90
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		6,173,662.64
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		93,847,130.11
其中：股票投资收益		94,363,571.81
基金投资收益		-
债券投资收益		-516,441.70
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		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		48,629,173.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		2,744,047.40
减：二、费用		13,682,118.22

1. 管理人报酬		6,089,947.82
2. 托管费		1,014,991.28
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		6,393,367.71
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用		183,811.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		139,247,276.78
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		139,247,276.78

注：本基金基金合同自 2014 年 9 月 10 日起生效，至 2014 年 12 月 31 日未满一年。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,467,496,662.54	-	1,467,496,662.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	139,247,276.78	139,247,276.78
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）	-864,182,164.75	-53,971,052.25	-918,153,217.00
其中：1. 基金申购款	44,726,663.24	3,644,099.78	48,370,763.02
2. 基金赎回款	-908,908,827.99	-57,615,152.03	-966,523,980.02
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）	603,314,497.79	85,276,224.53	688,590,722.32

注：本基金基金合同自 2014 年 9 月 10 日起生效，至 2014 年 12 月 31 日未满一年。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信潜力新蓝筹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[2014]第 702 号《关于核准建信潜力新蓝筹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《建信潜力新蓝筹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 1,466,728,443.99 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 498 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,467,496,662.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 768,218.55 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行或上市的股票(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、股指期货、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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金持有的股票占基金资产的比例为 80%-95%,债券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-20%,其中每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金投资于潜力新蓝筹股票的资产不低于非现金基金资产的比例为 80%。本基金的业绩比较基准为 85%X 沪深 300 指数收益率+15%X 中债总财富(总值)指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2015 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的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 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2014 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、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中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号-公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号-合营

安排》、《企业会计准则第 41 号-在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号-长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号-职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号-财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号-合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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。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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1

股票交易

无。

债券交易

无。

债券回购交易

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年9月10日(基金合同生效日)至2014 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,089,947.82
其中：支付销售机构的客户维护费	3,330,142.45

注：1、支付基金管理人建信基金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 X1.50%/当年天数；

2、本基金基金合同自 2014 年 9 月 10 日起生效，至 2014 年 12 月 31 日未满一年；

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,014,991.28

注：1、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 0.25%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 X0.25%/当年天数；

2、本基金基金合同自 2014 年 9 月 10 日起生效，至 2014 年 12 月 31 日未满一年。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	540,891.22	214,584.65	-	-

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按约定利率计息；

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2014 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债

债表中的“结算备付金”科目中单独列示；

3. 本基金基金合同自 2014 年 9 月 10 日起生效，至 2014 年 12 月 31 日未满一年。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

7.4.9 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.9.2 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
600580	卧龙电气	2014 年 12 月 8 日	重大事项停牌	10.48	2015 年 1 月 14 日	11.12	2,069,975	21,107,871.64	21,693,338.00	-
002437	誉衡药业	2014 年 11 月 21 日	重大事项停牌	23.75	2015 年 1 月 26 日	26.13	600,000	15,112,255.66	14,250,000.00	-
600584	长电科技	2014 年 11 月 3 日	重大资产重组	11.13	2015 年 1 月 14 日	12.24	1,259,901	14,273,754.21	14,022,698.13	-

注：本基金截至 2014 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末，无银行间市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

7.4.10 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最

低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 556,347,569.50 元，属于第二层次的余额为 49,966,036.13 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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和债券的公允价值列入第一层次；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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	606,313,605.63	82.48
	其中：股票	606,313,605.63	82.48

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	102,033,506.31	13.88
7	其他各项资产	26,768,768.53	3.64
8	合计	735,115,880.47	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	232,020,848.73	33.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,119,246.32	2.78
F	批发和零售业	21,302,104.66	3.09
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	-	-
J	金融业	175,483,713.02	25.48
K	房地产业	132,095,208.26	19.18
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	26,292,484.64	3.82
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	606,313,605.63	88.05

注：以上行业分类以 2014 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

8.3 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	880,000	65,744,800.00	9.55
2	000002	万科A	4,149,992	57,684,888.80	8.38
3	600048	保利地产	3,800,000	41,116,000.00	5.97
4	600690	青岛海尔	1,839,982	34,150,065.92	4.96
5	601628	中国人寿	940,000	32,101,000.00	4.66
6	600089	特变电工	2,239,891	27,729,850.58	4.03
7	002573	国电清新	949,873	26,292,484.64	3.82
8	600580	卧龙电气	2,069,975	21,693,338.00	3.15
9	600685	广船国际	599,961	21,370,610.82	3.10
10	000963	华东医药	404,906	21,302,104.66	3.09

