

建信全球机遇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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
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
§4 管理人报告	9
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.....	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.....	16
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
4.10 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	18
§5 托管人报告	18
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.....	19
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.....	19
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表	20
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.....	24
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	47
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	47
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.....	57

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	59
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	60
8.11 投资组合报告附注	60
§9 基金份额持有人信息.....	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
§10 开放式基金份额变动.....	61
§11 重大事件揭示.....	61
11.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8 其他重大事件	67
§12 备查文件目录.....	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信全球机遇股票型证券投资基金
基金简称	建信全球机遇股票（QDII）
基金主代码	539001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月14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	63,386,551.95份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过全球化的资产配置和组合管理，在分散和控制投资风险的同时追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金采取“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的投资策略进行投资组合的构建。
业绩比较基准	标准普尔全球BMI市场指数总收益率(S&P Global BMI) × 70% + 标准普尔 BMI 中国（除 A、B 股）指数总收益率(S&P BMI China ex-A-B-Shares) × 30%
风险收益特征	本基金是全球股票型基金，其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。

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
办公地址		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
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	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

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有限公司（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	33,969,065.81	20,487,659.88	-4,500,140.63
本期利润	7,555,073.61	26,416,022.00	34,477,772.99
加权平均基金份额本期利润	0.0637	0.1091	0.1106

本期加权平均净值利润率	6.11%	11.48%	12.88%
本期基金份额净值增长率	6.00%	12.13%	13.80%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	4,915,467.21	-17,112,476.22	-48,990,823.69
期末可供分配基金份额利润	0.0775	-0.0896	-0.1721
期末基金资产净值	68,302,019.16	194,232,035.81	258,033,955.04
期末基金份额净值	1.078	1.017	0.907
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	7.80%	1.70%	-9.30%

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	0.84%	0.72%	2.80%	0.70%	-1.96%	0.02%
过去六个月	1.03%	0.62%	0.26%	0.61%	0.77%	0.01%
过去一年	6.00%	0.60%	7.47%	0.59%	-1.47%	0.01%
过去三年	35.26%	0.67%	47.14%	0.69%	-11.88%	-0.02%
自基金合同生效起至今	7.80%	0.81%	34.30%	0.88%	-26.50%	-0.07%

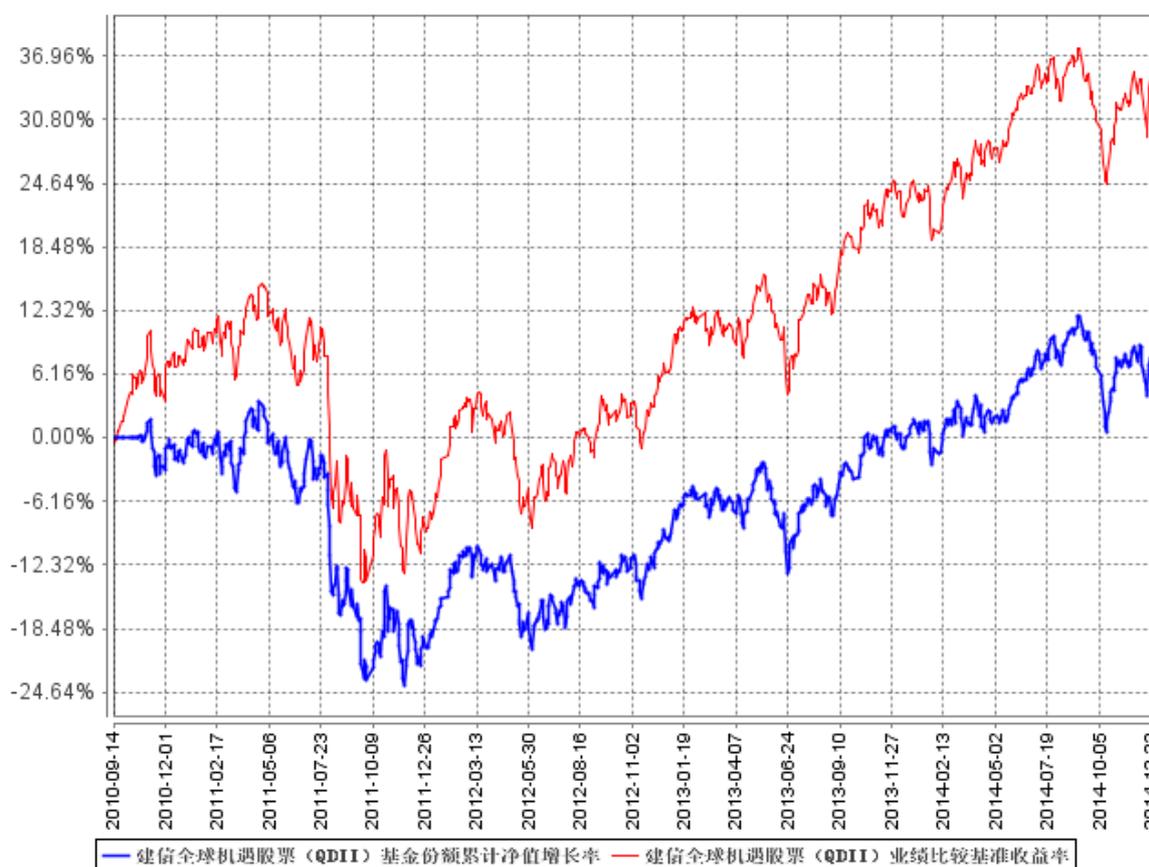
注：1、本基金的业绩比较基准为：标准普尔全球 BMI 市场指数总收益率（S&P Global BMI）×70% + 标准普尔 BMI 中国（除 A、B 股）指数总收益率（S&P BMI China ex-A-B-Shares）×30%。标准普尔全球市场指数（S&P Global BMI）是市场中首只采用自由流通市值进行加权的全市场指数。该指数覆盖全球 47 个市场的 12,000 多家上市公司，其中包括 26 个发达市场和 21 个发展中国家；涵盖全球上市股票约 97% 的市值，在国际上被广泛采用为有关投资产品的业绩基准。

标准普尔 BMI 中国（除 A、B 股）指数（S&P BMI China ex-A-B-Shares）是由标准普尔指数公司于 2007 年 11 月 15 日推出的标准普尔 QDII 系列指数之一，旨在为中国境内合格机构投资者（QDII）在海外资本市场进行投资提供广泛的市场比较基准和投资方案。该指数反映在香港证券市场、美国证券市场、新加坡证券市场、日本证券市场上市的以外币计价的中国公司股票价格走势。

