

# 建信新兴市场优选混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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： 2017 年 8 月 26 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 2017 年 8 月 23 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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5         |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....                      | 6         |
| 2.5 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.6 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9         |
| 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....             | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 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.....                | 13        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>15</b> |
| 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真实、准确和完整发表意见.....      | 15        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>16</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 16        |
| 6.2 利润表.....                                 | 17        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 18        |
| 6.4 报表附注.....                                | 19        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 40        |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....              | 40        |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....                      | 41        |
| 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.....       | 41        |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....                     | 47        |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....                  | 49        |
| 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.....      | 49        |
| 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.....   | 49        |
| 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.....   | 49        |
| 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.....     | 49        |
| 7.11 投资组合报告附注.....                           | 49        |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....                    | <b>51</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 51        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 51        |
| 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..... | 51        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>               | <b>52</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                 | <b>53</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 53        |
| 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.....  | 53        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....       | 53        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                    | 53        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....             | 53        |
| 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.....     | 53        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....            | 53        |
| 10.8 其他重大事件.....                       | 59        |
| <b>§11 备查文件目录.....</b>                 | <b>61</b> |
| 11.1 备查文件目录.....                       | 61        |
| 11.2 存放地点.....                         | 61        |
| 11.3 查阅方式.....                         | 61        |

## § 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 | 87,652,409.89 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                  |
|         | 联系电话                         | 010-66228888         |
|         | 电子邮箱                         | xinxipilu@ccbfund.cn |
| 客户服务电话  | 400-81-95533<br>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                         | 易会满               |

## 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 | <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  |

## 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日) |
| 本期已实现收益       | 915,305.32                  |
| 本期利润          | 8,972,876.32                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1016                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 11.93%                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 13.40%                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日)            |
| 期末可供分配利润      | -28,826,715.21              |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.3289                     |
| 期末基金资产净值      | 77,091,227.79               |
| 期末基金份额净值      | 0.880                       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2017年6月30日)            |
| 基金份额累计净值增长率   | -12.00%                     |

