

建信新兴市场优选混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	38
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	45
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	47
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细.....	47
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	47
7.11 投资组合报告附注.....	47

§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 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.....	49
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	55
§11 备查文件目录	56
11.1 备查文件目录.....	56
11.2 存放地点.....	56
11.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信新兴市场优选混合型证券投资基金
基金简称	建信新兴市场混合（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	87,595,026.70 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	本基金属于混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,649,739.96
本期利润	-1,431,932.25
加权平均基金份额本期利润	-0.0162
本期加权平均净值利润率	-2.39%

本期基金份额净值增长率	-1.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016年6月30日）
期末可供分配利润	-24,653,118.34
期末可供分配基金份额利润	-0.2814
期末基金资产净值	62,941,908.36
期末基金份额净值	0.719
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016年6月30日）
基金份额累计净值增长率	-28.10%

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

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

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

3.2 基金净值表现

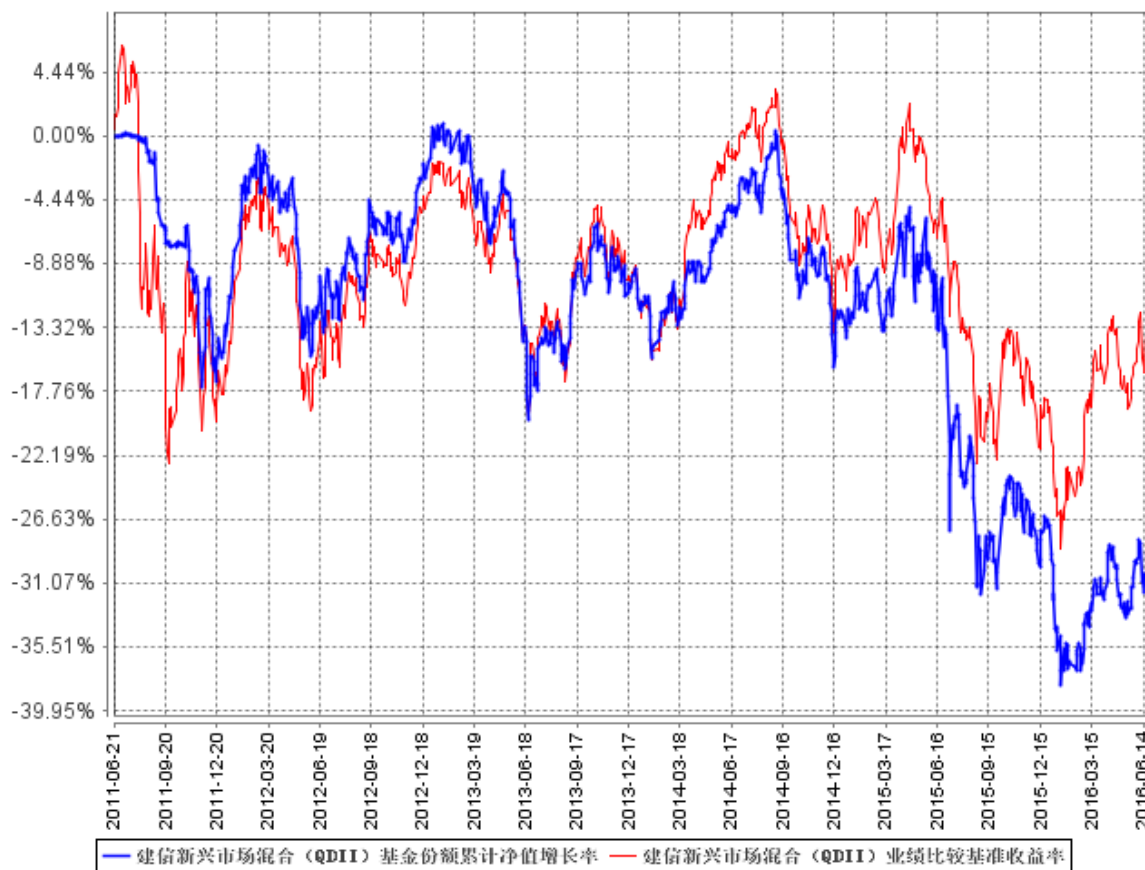
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.13%	1.37%	4.92%	1.49%	-2.79%	-0.12%
过去三个月	3.75%	1.10%	3.40%	1.10%	0.35%	0.00%
过去六个月	-1.51%	1.28%	8.87%	1.24%	-10.38%	0.04%
过去一年	-17.07%	1.58%	-5.78%	1.30%	-11.29%	0.28%
过去三年	-15.11%	1.14%	3.24%	0.99%	-18.35%	0.15%
自基金合同生效起至今	-28.10%	1.05%	-11.65%	1.08%	-16.45%	-0.03%

