

# 建信改革红利股票型证券投资基金 2015 年 半年度报告摘要

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	建信改革红利股票
基金主代码	000592
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 5 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	89,810,988.20 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	我国全面深化改革将对经济和资本市场产生深远影响，改革红利的释放有望带来超额投资收益。本基金主要投资受益于全面深化改革的行业股票，包括受益于国企改革、户籍和土地制度改革以及资源要素价格改革等的相关行业上市公司，追求超越业绩比较基准的长期回报。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势等因素对各个行业及上市公司的影响以及核心股票资产的估值水平，合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资比例。本基金主要投资受益于改革红利的相关行业，本基金将综合考虑国家经济政策、经济周期、各行业的相对估值水平和行业竞争格局等因素，进行股票资产在各行业间的配置。本基金坚持“自下而上”的个股选择策略，致力于选择具有竞争力比较优势、未来成长空间大、持续经营能力强的上市公司。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标。
业绩比较基准	85%×沪深 300 指数收益率+15%×中债总财富（总值）指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	建信基金管理有限责任公	中国农业银行股份有限公司

	司		
信息披露负责人	姓名	吴曙明	林葛
	联系电话	010-66228888	010-66060069
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tgxxpl@abcchina.com
客户服务电话	400-81-95533 010-66228000	95599	
传真	010-66228001	010-68121816	

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	16,184,562.87
本期利润	-1,416,140.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0298
本期基金份额净值增长率	60.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.7854
期末基金资产净值	186,133,118.27
期末基金份额净值	2.072

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

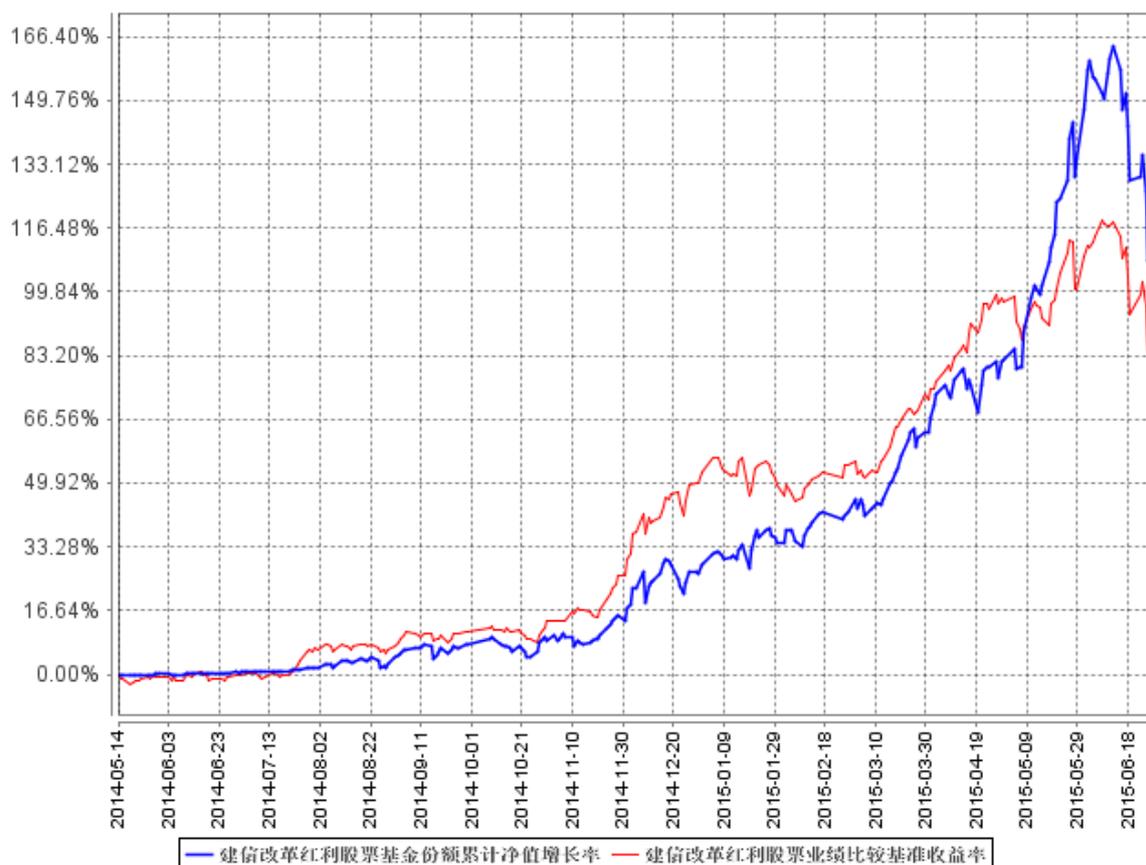
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-11.72%	3.87%	-6.30%	2.97%	-5.42%	0.90%
过去三个月	27.12%	2.97%	9.45%	2.22%	17.67%	0.75%
过去六个月	60.99%	2.39%	23.14%	1.92%	37.85%	0.47%
过去一年	106.17%	1.88%	88.37%	1.56%	17.80%	0.32%
自基金合同生效起至今	107.20%	1.77%	88.04%	1.49%	19.16%	0.28%