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

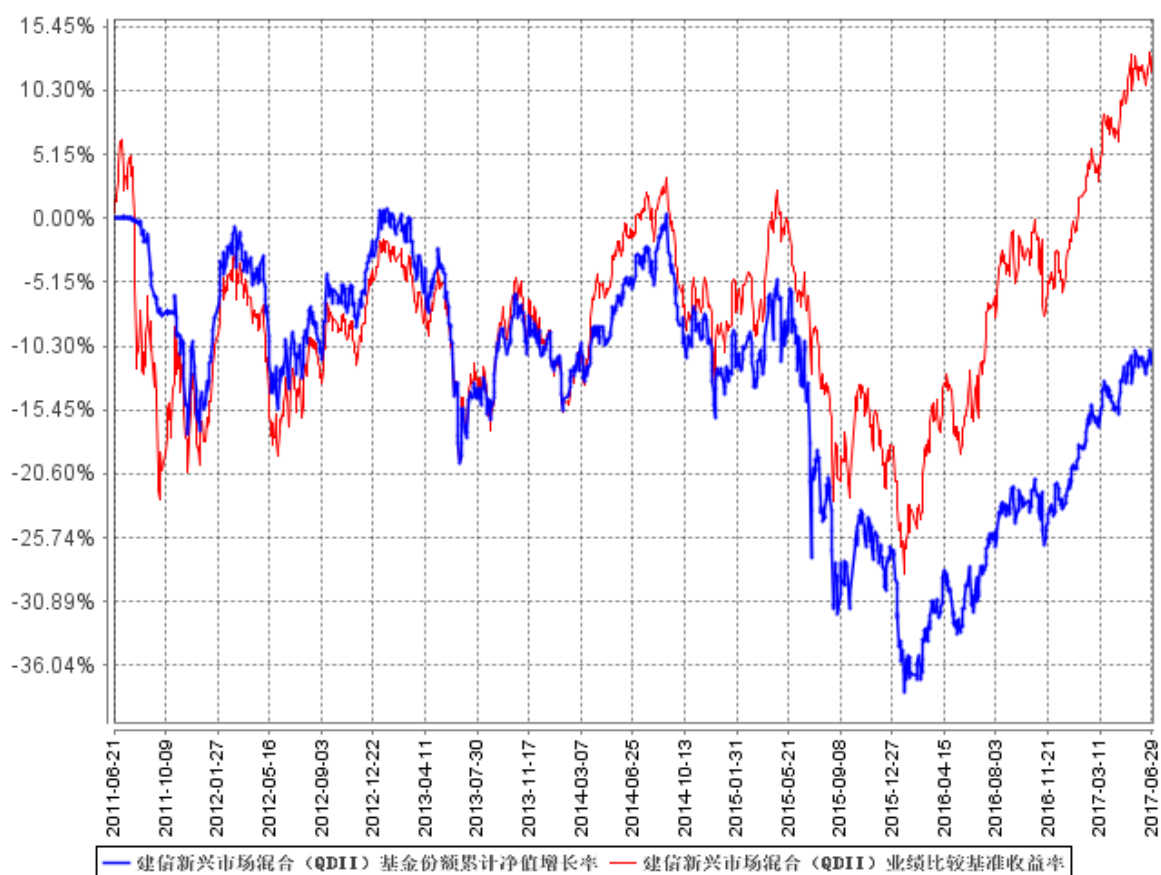
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | -0.68%   | 0.53%       | 0.39%      | 0.53%         | -1.07% | 0.00%  |
| 过去三个月 | 2.92%    | 0.60%       | 4.54%      | 0.66%         | -1.62% | -0.06% |
| 过去六个月 | 13.40%   | 0.58%       | 15.54%     | 0.61%         | -2.14% | -0.03% |
| 过去一   | 22.39%   | 0.68%       | 26.28%     | 0.76%         | -3.89% | -0.08% |

|            |         |       |        |       |         |        |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|--------|
| 年          |         |       |        |       |         |        |
| 过去三年       | -7.66%  | 1.14% | 12.81% | 0.98% | -20.47% | 0.16%  |
| 自基金合同生效起至今 | -12.00% | 1.00% | 11.57% | 1.03% | -23.57% | -0.03% |

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



- 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、海外投资部、资产配置及量化投资部、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、人力资源管理部、基金运营部、财务管理部、信息技术部、风险管理部和内控合规部，以及深圳、成都、上海、北京、广州五家分公司和华东、西北、东北、武汉、南京五个营销中心，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“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 2017 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、建信现金增利货币市场基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信瑞盛添利混合型证券投资基金、建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信瑞丰添利混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒丰纯债债券型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信瑞福添利混合型证券投资基金，共计 87 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 3,439.09 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 | 海外投资部总经理、本基金的基金经理 | 2011年6月21日      | -    | 19     | 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经理。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准备工作提供支持。王曦在2003年加入信安，担任香港和中国股票市场的基金经理以及亚洲和新兴市场策略的助理基金经理。作为全球研发团队的资深成员，王曦也负责我们全球研究平台（GRP）的模型搭建，特别是亚洲和大中华选股模型。他也曾在建设银行和信安的中国合资公司成立之初时任高级顾问。王曦在2008年离开信安，曾在中国平安资产管理公司（香港）担任股票投资总监，也曾任贝莱德亚洲的基金经理。王曦持有爱荷华大学Tippie管理学院的MBA学位，中国人民大学经济学和国际金融学士学位。他执有特许金融分析师（CFA）资格。 |
| Mihail Dobrinov | 投资组合经理      | 18     | Mihail Dobrinov 是信安环球股票的基金经理。他领导新兴市场团队，包括亚洲、拉丁美洲、东欧、中东和非洲的股票市场。他负责监督分散化新兴市场组合和专门的亚洲地区股票策略。在1995年，Mihail最初以国际和新兴市场债务和货币专家身份加入信安。他在2002年加入股票团队，并且在2007年被任命为新兴市场股票的基金经理。Mihail的基本研究经验包括许多不同的经济板块，特别专注于工业、原材料和能源公司。他的覆盖领域包括工业和电信板块的公司。Mihail从University of Iowa取得金融MBA学位，并从Sofia University, Bulgaria取得一个法学学位。他获得了使用特许金融分析师称号的权利并且是CFA Institute的成员。         |

### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

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，本基金管理人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% 的情况有 1 次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

### 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

上半年新兴市场有较大幅度上涨，新兴市场主要国家经济继续好转，成熟市场国家经济前景看好提升了投资人的风险偏好，资金流入新兴市场，是市场上涨的主要推动力量。

新兴市场主要国家延续前期趋势，经济继续好转，俄罗斯、巴西和印度的 CPI 回落。俄罗斯经济开始正增长，1 季度 GDP0.5%，制造业 PMI 保持扩张状态，俄罗斯央行连续降息。巴西经济仍然处于衰退状态，但没有继续恶化。印度经济仍然保持较好的增长速度。中国经济处于景气周期

的顶点，固定资产投资、GDP 继续温和增长，但 PPI 从前期高位开始下降，以及 PMI 回落表明中央经济调控政策开始显现成效。央行继续执行货币稳健中性政策，中央和地方政府坚决打击房地产炒作，一线和二线城市房地产销售明显降温。中央对资产泡沫的防范受到海外投资人的普遍认同。

成熟市场经济也表现良好，虽然美联储在 3 月和 6 月分别加息 25 基点，但良好的经济基本面鼓舞市场信心，投资人风险偏好提升，资金流入新兴市场，推动市场上涨。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8800 元；本报告期基金份额净值增长率为 13.40%，业绩比较基准收益率为 15.54%。

#### 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，我们依然看好新兴市场主要经济体的经济增长，成熟市场的经济增长也将对新兴市场国家产生积极作用。企业盈利随着经济基本面的好转可能出现加速增长。新兴市场的主要风险可能来自美联储加息，以及美联储“缩表”对市场带来的冲击，另外上半年新兴市场上涨幅度较大，有一定技术性回调压力。我们将秉承价值投资理念，深入研究，力争为投资人带来超额回报。

#### 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、运营总经理及内控合规总经理组成。

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、内控合规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）。

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。

#### **4.8 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——建信基金管理有限责任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责任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 2017 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：2017年6月30日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2017年6月30日         | 上年度末<br>2016年12月31日         |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                           |                             |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 7,267,093.23              | 5,927,099.30                |
| 结算备付金           |            | -                         | -                           |
| 存出保证金           |            | -                         | -                           |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 70,857,308.04             | 60,528,954.77               |
| 其中：股票投资         |            | 64,587,047.94             | 57,134,529.26               |
| 基金投资            |            | 6,270,260.10              | 3,394,425.51                |
| 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    | 663.11                    | 100.22                      |
| 应收股利            |            | 279,167.20                | 5,758.72                    |
| 应收申购款           |            | 22,226.87                 | 10,935.72                   |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | 71,420.33                 | -                           |
| 资产总计            |            | 78,497,878.78             | 66,472,848.73               |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2016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          | 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           |            | 650,720.19                | 117,126.54                  |
| 应付管理人报酬         |            | 116,133.98                | 96,721.77                   |
| 应付托管费           |            | 22,581.59                 | 18,807.04                   |
| 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  | 617,215.23     | 513,719.13     |
| 负债合计          |          | 1,406,650.99   | 746,374.48     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 87,652,409.89  | 84,707,202.33  |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | -10,561,182.10 | -18,980,728.08 |
| 所有者权益合计       |          | 77,091,227.79  | 65,726,474.25  |
| 负债和所有者权益总计    |          | 78,497,878.78  | 66,472,848.73  |

