

# 建信新兴市场优选股票型证券投资基金 2014 年年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	46
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	46
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	47
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	58
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	61

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	61
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细 .....	61
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	61
8.11 投资组合报告附注 .....	61
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	62
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>62</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>63</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
11.4 基金投资策略的改变 .....	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	69
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>69</b>
12.1 备查文件目录 .....	69
12.2 存放地点 .....	70
12.3 查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	建信新兴市场优选股票型证券投资基金
基金简称	建信新兴市场股票（QDII）
基金主代码	539002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月21日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	62,570,371.66份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	蒋松云
	联系电话	010-66228888	(010) 66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	(010) 66105798
注册地址		北京市西城区金融大街7	北京市西城区复兴门内大街55

	号英蓝国际金融中心 16 层	号
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100033	100140
法定代表人	杨文升	姜建清

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Principal Global Investors, LLC.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	信安环球投资有限公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	140 Broadway New York
办公地址		801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490	140 Broadway New York
邮政编码		IA 50392-0490	NY10005

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ccbfund.cn">http://www.ccbfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	1,351,118.99	-1,034,492.70	860,056.30

本期利润	-1,588,942.86	-8,937,912.32	20,775,781.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0193	-0.0810	0.1416
本期加权平均净值利润率	-2.10%	-8.79%	15.27%
本期基金份额净值增长率	-3.52%	-7.82%	16.02%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2014 年末</b>	<b>2013 年末</b>	<b>2012 年末</b>
期末可供分配利润	-7,759,772.23	-11,392,995.91	-13,894,246.87
期末可供分配基金份额利润	-0.1240	-0.1191	-0.1065
期末基金资产净值	54,810,599.43	86,876,799.02	128,450,497.37
期末基金份额净值	0.876	0.908	0.985
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2014 年末</b>	<b>2013 年末</b>	<b>2012 年末</b>
基金份额累计净值增长率	-12.40%	-9.20%	-1.50%

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

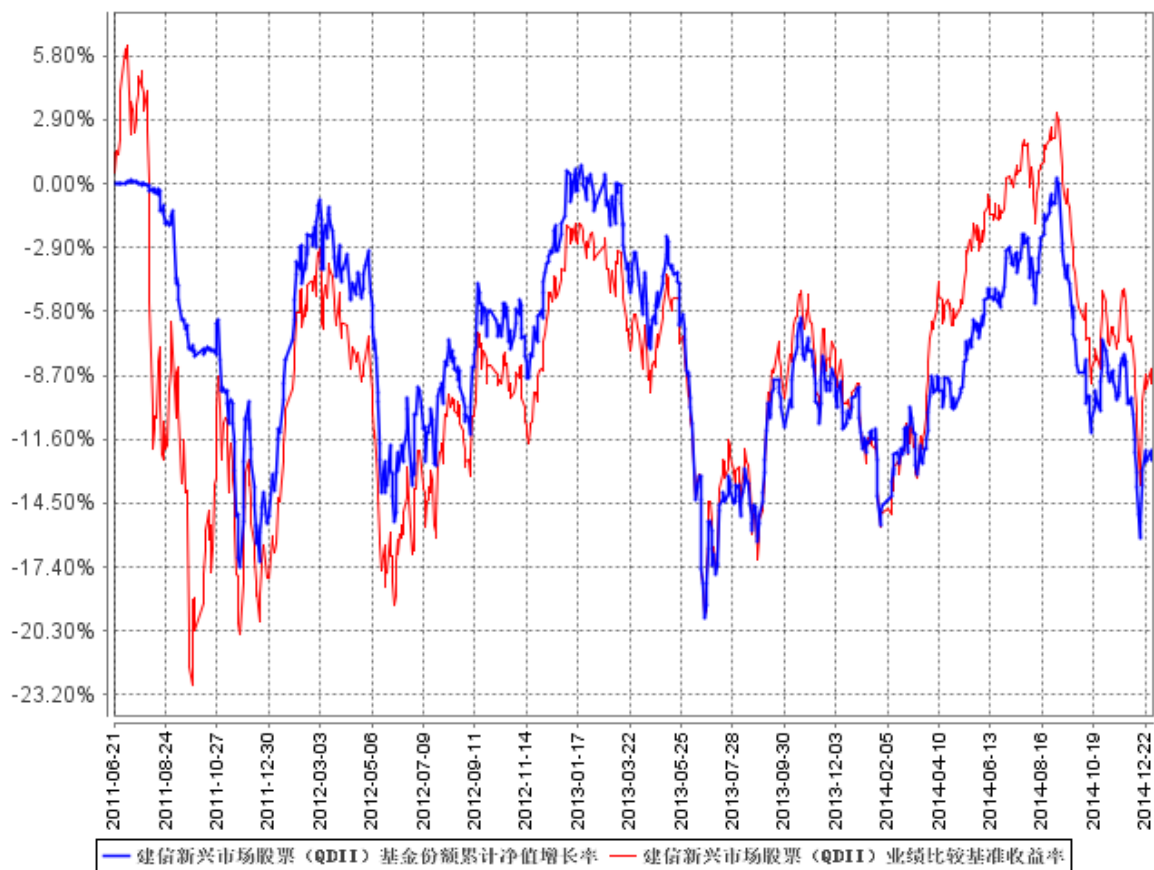
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-4.16%	0.81%	-3.50%	0.86%	-0.66%	-0.05%
过去六个月	-8.08%	0.75%	-7.86%	0.74%	-0.22%	0.01%
过去一年	-3.52%	0.69%	0.24%	0.71%	-3.76%	-0.02%
过去三年	3.18%	0.82%	11.02%	0.86%	-7.84%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-12.40%	0.81%	-8.87%	1.04%	-3.53%	-0.23%