2、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

建信全球机遇股票（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

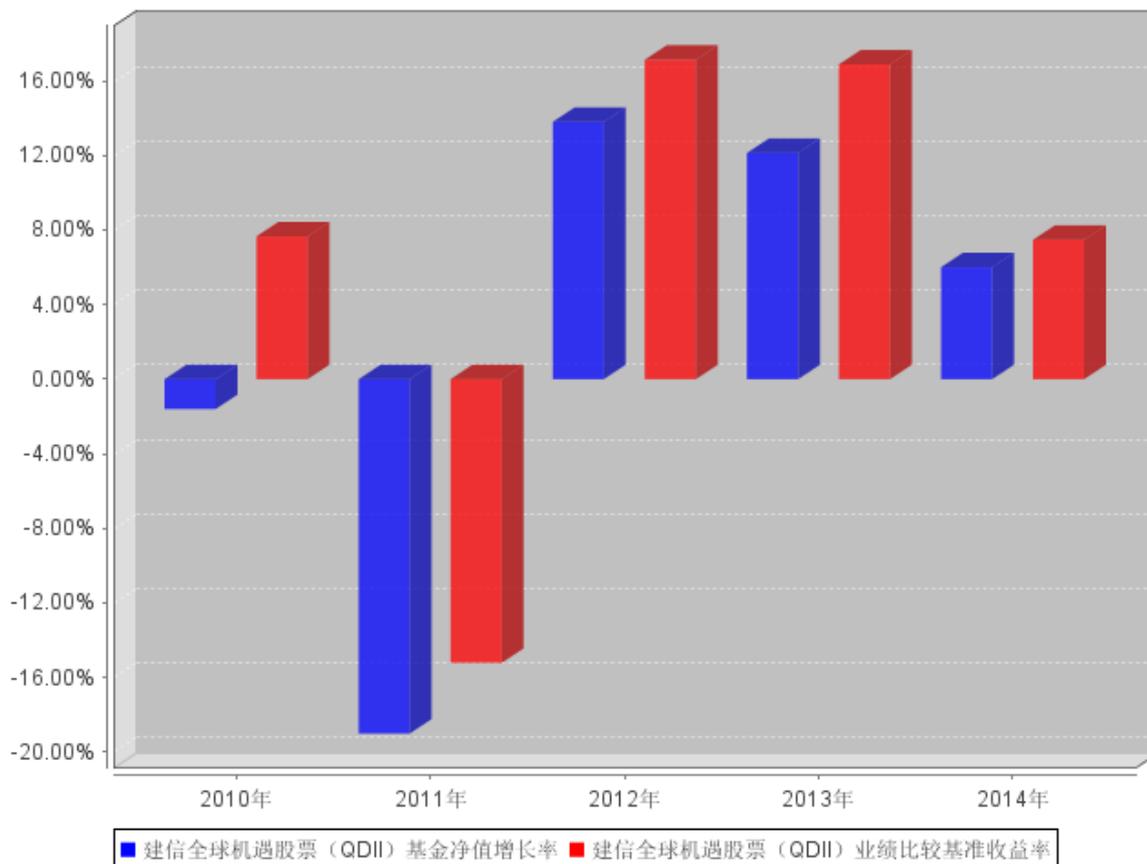


注：1、同期业绩比较基准以人民币计价。

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

建信全球机遇股票（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 2010 年 9 月 14 日生效，2010 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 4 月 20 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			<p>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。</p>
--	------	--	--	--

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	<p>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</p>

			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。
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。
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&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。

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 年全球市场呈震荡行情，市场出现较大分化，黑天鹅事件频繁出现。总结全年，几个突出事件包括：中国股市雄冠全球、美元指数大幅攀升、飞机失事、地缘政治冲突加剧、石油价格崩盘等。正确的资产配置策略是 2014 年取得良好投资回报的关键要素。

美元指数大幅攀升超出所有人的预期，美国经济稳健复苏，14 年美联储如期结束量化宽松，美国市场表现良好，资金出现比较明显的回流美国迹象；另外 2014 年下半年，欧洲经济复苏力度明显减弱，石油价格下跌后，欧洲通缩压力加大，欧洲央行近期推出了超市场预期的欧版 QE，欧元对美元出现了较大幅度的贬值。如果以美元计算，美国市场回报超过 13%，中国市场上涨近 52%，印度市场上涨超过 20%，而其他主要市场都有不同程度的下跌。

地缘政治风险促发的黑天鹅事件也对资本市场产生了较大冲击。马航在乌克兰上空被击落，直接触发了俄罗斯与欧洲和美国的冲突升级。而欧佩克用反常规的方式，在石油价格下滑的情况下继续增加产量令石油价格一泻千里。石油的出口国，尤其是俄罗斯经济受到重创，经济增长处于收缩边缘，货币大幅贬值。本次的“石油价格黑天鹅”，石油的出口国成为短期的输家，而石油的进口国成为短期的赢家。

新兴市场在 2014 年出现了较大分化，由于石油和原材料价格下跌，俄罗斯和巴西经济增长低迷，通胀较高，两地市场下跌幅度较大；印度和中国是石油的进口国，石油下跌有利于经济发展，并且大幅度压低了通胀水平，印度通胀由 8%-10% 水平大幅降低至 4-5%，通胀下行为货币政策的放松提供了较大空间，另外印度新任总理执行了一系列改革，市场逐渐看好未来印度经济增长的前景。中国经济增长速度有所放缓，石油价格的下跌进一步推动中国通胀率下降至 2% 以下的低位，进入下半年，中国市场出现了大幅上涨，我们认为上涨原因可以归结到以下几个方面：1、中国经济年底实现“软着陆”，而非年初市场担心的“硬着陆”；2、央行降息、降准等货币宽松政策；3、融资融券业务增加了入市资金；4、尽管 GDP 增长速度放缓，企业盈利似乎出现了增速筑底的征兆；最后，沪港通、一带一路等事件性利好因素带动了相关板块的投资热情。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本年度本基金净值增长率 6.00%，波动率 0.60%，业绩比较基准收益率 7.47%，波动率 0.59%。

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，我们继续看好美国市场，但认为震荡幅度可能加大。美国经济可能继续稳健复苏的步伐，就业市场逐步好转，石油价格的下跌也会降低美国企业的经营成本；不利因素是美国加息时点存在不确定性，可能对市场产生一定的扰动作用。另外美元指数不断走强可能会降低美国企业海外业务的竞争力和营业收入，美国企业盈利增长的幅度可能放缓。欧洲经济复苏力度低迷，地缘政治冲突和希腊债务问题对欧洲经济存在一定冲击，但欧央行推出量化宽松后大幅提振了市场信心，同时欧洲经济也可能重新回到增长的轨道上，欧洲市场可能仍然存在一定机会。美元继续走强和油价在相关国家操控下继续崩跌，仍将对欧洲和新兴市场的某些国家的经济带来较大不确定性；乌克兰事态发展的方向对未来市场走向将起到较大程度的影响，如果冲突双方化干戈为玉帛，欧洲和俄罗斯经济有望恢复，市场很可能大幅反弹；但如果事态进一步恶化，尤其油价继续下探，可能引发部分国家的社会不稳定，新兴市场内部国家经济和市场可能出现进一步的分化。我们认为短期市场存在一定不确定性，但区域性、行业性的机会仍然值得关注。我们将继续遵循一贯的价值投资理念，挑选具有核心竞争力、估值合理的投资标的，力争为投资人带来良好的超额收益。