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

建信新兴市场混合（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。

§ 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、北京四家分公司和华东、西北两个营销中心，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“创新、诚信、专业、稳健、共赢”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“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力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、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、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、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、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、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、

建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金，共计 68 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 2,453.84 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	量化衍生品及海外投资部总经理、本基金的基金经理	2011年6月21日	-	17	美国哥伦比亚大学商学院MBA。曾任美国美林证券公司研究员、高盛证券公司研究员、美林证券公司投资组合策略分析师、美国阿罗亚投资公司基金经理；2010年3月加入建信基金管理有限责任公司，历任海外投资部执行总监、总监，量化衍生品及海外投资部总监。2011年4月20日起任建信全球机遇混合基金基金经理，2011年6月21日起任建信新兴市场混合基金基金经理，2012年6月26日起任建信全球资源混合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
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

			<p>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。</p> <p>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。他持有特许金融分析师（CFA）资格。</p>
Mihail Dobrinov	投资组合经理	18	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

			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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年新兴市场表现较好，成熟市场货币宽松，石油价格上涨是推动市场上行的主要原因。

2016 年 1 月受到美联储可能连续加息的预期影响，全球市场，包括新兴市场和原材料市场都出现大幅下跌。但随后市场发生了逆转，由于美国经济增长低于预期，美联储加息推迟，之后英

国脱欧更加剧了市场对未来经济的担忧，英国央行降息，美联储加息时点更进一步推迟至 9 月，并且 9 月加息的可能性也较低。宽松的货币政策预期推动了风险资产的上涨。石油价格在 1 月触及新低后大幅反弹，最大上涨幅度超过 50%，但是当欧佩克国家石油限产协议没有达成，欧佩克产量创出新高后，WTI 石油价格在 6 月到达 52 美元后下跌，但即使如此，石油价格也大大高于 1 月的低点价格。其它主要原材料价格也总体处于上涨趋势。俄罗斯和巴西等原材料生产国的经济因此受益。

俄罗斯经济衰退状况有所好转，近期工业 PMI 基本保持在 50 分位以上，工业生产开始正增长，虽然个人收入和消费同比还在下降，但下降幅度出现好转。巴西经济虽然继续下行，但由于总统受到弹劾并被停职 180 天。投资人对巴西政治权力的变更抱有期待，市场有一定幅度上涨。印度经济保持较高的增长速度，1 季度 GDP 增长 7.9%，但通胀有所上涨。中国一季度 GDP 增长 6.7%，固定资产投资上升 9.6%，工业 PMI 维持在 50 分位附近，房地产市场在中央“去库存”的多项利好下，销售状况出现好转。从当前数据看，中国经济增长速度基本企稳，虽然增速处于近 10 年的低位，但中央政府没有使用大规模刺激手段，同时稳健推动去产能进程，企业对低速增长环境的适应能力大大增加。美联储的货币政策和近期的英国公投“脱欧”事件对新兴市场产生了一定影响。

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-1.51%，波动率 1.28%，业绩比较基准收益率 8.87%，波动率 1.24%。

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，我们新兴市场主要国家的经济基本面可能将继续维持当前状态，俄罗斯和巴西经济相对较弱，中国和印度经济相对较好。未来石油价格和成熟市场的货币政策仍将是市场涨跌的主要驱动力量。我们认为石油的价格仍然存在较大的不确定性，在欧洲央行和日本央行倾向放松的背景下，美联储加息的态度可能会更加谨慎，所以全球总体的货币环境可能仍然偏向宽松，并对新兴市场可能形成一定支持。主要风险或许来自英国脱欧后可能产生连锁效应，例如英国或欧洲经济是否会出现问题，欧盟其它成员国家是否会效仿英国等，前期土耳其发生的军事政变也显示出欧洲各国政治方面的不稳定性。这些不稳定因素可能会对新兴市场产生一定的影响。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裁、督察长、投资总经理、研究总经理、风险管理总经理、运营总经理及监察稽核总经理组成。

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

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本报告期内，本基金托管人在对建信新兴市场优选混合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

本报告期内，建信新兴市场优选混合型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限公司在建信新兴市场优选混合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，建信新兴市场优选混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对建信基金管理有限公司编制和披露的建信新兴市场优选混合型证券投资基金2016年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信新兴市场优选混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,162,973.93	7,355,758.06
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	55,735,569.89	60,850,297.28
其中：股票投资		52,197,609.96	57,314,488.83
基金投资		3,537,959.93	3,535,808.45
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	217.24	140.84
应收股利		628,163.31	42,795.37
应收申购款		125,829.73	11,162.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	153,418.05	-
资产总计		63,806,172.15	68,260,153.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		68,092.37	163,068.74
应付管理人报酬		89,981.06	99,523.91
应付托管费		17,496.32	19,351.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	688,694.04	413,518.29
负债合计		864,263.79	695,462.79
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	87,595,026.70	92,559,649.85
未分配利润	6.4.7.10	-24,653,118.34	-24,994,958.98
所有者权益合计		62,941,908.36	67,564,690.87
负债和所有者权益总计		63,806,172.15	68,260,153.66