注：同期业绩比较基准以人民币计价。

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

建信新兴市场股票（QDII）基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



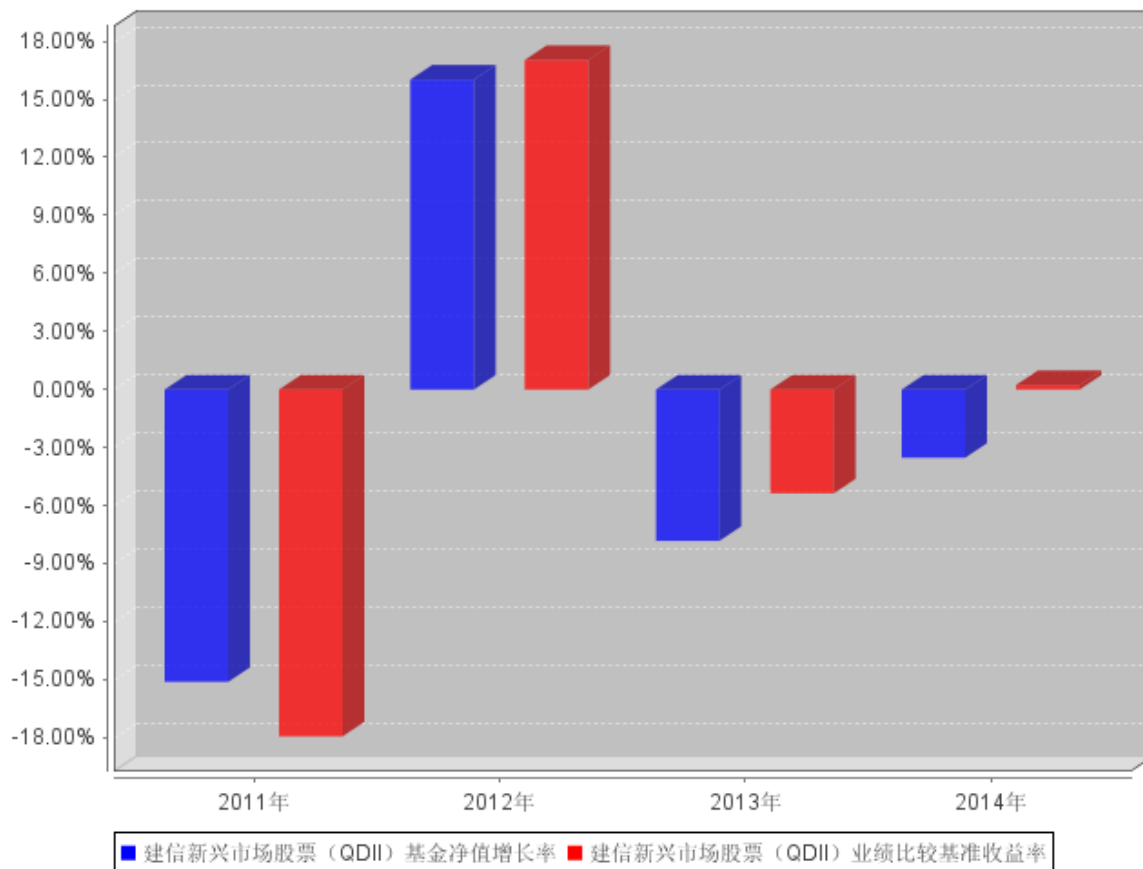
注：1、同期业绩比较基准以人民币计价。

2、本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。



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

建信新兴市场股票（QDII）自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，2011 年净值增长率以实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

自基金合同生效以来未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

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

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

截至 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		
赵英楷	海外投资部总监、本基金的	2011 年 6 月 21 日	-	16	美国哥伦比亚大学商学院 MBA。曾任美国美林证券

	基金经理				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。
--	------	--	--	--	---

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职位	证券从业年限	说明
Mohammed Zaidi	投资组合经理	16	Mohammed Zaidi 是信安环球股票的基金经理。他在新加坡办公，担任全球新兴市场股票策略的共同基金经理及新兴亚洲股票策略负责人。Mohammed 的职业生涯开始于 1997 年，在全球宏观对冲基金管理人 VZB Capital 担任新兴市场分析师及基金经理。他在 2001 年作为新兴市场股票分析师加入信安，专注于基础选股工作，并且是负责信安内部研发的全球研究平台（GRP）初始搭建的核心分析师之一。他专注于将 GRP 调整适用于新兴市场和亚洲股票。在 2006 年离开公司后，他曾经担任 Martin Currie 投资管理公司的新兴市场基金经理和分析师。在那之前服务于该团队的前任雇主

			Scottish Widows 投资合伙公司。他持有麻省理工学院斯隆管理学院 MBA 学位，宾夕法尼亚大学沃顿学院经济学学士学位。
王曦	投资组合经理	13	王曦在信安担任香港和中国投资组合的基金经理，他也是我们的高级投资分析师和大中华区研究团队负责人。王曦的金融职业生涯开始于中国银行总行，担任财务总监执行助理超过 3 年时间，也为该行 IPO 准备工作提供支持。王曦在 2003 年加入信安，担任香港和中国股票市场的基金经理以及亚洲和新兴市场策略的助理基金经理。作为全球研发团队的资深成员，王曦也负责我们全球研究平台（GRP）的模型搭建，特别是亚洲和大中华选股模型。他也曾在建设银行和信安的中国合资公司成立之初时任高级顾问。王曦在 2008 年离开信安，曾在中国平安资产管理公司（香港）担任股票投资总监，也曾任贝莱德亚洲的基金经理。王曦持有爱荷华大学 Tippie 管理学院的 MBA 学位，中国人民大学经济学和国际金融学士学位。他执有特许金融分析师（CFA）资格。
Mihail Dobrinov	投资组合经理	18	Mihail Dobrinov 是信安环球股票的基金经理。他领导新兴市场团队，包括亚洲、拉丁美洲、东欧、中东和非洲的股票市场。他负责监督分散化新兴市场组合和专门的亚洲地区股票策略。在 1995 年，Mihail 最初以国际和新兴市场债务和货币专家身份加入信安。他在 2002 年加入股票团队，并且在 2007 年被任命为新兴市场股票的基金经理。Mihail 的基本研究经验包括许多不同的经济板块，特别专注于工业、原材料和能源公司。他的覆盖领域包括工业和电信板块的公司。Mihail 从 University of Iowa 取得金融 MBA 学位，并从 Sofia University, Bulgaria 取得一个法学学位。他获得了使用特许金融分析师称号的权利并且是 CFA Institute 的成员。

### 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》、《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。

### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.4.1 公平交易制度和控制方法

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

#### 4.4.2 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人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。

#### 4.4.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年度上半年，新兴市场总体表现良好，在经历了 2013 年的调整后，投资人风险偏好上升、流动性因素驱动了一段上涨行情。

2014 年年初，新兴市场经历了一段震荡行情，中国经济增长疲软、中国中央政府加大对影子银行的监管力度，以及一些新兴市场国家出现了新一轮货币贬值等因素导致市场下滑。但市场进入二季度后，投资人风险偏好明显上升，成熟市场经济基本面良好，流动性宽松，为新兴市场提供了比较良好的外部环境。新兴市场的一些区域性事件也推动了市场的上涨，例如乌克兰危机的缓和推动了俄罗斯市场的反弹，印度大选结果极大程度地增强了投资人对印度政府治理腐败、推动经济发展的信心；中国政府也推出了经济刺激政策，中国央行两次“定向降准”，以及中国银监会调整贷存比的计算方法推动了市场的乐观情绪，另外 6 月份中国的经济数据也显示出中国经济正在企稳。

但从 8 月份开始，因乌克兰冲突引发的对俄罗斯制裁措施开始对以德国为首的欧元区经济产生负面影响，并引发市场对全球经济增长前景的担忧，及其对新兴市场经济的影响；同时，国际原油价格从 105 美元/桶的高位下跌到 53 美元/桶，更对依赖大宗商品出口的新兴市场经济体形成较大冲击。另外，受欧元区负利率、欧洲经济放缓、美联储可能明年开始加息的预期与俄罗斯地缘对抗等因素的影响，欧元区资金大量流入美国，引发美元短期大幅升值，也连带引发流动性从新兴市场股市获利撤离。

进入四季度，在原油价格崩塌的驱动下，主要新兴市场股市表现出现较大分化，其中俄罗斯、巴西市场继续大幅下跌，中国、印度市场则在震荡中大幅上涨。

综观全年，新兴市场主要国家的经济基本面依然疲软，但下半年石油价格的崩盘引发了新兴市场各经济体的较大分化，俄罗斯、巴西等对原材料出口依赖较大的国家经济受到很大负面影响，例如俄罗斯工业 PMI 指标下跌至 48.9，巴西的工业 PMI 指标在 50 分位荣枯线起伏，同时货币也出现大幅贬值；而印度、中国是石油的进口国，能源价格的下跌有利于企业利润率的控制和提高和通货膨胀的控制。其中印度的通胀率在近几年一直维持在 8%至 10%的高位，但近期显著下降到 4.38%，工业 PMI 也连续几个月上行，12 月达到 54.5 的近期高位。中国经济受益于石油价格下跌，但市场的上涨更多反映的是政策利好。沪港通、央行降息、中央各部委密集推出定向刺激政策，极大地鼓舞了市场信心，中国市场，尤其是 A 股市场迎来了近几年最大涨幅。