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。

4.9 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进行利润分配，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。

4.10 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

§ 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全球机遇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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2014 年，建信全球机遇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全球机遇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，建信全球机遇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全球机遇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 20561 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	建信全球机遇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全球机遇股票型证券投资基金(以下简称“建信全球机遇股票基金”)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全球机遇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，上述建信全球机遇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，公允反映了建信全球机遇股票基金 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：建信全球机遇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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	5,559,749.25	13,134,115.84
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	63,343,318.39	183,656,079.20
其中：股票投资		57,410,542.67	172,230,101.46
基金投资		5,932,775.72	11,425,977.74
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		2,014,549.02	76,857.19
应收利息	7.4.7.5	575.86	1,035.72
应收股利		122,700.24	126,555.46
应收申购款		22,547.92	4,838.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	1,802,932.27	307,447.54
资产总计		72,866,372.95	197,306,929.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
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		2,254,841.47	2,137,152.84
应付管理人报酬		120,625.12	308,626.14
应付托管费		23,454.88	60,010.62
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	2,165,432.32	569,103.63
负债合计		4,564,353.79	3,074,893.23
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	63,386,551.95	191,013,739.30
未分配利润	7.4.7.10	4,915,467.21	3,218,296.51
所有者权益合计		68,302,019.16	194,232,035.81
负债和所有者权益总计		72,866,372.95	197,306,929.04

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.078 元，基金份额总额 63,386,551.95 份。

7.2 利润表

会计主体：建信全球机遇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
一、收入		11,112,122.67	33,295,745.12

1. 利息收入		27,163.43	35,792.49
其中：存款利息收入	7.4.7.11	27,163.43	35,790.25
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		-	2.24
2. 投资收益（损失以“-”填列）		36,975,926.88	28,395,454.71
其中：股票投资收益	7.4.7.12	30,249,841.90	20,620,258.51
基金投资收益	7.4.7.13	4,002,267.76	2,782,872.17
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	6,061.36	32,061.66
股利收益	7.4.7.17	2,717,755.86	4,960,262.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-26,413,992.20	5,928,362.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		519,542.18	-1,065,427.99
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	3,482.38	1,563.79
减：二、费用		3,557,049.06	6,879,723.12
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,225,842.24	4,149,501.65
2. 托管费	7.4.10.2.2	432,802.67	806,847.27
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	519,505.48	1,545,524.48
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	378,898.67	377,849.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,555,073.61	26,416,022.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,555,073.61	26,416,022.00

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信全球机遇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)	191,013,739.30	3,218,296.51	194,232,035.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	7,555,073.61	7,555,073.61
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)	-127,627,187.35	-5,857,902.91	-133,485,090.26
其中: 1. 基金申购款	2,981,140.56	195,273.39	3,176,413.95
2. 基金赎回款	-130,608,327.91	-6,053,176.30	-136,661,504.21
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)	63,386,551.95	4,915,467.21	68,302,019.16
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)	284,626,066.31	-26,592,111.27	258,033,955.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	26,416,022.00	26,416,022.00
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)	-93,612,327.01	3,394,385.78	-90,217,941.23
其中: 1. 基金申购款	1,370,507.44	-76,098.32	1,294,409.12
2. 基金赎回款	-94,982,834.45	3,470,484.10	-91,512,350.35
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)	191,013,739.30	3,218,296.51	194,232,035.81

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

建信全球机遇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〔2010〕第 982 号《关于核准建信全球机遇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《建信全球机遇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 681,859,858.00 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(2010)第 232 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 9 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 681,944,805.65 份基金份额,其中认购资金利息折合 84,947.65 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《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要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,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及其他权益类证券市值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%。本基金的业绩比较基准为标准普尔全球 BMI 市场指数总收益率(S&P Global BMI)×70%+标准普尔 BMI 中国(除 A、B 股)指数总收益率(S&P BMI China ex-A-B-Shares)×30%。

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 03 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》、《建信全球机遇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。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也可按直线法计算。

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	5,559,749.25	13,134,115.84
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-

其他存款	-	-
合计:	5,559,749.25	13,134,115.84

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	49,960,218.81	57,410,542.67	7,450,323.86
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	5,237,654.57	5,932,775.72	695,121.15
其他	-	-	-
合计	55,197,873.38	63,343,318.39	8,145,445.01
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	141,175,184.26	172,230,101.46	31,054,917.20
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	7,921,457.73	11,425,977.74	3,504,520.01
其他	-	-	-
合计	149,096,641.99	183,656,079.20	34,559,437.21

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

无。

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	575.86	1,035.72
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	575.86	1,035.72

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	1,802,932.27	307,447.54
合计	1,802,932.27	307,447.54

7.4.7.7 应付交易费用

无余额。

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	170.13	29.27
预提费用	361,589.28	261,589.28
应付未起息外汇交易	1,803,672.91	307,485.08
合计	2,165,432.32	569,103.63

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	191,013,739.30	191,013,739.30
本期申购	2,981,140.56	2,981,140.56
本期赎回(以“-”号填列)	-130,608,327.91	-130,608,327.91
- 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	63,386,551.95	63,386,551.95

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	-17,112,476.22	20,330,772.73	3,218,296.51
本期利润	33,969,065.81	-26,413,992.20	7,555,073.61
本期基金份额交易产生的变动数	-5,529,862.35	-328,040.56	-5,857,902.91
其中：基金申购款	243,885.51	-48,612.12	195,273.39
基金赎回款	-5,773,747.86	-279,428.44	-6,053,176.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,326,727.24	-6,411,260.03	4,915,467.21

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
	活期存款利息收入	27,154.97
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	-	2.44
其他	8.46	-
合计	27,163.43	35,790.25

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 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
卖出股票成交总额	282,628,683.70	330,647,006.75
减：卖出股票成本总额	252,378,841.80	310,026,748.24
买卖股票差价收入	30,249,841.90	20,620,258.51

7.4.7.13 基金投资收益

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
卖出/赎回基金成交总额	19,829,771.62	16,588,903.23
减：卖出/赎回基金成本总额	15,827,503.86	13,806,031.06
基金投资收益	4,002,267.76	2,782,872.17

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	6,061.36	32,061.66
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	6,061.36	32,061.66

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	2,461,616.05	4,703,509.00
基金投资产生的股利收益	256,139.81	256,753.37
合计	2,717,755.86	4,960,262.37