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

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

建信改革红利股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、量化衍生品及海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务

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

截至 2015 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金 (LOF)、建信创新中国股票型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、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、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金，共计 55 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 1654.99 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		
陶灿	本基金的 基金经理	2014 年 5 月 14 日	-	8	硕士。 2007 年 7 月加入本公司，从事行业研究，历任研究员、基金经理助理。 2011 年 7 月 11 日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理；2014 年 5 月 14 日起任建信改革红利股票型证券投资基金基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管

理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年以来，市场整体走势较好，指数先扬后抑，风格上以中小盘股票为主，在半年度末，由于配资监管引发市场剧烈调整，但整个上半年还是保持较为强势的格局。

从基本面看，上半年宏观经济层面数据继续保持较弱态势，但流动性方面维持较为宽松的环境，期间陆续实施了降准、降息操作，引导市场市场对宽松货币政策的正面预期，值得一提的是，在二季度由于场外配资的大幅增长，引发较强的约束监管，在 6 月中下旬，由于边际效应，最终出现负面的正反馈。

在上半年，本基金以成长为主，价值为辅，核心关注国企改革主题，在具体的配置上，聚焦行业与个股，淡化宏观经济的影响，同时积极应对场外配资的负面影响，优化组合结构。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率 60.99%，波动率 2.39%，业绩比较基准收益率 23.14%，波动率 1.92%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观基金增长依然保持较弱局面，流动性政策将大概率保持正面影响，但不可否认的是宽松货币政策也许会遭遇美元加息的扰动，企业盈利的恢复亦将是小概率事件，而国企改革的落地措施有望得到进一步体现，下半年的市场依然不是基本面主导的市场，主题投资依然是市场焦点。本基金将综合考量成长的确定性，估值的合理性，聚焦投资受益于改革的板块和行业，为投资者创造超额回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

自 2015 年 3 月 26 日起，公司按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值价格，对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）进行估值。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

规定。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—建信基金管理有限责任公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，建信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：建信改革红利股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		40,170,090.95	5,074,977.58
结算备付金		360,779.65	317,897.84
存出保证金		47,816.40	91,930.27

交易性金融资产		176,831,205.32	54,765,850.75
其中：股票投资		176,120,639.42	54,146,918.69
基金投资		-	-
债券投资		710,565.90	618,932.06
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		7,854.65	2,832.54
应收股利		-	-
应收申购款		3,257,372.44	622,781.93
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		220,675,119.41	60,876,270.91
<b>负债和所有者权益</b>		<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2015年6月30日</b>	<b>2014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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,540,634.06	571,157.80
应付赎回款		27,586,550.89	1,194,379.85
应付管理人报酬		254,442.98	81,373.85
应付托管费		42,407.14	13,562.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		801,530.90	354,427.40
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		316,435.17	254,151.57
负债合计		34,542,001.14	2,469,052.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		89,810,988.20	45,399,058.11
未分配利润		96,322,130.07	13,008,160.06
所有者权益合计		186,133,118.27	58,407,218.17
负债和所有者权益总计		220,675,119.41	60,876,270.91

注：1. 报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.072 元，基金份额总额 89,810,988.20 份。

## 6.2 利润表

会计主体：建信改革红利股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 5 月 14 日(基 金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		212,960.90	3,176,588.77
1.利息收入		42,009.80	1,978,621.71
其中：存款利息收入		40,917.70	62,935.57
债券利息收入		1,092.10	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,915,686.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,705,618.85	23,707.60
其中：股票投资收益		15,888,742.41	-112,142.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益		588,485.24	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		228,391.20	135,850.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-17,600,703.38	1,174,259.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		1,066,035.63	-
<b>减：二、费用</b>		1,629,101.41	1,104,020.56
1. 管理人报酬		649,045.09	870,483.94
2. 托管费		108,174.18	145,080.65
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		688,331.97	35,659.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		183,550.17	52,796.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,416,140.51	2,072,568.21
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,416,140.51	2,072,568.21