#### 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-3.52%，波动率 0.69%，业绩比较基准收益率 0.24%，波动率 0.71%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本年度新兴市场经受全球宏观因素的较大冲击，在经济总体表现不佳、经济增长水平处于历史的低位情况下，各国均急需进行结构调整，股市表现出现较大分化。我们看到中国正在向新兴产业快速升级；印度新政府就任后得到市场较普遍的认可，提升了未来改革预期和长期投资的信心。虽然新兴市场国家经济结构改革难以在短期内实质性完成，但市场已经对佼佼者如中国、印度做出了较大的估值修复，我们预期未来中国货币环境处于宽松通道，估值水平依然较低，在 2015 年将会继续多次降准、降息；定向刺激和国企改革预期也会带来较多结构性机会。未来中国市场的最大不确定性可能来自经济增速是否能够企稳，以及企业盈利水平能否恢复。印度新政府的锐意改革，已经为经济增长注入活力，同时在能源、大宗商品价格大幅降低的有利宏观环境下，印度通胀水平大幅下降，为货币政策的放松提供打开了空间，另外经济先行指标持续好转，对市场会进一步形成支持。虽然印度市场在经历了 14 年较大涨幅后估值略高，并且市场存在一定技术性回调需求，但我们仍然持谨慎乐观态度。

同时我们看到，新兴市场经济体中，还有相当一部分国家对能源、大宗商品出口较大依存度。但目前石油价格走势仍存在较大不确定性，美国、欧洲、欧佩克、和俄罗斯等国家间的地缘政治博弈很大程度会影响未来石油市场的供需表现，其向下和向上的空间都较大，这种不确定性大幅增加了市场震荡的幅度和投资管理的难度，我们对俄罗斯和巴西市场等商品出口国持谨慎态度。综上所述，我们认为未来市场区域性、结构性机会更值得关注。我们将继续加强对行业、个股的研究，在控制风险的前提下为投资人创造超额收益。

#### 4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2014 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司监察稽核部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总经理和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施：

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备季度监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由监察稽核部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司 2014 年度监察稽核工作计划，实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发“三条底线”违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。



7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与外方股东信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的核心价值观，树立并坚持诚信、规范、专业、创新的经营理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定

价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

#### **4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定，本基金本报告期未达到利润分配条件，未进行利润分配。

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

2014 年，本基金托管人在对建信新兴市场优选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2014 年，建信新兴市场优选股票型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信新兴市场优选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，建信新兴市场优选股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信新兴市场优选股票型证券投资基金 2014 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2015)第 20567 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信新兴市场优选股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的建信新兴市场优选股票型证券投资基金（以下简称“建信新兴市场股票基金”）的财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是建信新兴市场股票基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述建信新兴市场股票基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了建信新兴市场股票基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况。

注册会计师的姓名	薛竞	陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼	
审计报告日期	2015 年 3 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：建信新兴市场优选股票型证券投资基金

报告截止日：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	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,510,487.84	5,501,866.15
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	50,568,353.31	82,238,150.17
其中：股票投资		46,453,686.28	79,830,219.29
基金投资		4,114,667.03	2,407,930.88
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,368,486.84	-
应收利息	7.4.7.5	564.54	343.70
应收股利		133,922.44	31,104.28
应收申购款		79,258.68	4,822.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	402,863.03	7,536.01
资产总计		56,063,936.68	87,783,823.20
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-

应付赎回款		307,699.05	403,382.59
应付管理人报酬		92,809.11	137,806.59
应付托管费		18,046.19	26,795.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	834,782.90	339,039.24
负债合计		1,253,337.25	907,024.18
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	62,570,371.66	95,646,248.95
未分配利润	7.4.7.10	-7,759,772.23	-8,769,449.93
所有者权益合计		54,810,599.43	86,876,799.02
负债和所有者权益总计		56,063,936.68	87,783,823.20

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.876 元，基金份额总额 62,570,371.66 份。

## 7.2 利润表

会计主体：建信新兴市场优选股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		744,466.85	-5,784,764.31
1. 利息收入		17,804.73	28,268.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	17,804.73	28,268.02
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）		3,643,002.19	2,581,613.59
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,535,178.17	216,292.39
基金投资收益	7.4.7.13	273,715.27	-29,960.20
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	1,963.13	28,356.56
股利收益	7.4.7.17	1,832,145.62	2,366,924.84
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-2,940,061.85	-7,903,419.62

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		21,497.20	-507,517.74
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	2,224.58	16,291.44
<b>减：二、费用</b>		2,333,409.71	3,153,148.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,358,673.19	1,836,401.75
2. 托管费	7.4.10.2.2	264,186.56	357,078.20
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	318,844.80	567,453.91
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	391,705.16	392,214.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,588,942.86	-8,937,912.32
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,588,942.86	-8,937,912.32

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信新兴市场优选股票型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1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）	95,646,248.95	-8,769,449.93	86,876,799.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-1,588,942.86	-1,588,942.86
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）	-33,075,877.29	2,598,620.56	-30,477,256.73
其中：1. 基金申购款	3,244,901.52	-287,253.66	2,957,647.86
2. 基金赎回款	-36,320,778.81	2,885,874.22	-33,434,904.59
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）	62,570,371.66	-7,759,772.23	54,810,599.43
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	130,406,284.31	-1,955,786.94	128,450,497.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-8,937,912.32	-8,937,912.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-34,760,035.36	2,124,249.33	-32,635,786.03
其中：1. 基金申购款	1,721,066.60	-138,884.67	1,582,181.93
2. 基金赎回款	-36,481,101.96	2,263,134.00	-34,217,967.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	95,646,248.95	-8,769,449.93	86,876,799.02

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

建信新兴市场优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 316 号《关于核准建信新兴市场优选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 426,628,617.18 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 426,647,075.13

份基金份额，其中认购资金利息折合 18,457.95 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman&Co.)，境外投资顾问为信安环球投资有限公司(Principal Global Investors, LLC.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为新兴市场经济体证券市场及其他证券市场具有良好流动性的金融工具，包括股票和其他权益类证券、现金、债券及中国证监会允许投资其他金融工具。其中股票及其他权益类证券包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、存托凭证、公募股票基金等。现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；中长期政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品等。其中，本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例不低于 60%；现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具市值占基金资产的比例不高于 40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金不低于 80%的股票资产投资于注册地或主要经济活动在新兴市场国家或地区的公司或组织发行的证券，“主要经济活动在新兴市场国家或地区”指主营业务收入的至少 50%来自于新兴市场国家或地区；“新兴市场国家或地区”指本基金业绩比较基准指数包含的国家或地区。本基金的业绩比较基准为摩根士丹利资本国际新兴市场指数(MSCI Emerging Markets Index(Net Total Return))。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 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》、《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。



## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

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

#### (2) 金融负债的分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

（2）目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地

区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
活期存款	3,510,487.84	5,501,866.15
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,510,487.84	5,501,866.15

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	44,396,702.63	46,453,686.28	2,056,983.65
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	3,751,560.20	4,114,667.03	363,106.83
其他	-	-	-
合计	48,148,262.83	50,568,353.31	2,420,090.48
项目	上年度末 2013年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	74,694,592.28	79,830,219.29	5,135,627.01
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	2,183,405.56	2,407,930.88	224,525.32
其他	-	-	-
合计	76,877,997.84	82,238,150.17	5,360,152.33

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
应收活期存款利息	564.54	343.70
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	564.54	343.70