7.4.7.18 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12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013 年12月31日
1. 交易性金融资产	-26,413,992.20	5,928,362.12
——股票投资	-23,604,593.34	4,626,339.20
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-2,809,398.86	1,302,022.92
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-26,413,992.20	5,928,362.12

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年 12月31日
基金赎回费收入	3,482.38	1,563.79
合计	3,482.38	1,563.79

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 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
交易所市场交易费用	519,505.48	1,545,524.48
银行间市场交易费用	-	-
合计	519,505.48	1,545,524.48

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	299,971.54
存托服务费	-	-
银行划款手续费	6,009.67	5,443.60
账户维护费	-	-
其他	889.00	434.58
合计	378,898.67	377,849.72

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	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管理费	2,225,842.24	4,149,501.65
其中：支付销售机构的客户维护费	627,942.30	1,158,667.46

注：1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬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 1.80%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 X1.80% / 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	432,802.67	806,847.27

的托管费		
------	--	--

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

无。

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

报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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	2,609,033.53	25,706.68	3,663,629.47	32,760.07
布朗兄弟哈里曼银行	2,950,715.72	1,448.29	9,470,486.37	3,027.74

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

无。

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

无。

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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。

本基金通过全球化的资产配置和组合管理，在分散和控制投资风险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。

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所持金融工具变现的难易程度。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，本基金的基金管理人通过风险管理委员会设定流动性比例要求，独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。除附注 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，其余均能及时变现。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投资的公允价值。

本基金所持有的全部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均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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款。

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	5,559,749.25	-	-	-	5,559,749.25
结算备付金	-	-	-	-	0.00
存出保证金	-	-	-	-	0.00
交易性金融资产	-	-	-	63,343,318.39	63,343,318.39
衍生金融资产	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	2,014,549.02	2,014,549.02
应收利息	-	-	-	575.86	575.86
应收股利	-	-	-	122,700.24	122,700.24
应收申购款	-	-	-	22,547.92	22,547.92
其他资产	-	-	-	1,802,932.27	1,802,932.27
资产总计	5,559,749.25	-	-	67,306,623.70	72,866,372.95

负债					
卖出回购金融资产款					0.00
短期借款					0.00
交易性金融负债					0.00
衍生金融负债					0.00
应付证券清算款					0.00
应付赎回款				2,254,841.47	2,254,841.47
应付管理人报酬				120,625.12	120,625.12
应付托管费				23,454.88	23,454.88
应付销售服务费					0.00
应付交易费用					0.00
应交税费					0.00
应付利息					0.00
应付利润					0.00
其他负债				2,165,432.32	2,165,432.32
负债总计				4,564,353.79	4,564,353.79
利率敏感度缺口	5,559,749.25			-62,742,269.91	68,302,019.16
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	13,134,115.84				13,134,115.84
结算备付金					
存出保证金					
交易性金融资产				-183,656,079.20	183,656,079.20
衍生金融资产					
买入返售金融资产					
应收证券清算款				76,857.19	76,857.19
应收利息				1,035.72	1,035.72
应收股利				126,555.46	126,555.46
应收申购款				4,838.09	4,838.09
其他资产				307,447.54	307,447.54
资产总计	13,134,115.84			-184,172,813.20	197,306,929.04
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				2,137,152.84	2,137,152.84
应付管理人报酬				308,626.14	308,626.14
应付托管费				60,010.62	60,010.62
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	-	-	-	569,103.63	569,103.63
负债总计	-	-	-	3,074,893.23	3,074,893.23
利率敏感度缺口	13,134,115.84	-	-	-181,097,919.97	194,232,035.81

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	2,606,251.47	258,066.57	87,802.80	2,952,120.84
交易性金融资产	25,460,591.60	25,614,065.93	12,268,660.86	63,343,318.39
应收股利	39,868.89	82,831.35	-	122,700.24
应收利息	21.29	-	-	21.29
应收证券清算款	212,934.04	1,801,614.98	-	2,014,549.02
其它资产	1,802,932.27	-	-	1,802,932.27
资产合计	30,122,599.56	27,756,578.83	12,356,463.66	70,235,642.05
以外币计价的负债				
其它负债	-	1,801,614.98	2,057.93	1,803,672.91
负债合计	-	1,801,614.98	2,057.93	1,803,672.91
资产负债表外汇风险敞口净额	30,122,599.56	25,954,963.85	12,354,405.73	68,431,969.14
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	4,221,517.82	5,147,668.91	102,174.80	9,471,361.53
交易性金融资产	81,842,034.15	53,412,764.72	48,401,280.33	183,656,079.20

应收股利	79,548.75	5,325.92	41,680.79	126,555.46
应收证券清算款	-	76,857.19	-	76,857.19
其它资产	195,493.68	111,953.86	-	307,447.54
资产合计	86,338,594.40	58,754,570.60	48,545,135.92	193,638,300.92
以外币计价的负债				
其它负债	111,962.56	188,811.05	6,711.47	307,485.08
负债合计	111,962.56	188,811.05	6,711.47	307,485.08
资产负债表外汇风险敞口净额	86,226,631.84	58,565,759.55	48,538,424.45	193,330,815.84

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%	-3,421,598.46	-9,666,540.79
	所有外币相对人民币升值 5%	3,421,598.46	9,666,540.79

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	57,410,542.67	84.05	172,230,101.46	88.67
交易性金融资产—基金投资	5,932,775.72	8.69	11,425,977.74	5.88
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	63,343,318.39	92.74	183,656,079.20	94.55

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%	3,234,080.08	9,128,905.68
	业绩比较基准下降 5%	-3,234,080.08	-9,128,905.68

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 63,343,318.39 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 183,656,079.20 元，无第二层次或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期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次未发生重大变动。

(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 (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	57,410,542.67	78.79
	其中: 普通股	54,501,776.27	74.80
	存托凭证	2,908,766.40	3.99
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	5,932,775.72	8.14
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	5,559,749.25	7.63
8	其他各项资产	3,963,305.31	5.44
9	合计	72,866,372.95	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	25,460,591.60	37.28
中国香港	19,681,290.21	28.82
英国	3,070,505.20	4.50
法国	2,807,227.84	4.11
日本	2,249,685.07	3.29
瑞士	1,438,316.95	2.11
德国	1,417,591.16	2.08
加拿大	827,998.32	1.21
瑞典	457,336.32	0.67
合计	57,410,542.67	84.05

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	5,114,751.71	7.49
必需消费品	3,806,119.24	5.57
能源	3,089,467.02	4.52
金融	15,749,682.77	23.06
保健	6,686,374.62	9.79
工业	5,918,312.36	8.66
信息技术	8,944,069.47	13.09
材料	1,677,391.36	2.46
电信服务	3,087,869.74	4.52
公共事业	3,336,504.38	4.88
合计	57,410,542.67	84.05

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	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	CNE1000001Z5	香港证券交易所	中国香港	737,000	2,540,705.72	3.72