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值0.719元，基金份额总额87,595,026.70份。

6.2 利润表

会计主体：建信新兴市场优选混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016年1月1日至 2016年6月30日	2015年1月1日至2015 年6月30日
一、收入		-543,143.46	-6,503,799.25

1.利息收入		6,856.57	14,033.33
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,856.57	14,033.33
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）		-3,917,877.42	4,205,426.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,940,659.98	870,553.71
基金投资收益	6.4.7.13	-	89,143.71
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	800,882.19
股利收益	6.4.7.17	1,022,782.56	2,444,847.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,217,807.71	-9,861,877.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		144,998.68	-953,775.27
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	5,071.00	92,393.20
减：二、费用		888,788.79	1,652,793.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	537,891.94	871,757.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	104,590.13	169,508.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	67,763.68	431,986.53
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	178,543.04	179,541.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,431,932.25	-8,156,593.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,431,932.25	-8,156,593.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信新兴市场优选混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	92,559,649.85	-24,994,958.98	67,564,690.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-1,431,932.25	-1,431,932.25
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）	-4,964,623.15	1,773,772.89	-3,190,850.26
其中：1.基金申购款	2,583,644.23	-822,664.73	1,760,979.50
2.基金赎回款	-7,548,267.38	2,596,437.62	-4,951,829.76
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）	87,595,026.70	-24,653,118.34	62,941,908.36
项目	上年度可比期间 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）	62,570,371.66	-7,759,772.23	54,810,599.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-8,156,593.19	-8,156,593.19
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）	89,305,370.58	-4,306,321.13	84,999,049.45
其中：1.基金申购款	191,924,170.65	-13,438,657.28	178,485,513.37
2.基金赎回款	-102,618,800.07	9,132,336.15	-93,486,463.92
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）	151,875,742.24	-20,222,686.55	131,653,055.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>孙志晨</u>	<u>赵乐峰</u>	<u>丁颖</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信新兴市场优选混合型证券投资基金(原名为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 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,建信新兴市场优选股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 8 日公告后更名为建信新兴市场优选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信新兴市场优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于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。本基金为混合型基金,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))。

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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信新兴市场优选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	7,162,973.93
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	7,162,973.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	57,767,734.86	52,197,609.96	-5,570,124.90
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	3,933,073.20	3,537,959.93	-395,113.27
其他	-	-	-
合计	61,700,808.06	55,735,569.89	-5,965,238.17

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无余额。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	217.24
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	217.24

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	-
应收未起息外汇交易	153,418.05
合计	153,418.05

6.4.7.7 应付交易费用

无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	175.78
其他应付款-应付外汇结算款-港币	-
预提费用	535,071.38
应付未起息外汇交易	153,446.88
合计	688,694.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	92,559,649.85	92,559,649.85
本期申购	2,583,644.23	2,583,644.23
本期赎回(以“-”号填列)	-7,548,267.38	-7,548,267.38
- 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	87,595,026.70	87,595,026.70

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-21,234,037.72	-3,760,921.26	-24,994,958.98
本期利润	-4,649,739.96	3,217,807.71	-1,431,932.25
本期基金份额交易产生的变动数	1,263,477.07	510,295.82	1,773,772.89
其中：基金申购款	-709,085.59	-113,579.14	-822,664.73
基金赎回款	1,972,562.66	623,874.96	2,596,437.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-24,620,300.61	-32,817.73	-24,653,118.34

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	6,851.94
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	4.63
合计	6,856.57

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	22,044,912.16
减：卖出股票成本总额	26,985,572.14
买卖股票差价收入	-4,940,659.98

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期间无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期末投资债券。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末投资债券。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末投资债券。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.16 衍生工具收益**6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期间无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期间无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	966,802.61
基金投资产生的股利收益	55,979.95
合计	1,022,782.56

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	3,217,807.71
——股票投资	3,215,656.23
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	2,151.48
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	3,217,807.71

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	5,071.00
合计	5,071.00

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	67,763.68
银行间市场交易费用	-
合计	67,763.68

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	26,852.28
信息披露费	149,205.06
存托服务费	-
银行汇划费	960.98
银行划款手续费	-
债券托管账户维护费	-
其他	1,524.72
合计	178,543.04

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至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。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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。

6.4.10.1.2 债券交易

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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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。

6.4.10.1.4 基金交易

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。

6.4.10.1.5 权证交易

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。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	537,891.94	871,757.27
其中：支付销售机构的客户维护费	147,058.33	211,403.83

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

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	104,590.13	169,508.43

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30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	11.42%	6.58%

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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015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
中国工商银行	1,889,342.05	3,384.49	7,785,655.15	12,938.98
布朗兄弟哈里曼银行	5,273,631.88	3,467.45	2,231,824.96	1,064.98