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.880 元，基金份额总额 87,652,409.89 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2017年1月1日至<br>2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016<br>年6月30日 |
|-----------------------|------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 9,973,508.46                   | -543,143.46                         |
| 1.利息收入                |            | 23,183.41                      | 6,856.57                            |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 23,183.41                      | 6,856.57                            |
| 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）      |            | 1,996,411.72                   | -3,917,877.42                       |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 938,303.28                     | -4,940,659.98                       |
| 基金投资收益                | 6.4.7.13   | -                              | -                                   |
| 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   | -                              | -                                   |
| 股利收益                  | 6.4.7.17   | 1,058,108.44                   | 1,022,782.56                        |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18   | 8,057,571.00                   | 3,217,807.71                        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -111,224.76                    | 144,998.68                          |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.19   | 7,567.09                       | 5,071.00                            |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 1,000,632.14                   | 888,788.79                          |

|                     |            |              |               |
|---------------------|------------|--------------|---------------|
| 1. 管理人报酬            | 6.4.10.2.1 | 673,639.27   | 537,891.94    |
| 2. 托管费              | 6.4.10.2.2 | 130,985.37   | 104,590.13    |
| 3. 销售服务费            | 6.4.10.2.3 | -            | -             |
| 4. 交易费用             | 6.4.7.20   | 8,383.73     | 67,763.68     |
| 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   | 187,623.77   | 178,543.04    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 8,972,876.32 | -1,431,932.25 |
| 减：所得税费用             |            | -            | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 8,972,876.32 | -1,431,932.25 |

### 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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2017年1月1日至2017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）                        | 84,707,202.33              | -18,980,728.08 | 65,726,474.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                          | 8,972,876.32   | 8,972,876.32  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 2,945,207.56               | -553,330.34    | 2,391,877.22  |
| 其中：1.基金申购款                             | 13,909,862.23              | -2,131,269.67  | 11,778,592.56 |
| 2.基金赎回款                                | -10,964,654.67             | 1,577,939.33   | -9,386,715.34 |
| 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）                        | 87,652,409.89              | -10,561,182.10 | 77,091,227.79 |



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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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。

### 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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、红利

收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。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 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<br>2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 7,267,093.23           |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 7,267,093.23           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |               |               |
|---------------|------------------------|---------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 52,637,008.34          | 64,587,047.94 | 11,950,039.60 |
| 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            | 6,052,834.37           | 6,270,260.10  | 217,425.73    |
| 其他            | -                      | -             | -             |

|    |               |               |               |
|----|---------------|---------------|---------------|
| 合计 | 58,689,842.71 | 70,857,308.04 | 12,167,465.33 |
|----|---------------|---------------|---------------|

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 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。

##### 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<br>2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 663.11            |
| 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         | 663.11            |

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2017年6月30日 |
|-----------|-------------------|
| 其他应收款     | -                 |
| 待摊费用      | -                 |
| 应收未起息外汇交易 | 71,420.33         |
| 合计        | 71,420.33         |

**6.4.7.7 应付交易费用**

无。

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 1,866.14          |
| 预提费用        | 543,923.16        |
| 应付未起息外汇交易   | 71,425.93         |
| 合计          | 617,215.23        |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 84,707,202.33              | 84,707,202.33  |
| 本期申购          | 13,909,862.23              | 13,909,862.23  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -10,964,654.67             | -10,964,654.67 |
| - 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           | 87,652,409.89              | 87,652,409.89  |

**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           | -28,743,036.52 | 9,762,308.44  | -18,980,728.08 |
| 本期利润           | 915,305.32     | 8,057,571.00  | 8,972,876.32   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -998,984.01    | 445,653.67    | -553,330.34    |
| 其中：基金申购款       | -4,659,590.28  | 2,528,320.61  | -2,131,269.67  |
| 基金赎回款          | 3,660,606.27   | -2,082,666.94 | 1,577,939.33   |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | -28,826,715.21 | 18,265,533.11 | -10,561,182.10 |