2	WELLS FARGO & CO	富国银行	US9497461015	纽约 证券 交易 所	美国	6,579	2,206,883.31	3.23
3	MICROSOFT CORP	微软	US5949181045	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	7,513	2,135,401.58	3.13
4	KROGER CO	克罗格公 司	US5010441013	纽约 证券 交易 所	美国	4,219	1,657,649.28	2.43
5	NOVARTIS AG-REG	诺华	CH0012005267	瑞士 证券 交易 所	瑞士	2,529	1,438,316.95	2.11
6	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科 学	CH0012005267	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,393	1,380,227.22	2.02
7	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	Discover 金融服 务公 司	US2547091080	纽约 证券 交易 所	美国	3,372	1,351,272.72	1.98
8	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	KYG875721634	香港 证券 交易 所	中国香 港	13,600	1,206,971.10	1.77
9	BAIDU INC - SPON ADR	百度	US0567521085	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	766	1,068,530.50	1.56
10	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	帝国烟草	GB0004544929	英国 伦敦 交易 所	英国	3,894	1,053,947.44	1.54
11	MARRIOTT VACATIONS WORLD	万豪环球 度假	US57164Y1073	纽约 证券 交易 所	美国	2,231	1,017,581.99	1.49
12	CHINA MOBILE LTD	中国移动	HK0941009539	香港 证券 交易 所	中国香 港	14,000	999,498.29	1.46

				交易所				
13	INGENICO	安智	FR0000125346	法国交易所	法国	1,488	968,278.45	1.42
14	ANTHEM INC	Anthem 股份有限公司	US0367521038	纽约证券交易所	美国	1,229	945,069.94	1.38
15	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	CNE1000003X6	香港证券交易所	中国香港	15,000	935,994.26	1.37
16	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	Dr Pepper Snapple 集团公司	US26138E1091	纽约证券交易所	美国	2,131	934,677.74	1.37
17	CHINA MERCHANTS BANK-H	招商银行	CNE1000002M1	香港证券交易所	中国香港	58,329	895,432.41	1.31
18	CARDINAL HEALTH INC	-	US14149Y1082	纽约证券交易所	美国	1,738	858,549.18	1.26
19	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	DIRECT LINE 保险集团公司	GB00B89W0M42	英国伦敦交易所	英国	30,685	853,067.54	1.25
20	GUANGDONG INVESTMENT LTD	粤海投资	HK0270001396	香港证券交易所	中国香港	106,000	844,564.22	1.24
21	OMRON CORP	-	JP3197800000	东京交易所	日本	3,000	839,915.85	1.23
22	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	加拿大萧氏通讯公司	CA82028K2002	多伦多证券交易所	加拿大	5,000	827,998.32	1.21
23	LOWES COS INC	劳氏	US5486611073	纽约证券交易所	美国	1,961	825,555.90	1.21

24	ALLSTATE CORP	全州保险	US0200021014	纽约 证券 交易 所	美国	1,761	756,983.02	1.11
25	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	三菱电机	JP3902400005	东京 交易 所	日本	10,000	742,824.66	1.09
26	NORTHROP GRUMMAN CORP	诺斯罗普 格鲁曼	US6668071029	纽约 证券 交易 所	美国	823	742,246.75	1.09
27	ABBVIE INC	艾伯维有 限公司	US00287Y1091	纽约 证券 交易 所	美国	1,829	732,381.64	1.07
28	ORANGE	-	FR0000133308	法国 交易 所	法国	6,845	722,125.19	1.06
29	HCA HOLDINGS INC	HCA 控股 公司	US40412C1018	纽约 证券 交易 所	美国	1,591	714,475.80	1.05
30	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	荷兰皇家 壳牌	GB00B03MM408	英国 伦敦 交易 所	英国	3,242	690,905.28	1.01
31	IBERDROLA SA-SPONSORED ADR	伊维尔德 罗拉有限 公司	US4507371015	纽约 证券 交易 所	美国	4,110	676,636.27	0.99
32	KDDI CORP	KDDI 株式 会社	JP3496400007	东京 交易 所	日本	1,700	666,944.56	0.98
33	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	US3695501086	纽约 证券 交易 所	美国	781	657,677.59	0.96
34	AECOM TECHNOLOGY CORP	-	US00766T1007	纽约 证券 交易 所	美国	3,481	646,888.26	0.95
35	XEROX CORP	施乐	US9841211033	纽约 证券 交易 所	美国	7,462	632,847.30	0.93

36	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中国神华	CNE1000002R0	香港 证券 交易 所	中国香 港	34,500	624,607.54	0.91
37	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	公共服务 企业集团	US7445731067	纽约 证券 交易 所	美国	2,455	622,067.02	0.91
38	SIEMENS AG-REG	西门子	DE0007236101	柏林 证券 交易 所	德国	869	607,398.41	0.89
39	VALEO SA	法雷奥集 团	FR0000130338	法国 交易 所	法国	747	576,982.92	0.84
40	APPLE INC	苹果公司	US0378331005	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	823	555,866.73	0.81
41	LINCOLN NATIONAL CORP	林肯国民	US5341871094	纽约 证券 交易 所	美国	1,551	547,321.11	0.80
42	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际	CNE1000006Z4	香港 证券 交易 所	中国香 港	66,000	545,645.60	0.80
43	NATIXIS	法国外贸 银行	FR0000120685	法国 交易 所	法国	13,201	539,841.28	0.79
44	TIME WARNER CABLE	时代华纳 有线公司	US88732J2078	纽约 证券 交易 所	美国	574	534,081.25	0.78
45	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	L-3 通讯 控股	US5024241045	纽约 证券 交易 所	美国	676	522,060.60	0.76
46	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	统一互联 网公司	DE0005089031	柏林 证券 交易 所	德国	1,795	501,654.37	0.73
47	MONDI PLC	盟迪公共 有限公司	GB00B1CRLC47	英国 伦敦	英国	4,716	472,584.94	0.69

				交易所				
48	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	香港电讯信托与香港电讯-ss	HK0000093390	香港证券交易所	中国香港	59,000	470,087.63	0.69
49	CHINA VANKE CO LTD-H	万科	CNE100001SR9	香港证券交易所	中国香港	34,300	468,107.57	0.69
50	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	塔塔汽车有限公司	US8765685024	纽约证券交易所	美国	1,774	458,953.88	0.67
51	BOLIDEN AB	博利登有限公司	SE0000869646	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	4,661	457,336.32	0.67
52	CHINA NATIONAL MATERIALS - H	中材股份	CNE100000874	香港证券交易所	中国香港	247,000	455,951.08	0.67
53	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	中国中铁	CNE100000722	香港证券交易所	中国香港	89,000	447,936.16	0.66
54	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村商业银行	CNE100000X44	香港证券交易所	中国香港	117,000	445,798.33	0.65
55	LINK REIT	领汇房地产	HK0823032773	香港证券交易所	中国香港	11,500	440,445.84	0.64
56	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	中银香港	HK2388011192	香港证券交易所	中国香港	21,500	440,130.29	0.64
57	HOST HOTELS & RESORTS INC	host 酒店及度假酒店公司	US44107P1049	纽约证券交易所	美国	2,952	429,364.36	0.63
58	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国石化	CNE1000002Q2	香港证券交易所	中国香港	80,600	397,393.26	0.58