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 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。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金通过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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均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年末未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除 6.4.13.4.1.1 中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,162,973.93	-	-	-	7,162,973.93
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	55,735,569.89	55,735,569.89
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	-	-	-	217.24	217.24
应收股利	-	-	-	628,163.31	628,163.31
应收申购款	-	-	-	125,829.73	125,829.73
其他资产	-	-	-	153,418.05	153,418.05
资产总计	7,162,973.93	-	-	56,643,198.22	63,806,172.15

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				68,092.37	68,092.37
应付管理人报酬				89,981.06	89,981.06
应付托管费				17,496.32	17,496.32
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				688,694.04	688,694.04
负债总计				864,263.79	864,263.79
利率敏感度缺口	7,162,973.93			-55,778,934.43	62,941,908.36
上年度末 2015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	7,355,758.06				7,355,758.06
结算备付金					
存出保证金					
交易性金融资产				60,850,297.28	60,850,297.28
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				140.84	140.84
应收股利				42,795.37	42,795.37
应收申购款	1,093.74			10,068.37	10,068.37
其他资产					
资产总计	7,356,851.80			60,903,301.86	68,260,153.66
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				163,068.74	163,068.74
应付管理人报酬				99,523.91	99,523.91
应付托管费				19,351.85	19,351.85
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	-	-	-	413,518.29	413,518.29
负债总计	-	-	-	695,462.79	695,462.79
利率敏感度缺口	7,356,851.80	-	-	-60,207,839.07	67,564,690.87

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	5,782,466.02	153,450.86	17,260.95	5,953,177.83
交易性金融资产	9,083,060.93	46,652,508.96		
			-	55,735,569.89
应收股利	-	569,114.31		
			-	569,114.31
应收利息	9.28	-		
			-	9.28
其它资产	153,418.05	-		
			-	153,418.05
资产负债表外汇风险敞口净额	15,018,954.28	47,221,627.25	17,260.95	62,257,842.48
项目	上年度末 2015年12月31日			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	6,941,245.28	3.77	13,707.05	6,954,956.10
交易性金融资产	3,980,726.04	56,869,571.24		
			-	60,850,297.28

应收股利	12,300.18	30,495.19		
			-	42,795.37
应收利息	15.00	-		
			-	15.00
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	10,934,286.50	56,900,070.20	13,707.05	67,848,063.75

6.4.13.4.2 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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	所有外币相对人民币贬值5%	-3,112,892.12	-3,392,403.19
	所有外币相对人民币升值5%	3,112,892.12	3,392,403.19

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资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%。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 6 月 30 日		2015 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	52,197,609.96	82.93	57,314,488.83	84.83
交易性金融资产—基金投资	3,537,959.93	5.62	3,535,808.45	5.23
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	55,735,569.89	88.55	60,850,297.28	90.06

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
		业绩比较基准上升 5%	3,178,897.21
业绩比较基准下降 5%	-3,178,897.21	-3,712,396.35	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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 2016 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 55,735,569.89 元，无属于第二层次或第三层次的余额(2015 年 6 月 30 日：第一层次 123,630,966.29 元，无属于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

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 2016 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(2015 年 6 月 30 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。

§ 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	52,197,609.96	81.81
	其中：普通股	44,809,811.60	70.23
	存托凭证	7,387,798.36	11.58
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	3,537,959.93	5.54
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	7,162,973.93	11.23
8	其他各项资产	907,628.33	1.42
9	合计	63,806,172.15	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	44,533,440.16	70.75
美国	7,664,169.80	12.18
合计	52,197,609.96	82.93

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
非必需消费品	4,358,190.62	6.92
必需消费品	376,738.54	0.60
能源	4,384,029.76	6.97
金融	16,174,849.41	25.70
医疗保健	276,371.44	0.44
工业	2,872,353.57	4.56
信息技术	15,226,068.30	24.19
材料	1,415,777.95	2.25
电信服务	6,002,937.12	9.54
公用事业	1,110,293.25	1.76
合计	52,197,609.96	82.93

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	KYG875721634	香港证券交易所	中国香港	41,200	6,200,904.34	9.85
2	CHINA MOBILE LTD	中国移动	HK0941009539	香港证券交易所	中国香港	57,000	4,318,690.24	6.86
3	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	CNE1000001Z5	香港证券交易所	中国香港	1,206,000	3,184,961.94	5.06
4	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	5,247	2,767,159.38	4.40
5	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国石化	CNE1000002Q2	香港证券交易所	中国香港	416,000	1,991,039.23	3.16
6	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	重庆农村商业银行	CNE100000X44	香港证券交易所	中国香港	549,000	1,839,318.21	2.92
7	NETEASE INC-ADR	网易公司	US64110W1027	纳斯达克证券交易所	美国	1,402	1,796,355.21	2.85
8	CNOOC LTD	中国海洋石油	HK0883013259	香港证券交易所	中国香港	187,000	1,537,500.05	2.44
9	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海外发展	HK0688002218	香港证券交易所	中国香港	72,000	1,507,637.88	2.40
10	SUNNY OPTICAL	舜宇光	KYG8586D1097	香港	中国香	54,000	1,253,031.69	1.99