**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 23,172.26                  |
| 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        | 11.15                      |
| 合计        | 23,183.41                  |

**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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 4,929,262.41               |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,990,959.13               |
| 买卖股票差价收入   | 938,303.28                 |

**6.4.7.13 基金投资收益**

本基金本报告期无基金投资收益。

**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**

本基金本报告期未投资债券。

**6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期未投资债券。

**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                   |
|-------------|----------------------|
|             | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 1,018,780.27         |
| 基金投资产生的股利收益 | 39,328.17            |
| 合计          | 1,058,108.44         |

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 8,057,571.00         |
| ——股票投资     | 7,971,006.61         |
| ——债券投资     | -                    |
| ——资产支持证券投资 | -                    |
| ——基金投资     | 86,564.39            |
| ——贵金属投资    | -                    |
| ——其他       | -                    |
| 2. 衍生工具    | -                    |
| ——权证投资     | -                    |
| 3. 其他      | -                    |
| 合计         | 8,057,571.00         |

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 7,567.09             |
| 合计      | 7,567.09             |

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                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 8,383.73             |
| 银行间市场交易费用 | -                    |
| 合计        | 8,383.73             |

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期                   |
|-------|----------------------|
|       | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 审计费用  | 35,704.06            |
| 信息披露费 | 148,768.56           |
| 银行汇划费 | 1,038.00             |

|           |            |
|-----------|------------|
| 银行划款手续费   | -          |
| 债券托管账户维护费 | -          |
| 其他        | 2,113.15   |
| 合计        | 187,623.77 |

#### 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

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：（1）金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；（2）纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

#### 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          |

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

本基金本报告期及上年度可比期内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

本基金本报告期及上年度可比期内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

本基金本报告期及上年度可比期内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

本基金本报告期及上年度可比期内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

本基金本报告期及上年度可比期内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

本基金本报告期及上年度可比期内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

本基金本报告期及上年度可比期内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<br>2017年1月1日至2017年6 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年6月30 |
|----|------------------------|--------------------------------|
|----|------------------------|--------------------------------|

|                 | 月 30 日     | 日          |
|-----------------|------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 673,639.27 | 537,891.94 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 191,445.73 | 147,058.33 |

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                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 130,985.37                      | 104,590.13                      |

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 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                            | 2017年1月1日至2017年6月30日 | 2016年1月1日至2016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          | 11.41%               | 11.42%               |

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              |          |
|-----------|----------------------|-----------|----------------------|----------|
|           | 2017年1月1日至2017年6月30日 |           | 2016年1月1日至2016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    | 3,001,818.04         | 12,917.99 | 1,889,342.05         | 3,384.49 |
| 布朗兄弟哈里曼银行 | 4,265,275.19         | 10,254.27 | 5,273,631.88         | 3,467.45 |

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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2017 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。

#### 6.4.12.4 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之内。

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、  
内控合规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  
督察长和内控合规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。