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于公司网站 www.ccbfund.cn 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601318	中国平安	132,572,022.66	19.25
2	600030	中信证券	111,656,786.95	16.22
3	000002	万科A	84,975,967.67	12.34
4	600893	航空动力	79,232,910.18	11.51
5	601628	中国人寿	75,263,555.43	10.93
6	600036	招商银行	73,424,598.78	10.66
7	000961	中南建设	66,768,019.82	9.70
8	600372	中航电子	61,178,253.87	8.88
9	000024	招商地产	60,755,208.59	8.82
10	002104	恒宝股份	60,471,609.32	8.78
11	600690	青岛海尔	53,223,338.43	7.73
12	600837	海通证券	52,437,126.42	7.62
13	601098	中南传媒	51,585,371.43	7.49

14	600089	特变电工	50,839,694.24	7.38
15	002051	中工国际	46,130,996.82	6.70
16	002100	天康生物	45,460,006.30	6.60
17	002008	大族激光	40,294,113.34	5.85
18	600376	首开股份	39,227,614.62	5.70
19	601988	中国银行	37,350,908.50	5.42
20	002063	远光软件	35,810,718.66	5.20
21	002658	雪迪龙	35,648,936.56	5.18
22	601377	兴业证券	35,573,842.76	5.17
23	600572	康恩贝	34,354,255.30	4.99
24	600340	华夏幸福	33,611,648.44	4.88
25	000963	华东医药	31,414,213.74	4.56
26	000826	桑德环境	30,250,960.97	4.39
27	002653	海思科	30,136,625.48	4.38
28	000541	佛山照明	29,739,373.23	4.32
29	600970	中材国际	29,738,891.00	4.32
30	600580	卧龙电气	29,571,516.59	4.29
31	002366	丹甫股份	29,391,520.28	4.27
32	600118	中国卫星	29,272,589.16	4.25
33	000733	振华科技	29,188,605.37	4.24
34	002465	海格通信	28,246,307.79	4.10
35	002111	威海广泰	28,042,854.28	4.07
36	002073	软控股份	27,872,219.11	4.05
37	600048	保利地产	27,719,369.24	4.03
38	601169	北京银行	27,449,109.35	3.99
39	002508	老板电器	26,904,906.85	3.91
40	000905	厦门港务	26,271,040.50	3.82
41	600000	浦发银行	26,200,000.00	3.80
42	300058	蓝色光标	22,498,995.02	3.27
43	002573	国电清新	22,337,658.37	3.24
44	600566	洪城股份	21,813,844.77	3.17
45	000793	华闻传媒	21,566,702.83	3.13
46	000402	金融街	21,356,015.23	3.10
47	600685	广船国际	20,689,062.78	3.00
48	002580	圣阳股份	20,489,635.28	2.98
49	002065	东华软件	20,465,597.88	2.97

50	002672	东江环保	19,651,798.05	2.85
51	601668	中国建筑	19,530,000.00	2.84
52	002437	誉衡药业	15,112,255.66	2.19
53	300137	先河环保	14,911,199.97	2.17
54	002230	科大讯飞	14,833,969.55	2.15
55	300274	阳光电源	14,826,874.83	2.15
56	300010	立思辰	14,718,101.42	2.14
57	002019	亿帆鑫富	14,691,994.46	2.13
58	300003	乐普医疗	14,677,847.74	2.13
59	600999	招商证券	14,547,200.00	2.11
60	000651	格力电器	14,276,847.82	2.07
61	600584	长电科技	14,273,754.21	2.07
62	000776	广发证券	13,881,603.75	2.02
63	600109	国金证券	13,849,045.50	2.01
64	601800	中国交建	13,783,980.00	2.00

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。

8.4.2 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	600030	中信证券	140,743,069.21	20.44
2	601318	中国平安	93,254,245.92	13.54
3	600893	航空动力	79,157,824.69	11.50
4	601628	中国人寿	73,372,709.12	10.66
5	000961	中南建设	68,230,574.14	9.91
6	600372	中航电子	59,939,884.89	8.70
7	600036	招商银行	54,999,028.71	7.99
8	000024	招商地产	54,542,157.47	7.92
9	601098	中南传媒	53,226,212.22	7.73
10	600837	海通证券	53,012,120.35	7.70
11	002104	恒宝股份	52,126,172.46	7.57
12	601988	中国银行	43,573,226.71	6.33
13	601377	兴业证券	42,899,486.51	6.23
14	002100	天康生物	42,270,593.98	6.14
15	600376	首开股份	40,805,732.75	5.93
16	000002	万科A	38,432,159.15	5.58