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信改革红利股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	45,399,058.11	13,008,160.06	58,407,218.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,416,140.51	-1,416,140.51
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）	44,411,930.09	84,730,110.52	129,142,040.61
其中：1.基金申购款	148,484,904.37	174,564,244.77	323,049,149.14
2.基金赎回款	-104,072,974.28	-89,834,134.25	-193,907,108.53
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）	89,810,988.20	96,322,130.07	186,133,118.27
项目	上年度可比期间 2014 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	450,208,397.50	-	450,208,397.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,072,568.21	2,072,568.21
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持	-	-	-



## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《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》、《建信改革红利股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债

券除外), 按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年5月14日(基金合同生效日) 至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	649,045.09	-
其中：支付销售机构的客户维护费	269,118.28	-

注：1、支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数；

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

**6.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年5月14日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费		108,174.18		-

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.25%/当年天数。

**6.4.8.2.3 销售服务费**

无。

**6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

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

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

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。

**6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年5月14日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	40,170,090.95	37,906.43	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按约定利率计息。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

### 6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002080	中材科技	2015年4月21日	筹划重大资产重组	23.23	-	-	43,700	1,039,749.34	1,015,151.00	-
002368	太极股份	2015年5月14日	重大事项停牌	52.73	-	-	19,050	984,171.00	1,004,506.50	-
002589	瑞康医药	2015年5月21日	重大事项停牌	104.25	-	-	7,447	293,614.11	776,349.75	-
300099	尤洛卡	2015年6月23日	重大事项停牌	23.44	-	-	173,100	4,756,984.00	4,057,464.00	-
300155	安居宝	2015年6月15日	重大事项停牌	40.15	2015年7月20日	32.54	24,900	1,020,287.00	999,735.00	-
600310	桂东电力	2015年6月30日	重大事项停牌	31.53	2015年7月13日	34.68	21,900	681,756.00	690,507.00	-
601311	骆驼股份	2015年6月18日	重大事项停牌	23.31	2015年7月15日	25.38	103,200	2,710,112.00	2,405,592.00	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后经交易所批准复牌。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

至本报告期末，本基金银行间市场无债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易，故未存在作为抵押的债券。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 165,881,900.07 元，属于第二层次的余额为 10,949,305.25 元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 26 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允

价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	176,120,639.42	79.81
	其中：股票	176,120,639.42	79.81
2	固定收益投资	710,565.90	0.32
	其中：债券	710,565.90	0.32
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	40,530,870.60	18.37
7	其他各项资产	3,313,043.49	1.50
8	合计	220,675,119.41	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,492,512.68	2.95
B	采矿业	6,205,810.00	3.33
C	制造业	107,119,741.09	57.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,946,667.00	1.58
E	建筑业	2,456,310.00	1.32
F	批发和零售业	2,591,964.75	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	2,333,870.00	1.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,285,552.74	6.06

J	金融业	15,854,943.52	8.52
K	房地产业	7,710,264.70	4.14
L	租赁和商务服务业	2,549,550.94	1.37
M	科学研究和技术服务业	2,056,320.00	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	3,367,350.00	1.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,149,782.00	2.23
S	综合	-	-
	合计	176,120,639.42	94.62

注：以上行业分类以 2015 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600651	飞乐音响	847,634	17,435,831.38	9.37
2	600271	航天信息	237,858	15,391,791.18	8.27
3	000915	山大华特	159,700	8,943,200.00	4.80
4	000488	晨鸣纸业	596,367	5,349,411.99	2.87
5	601988	中国银行	1,023,800	5,006,382.00	2.69
6	002037	久联发展	146,510	4,931,526.60	2.65
7	601398	工商银行	930,559	4,913,351.52	2.64
8	002275	桂林三金	191,400	4,892,184.00	2.63
9	601998	中信银行	591,000	4,556,610.00	2.45
10	002699	美盛文化	105,700	4,149,782.00	2.23

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn) 网站的半年度报告正文。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600651	飞乐音响	16,341,870.24	27.98
2	600271	航天信息	14,953,320.77	25.60