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应收未起息外汇交易	402,863.03	7,536.01
合计	402,863.03	7,536.01

**7.4.7.7 应付交易费用**

无。

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	207.78	47.58
预提费用	431,450.54	331,450.54
应付未起息外汇交易	403,124.58	7,541.12
合计	834,782.90	339,039.24

**7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	95,646,248.95	95,646,248.95
本期申购	3,244,901.52	3,244,901.52
本期赎回（以“-”号填列）	-36,320,778.81	-36,320,778.81
- 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	62,570,371.66	62,570,371.66

**7.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,392,995.91	2,623,545.98	-8,769,449.93
本期利润	1,351,118.99	-2,940,061.85	-1,588,942.86
本期基金份额交易产生的变动数	3,478,735.88	-880,115.32	2,598,620.56
其中：基金申购款	-338,379.54	51,125.88	-287,253.66
基金赎回款	3,817,115.42	-931,241.20	2,885,874.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,563,141.04	-1,196,631.19	-7,759,772.23

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
活期存款利息收入	17,775.40	28,264.01
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	-	3.72
其他	29.33	0.29
合计	17,804.73	28,268.02

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
卖出股票成交总额	101,645,268.20	129,417,417.16
减：卖出股票成本总额	100,110,090.03	129,201,124.77
买卖股票差价收入	1,535,178.17	216,292.39

**7.4.7.13 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	8,642,063.50	11,435,207.77
减：卖出/赎回基金成本总额	8,368,348.23	11,465,167.97
基金投资收益	273,715.27	-29,960.20

**7.4.7.14 债券投资收益****7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

无。

**7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无。



**7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益**

无。

**7.4.7.15 贵金属投资收益****7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**7.4.7.16 衍生工具收益****7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
卖出权证成交总额	1,963.13	28,356.56
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	1,963.13	28,356.56

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,717,641.87	2,329,209.83
基金投资产生的股利收益	114,503.75	37,715.01
合计	1,832,145.62	2,366,924.84

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
1. 交易性金融资产	-2,940,061.85	-7,903,419.62
——股票投资	-3,078,643.36	-7,883,153.87
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	138,581.51	-20,265.75
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-2,940,061.85	-7,903,419.62

**7.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
基金赎回费收入	2,224.58	16,291.44
合计	2,224.58	16,291.44

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

**7.4.7.20 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日

交易所市场交易费用	318,844.80	567,453.91
银行间市场交易费用	-	-
合计	318,844.80	567,453.91

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014 年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013 年12月31日
审计费用	72,000.00	72,000.00
信息披露费	300,000.00	299,998.49
银行划款手续费	4,101.09	4,252.77
债券托管账户维护费	-	-
其他	15,604.07	15,962.89
合计	391,705.16	392,214.15

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司
布朗兄弟哈里曼银行 (Brown Brothers Harriman & Co.)	境外资产托管人
信安环球投资有限公司 (Principal Global Investors, LLC.)（“信安环球”）	境外投资顾问

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1****股票交易**

无。

**债券交易**

无。

**债券回购交易**

无。

**基金交易**

无。

**7.4.10.1.2 权证交易**

无。

**7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

无。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,358,673.19	1,836,401.75
其中：支付销售机构的客户维护费	379,264.74	510,596.71

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

日管理人报酬=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 X 1.8%/ 当年天数。

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	264,186.56	357,078.20

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

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2011 年 6 月 21 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	9,999,138.89	9,999,138.89
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,138.89	9,999,138.89
期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.98%	10.45%

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

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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
	中国工商银行	2,027,923.97	16,669.10	2,582,954.24
布朗兄弟哈里曼银行	1,482,563.87	1,106.30	2,918,911.91	1,426.56

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间未发生其他需要说明的关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌而于期末流通受限证券。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按信用评级列示的债券投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年末未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除 7.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于



市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 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	3,510,487.84	-	-	-	3,510,487.84
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	50,568,353.31	50,568,353.31
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,368,486.84	1,368,486.84
应收利息	-	-	-	564.54	564.54
应收股利	-	-	-	133,922.44	133,922.44
应收申购款	15,959.55	-	-	63,299.13	79,258.68
其他资产	-	-	-	402,863.03	402,863.03
资产总计	3,526,447.39	-	-	52,537,489.29	56,063,936.68
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	-	-	-	307,699.05	307,699.05
应付管理人报酬	-	-	-	92,809.11	92,809.11
应付托管费	-	-	-	18,046.19	18,046.19
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	-	-	-	834,782.90	834,782.90
负债总计	-	-	-	1,253,337.25	1,253,337.25
利率敏感度缺口	3,526,447.39	-	-	-51,284,152.04	54,810,599.43
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	5,501,866.15	-	-	-	5,501,866.15
结算备付金	-	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-82,238,150.17	82,238,150.17
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	343.70	343.70
应收股利	-	-	31,104.28	31,104.28
应收申购款	-	-	4,822.89	4,822.89
其他资产	-	-	7,536.01	7,536.01
资产总计	5,501,866.15	-	-82,281,957.05	87,783,823.20
负债				
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	403,382.59	403,382.59
应付管理人报酬	-	-	137,806.59	137,806.59
应付托管费	-	-	26,795.76	26,795.76
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	339,039.24	339,039.24
负债总计	-	-	907,024.18	907,024.18
利率敏感度缺口	5,501,866.15	-	-81,374,932.87	86,876,799.02

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，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）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2014 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	1,495,177.10	1.86	23,991.09	1,519,170.05
交易性金融资产	17,682,863.68	13,591,346.56	19,294,143.07	50,568,353.31
应收股利	41,556.33	61,058.54	31,307.57	133,922.44
应收利息	5.69	-	-	5.69
应收证券清算款	965,362.26	403,124.58	-	1,368,486.84
其它资产	402,863.03	-	-	402,863.03
资产合计	20,587,828.09	14,055,531.54	19,349,441.73	53,992,801.36
以外币计价的负债				
其它负债	-	403,124.58	-	403,124.58
负债合计	-	403,124.58	-	403,124.58
资产负债表外汇风险敞口净额	20,587,828.09	13,652,406.96	19,349,441.73	53,589,676.78
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	4,734,852.06	1.11	49,353.17	4,784,206.34
交易性金融资产	37,435,402.98	15,286,450.85	29,516,296.34	82,238,150.17
应收股利	13,240.21	1,597.62	12,746.45	27,584.28
应收利息	28.17	-	-	28.17
其它资产	7,536.01	-	-	7,536.01
资产合计	42,191,059.43	15,288,049.58	29,578,395.96	87,057,504.97
以外币计价的负债				
其它负债	-	-	7,541.12	7,541.12
负债合计	-	-	7,541.12	7,541.12
资产负债表外汇风险敞口净额	42,191,059.43	15,288,049.58	29,570,854.84	87,049,963.85

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2014 年 12 月 31 日)	上年度末 (2013 年 12 月 31 日)
	所有外币相对人民币贬值 5%	-2,679,483.84	-4,352,498.19
	所有外币相对人民币升值 5%	2,679,483.84	4,352,498.19

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 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	46,453,686.28	84.75	79,830,219.29	91.89
交易性金融资产-基金投资	4,114,667.03	7.51	2,407,930.88	2.77
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	50,568,353.31	92.26	82,238,150.17	94.66

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
		业绩比较基准上升 5%	2,457,961.04
业绩比较基准下降 5%	-2,457,961.04	-3,779,140.76	

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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 50,568,353.31 元，无属于第二层次或第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层次 81,910,364.84 元，第二层次 327,785.33 元，无第三层次)。