	TECH	学科技		证券交易所	港			
11	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	CNE1000003X6	香港证券交易所	中国香港	37,000	1,079,918.28	1.72
12	BAIDU INC - SPON ADR	百度	US0567521085	纳斯达克证券交易所	美国	956	1,046,956.40	1.66
13	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	交通银行	CNE100000205	香港证券交易所	中国香港	243,000	1,015,578.72	1.61
14	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	瑞声科技	KYG2953R1149	香港证券交易所	中国香港	17,500	984,900.34	1.56
15	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广汽集团	CNE100000Q35	香港证券交易所	中国香港	118,000	932,872.31	1.48
16	CHINA MERCHANTS BANK-H	招商银行	CNE1000002M1	香港证券交易所	中国香港	59,000	874,378.69	1.39
17	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	中国交建	CNE1000002F5	香港证券交易所	中国香港	123,000	872,532.60	1.39
18	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中国电信	CNE1000002V2	香港证券交易所	中国香港	242,000	715,632.28	1.14
19	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	中信集团	CNE1000001Q4	香港证券交易所	中国香港	177,000	712,512.74	1.13
20	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	中国财险	CNE100000593	香港证券交易所	中国香港	68,000	704,384.83	1.12
21	CHINA RAILWAY	中国铁	CNE100000981	香港	中国香	85,000	702,496.01	1.12

	CONSTRUCTION-H	建		证券 交易 所	港			
22	CHINA EVERBRIGHT LTD	中国光 大控股	HK0165000859	香港 证券 交易 所	中国香 港	52,000	662,198.32	1.05
23	TONGDA GROUP HOLDINGS LTD	通达集 团	KYG8917X1218	香港 证券 交易 所	中国香 港	510,000	658,181.37	1.05
24	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	光大银 行	CNE100001QW3	香港 证券 交易 所	中国香 港	215,000	650,489.34	1.03
25	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国人 寿	CNE1000002L3	香港 证券 交易 所	中国香 港	44,000	625,003.08	0.99
26	PETROCHINA CO LTD-H	中国石 油	CNE1000003W8	香港 证券 交易 所	中国香 港	138,000	623,926.19	0.99
27	CHINA POWER INTERNATIONAL	中国电 力	HK2380027329	香港 证券 交易 所	中国香 港	233,000	567,543.61	0.90
28	BEIJING JINGNENG CLEAN ENE-H	京能清 洁能源	CNE100001336	香港 证券 交易 所	中国香 港	252,000	542,749.64	0.86
29	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	东方航 空	CNE1000002K5	香港 证券 交易 所	中国香 港	164,000	541,040.30	0.86
30	CHINA LODGING GROUP-SPON ADS	华住酒 店集团 有限公 司	US16949N1090	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	2,150	519,385.42	0.83
31	TECHNOVATOR INTERNATIONAL LT	同方泰 德	SG9999008015	香港 证券 交易 所	中国香 港	154,000	518,579.57	0.82
32	NEW ORIENTAL	新东方	US6475811070	纽约	美国	1,861	516,826.97	0.82

	EDUCATIO-SP ADR	教育科 技集团		证券 交易 所				
33	TAL EDUCATION GROUP- ADR	学而思 教育集 团	US8740801043	纽约 证券 交易 所	美国	1,246	512,769.21	0.81
34	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控 股	BMG5800U1071	香港 证券 交易 所	中国香 港	52,400	499,797.34	0.79
35	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏 信	HK0000077468	香港 证券 交易 所	中国香 港	97,000	499,076.00	0.79
36	CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	中国信 达	CNE100001QS1	香港 证券 交易 所	中国香 港	218,000	486,290.14	0.77
37	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	中国建 材	CNE1000002N9	香港 证券 交易 所	中国香 港	166,000	479,538.24	0.76
38	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	中国太 平	HK0000055878	香港 证券 交易 所	中国香 港	38,800	478,847.67	0.76
39	BYD CO LTD-H	比亚迪	CNE100000296	香港 证券 交易 所	中国香 港	11,500	456,543.35	0.73
40	BELJING CAPITAL LAND LTD-H	首创置 业	CNE100000239	香港 证券 交易 所	中国香 港	184,000	443,471.17	0.70
41	PCCW LTD	电讯盈 科	HK0008011667	香港 证券 交易 所	中国香 港	88,000	391,096.99	0.62
42	AIA GROUP LTD	友邦保 险	HK0000069689	香港 证券 交易 所	中国香 港	9,800	388,216.75	0.62
43	KWG PROPERTY HOLDING LTD	合景泰 富	KYG532241042	香港 证券 交易 所	中国香 港	100,500	385,665.56	0.61