				交易所				
59	VALERO ENERGY CORP	VALERO 能源	US91913Y1001	纽约 证券 交易所	美国	1,309	396,483.66	0.58
60	FEDEX CORP	联邦快递	US31428X1063	纽约 证券 交易所	美国	370	393,171.45	0.58
61	HAITONG INTERNATIONAL SECURI	海通国际	BMG4232X1020	香港 证券 交易所	中国香 港	96,000	374,113.71	0.55
62	HESS CORP	阿美拉达 赫斯	US42809H1077	纽约 证券 交易所	美国	786	355,039.80	0.52
63	THE UNITED LABORATORIES INTE	联邦制药	KYG8813K1085	香港 证券 交易所	中国香 港	98,000	350,210.95	0.51
64	CNOOC LTD	中国海洋 石油	HK0883013259	香港 证券 交易所	中国香 港	38,000	312,960.51	0.46
65	PETROCHINA CO LTD-H	中国石油	CNE1000003W8	香港 证券 交易所	中国香 港	46,000	312,076.97	0.46
66	HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	汉诺威再 保险有限 公司	DE0008402215	柏林 证券 交易所	德国	552	308,538.38	0.45
67	TAL EDUCATION GROUP- ADR	学而思教 育集团	US8740801043	纽约 证券 交易所	美国	1,777	305,435.58	0.45
68	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏信	HK0000077468	香港 证券 交易所	中国香 港	46,000	277,603.35	0.41
69	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴 集团控股 有限公司	US01609W1027	纽约 证券 交易所	美国	416	264,579.69	0.39

				所				
70	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	农业银行	CNE100000Q43	香港 证券 交易 所	中国香 港	84,000	259,759.11	0.38
71	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	浙江沪杭 甬	CNE1000004S4	香港 证券 交易 所	中国香 港	36,000	255,877.87	0.37
72	JIANGNAN GROUP LTD	江南集团	KYG513831001	香港 证券 交易 所	中国香 港	228,000	241,015.56	0.35
73	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中国电信	CNE1000002V2	香港 证券 交易 所	中国香 港	64,000	229,214.07	0.34
74	PICC PROPERTY & CASUALTY -H	中国财险	CNE100000593	香港 证券 交易 所	中国香 港	19,080	226,978.73	0.33
75	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	雅居乐地 产	KYG011981035	香港 证券 交易 所	中国香 港	64,000	222,650.67	0.33
76	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	KYG525681477	香港 证券 交易 所	中国香 港	122,000	222,319.34	0.33
77	SUN HUNG KAI & CO LTD	新鸿基公 司	HK0086000525	香港 证券 交易 所	中国香 港	46,000	214,825.08	0.31
78	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORPLT	中国铁建	CNE100000981	香港 证券 交易 所	中国香 港	26,500	206,541.94	0.30
79	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育 用品	KYG040111059	香港 证券 交易 所	中国香 港	19,000	205,342.86	0.30
80	BEIJING CAPITAL LAND LTD-H	首创置业	CNE100000239	香港 证券 交易 所	中国香 港	88,000	204,096.45	0.30

81	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	富力地产	CNE100000569	香港 证券 交易 所	中国香 港	25,200	188,656.68	0.28
82	SHENZHEN INTL HOLDINGS	深圳国际 控股	BMG8086V1467	香港 证券 交易 所	中国香 港	21,000	188,524.15	0.28
83	LENOVO GROUP LTD	联想集团	HK0992009065	香港 证券 交易 所	中国香 港	22,000	177,022.43	0.26
84	SOUND GLOBAL LTD	桑德国际	SG1W63939514	香港 证券 交易 所	中国香 港	23,000	162,933.21	0.24
85	HENGAN INTL GROUP CO LTD	恒安国际	KYG4402L1510	香港 证券 交易 所	中国香 港	2,500	159,844.78	0.23
86	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥 控股	KYG2113L1068	香港 证券 交易 所	中国香 港	40,000	158,405.10	0.23
87	CW GROUP HOLDINGS LTD	-	KYG2730T1022	香港 证券 交易 所	中国香 港	88,000	157,584.67	0.23
88	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电 子	HK0285041858	香港 证券 交易 所	中国香 港	25,500	150,871.39	0.22
89	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国人寿	CNE1000002L3	香港 证券 交易 所	中国香 港	6,000	144,126.55	0.21
90	CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	华南城	HK0000056264	香港 证券 交易 所	中国香 港	50,000	139,629.99	0.20
91	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	唯品会控 股有限公 司	US92763W1036	纽约 证券 交易 所	美国	1,126	134,630.48	0.20
92	TIANGONG INTL CO LTD	天工国际	KYG888311134	香港	中国香	118,000	133,113.92	0.19

				证券交易所	港			
93	HUADIAN FUXIN ENERGY CORP -H	华电福新	CNE100001F60	香港证券交易所	中国香港	46,000	132,451.27	0.19
94	KWG PROPERTY HOLDING LTD	合景泰富	KYG532241042	香港证券交易所	中国香港	30,500	127,761.44	0.19
95	SINOPHARM GROUP CO-H	国药控股股份有限公司	CNE100000FN7	香港证券交易所	中国香港	5,600	121,265.10	0.18
96	OZNER WATER INTERNATIONAL HO	-	KYG6868L1041	香港证券交易所	中国香港	51,000	119,892.46	0.18
97	PAX GLOBAL TECHNOLOGY LTD	百富环球	BMG6955J1036	香港证券交易所	中国香港	18,000	113,597.28	0.17
98	HUADIAN POWER INTL CORP-H	华电国际	CNE1000003D8	香港证券交易所	中国香港	20,000	107,286.32	0.16
99	CHINA ELECTRONICS CORP HOLDI	中国电子	BMG2110E1214	香港证券交易所	中国香港	72,000	106,213.46	0.16
100	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	华润电力	HK0836012952	香港证券交易所	中国香港	6,000	94,664.40	0.14
101	JINTIAN PHARMACEUTICAL GROUP	金天医药集团	KYG513961022	香港证券交易所	中国香港	42,000	88,132.56	0.13
102	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	中国太保	CNE1000009Q7	香港证券交易所	中国香港	2,800	87,028.14	0.13
103	CHINA HIGH SPEED TRANSMISSIO	中国高速传动	KYG2112D1051	香港证券交易所	中国香港	21,000	80,015.08	0.12