(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) 第三层级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(2013 年 12 月 31 日：同)。

(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	46,453,686.28	82.86

	其中：普通股	33,192,666.19	59.21
	存托凭证	11,454,685.90	20.43
	优先股	1,806,334.19	3.22
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	4,114,667.03	7.34
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	3,510,487.84	6.26
8	其他各项资产	1,985,095.53	3.54
9	合计	56,063,936.68	100.00

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	13,342,050.89	24.34
中国香港	9,476,679.53	17.29
韩国	7,160,422.12	13.06
英国	4,520,347.35	8.25
巴西	3,493,876.05	6.37
南非	3,048,174.36	5.56
马来西亚	1,342,408.67	2.45
墨西哥	1,131,307.20	2.06
泰国	920,996.76	1.68
印尼	688,145.19	1.26
波兰	668,265.03	1.22
菲律宾	478,711.04	0.87
希腊	182,302.09	0.33
合计	46,453,686.28	84.75

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
非必需消费品	4,450,831.97	8.12
必需消费品	3,561,532.56	6.50
能源	2,511,880.89	4.58
金融	13,797,652.05	25.17
医疗保健	1,734,646.70	3.16
工业	1,710,960.62	3.12
信息技术	10,718,235.83	19.56
材料	1,474,655.82	2.69
电信服务	3,431,322.67	6.26
公用事业	3,061,967.17	5.59
合计	46,453,686.28	84.75

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

#### 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	台积电	US8740391003	纽约证券交易所	美国	17,276	2,365,831.07	4.32
2	HON HAI PRECISION-GDR REG S	鸿海精密工业股份有限公司	US4380902019	伦敦国际交易所	英国	67,819	2,328,062.83	4.25
3	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	CNE1000001Z5	香港证券交易所	中国香港	603,000	2,078,759.23	3.79
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	三星电子有限责任公司	KR7005930003	韩国证券交易所	韩国	232	1,726,722.59	3.15
5	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	塔塔汽车有限公司	US8765685024	纽约证券交易所	美国	4,266	1,103,662.49	2.01
6	ICICI BANK LTD-SPON ADR	ICICI 银行有限公司	US4510461040	纽约证券交易所	美国	14,916	1,054,180.10	1.92

7	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	KYG875721634	香港 证券 交易 所	中国香 港	10,900	967,351.84	1.76
8	CHINA MOBILE LTD	中国移动	HK0941009539	香港 证券 交易 所	中国香 港	13,000	928,105.56	1.69
9	AXIS BANK LTD- GDR REG S	Axis 银行 有限公司	US05462W1099	伦敦 国际 交易 所	英国	3,684	879,153.44	1.60
10	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	-	BRITUBACNPR1	巴西 证券 交易 所	巴西	9,398	748,887.85	1.37
11	SK HYNIX INC	海力士半 导体公司	KR7000660001	韩国 证券 交易 所	韩国	2,730	731,138.56	1.33
12	NASPERS LTD-N SHS	纳斯派斯 有限公司	ZAE000015889	南非 证券 交易 所	南非	832	666,708.85	1.22
13	WIPRO LTD-ADR	-	US97651M1099	纽约 证券 交易 所	美国	9,610	665,656.64	1.21
14	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	新韩金融 集团	KR7055550008	韩国 证券 交易 所	韩国	2,581	643,462.78	1.17
15	KOREA ELECTRIC POWER CORP	韩国电力	KR7015760002	韩国 证券 交易 所	韩国	2,485	595,138.34	1.09
16	FIRSTRAND LTD	第一兰特 有限公司	ZAE000066304	南非 证券 交易 所	南非	22,190	593,493.71	1.08
17	WELLS FARGO & CO	富国银行	US9497461015	纽约 证券 交易 所	美国	1,760	590,380.70	1.08
18	GAIL INDIA LTD-REG	GAIL 印度	US36268T2069	伦敦	英国	2,271	589,200.96	1.07



	S GDR	有限公司		国际交易所				
19	SANLAM LTD	桑勒姆有限公司	ZAE000070660	南非证券交易所	南非	15,634	578,807.31	1.06
20	MICROSOFT CORP	微软	US5949181045	纳斯达克证券交易所	美国	2,001	568,739.33	1.04
21	LUKOIL OAO-SPON ADR	卢克石油公司	US6778621044	美国OTC市场	美国	2,268	532,217.16	0.97
22	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	波兰人寿和财产保险公司	PLPZU0000011	波兰证券交易所	波兰	592	495,583.19	0.90
23	TELEKOM MALAYSIA BHD	马来西亚电信有限公司	MYL486300006	马来西亚证券交易所	马来西亚	40,100	482,813.86	0.88
24	HUADIAN POWER INTL CORP-H	华电国际	CNE1000003D8	香港证券交易所	中国香港	86,000	461,331.18	0.84
25	MTN GROUP LTD	MTN集团有限公司	ZAE000042164	南非证券交易所	南非	3,815	446,742.88	0.82
26	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	农业银行	CNE100000Q43	香港证券交易所	中国香港	144,000	445,301.34	0.81
27	CHINA MERCHANTS BANK-H	招商银行	CNE1000002M1	香港证券交易所	中国香港	28,500	437,515.19	0.80
28	BANCO BRADESCO SA-PREF	巴西布拉德斯科银行股份有限公司	BRBBDACACNPR8	巴西证券交易所	巴西	5,400	436,024.52	0.80
29	DOCTOR REDDYS	-	US2561352038	纽约	美国	1,377	425,084.79	0.78

	LAB-ADR			证券交易所				
30	SK TELECOM	SK 电信集团公司	KR7017670001	韩国证券交易所	韩国	280	420,878.26	0.77
31	PETROCHINA CO LTD-H	中国石油	CNE1000003W8	香港证券交易所	中国香港	60,000	407,056.92	0.74
32	KROGER CO	克罗格公司	US5010441013	纽约证券交易所	美国	1,018	399,973.21	0.73
33	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	盘谷银行	TH0001010014	泰国证券交易所	泰国	10,900	397,090.96	0.72
34	KT&G CORP	-	KR7033780008	韩国证券交易所	韩国	901	384,567.97	0.70
35	GRUMA S. A. B. -B	GRUMA 可变动资本额股份有限公司	MXF4948K1056	墨西哥证券交易所	墨西哥	5,800	378,792.00	0.69
36	HYUNDAI MOTOR CO	现代汽车有限公司	KR7005380001	韩国证券交易所	韩国	392	371,566.40	0.68
37	POSCO	浦项制铁公司	KR7005490008	韩国证券交易所	韩国	240	370,848.48	0.68
38	JBS SA	JBS 股份公司	BRJBSSACNOR8	巴西证券交易所	巴西	13,600	350,802.09	0.64
39	KROTON EDUCACIONAL SA	KROTON 教育公司	BRKROTACNOR9	巴西证券交易所	巴西	9,800	349,834.81	0.64
40	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中国电信	CNE1000002V2	香港证券	中国香港	94,000	336,658.16	0.61