				交易所				
44	LONGFOR PROPERTIES	龙湖地产	KYG5635P1090	香港证券交易所	中国香港	44,000	378,311.13	0.60
45	WH GROUP LTD	万洲国际	KYG960071028	香港证券交易所	中国香港	72,500	376,738.54	0.60
46	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	中国联通	HK0000049939	香港证券交易所	中国香港	50,000	342,722.67	0.54
47	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	BMG653181005	香港证券交易所	中国香港	60,000	302,040.38	0.48
48	CHINA BIOLOGIC PRODUCTS INC	中国生物制品股份有限公司	US16938C1062	纳斯达克证券交易所	美国	392	276,371.44	0.44
49	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	创科实业	HK0669013440	香港证券交易所	中国香港	10,000	275,631.08	0.44
50	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理文造纸	KYG5427W1309	香港证券交易所	中国香港	56,000	275,203.74	0.44
51	WEICHAI POWER CO LTD-H	潍柴动力	CNE1000004L9	香港证券交易所	中国香港	39,000	264,657.11	0.42
52	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	世茂房地产	KYG810431042	香港证券交易所	中国香港	31,000	258,588.96	0.41
53	SHANGHAI JIN JIANG INTL HO-H	锦江酒店	CNE1000003Z1	香港证券交易所	中国香港	116,000	250,828.55	0.40
54	CHINA COMMUNICATIONS	中国通信服务	CNE1000002G3	香港证券交易所	中国香港	68,000	234,794.94	0.37

	SERVI-H			交易所				
55	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中国神华	CNE1000002R0	香港证券交易所	中国香港	19,000	231,564.29	0.37
56	JD.COM INC-ADR	京东	US47215P1066	纳斯达克证券交易所	美国	1,622	228,345.77	0.36
57	CHINA RESOURCES CEMENT	华润水泥控股	KYG2113L1068	香港证券交易所	中国香港	98,000	207,719.00	0.33
58	FOSUN INTERNATIONAL LTD	复星国际	HK0656038673	香港证券交易所	中国香港	23,000	196,574.10	0.31
59	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	东方海外国际	BMG677491539	香港证券交易所	中国香港	7,500	168,904.16	0.27
60	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	KYG9828G1082	香港证券交易所	中国香港	32,000	155,891.81	0.25
61	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上海石化	CNE1000004C8	香港证券交易所	中国香港	50,000	151,276.59	0.24
62	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	中国联塑	KYG2157Q1029	香港证券交易所	中国香港	36,000	126,149.29	0.20
63	XINYI AUTOMOBILE GLASS HONG	信义汽车玻璃香港企业有限公司	KYG9830W1096	香港证券交易所	中国香港	4,000	9,298.81	0.01

注：所用证券代码采用 ISIN 码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	US01609W1027	1,802,488.71	2.67
2	NETEASE INC-ADR	US64110W1027	1,554,448.78	2.30
3	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	CNE1000002Q2	754,721.51	1.12
4	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	CNE100000Q35	733,601.10	1.09
5	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	CNE100000X44	729,441.89	1.08
6	CHINA EVERBRIGHT LTD	HK0165000859	689,761.63	1.02
7	BAIDU INC - SPON ADR	US0567521085	633,673.34	0.94
8	CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	CNE100001QS1	633,447.57	0.94
9	PETROCHINA CO LTD-H	CNE1000003W8	618,685.67	0.92
10	KWG PROPERTY HOLDING LTD	KYG532241042	566,493.84	0.84
11	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	CNE1000002N9	530,808.38	0.79
12	SUNNY OPTICAL TECH	KYG8586D1097	484,183.08	0.72
13	AIA GROUP LTD	HK0000069689	477,903.03	0.71
14	BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDI	KYG112591014	442,417.14	0.65
15	BYD CO LTD-H	CNE100000296	409,413.74	0.61
16	LONGFOR PROPERTIES	KYG5635P1090	406,332.35	0.60
17	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	US6475811070	401,621.09	0.59
18	TAL EDUCATION GROUP- ADR	US8740801043	376,506.29	0.56
19	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	CNE1000001Q4	361,816.72	0.54
20	WH GROUP LTD	KYG960071028	361,663.68	0.54

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

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

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

金额单位：人民币元

序	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金
---	----------	------	----------	-------