3	000915	山大华特	9,754,999.94	16.70
4	600050	中国联通	8,580,479.00	14.69
5	000488	晨鸣纸业	6,943,027.30	11.89
6	002037	久联发展	6,042,935.50	10.35
7	002275	桂林三金	5,178,276.32	8.87
8	601998	中信银行	4,833,896.31	8.28
9	002699	美盛文化	4,781,262.00	8.19
10	300099	尤洛卡	4,756,984.00	8.14
11	601398	工商银行	4,754,272.72	8.14
12	601988	中国银行	4,748,533.00	8.13
13	600109	国金证券	4,505,404.20	7.71
14	002457	青龙管业	4,350,979.42	7.45
15	000400	许继电气	4,284,556.75	7.34
16	002146	荣盛发展	4,259,856.00	7.29
17	300275	梅安森	3,771,482.00	6.46
18	002090	金智科技	3,571,334.85	6.11
19	600028	中国石化	3,570,700.00	6.11
20	600259	广晟有色	3,557,780.00	6.09
21	600438	通威股份	3,398,444.42	5.82
22	000952	广济药业	3,303,118.00	5.66
23	002597	金禾实业	3,271,097.28	5.60
24	002358	森源电气	3,210,868.45	5.50
25	000961	中南建设	3,172,528.00	5.43
26	000524	岭南控股	3,118,750.00	5.34
27	300422	博世科	3,114,000.00	5.33
28	002477	雏鹰农牧	3,054,905.30	5.23
29	000802	北京文化	3,036,251.00	5.20
30	300017	网宿科技	3,009,205.30	5.15
31	600687	刚泰控股	2,971,438.00	5.09
32	601601	中国太保	2,835,547.40	4.85
33	002086	东方海洋	2,772,280.80	4.75
34	601311	骆驼股份	2,710,112.00	4.64
35	002405	四维图新	2,596,651.00	4.45
36	002065	东华软件	2,540,865.00	4.35
37	600223	鲁商置业	2,487,852.63	4.26
38	000544	中原环保	2,481,479.25	4.25

39	002196	方正电机	2,399,194.52	4.11
40	300178	腾邦国际	2,278,500.00	3.90
41	002726	龙大肉食	2,258,525.00	3.87
42	002347	泰尔重工	2,230,735.00	3.82
43	300299	富春通信	2,199,509.00	3.77
44	002584	西陇化工	2,177,715.00	3.73
45	002327	富安娜	2,135,965.35	3.66
46	002206	海利得	2,053,372.00	3.52
47	600048	保利地产	2,043,452.32	3.50
48	300332	天壕节能	2,030,916.40	3.48
49	600138	中青旅	2,030,200.00	3.48
50	002612	朗姿股份	1,960,509.00	3.36
51	002241	歌尔声学	1,921,928.00	3.29
52	300267	尔康制药	1,761,115.10	3.02
53	601166	兴业银行	1,738,136.00	2.98
54	000998	隆平高科	1,734,941.75	2.97
55	000988	华工科技	1,647,641.00	2.82
56	002675	东诚药业	1,634,704.00	2.80
57	002656	卡奴迪路	1,607,682.00	2.75
58	002153	石基信息	1,584,945.50	2.71
59	600999	招商证券	1,556,314.00	2.66
60	600993	马应龙	1,524,507.30	2.61
61	000712	锦龙股份	1,522,513.00	2.61
62	002034	美欣达	1,506,094.00	2.58
63	300068	南都电源	1,469,246.00	2.52
64	600298	安琪酵母	1,467,340.00	2.51
65	300002	神州泰岳	1,437,594.00	2.46
66	000957	中通客车	1,416,619.97	2.43
67	300153	科泰电源	1,415,252.82	2.42
68	002412	汉森制药	1,388,539.00	2.38
69	601377	兴业证券	1,383,942.00	2.37
70	000861	海印股份	1,325,643.94	2.27
71	600570	恒生电子	1,322,954.74	2.27
72	300274	阳光电源	1,285,277.29	2.20
73	000831	五矿稀土	1,189,228.00	2.04
74	000783	长江证券	1,180,847.00	2.02