				交易所				
41	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	US3755581036	纳斯达克 证券交易所	美国	580	334,530.63	0.61
42	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	-	BRBBSEACNOR5	巴西 证券交易所	巴西	4,400	325,892.20	0.59
43	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	DISCOVER 金融服务 公司	US2547091080	纽约 证券交易所	美国	811	324,994.71	0.59
44	HDFC BANK LTD-ADR	HDFC 银行	US40415F1012	纽约 证券交易所	美国	1,041	323,271.36	0.59
45	CIELO SA	-	BRCIELACNOR3	巴西 证券交易所	巴西	3,300	316,696.08	0.58
46	TENAGA NASIONAL BHD	马来西亚 国家能源 有限公司	MYL534700009	马来 西亚 证券 交易 所	马来 西 亚	13,000	313,956.41	0.57
47	MALAYAN BANKING BHD	马来西亚 银行有限 公司	MYL115500000	马来 西亚 证券 交易 所	马来 西 亚	19,400	311,327.86	0.57
48	AMOREPACIFIC CORP	爱茉莉太 平洋集团	KR7090430000	韩国 证券 交易 所	韩国	25	311,283.89	0.57
49	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	韩国中小 企业银行	KR7024110009	韩国 证券 交易 所	韩国	3,863	305,497.38	0.56
50	BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	巴克莱非 洲集团有 限公司	ZAE000174124	南非 证券 交易 所	南非	3,075	295,993.63	0.54

51	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	墨西哥集团可变动 资本额股 份公司	MXP370841019	墨西哥证 券交 易所	墨西哥	16,400	291,527.40	0.53
52	LENOVO GROUP LTD	联想集团	HK0992009065	香港证 券交 易所	中国香 港	36,000	289,673.06	0.53
53	ALLSTATE CORP	全州保险	US0200021014	纽约证 券交 易所	美国	668	287,146.31	0.52
54	HANA FINANCIAL GROUP	韩亚金融 集团公司	KR7086790003	韩国证 券交 易所	韩国	1,583	284,115.26	0.52
55	CREDICORP LTD	-	BMG2519Y1084	纽约证 券交 易所	美国	282	276,399.88	0.50
56	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	巴西分销 集团公司	BRPCARACNPRO	巴西证 券交 易所	巴西	1,200	272,580.96	0.50
57	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电福新	CNE100001F60	香港证 券交 易所	中国香 港	94,000	270,661.30	0.49
58	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	印尼电信 股份有 限公 司	ID1000129000	印度 尼西 亚证 券交 易所	印尼	190,800	270,033.29	0.49
59	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	中国财险	CNE100000593	香港证 券交 易所	中国香 港	22,000	261,715.51	0.48
60	LG HAUSYS LTD	LG 新型建 材有限 公司	KR7108670001	韩国证 券交 易所	韩国	288	261,680.38	0.48
61	HYOSUNG CORPORATION	晓星株式 会社	KR7004800009	韩国证 券交 易所	韩国	661	253,583.64	0.46

62	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中国神华	CNE1000002R0	香港证券交易所	中国香港	14,000	253,463.93	0.46
63	COWAY CO LTD	豪威有限公司	KR7021240007	韩国证券交易所	韩国	535	252,655.95	0.46
64	KIA MOTORS CORPORATION	起亚汽车公司	KR7000270009	韩国证券交易所	韩国	843	247,282.24	0.45
65	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	世茂房地产	KYG810431042	香港证券交易所	中国香港	18,000	246,222.10	0.45
66	MARRIOTT VACATIONS WORLD	万豪环球度假	US57164Y1073	纽约证券交易所	美国	534	243,562.88	0.44
67	UNIVERSAL ROBINA CORP	环球罗宾娜公司	PHY9297P1004	菲律宾证券交易所	菲律宾	9,010	241,634.82	0.44
68	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	-	MXCFU000001	墨西哥证券交易所	墨西哥	13,300	240,065.66	0.44
69	STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	施泰因霍夫国际控股公司	ZAE000016176	南非证券交易所	南非	7,627	239,610.62	0.44
70	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团控股公司	US01609W1027	纽约证券交易所	美国	374	237,867.31	0.43
71	BDO UNIBANK INC	-	PHY077751022	菲律宾证券交易所	菲律宾	15,780	237,076.22	0.43
72	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	印多福苏克斯股份公司	ID1000057003	印度尼西亚证券交易所	印尼	70,900	236,409.17	0.43

73	DIGI.COM BHD	-	MYL694700005	马来西亚 证券交易所	马来西亚	21,700	234,310.54	0.43
74	BRF SA	-	BRBRFSACN0R8	巴西 证券交易所	巴西	1,600	233,769.80	0.43
75	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际	CNE1000006Z4	香港 证券交易所	中国香港	28,000	231,486.01	0.42
76	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育 用品	KYG040111059	香港 证券交易所	中国香港	21,000	226,957.90	0.41
77	SASOL LTD	沙索有限 公司	ZAE000006896	南非 证券交易所	南非	995	226,817.36	0.41
78	ANTHEM INC	-	US0367521038	纽约 证券交易所	美国	294	226,078.57	0.41
79	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	-	US26138E1091	纽约 证券交易所	美国	515	225,884.11	0.41
80	APPLE INC	苹果公司	US0378331005	纳斯 达克证 券交 易所	美国	334	225,588.68	0.41
81	CHINA VANKE CO LTD-H	万科	CNE100001SR9	香港 证券交易所	中国香港	16,500	225,182.94	0.41
82	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	-	MX01PI000005	墨西 哥证 券交 易所	墨西哥	3,000	220,922.14	0.40
83	CARDINAL HEALTH INC	-	US14149Y1082	纽约 证券 交易 所	美国	422	208,462.46	0.38

				所				
84	MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR	诺里尔斯 克镍业公 司	US46626D1081	伦敦 国际 交易 所	英国	2,373	206,479.90	0.38
85	CNOOC LTD	中国海洋 石油	HK0883013259	香港 证券 交易 所	中国香 港	25,000	205,895.07	0.38
86	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	X5 零售集 团公司	US98387E2054	伦敦 国际 交易 所	英国	2,675	199,693.57	0.36
87	LOWES COS INC	劳氏	US5486611073	纽约 证券 交易 所	美国	473	199,126.95	0.36
88	PTT EXPLORATION & PROD-FOR	PTT 勘探 与生产股 份公司	TH0355A10Z12	泰国 证券 交易 所	泰国	9,500	197,764.83	0.36
89	SHENZHEN INTL HOLDINGS	深圳国际 控股	BMG8086V1467	香港 证券 交易 所	中国香 港	22,000	197,501.49	0.36
90	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国石化	CNE1000002Q2	香港 证券 交易 所	中国香 港	40,000	197,217.50	0.36
91	THAI UNION FROZEN PROD-FOREI	泰国联合 冷冻产品 股份公司	TH0450A10Z16	泰国 证券 交易 所	泰国	11,600	195,125.49	0.36
92	SINOPHARM GROUP CO-H	国药控股 股份公司	CNE100000FN7	香港 证券 交易 所	中国香 港	8,800	190,559.44	0.35
93	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	希腊电信 组织	GRS260333000	希腊 证券 交易 所	希腊	2,687	182,302.09	0.33
94	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	印尼国家 银行股份 公司	ID1000096605	印度 尼西 亚证 券交	印尼	60,300	181,702.73	0.33