号				资产净值比例 (%)
1	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	CNE100000Q43	1,417,069.67	2.10
2	CHINA MERCHANTS BANK-H	CNE1000002M1	1,242,414.12	1.84
3	TENCENT HOLDINGS LTD	KYG875721634	1,177,576.49	1.74
4	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	HK0000055878	851,651.41	1.26
5	CHINA TRAVEL INTL INV HK	HK0308001558	722,653.84	1.07
6	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	CNE1000002Q2	658,717.57	0.97
7	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	646,248.71	0.96
8	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	CNE1000019K9	636,503.12	0.94
9	SINO BIOPHARMACEUTICAL	KYG8167W1380	619,292.98	0.92
10	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	KYG9222R1065	603,289.41	0.89
11	BIOSTIME INTERNATIONAL HOLDI	KYG112591014	576,051.91	0.85
12	CNOOC LTD	HK0883013259	561,182.60	0.83
13	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	KYG3777B1032	560,258.01	0.83
14	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	CNE100001QW3	532,884.57	0.79
15	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	HK0000218211	526,316.78	0.78
16	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	KYG040111059	513,704.83	0.76
17	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	CNE100000312	498,419.50	0.74
18	HUADIAN POWER INTL CORP-H	CNE1000003D8	497,827.46	0.74
19	FOSUN INTERNATIONAL LTD	HK0656038673	480,864.24	0.71
20	TIANNENG POWER INTL LTD	KYG8655K1094	473,262.30	0.70

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

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本(成交)总额	18,653,037.04
卖出收入(成交)总额	22,044,912.16

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	HANG SENG H-SHARE INDEX ETF	ETF	交易型开放式指数	Hang Heng Investment Management Ltd	2,119,068.80	3.37
2	VANECK VECTORS RUSSIA ETF	ETF	交易型开放式指数	VanEck Vectors ETF Trust	693,093.02	1.10
3	VANGUARD FTSE EUROPE ETF	ETF	交易型开放式指数	The Vanguard Group	526,000.05	0.84
4	ISHARES MSCI BRAZIL CAPPED E	ETF	交易型开放式指数	BlackRock Fund Advisors	199,798.06	0.32

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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

7.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	628,163.31
4	应收利息	217.24
5	应收申购款	125,829.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	153,418.05
9	合计	907,628.33

7.11.4 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。

7.11.5 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。

§ 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
4,132	21,199.18	10,004,447.69	11.42%	77,590,579.01	88.58%

8.2 期末上市基金前十名持有人

无

8.3 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	56,354.39	0.06%

8.4 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。

§ 9 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	92,559,649.85
本报告期基金总申购份额	2,583,644.23
减：本报告期基金总赎回份额	7,548,267.38
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	87,595,026.70

§ 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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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	
BLOOMBERG TRADEBOOK-ASIA CREDIT	-	474,311.66	1.17%	474.33	1.53%	-
CITIGROUP-ASIA ALGO	-	2,142,152.63	5.27%	1,270.52	4.11%	-
CONVERGEX-ALGORITHMS	-	3,707,991.61	9.12%	1,501.95	4.86%	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC-PROGRAMS	-	7,326,139.85	18.01%	4,633.09	14.98%	-
CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM	-	317,715.35	0.78%	222.39	0.72%	-
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.	-	1,621,701.31	3.99%	3,243.41	10.49%	-
GOLDMAN SACH-ASIA PROGRAM	-	1,367,881.32	3.36%	431.13	1.39%	-
HSBC, INC-ASIA PROGRAM	-	2,537,863.90	6.24%	1,327.34	4.29%	-
INSTINET CORP, ASIA-PROGRAM	-	13,070,369.40	32.13%	6,799.84	21.99%	-
JEFFERIES&CO, INC. -ASIA	-	223,436.19	0.55%	446.88	1.45%	-
JP MORGAN-ASIA	-	240,562.85	0.59%	168.39	0.54%	-
LIQUIDNET	-	217,965.06	0.54%	217.97	0.70%	-
MACQUARIE_ASIA ALGORITHMS	-	248,315.26	0.61%	173.82	0.56%	-
MERRILL LYNCH-ASIA PROGRAM	-	2,301,157.10	5.66%	1,625.45	5.26%	-
MIZUHO	-	2,374,432.53	5.84%	4,748.88	15.36%	-
MORGAN STANLEY -ASIA	-	355,674.26	0.87%	280.77	0.91%	-
SANFORD BERNSTEIN-ASIA	-	1,886,481.23	4.64%	3,015.19	9.75%	-
UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM	-	265,280.46	0.65%	338.74	1.10%	-
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-