				交易所				
104	DATANG INTL POWER GEN CO-H	大唐发电	CNE1000002Z3	香港 证券 交易 所	中国香 港	24,000	78,950.11	0.12
105	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国 控股	KYG8569A1067	香港 证券 交易 所	中国香 港	12,000	74,690.21	0.11
106	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电力	HK2380027329	香港 证券 交易 所	中国香 港	23,000	71,305.96	0.10
107	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	东风集团 股份	CNE100000312	香港 证券 交易 所	中国香 港	8,000	69,294.34	0.10
108	CHINA PIONEER PHARMA HOLDING	中国先锋 医药	KYG2162L1068	香港 证券 交易 所	中国香 港	12,000	57,745.28	0.08
109	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	世贸房地 产	KYG810431042	香港 证券 交易 所	中国香 港	3,500	47,876.52	0.07
110	SJM HOLDINGS LTD	奥博控股	HK0880043028	香港 证券 交易 所	中国香 港	4,000	39,001.73	0.06
111	SINOTRANS LIMITED-H	中国外运	CNE1000004F1	香港 证券 交易 所	中国香 港	7,000	28,549.21	0.04

注：所用证券代码采用 ISI 所用证券代码采用 ISIN 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	APPLE INC	US0378331005	3,467,851.25	1.79

2	LENOVO GROUP LTD	HK0992009065	3,110,125.17	1.60
3	ORACLE CORP	US68389X1054	2,335,928.26	1.20
4	HUANENG POWER INTL INC-H	CNE1000006Z4	2,157,263.24	1.11
5	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	JP3902400005	2,020,975.06	1.04
6	AECOM TECHNOLOGY CORP	US00766T1007	2,019,828.87	1.04
7	CONTINENTAL AG	DE0005439004	2,013,249.12	1.04
8	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	CNE1000001Q4	1,762,660.38	0.91
9	NATIXIS	FR0000120685	1,649,550.28	0.85
10	MASTERCARD INC-CLASS A	US57636Q1040	1,602,519.61	0.83
11	VALEO SA	FR0000130338	1,577,811.72	0.81
12	PFIZER INC	US7170811035	1,577,522.48	0.81
13	REA GROUP LTD	AU000000REA9	1,568,503.92	0.81
14	EMC CORP/MA	US2686481027	1,542,676.49	0.79
15	DOW CHEMICAL CO/THE	US2605431038	1,540,327.86	0.79
16	KOHL'S CORP	US5002551043	1,521,813.19	0.78
17	HCA HOLDINGS INC	US40412C1018	1,493,688.27	0.77
18	HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	DE0008402215	1,453,377.19	0.75
19	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	US0394831020	1,434,606.96	0.74
20	ANTOFAGASTA PLC	GB0000456144	1,388,670.21	0.71

注：1、买入金额按买入成交金额(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	TENCENT HOLDINGS LTD	KYG875721634	4,618,614.25	2.38
2	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	US2547091080	3,842,942.98	1.98
3	COMCAST CORP-CLASS A	US20030N1019	3,752,637.74	1.93
4	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	CNE1000001Q4	3,559,158.33	1.83
5	BAIDU INC - SPON ADR	US0567521085	3,353,271.34	1.73
6	DUERR AG	DE0005565204	3,221,381.41	1.66
7	APPLE INC	US0378331005	3,193,822.59	1.64

8	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	3,172,078.83	1.63
9	HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	DE0008402215	3,088,911.10	1.59
10	MCKESON CORP	US58155Q1031	3,053,871.57	1.57
11	FIFTH THIRD BANCORP	US3167731005	2,873,782.60	1.48
12	AMGEN INC	US0311621009	2,756,940.12	1.42
13	OMNICARE INC	US6819041087	2,755,191.53	1.42
14	LENOVO GROUP LTD	HK0992009065	2,591,240.20	1.33
15	BANK OF CHINA LTD-H	CNE1000001Z5	2,567,265.77	1.32
16	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	US00287Y1091	2,553,203.99	1.31
17	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	CNE100000Q43	2,547,779.01	1.31
18	CANADIAN NATL RAILWAY CO	CA1363751027	2,495,212.98	1.28
19	SHIRE PLC	JE00B2QKY057	2,395,029.79	1.23
20	ORACLE CORP	US68389X1054	2,336,800.41	1.20

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	161,163,876.35
卖出收入（成交）总额	282,628,683.70

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 基金	交易型开 放式指数	HANG SENG INVESTMENT MANAGEMENT LTD	5,932,775.72	8.69

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	2,014,549.02
3	应收股利	122,700.24
4	应收利息	575.86
5	应收申购款	22,547.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,802,932.27
9	合计	3,963,305.31

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
4,363	14,528.20	670,022.73	1.06%	62,716,529.22	98.94%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人所有从业人员未持有本基金。

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

期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本开放式基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年9月14日）基金份额总额	681,944,805.65
本报告期期初基金份额总额	191,013,739.30
本报告期基金总申购份额	2,981,140.56
减：本报告期基金总赎回份额	130,608,327.91
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	63,386,551.95

§ 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	
BNY CONVERGX	-	72,440,241.41	16.32%	31,375.45	9.71%	-
J. P. MORGAN	-	66,984,815.59	15.09%	38,388.63	11.87%	-
MERRILL LYNCH	-	36,311,723.30	8.18%	30,685.62	9.49%	-
UBS SECURITIES	-	35,567,377.01	8.01%	20,832.10	6.44%	-
CITIGROUP	-	32,422,752.59	7.31%	22,591.33	6.99%	-
MACQUARIE CAPITAL-EURO	-	31,728,801.33	7.15%	15,864.40	4.91%	-
CREDIT SUISSE	-	27,087,342.35	6.10%	33,147.84	10.25%	-
STIFEL	-	25,186,945.43	5.68%	8,012.88	2.48%	-