				易所				
95	ANGLO AMERICAN PLC	英美公司	GB00B1XZS820	英国 伦敦 交易 所	英国	1,567	179,534.56	0.33
96	NORTHROP GRUMMAN CORP	诺斯洛普 格鲁曼	US6668071029	纽约 证券 交易 所	美国	197	177,670.24	0.32
97	ABBVIE INC	艾伯维有 限公司	US00287Y1091	纽约 证券 交易 所	美国	441	176,588.47	0.32
98	HCA HOLDINGS INC	-	US40412C1018	纽约 证券 交易 所	美国	386	173,342.34	0.32
99	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	唯品会控 股公司	US92763W1036	纽约 证券 交易 所	美国	1,446	172,891.37	0.32
100	KGHM POLSKA MIEDZ SA	波兰铜业 集团公司	PLKGHM000017	波兰 证券 交易 所	波兰	921	172,681.84	0.32
101	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	中国铁建	CNE100000981	香港 证券 交易 所	中国香 港	22,000	171,468.78	0.31
102	HOST HOTELS & RESORTS INC	HOST 酒店 及度假酒 店公司	US44107P1049	纽约 证券 交易 所	美国	1,103	160,429.84	0.29
103	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	US3695501086	纽约 证券 交易 所	美国	188	158,314.19	0.29
104	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	华润电力	HK0836012952	香港 证券 交易 所	中国香 港	10,000	157,774.00	0.29
105	AECOM TECHNOLOGY CORP	-	US00766T1007	纽约 证券 交易 所	美国	837	155,543.08	0.28



106	XEROX CORP	施乐	US9841211033	纽约 证券 交易 所	美国	1,803	152,911.24	0.28
107	EXELON CORP	-	US30161N1019	纽约 证券 交易 所	美国	670	152,017.99	0.28
108	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	公共服务 企业集团	US7445731067	纽约 证券 交易 所	美国	590	149,498.80	0.27
109	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运	CNE1000004F1	香港 证券 交易 所	中国香 港	36,000	146,824.48	0.27
110	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电 子	HK0285041858	香港 证券 交易 所	中国香 港	24,000	141,996.60	0.26
111	CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	-	BRCESPACNPB4	巴西 证券 交易 所	巴西	2,282	140,902.18	0.26
112	TATNEFT-SPONSORED ADR	鞑靼石油 公司	US6708312052	伦敦 国际 交易 所	英国	922	138,222.09	0.25
113	TAL EDUCATION GROUP- ADR	学而思教 育集团	US8740801043	纽约 证券 交易 所	美国	803	138,021.82	0.25
114	LINCOLN NATIONAL CORP	林肯国民	US5341871094	纽约 证券 交易 所	美国	374	131,978.14	0.24
115	GFPT PUBLIC CO LTD-FOR	GFPT 公共 公司	TH0297010Z10	泰国 证券 交易 所	泰国	39,600	131,015.48	0.24
116	TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	巴西电信 公司	BRVIVTACNPR7	巴西 证券 交易 所	巴西	1,200	129,478.03	0.24
117	TIME WARNER CABLE	时代华纳	US88732J2078	纽约	美国	138	128,402.81	0.23

		有限公司		证券交易所				
118	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	L-3 通讯控股	US5024241045	纽约证券交易所	美国	161	124,336.92	0.23
119	MULTIPLUS SA	-	BRMPLUACNOR3	巴西证券交易所	巴西	1,500	110,546.88	0.20
120	FEDEX CORP	联邦快递	US31428X1063	纽约证券交易所	美国	91	96,698.92	0.18
121	PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	巴西石油公司	US71654V4086	纽约证券交易所	美国	2,131	95,189.00	0.17
122	VALERO ENERGY CORP	-	US91913Y1001	纽约证券交易所	美国	314	95,107.62	0.17
123	HESS CORP	阿美拉达赫斯	US42809H1077	纽约证券交易所	美国	187	84,468.76	0.15
124	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	巴西石油公司	BRPETRACNPR6	巴西证券交易所	巴西	3,400	78,460.65	0.14

注：所用证券代码采用 ISIN 代码。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	SILICONWARE PRECISION-SP ADR	US8270848646	2,492,723.82	2.87
2	HON HAI PRECISION-GDR	US4380902019	1,785,251.04	2.05

	REG S			
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	US8740391003	1,338,962.85	1.54
4	PETROCHINA CO LTD-H	CNE1000003W8	1,232,901.50	1.42
5	KT&G CORP	KR7033780008	1,048,494.45	1.21
6	BANCO BRADESCO SA-PREF	BRBBDACNPR8	943,266.42	1.09
7	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	KR7005930003	929,767.94	1.07
8	AXIS BANK LTD- GDR REG S	US05462W1099	880,140.82	1.01
9	TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	BRVIVTACNPR7	821,809.83	0.95
10	SANLAM LTD	ZAE000070660	817,025.45	0.94
11	GAIL INDIA LTD-REG S GDR	US36268T2069	773,374.96	0.89
12	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	KR7055550008	770,421.64	0.89
13	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	BRITUBACNPR1	770,107.55	0.89
14	CHINA VANKE CO LTD-H	CNE100001SR9	765,016.95	0.88
15	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	762,765.67	0.88
16	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	KR7024110009	718,733.76	0.83
17	NASPERS LTD-N SHS	ZAE000015889	706,157.17	0.81
18	DOCTOR REDDYS LAB-ADR	US2561352038	689,692.66	0.79
19	CARDINAL HEALTH INC	US14149Y1082	682,550.73	0.79
20	KOREA ELECTRIC POWER CORP	KR7015760002	668,503.50	0.77

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

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

#### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比
----	----------	------	----------	----------------

				例 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	US8740391003	3,919,900.87	4.51
2	HON HAI PRECISION-GDR REG S	US4380902019	2,495,406.17	2.87
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	KR7005930003	2,235,929.65	2.57
4	SILICONWARE PRECISION-SP ADR	US8270848646	2,199,652.07	2.53
5	CNOOC LTD	HK0883013259	2,001,803.29	2.30
6	NASPERS LTD-N SHS	ZAE000015889	1,706,333.15	1.96
7	GAZPROM OAO-SPON ADR	US3682872078	1,524,834.46	1.76
8	TENAGA NASIONAL BHD	MYL534700009	1,483,599.05	1.71
9	PETROCHINA CO LTD-H	CNE1000003W8	1,443,740.81	1.66
10	TENCENT HOLDINGS LTD	KYG875721634	1,212,099.56	1.40
11	MTN GROUP LTD	ZAE000042164	1,170,959.27	1.35
12	AMBEV SA-ADR	US02319V1035	1,099,772.02	1.27
13	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	1,070,215.23	1.23
14	AU OPTRONICS CORP-SPON ADR	US0022551073	1,043,516.17	1.20
15	SBERBANK-SPONSORED ADR	US80585Y3080	1,001,106.94	1.15
16	VALE SA-SP ADR	US91912E1055	972,623.94	1.12
17	TATA STEEL LTD-GDR REG S	US87656Y4061	957,202.22	1.10
18	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	CNE1000002Q2	885,861.68	1.02
19	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	BRITUBACNPR1	881,062.13	1.01
20	SANLAM LTD	ZAE000070660	874,269.72	1.01

注：1、卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)，不包括相关交易费用。

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本(成交)总额	69,812,200.38
卖出收入(成交)总额	101,645,268.20

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

## 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	HANG SENG H-SHARE INDEX ETF	ETF	交易型开 放式指数	Hang Heng Investment Management Ltd	4,114,667.03	7.51

## 8.11 投资组合报告附注

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

8.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,368,486.84
3	应收股利	133,922.44
4	应收利息	564.54
5	应收申购款	79,258.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	402,863.03
9	合计	1,985,095.53

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,834	16,319.87	9,999,138.89	15.98%	52,571,232.77	84.02%

### 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	100,026.67	0.16%

### 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

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（2011年6月21日）基金份额总额	426,647,075.13
本报告期期初基金份额总额	95,646,248.95
本报告期基金总申购份额	3,244,901.52
减：本报告期基金总赎回份额	36,320,778.81
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	62,570,371.66