BARCLAYS	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC-ASIA	-	-	-	-	-	-
BLOOMBERG TRADEBOOK	-	-	-	-	-	-
BRADESCO SECURITIES	-	-	-	-	-	-
BTIG LLC	-	-	-	-	-	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC	-	-	-	-	-	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.	-	-	-	-	-	-
CIMB SECURITIES	-	-	-	-	-	-
CIMB-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP	-	-	-	-	-	-
CREDIT AGRICOLE SEC	-	-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS & CO. INC	-	-	-	-	-	-
HSBC ICN	-	-	-	-	-	-
HSBC INC	-	-	-	-	-	-
HYUNDAI SECURITIES	-	-	-	-	-	-
ING BANK	-	-	-	-	-	-
INSTINET CORP.	-	-	-	-	-	-
INVESTEC BANK (UK) LIMITED	-	-	-	-	-	-
ITG	-	-	-	-	-	-
ITG-ASIA	-	-	-	-	-	-
ITG-CSA	-	-	-	-	-	-
ITG-EUROPE CSA	-	-	-	-	-	-
J. P. MORGAN	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO, INC	-	-	-	-	-	-
KINIGHT SECURITIES	-	-	-	-	-	-
KOREAN INVESTMENT	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET-CSA	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPITAL-EURO	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPTIAL	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE EQUITIES	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-

MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.	-	-	-	-	-	-
PENSERRA SECURITIES LLC	-	-	-	-	-	-
REDBURN PARTNERS LLP	-	-	-	-	-	-
RENAISSANCE CAPITAL	-	-	-	-	-	-
SAMSUNG SECURITIES INC.	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-
SANTANDER INVESTMENT	-	-	-	-	-	-
SBERBANK CIB(UK) LTD	-	-	-	-	-	-
SCOTIA CAPITAL MARKETS INC	-	-	-	-	-	-
STANDARD BANK PLC	-	-	-	-	-	-
STIFEL NICOLAUS-PROGRAM	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES	-	-	-	-	-	-
VTB CAPITAL PLC	-	-	-	-	-	-
WELLS FARGO SECURITIES LLC	-	-	-	-	-	-
WESTMINSTER RESEARCH	-	-	-	-	-	-
WOORI SECURITIES	-	-	-	-	-	-
WOORI_E SECURITIES	-	-	-	-	-	-
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 BLOOMBERG TRADEBOOK-ASIA CREDIT, HSBC, INC-ASIA PROGRAM, JEFFERIES&CO, INC.-ASIA, LIQUIDNET, MIZUHO, SANFORD BERNSTEIN-ASIA; 本报告期无剔除的服务券商。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
BLOOMBERG TRADEBOOK-ASIA CREDIT	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP-ASIA ALGO	-	-	-	-	-	-	-	-
CONVERGEX-ALGORITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC-PROGRAMS	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC, INC-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
INSTINET CORP, ASIA-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES&CO, INC.-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
JP MORGAN-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE_ASIA ALOGRITHMS	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
MIZUHO	-	-	-	-	-	-	-	-

MORGAN STANLEY -ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BARCLAYS CAPITAL INC-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BLOOMBERG TRADEBOOK	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTIG LLC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CIMB SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CIMB-ASIA PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIGROUP	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT AGRICOLE SEC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-	-	-	-
DEUTSCHE BANK SECURITIES INC.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS & CO. INC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC ICN	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HSBC INC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HYUNDAI SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ING BANK	-	-	-	-	-	-	-	-	-
INSTINET CORP.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
INVESTEC BANK (UK) LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG-ASIA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG-CSA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ITG-EUROPE CSA	-	-	-	-	-	-	-	-	-
J. P. MORGAN	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JEFFERIES & CO, INC	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KINIGHT SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KOREAN INVESTMENT	-	-	-	-	-	-	-	-	-

LIQUIDNET-CSA	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPITAL-EURO	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE CAPITAL	-	-	-	-	-	-	-	-
MACQUARIE EQUITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	-	-
NOMURA SECURITIES INTERNATIONAL INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
PENSERRA SECURITIES LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
REDBURN PARTNERS LLP	-	-	-	-	-	-	-	-
RENAISSANCE CAPITAL	-	-	-	-	-	-	-	-
SAMSUNG SECURITIES INC.	-	-	-	-	-	-	-	-
SANFORD BERNSTEIN	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER INVESTMENT	-	-	-	-	-	-	-	-
SBERBANK CIB(UK) LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
SCOTIA CAPITAL MARKETS INC	-	-	-	-	-	-	-	-
STANDARD BANK PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
STIFEL NICOLAUS-PROGRAM	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
VTB CAPITAL PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
WELLS FARGO SECURITIES LLC	-	-	-	-	-	-	-	-
WESTMINSTER RESEARCH	-	-	-	-	-	-	-	-
WOORI SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
WOORI_E SECURITIES	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增上海长量为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016年5月25日
2	建信基金管理有限责任公司关于北京汇成基金销售有限公司为旗下代销机构并参加认购申购费率优惠活动的公	指定报刊和/或公司网站	2016年5月25日

	告		
3	建信基金管理有限责任公司关于新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2016 年 4 月 15 日
4	关于新增中信期货为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016 年 2 月 5 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信新兴市场优选混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信新兴市场优选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信新兴市场优选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信新兴市场优选混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

11.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司
2016 年 8 月 27 日