NICOLAUS-PROGRAM						
INSTINET CORP.	-	18,525,778.95	4.17%	18,350.05	5.68%	-
GOLDMAN SACHS	-	9,169,854.89	2.07%	6,954.75	2.15%	-
RBC CAPITAL MARKETS	-	7,845,250.25	1.77%	3,240.25	1.00%	-
ITG-CSA	-	7,829,418.25	1.76%	9,096.48	2.81%	-
ITG	-	7,622,988.92	1.72%	7,622.91	2.36%	-
MACQUARIE-AUSTRALIA	-	7,276,882.66	1.64%	6,903.07	2.14%	-
MACQUARIE CAPTIAL	-	7,271,719.96	1.64%	6,891.18	2.13%	-
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.	-	6,902,522.01	1.56%	5,633.92	1.74%	-
BARCLAYS CAPITAL INC.	-	6,231,643.00	1.40%	9,152.90	2.83%	-
MORGAN STANLEY	-	5,547,562.28	1.25%	6,294.35	1.95%	-
CREDIT AGRICOLE INDOSUEZ CHEVREUX	-	4,867,157.60	1.10%	3,297.87	1.02%	-
SANFORD BERNSTEIN	-	4,465,668.34	1.01%	8,317.60	2.57%	-
SCOTIA CAPITAL MARKETS INC.	-	4,415,687.71	1.00%	2,556.46	0.79%	-
UBS SECURITIES-ASIA PROGRAM	-	3,475,640.35	0.78%	1,737.76	0.54%	-
CIMB SECURITIES	-	3,139,558.58	0.71%	6,279.15	1.94%	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC	-	2,066,250.57	0.47%	2,767.60	0.86%	-
CIBC WORLD MARKETS INC.	-	1,408,158.61	0.32%	1,186.59	0.37%	-
WILLIAM BLAIR & CO.	-	1,324,850.32	0.30%	1,092.43	0.34%	-
DAIWA	-	1,180,156.87	0.27%	8,935.85	2.76%	-
NBF SECURITIES CORP	-	913,616.90	0.21%	653.75	0.20%	-
KEPLER CHEUVREUX	-	904,661.85	0.20%	633.28	0.20%	-
DEUTSCHE BANK-EURO ALGORITHMS	-	880,523.32	0.20%	440.28	0.14%	-
SOCIETE GENERALE ALGO EURO	-	775,228.31	0.17%	387.61	0.12%	-
HSBC	-	490,155.45	0.11%	735.27	0.23%	-
COWEN & COMPANY-ALGO	-	488,360.00	0.11%	132.33	0.04%	-
ING BANK	-	340,353.04	0.08%	680.70	0.21%	-
BNP PARIBAS	-	302,329.69	0.07%	604.66	0.19%	-
FOX RIVER(SUNGARD)	-	159,886.49	0.04%	34.66	0.01%	-
HSBC, INC	-	118,587.79	0.03%	237.17	0.07%	-

DBS VICKERS	-	101,506.18	0.02%	203.01	0.06%	-
BARCLAYS	-	-	-	1,333.11	0.41%	-
PENSERRA SECURITIES LLC	-	-	-	-	-	-
REDBURN PARTNERS LLP	-	-	-	-	-	-
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-
HANDELSBANKEN	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-
MIZUHO	-	-	-	-	-	-
PIPER JAFFRAY CO	-	-	-	-	-	-
ROYAL BANK OF SCOTLAND	-	-	-	-	-	-
STANDARD CHARTERED	-	-	-	-	-	-
T D NEWCREST	-	-	-	-	-	-
BMO CAPITAL MARKETS	-	-	-	-	-	-
KNIGHT SECURITIES	-	-	-	-	-	-
RBC CAPITAL MARKETS-EURO	-	-	-	-	-	-
SANDLER OCEIL&PARTNERS	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
ABN AMRO SECURITIES	-	-	-	-	-	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC	-	-	-	-	-	-
CARNEGIE	-	-	-	-	-	-
FIDELITY	-	-	-	-	-	-
BLAYLOCK ROBERT VAN	-	-	-	-	-	-
GRIFFITHS MCBURNEY	-	-	-	-	-	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.	-	-	-	-	-	-

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、除海通证券的交易席位为与优化配置基金共用的交易席位外，本报告期内新增的服务券商有 SCOTIA CAPITAL MARKETS INC.，UBS SECURITIES-ASIA PROGRAM，SOCIETE GENERALE ALGO EURO，DBS VICKERS，BNP PARIBAS，KEPLER CHEUVREUX，COWEN & COMPANY-ALGO，FOX RIVER(SUNGARD)，报告期内无剔除单元。

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		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
BNY CONVERGX	-	-	-	-	-	-	1,873,479.31	5.68%
J. P. MORGAN	-	-	-	-	-	-	647,533.12	1.96%
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	767,588.81	2.33%
UBS SECURITIES	-	-	-	-	-	-	1,178,379.93	3.57%
CITIGROUP	-	-	-	-	-	-	5,015,739.62	15.21%
MACQUARIE CAPITAL-EURO	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-	3,161,298.43	9.59%

STIFEL NICOLAUS-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
INSTINET CORP.	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC CAPITAL MARKETS	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG-CSA	-	-	-	-	-	-	1,989,109.62	6.03%
ITG	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE-AUSTRALIA	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPTIAL	-	-	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT AGRICOLE INDOSUEZ CHEVREUX	-	-	-	-	-	-	13,163,522.91	39.92%
SANFORD BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-	-	-
SCOTIA CAPITAL MARKETS INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
CIMB SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC	-	-	-	-	-	-	-	-
CIBC WORLD MARKETS INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
WILLIAM BLAIR & CO.	-	-	-	-	-	-	-	-
DAIWA	-	-	-	-	-	-	3,272,382.68	9.92%
NBF SECURITIES CORP	-	-	-	-	-	-	-	-
KEPLER CHEUVREUX	-	-	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK-EURO ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
SOCIETE GENERALE ALGO EURO	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC	-	-	-	-	-	-	-	-
COWEN & COMPANY-ALGO	-	-	-	-	-	-	-	-
ING BANK	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP PARIBAS	-	-	-	-	-	-	-	-
FOX RIVER (SUNGARD)	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC, INC	-	-	-	-	-	-	-	-

DBS VICKERS	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS	-	-	-	-	-	-	1,904,437.88	5.78%
PENSERRA SECURITIES LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
REDBURN PARTNERS LLP	-	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-	-	-
HANDELSBANKEN	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES	-	-	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-	-	-
MIZUHO	-	-	-	-	-	-	-	-
PIPER JAFFRAY CO	-	-	-	-	-	-	-	-
ROYAL BANK OF SCOTLAND	-	-	-	-	-	-	-	-
STANDARD CHARTERED	-	-	-	-	-	-	-	-
T D NEWCREST	-	-	-	-	-	-	-	-
BMO CAPITAL MARKETS	-	-	-	-	-	-	-	-
KNIGHT SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
RBC CAPITAL MARKETS-EURO	-	-	-	-	-	-	-	-
SANDLER OCEIL&PARTNERS	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
ABN AMRO SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC	-	-	-	-	-	-	-	-
CARNEGIE	-	-	-	-	-	-	-	-
FIDELITY	-	-	-	-	-	-	-	-
BLAYLOCK ROBERT VAN	-	-	-	-	-	-	-	-
GRIFFITHS MCBURNEY	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下部分开放式基金 2015 年参加中国工商银行基金定投费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2014 年 12 月 31 日

2	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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	建信全球机遇股票型证券投资基金 2013 年年度报告更正公告	指定报刊和/或公司网站	2014 年 3 月 28 日
11	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	2013 年第三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全球机遇股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信全球机遇股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信全球机遇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