## § 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。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

### 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 66,000.00 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，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
UBS SECURITIES	-	20,359,878.05	11.94%	12,702.03	6.36%	-
ITG-CSA	-	17,565,102.68	10.30%	21,108.38	10.57%	-
INSTINET CORP.	-	5,317,848.06	3.12%	3,697.21	1.85%	-
MACQUARIE-ASIA ALGORITHMS	-	7,088.60	0.00%	4.96	0.00%	-
WOORI SECURITIES	-	169,177.04	0.10%	338.17	0.17%	-
BARCLAYS CAPITAL INC.	-	2,277,044.44	1.33%	4,667.08	2.34%	-
STIFEL NICOLAUS-PROGRAM	-	10,736,682.50	6.29%	5,005.96	2.51%	-
J. P. MORGAN	-	19,275,788.24	11.30%	16,520.92	8.28%	-
CREDIT SUISSE	-	4,182,037.37	2.45%	11,579.06	5.80%	-
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.	-	3,739,833.58	2.19%	9,019.60	4.52%	-
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.	-	2,700,761.12	1.58%	3,488.91	1.75%	-
GOLDMAN SACHS & CO. INC	-	2,608,711.05	1.53%	4,624.49	2.32%	-
MORGAN STANLEY	-	5,150,914.33	3.02%	6,669.81	3.34%	-
SANFORD BERNSTEIN	-	46,836.54	0.03%	363.49	0.18%	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC	-	35,478.20	0.02%	53.22	0.03%	-
SCOTIA CAPITAL MARKETS INC	-	191,901.17	0.11%	183.52	0.09%	-
WESTMINSTER RESEARCH	-	74,311.52	0.04%	148.62	0.07%	-
KOREAN INVESTMENT	-	334,848.23	0.20%	669.65	0.34%	-
CITIGROUP	-	5,349,787.57	3.14%	8,523.71	4.27%	-
CIMB SECURITIES	-	260,304.96	0.15%	520.60	0.26%	-
BANK OF NEW YORK	-	7,919,130.19	4.64%	11,321.70	5.67%	-
ING BANK	-	2,518,339.57	1.48%	7,425.53	3.72%	-
JEFFERIES & CO, INC	-	2,969,343.99	1.74%	3,344.54	1.68%	-
ITG	-	3,963,160.67	2.32%	5,363.94	2.69%	-



SAMSUNG SECURITIES INC.	-	38,607.17	0.02%	77.14	0.04%	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC	-	4,613,276.45	2.70%	6,446.32	3.23%	-
BARCLAYS	-	364,148.22	0.21%	254.90	0.13%	-
MERRILL LYNCH	-	14,559,637.14	8.53%	22,469.70	11.26%	-
MACQUARIE CAPITAL	-	12,528,417.58	7.34%	13,284.30	6.65%	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.	-	106,669.71	0.06%	213.34	0.11%	-
HSBC ICN	-	1,612,270.30	0.95%	10,215.64	5.12%	-
BLOOMBERG TRADEBOOK	-	82,679.81	0.05%	82.68	0.04%	-
MACQUARIE CAPITAL-EURO	-	18,929,208.73	11.10%	9,251.19	4.63%	-
HYUNDAI SECURITIES	-	-	-	-	-	-
BRDESCO SECURITIES	-	-	-	-	-	-
BTIG LLC	-	-	-	-	-	-
KINIGHT SECURITIES	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET-CSA	-	-	-	-	-	-
REDBURN PARTNERS LLP	-	-	-	-	-	-
PENSERRA SECURITIES LLC	-	-	-	-	-	-
SBERBANK CIB(UK) LTD	-	-	-	-	-	-
INVESTEC BANK(UK) LIMITED	-	-	-	-	-	-
STANDARD BANK PLC	-	-	-	-	-	-
VTB CAPITAL PLC	-	-	-	-	-	-
WELLS FARGO SECURITIES LLC	-	-	-	-	-	-
WOORI_E SECURITIES	-	-	-	-	-	-
CREDIT AGRICOLE SEC	-	-	-	-	-	-
NOMURA SECURITIES	-	-	-	-	-	-

INTERNATIONAL INC.						
RENAISSANCE CAPITAL		-	-	-	-	-
SANTANDER INVESTMENT		-	-	-	-	-
海通证券		-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人制定了服务券商的选择标准，具体如下：

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

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

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

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

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

（6）其他有利于基金份额持有人利益的商业合作考虑。

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

## 2、券商的服务评价

（1）海外投资部每半年组织“服务总结”及评分。

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

3、本报告期新增服务券商 WOORI SECURITIES, STIFEL NICOLAUS-PROGRAM, BARCLAYS；本报告期无剔除的服务券商

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
UBS SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-

ITG-CSA	-	-	-	-	-	-	1,274,047.96	6.86%
INSTINET CORP.	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE-ASIA ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
WOORI SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
STIFEL NICOLAUS-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
J. P. MORGAN	-	-	-	-	-	-	4,076,951.09	21.94%
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-	2,463,716.69	13.26%
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.	-	-	-	-	-	-	594,760.45	3.20%
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS & CO. INC	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-	681,690.61	3.67%
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC	-	-	-	-	-	-	-	-
SCOTIA CAPITAL MARKETS INC	-	-	-	-	-	-	-	-
WESTMINSTER RESEARCH	-	-	-	-	-	-	-	-
KOREAN INVESTMENT	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP	-	-	-	-	-	-	4,870,376.69	26.22%
CIMB SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-	2,798,611.64	15.06%
ING BANK	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO, INC	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG	-	-	-	-	-	-	-	-
SAMSUNG SECURITIES INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC	-	-	-	-	-	-	1,626,514.06	8.75%
BARCLAYS	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	191,897.20	1.03%

MACQUARIE CAPITAL	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC ICN	-	-	-	-	-	-	-	-
BLOOMBERG TRADEBOOK	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPITAL-EURO	-	-	-	-	-	-	-	-
HYUNDAI SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
BTIG LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
KINIGHT SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET-CSA	-	-	-	-	-	-	-	-
REDBURN PARTNERS LLP	-	-	-	-	-	-	-	-
PENSERRA SECURITIES LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
SBERBANK CIB(UK) LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
INVESTEC BANK(UK) LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
STANDARD BANK PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
VTB CAPITAL PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
WELLS FARGO SECURITIES LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
WOORI SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT AGRICOLE SEC	-	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
RENAISSANCE CAPITAL	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER INVESTMENT	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于公司旗下三只 QDII 基金 2015 年境内外主要市场节假日暂停申购、赎回和定投等业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2014 年 12 月 29 日
2	建信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金继续参加“投基有道”渠道申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2014 年 11 月 8 日
3	关于调整公司旗下部分开放式基金申购（含定期定额投资）、赎回、转换业务规则的公告	指定报刊和/或公司网站	2014 年 10 月 24 日
4	关于公司旗下开放式基金参加天天基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2014 年 10 月 16 日
5	关于公司旗下开放式基金参加数米基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2014 年 10 月 16 日
6	建信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加“投基有道”渠道申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2014 年 9 月 30 日
7	2014 年第二季度基金产品风险评价结果	指定报刊和/或公司网站	2014 年 9 月 9 日
8	2014 年第一季度基金产品风险评价结果	指定报刊和/或公司网站	2014 年 9 月 9 日
9	2013 年第四季度基金产品风险评价结果	指定报刊和/或公司网站	2014 年 2 月 18 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信新兴市场优选股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信新兴市场优选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信新兴市场优选股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；

- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

## **12.2 存放地点**

基金管理人或基金托管人处。

## **12.3 查阅方式**

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司  
2015年3月31日