17	002063	远光软件	36,895,034.93	5.36
18	600572	康恩贝	32,471,236.43	4.72
19	002111	威海广泰	30,194,479.11	4.38
20	600340	华夏幸福	30,011,762.95	4.36
21	002051	中工国际	29,931,293.80	4.35
22	002073	软控股份	29,689,100.48	4.31
23	600089	特变电工	29,493,334.34	4.28
24	000826	桑德环境	29,309,947.51	4.26
25	000905	厦门港务	29,271,761.22	4.25
26	600118	中国卫星	28,123,100.69	4.08
27	601169	北京银行	27,998,085.05	4.07
28	600970	中材国际	27,305,203.75	3.97
29	600000	浦发银行	26,400,000.00	3.83
30	000541	佛山照明	26,030,575.28	3.78
31	000733	振华科技	24,170,666.30	3.51
32	002008	大族激光	23,190,485.24	3.37
33	300058	蓝色光标	22,964,272.28	3.33
34	600999	招商证券	22,311,357.91	3.24
35	002465	海格通信	21,996,750.60	3.19
36	002580	圣阳股份	21,368,776.87	3.10
37	000793	华闻传媒	21,331,032.10	3.10
38	600690	青岛海尔	21,069,392.46	3.06
39	002065	东华软件	20,935,210.15	3.04
40	002658	雪迪龙	20,816,545.43	3.02
41	600566	洪城股份	20,514,090.31	2.98
42	601668	中国建筑	20,397,521.93	2.96
43	002672	东江环保	17,500,297.17	2.54
44	002508	老板电器	17,072,620.80	2.48
45	300137	先河环保	15,333,636.09	2.23
46	300003	乐普医疗	14,465,606.77	2.10
47	300010	立思辰	14,244,810.73	2.07
48	002230	科大讯飞	14,185,134.82	2.06
49	601818	光大银行	13,815,374.32	2.01
50	601800	中国交建	13,796,485.12	2.00

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。

8.4.3 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	2,422,925,248.24
卖出股票收入（成交）总额	1,959,604,388.26

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。

8.5 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。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	545,339.16
2	应收证券清算款	24,064,565.51
3	应收股利	-
4	应收利息	79,989.44
5	应收申购款	2,078,874.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,768,768.53

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600580	卧龙电气	21,693,338.00	3.15	重大事项停牌

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
7,312	82,510.19	27,083,226.20	4.49%	576,231,271.59	95.51%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	79,760.08	0.0132%

9.3 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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、该只基金的基金经理未持有该只基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年9月10日）基金份额总额	1,467,496,662.54
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	44,726,663.24
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	908,908,827.99
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	603,314,497.79

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

我公司于2014年3月21日召开2014年度第一次临时股东会，会议决定解聘江先周先生公司董事职务并聘任杨文升先生为公司董事。

同日，我公司召开第三届董事会第六次会议，会议选举杨文升先生为公司董事长，江先周先生不再担任公司董事长。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为人民币 90,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	663,696,169.88	15.15%	604,228.85	15.35%	-
齐鲁证券	3	599,489,078.63	13.68%	543,121.49	13.79%	-
长江证券	2	556,812,628.20	12.71%	497,405.52	12.63%	-
华创证券	1	540,990,572.33	12.35%	492,518.73	12.51%	-
中投证券	3	510,969,768.91	11.66%	454,382.69	11.54%	-
光大证券	1	455,297,528.31	10.39%	403,140.10	10.24%	-
高华证券	1	340,048,439.71	7.76%	309,580.38	7.86%	-
瑞银证券	1	323,270,755.61	7.38%	283,316.13	7.20%	-
安信证券	2	235,292,418.72	5.37%	209,954.02	5.33%	-
中信证券	2	156,190,062.30	3.56%	139,804.89	3.55%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	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、本基金为 2014 年新成立基金，与同一托管行托管的基金共用原有交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	430,000,000.00	4.59%	-	-
长江证券	23,883,293.50	49.47%	600,000,000.00	6.40%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	24,394,799.30	50.53%	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	144,000,000.00	1.54%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	8,203,500,000.00	87.48%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司
2015 年 3 月 31 日