75	002115	三维通信	1,175,946.76	2.01
----	--------	------	--------------	------

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000998	隆平高科	4,868,413.13	8.34
2	600651	飞乐音响	4,835,819.85	8.28
3	601318	中国平安	4,757,069.50	8.14
4	000625	长安汽车	3,666,561.12	6.28
5	600837	海通证券	3,569,585.59	6.11
6	600271	航天信息	3,368,744.68	5.77
7	600050	中国联通	2,968,451.00	5.08
8	000802	北京文化	2,928,272.80	5.01
9	300275	梅安森	2,842,202.00	4.87
10	601601	中国太保	2,744,592.00	4.70
11	002065	东华软件	2,729,593.00	4.67
12	601166	兴业银行	2,600,961.98	4.45
13	600030	中信证券	2,361,641.00	4.04
14	000952	广济药业	2,321,231.50	3.97
15	600048	保利地产	2,281,205.14	3.91
16	300274	阳光电源	2,270,788.77	3.89
17	600340	华夏幸福	2,263,228.86	3.87
18	300267	尔康制药	2,228,997.56	3.82
19	600109	国金证券	2,138,400.00	3.66
20	002153	石基信息	2,055,910.55	3.52
21	002241	歌尔声学	2,024,240.00	3.47
22	002063	远光软件	1,904,301.00	3.26
23	600388	龙净环保	1,847,995.92	3.16
24	000712	锦龙股份	1,846,036.36	3.16
25	000400	许继电气	1,840,027.41	3.15
26	600358	国旅联合	1,774,179.06	3.04
27	300153	科泰电源	1,763,195.62	3.02
28	300070	碧水源	1,716,479.06	2.94
29	601328	交通银行	1,685,432.84	2.89
30	300178	腾邦国际	1,671,302.37	2.86
31	002726	龙大肉食	1,652,697.71	2.83

32	300002	神州泰岳	1,602,460.00	2.74
33	002412	汉森制药	1,539,520.00	2.64
34	600999	招商证券	1,488,294.80	2.55
35	600584	长电科技	1,479,377.16	2.53
36	000957	中通客车	1,466,171.83	2.51
37	002285	世联行	1,441,258.50	2.47
38	000861	海印股份	1,428,314.76	2.45
39	002327	富安娜	1,418,556.00	2.43
40	601377	兴业证券	1,415,452.92	2.42
41	601633	长城汽车	1,414,267.61	2.42
42	300005	探路者	1,369,218.64	2.34
43	300302	同有科技	1,359,489.00	2.33
44	600848	自仪股份	1,335,888.66	2.29
45	000997	新大陆	1,331,687.10	2.28
46	002584	西陇化工	1,322,226.00	2.26
47	300170	汉得信息	1,278,071.18	2.19
48	002034	美欣达	1,247,845.00	2.14
49	600280	中央商场	1,229,677.00	2.11
50	600292	中电远达	1,207,048.00	2.07
51	002400	省广股份	1,204,153.64	2.06
52	300075	数字政通	1,190,417.45	2.04
53	600570	恒生电子	1,189,656.00	2.04
54	000402	金融街	1,169,311.00	2.00

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	309,454,806.89
卖出股票收入（成交）总额	185,697,089.21

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	710,565.90	0.38
8	其他	-	-
9	合计	710,565.90	0.38

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	4,890	710,565.90	0.38

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1**

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

**7.12.2**

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	47,816.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,854.65
5	应收申购款	3,257,372.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,313,043.49

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
12,991	6,913.32	49,407.13	0.06%	89,761,581.07	99.94%

### 8.2 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	1,062,317.71	1.18%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年5月14日）基金份额总额	450,208,397.50
本报告期期初基金份额总额	45,399,058.11
本报告期基金总申购份额	148,484,904.37
减：本报告期基金总赎回份额	104,072,974.28
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	89,810,988.20

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

我公司于 2015 年 3 月 26 日召开 2015 年度第一次临时股东会会议，决定解聘杨文升先生、欧阳伯权先生公司董事职务，并解聘顾建国先生独立董事职务，批准聘任许会斌先生、张维义先生为公司董事，以及李全先生为公司独立董事。2015 年 3 月 26 日公司召开第四届董事会第一次会议，会议选举许会斌先生为公司董事长。2015 年 5 月 28 日，公司依法完成了法定代表人变更手续，许会斌先生为法定代表人。公司已根据相关法律法规要求，在指定媒体公开披露了公司前述人员的变更信息，并已在监管机构备案。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	223,420,151.30	45.13%	203,401.91	45.49%	-
海通证券	1	201,786,828.41	40.76%	180,062.75	40.27%	-
中信证券	1	69,902,051.39	14.12%	63,638.84	14.23%	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

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

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

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

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

（4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本报告期未发生变更交易单元的情况。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
银河证券	1,060,082.80	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司  
2015 年 8 月 29 日