#### 6.4.12.5 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。

#### **6.4.12.5.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

#### **6.4.12.5.2 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

#### **6.4.12.6 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。

#### **6.4.12.6.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

### 6.4.12.7 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。

#### 6.4.12.7.1 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。

##### 6.4.12.7.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2017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                | 7,267,093.23 | -    | -    | -             | 7,267,093.23  |
| 交易性金融资产             | -            | -    | -    | 70,857,308.04 | 70,857,308.04 |
| 应收利息                | -            | -    | -    | 663.11        | 663.11        |
| 应收股利                | -            | -    | -    | 279,167.20    | 279,167.20    |
| 应收申购款               | -            | -    | -    | 22,226.87     | 22,226.87     |
| 其他资产                | -            | -    | -    | 71,420.33     | 71,420.33     |
| 资产总计                | 7,267,093.23 | 0.00 | -    | 71,230,785.55 | 78,497,878.78 |
| 负债                  |              |      |      |               |               |
| 应付赎回款               | -            | -    | -    | 650,720.19    | 650,720.19    |
| 应付管理人报酬             | -            | -    | -    | 116,133.98    | 116,133.98    |
| 应付托管费               | -            | -    | -    | 22,581.59     | 22,581.59     |
| 其他负债                | -            | -    | -    | 617,215.23    | 617,215.23    |
| 负债总计                | -            | 0.00 | -    | 1,406,650.99  | 1,406,650.99  |
| 利率敏感度缺口             | 7,267,093.23 | 0.00 | -    | 69,824,134.56 | 77,091,227.79 |
| 上年度末<br>2016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                | 5,927,099.30 | -    | -    | -             | 5,927,099.30  |
| 结算备付金               | -            | -    | -    | -             | -             |
| 存出保证金               | -            | -    | -    | -             | -             |
| 交易性金融资产             | -            | -    | -    | 60,528,954.77 | 60,528,954.77 |

|           |              |      |      |               |               |
|-----------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 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      | -            | -    | -    | 100.22        | 100.22        |
| 应收股利      | -            | -    | -    | 5,758.72      | 5,758.72      |
| 应收申购款     | -            | -    | -    | 10,935.72     | 10,935.72     |
| 其他资产      | -            | -    | -    | -             | -             |
| 资产总计      | 5,927,099.30 | 0.00 | 0.00 | 60,545,749.43 | 66,472,848.73 |
| 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     | -            | -    | -    | 117,126.54    | 117,126.54    |
| 应付管理人报酬   | -            | -    | -    | 96,721.77     | 96,721.77     |
| 应付托管费     | -            | -    | -    | 18,807.04     | 18,807.04     |
| 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      | -            | -    | -    | 513,719.13    | 513,719.13    |
| 负债总计      | 0.00         | 0.00 | 0.00 | 746,374.48    | 746,374.48    |
| 利率敏感度缺口   | 5,927,099.30 | 0.00 | 0.00 | 59,799,374.95 | 65,726,474.25 |

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。

#### 6.4.12.7.1.2 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）。

#### 6.4.12.7.2 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。

##### 6.4.12.7.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|               | 2017 年 6 月 30 日          |               |               |               |
|---------------|--------------------------|---------------|---------------|---------------|
|               | 美元<br>折合人民币              | 港币<br>折合人民币   | 其他币种<br>折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                          |               |               |               |
| 银行存款          | 4,193,719.41             | 51,749.09     | 36,837.73     | 4,282,306.23  |
| 交易性金融资产       | 19,544,096.79            | 21,274,385.61 | 30,038,825.64 | 70,857,308.04 |
| 应收股利          | 92,074.46                | 150,352.60    | 36,740.14     | 279,167.20    |
| 其它资产          | 71,420.33                | -             | -             | 71,420.33     |
| 资产合计          | 23,901,310.99            | 21,476,487.30 | 30,112,403.51 | 75,490,201.80 |
| 以外币计价的负债      |                          |               |               |               |
| 其它负债          | -                        | 51,744.65     | 19,681.28     | 71,425.93     |
| 负债合计          | -                        | 51,744.65     | 19,681.28     | 71,425.93     |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 23,901,310.99            | 21,424,742.65 | 30,092,722.23 | 75,418,775.87 |
| 项目            | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |               |               |               |
|               | 美元<br>折合人民币              | 港币<br>折合人民币   | 其他币种<br>折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                          |               |               |               |
| 银行存款          | 5,600,504.47             | 4.55          | 34,065.42     | 5,634,574.44  |
| 交易性金融资产       | 14,968,615.02            | 18,542,114.42 | 27,018,225.33 | 60,528,954.77 |
| 应收股利          | 795.26                   | -             | 4,963.46      | 5,758.72      |
| 应收利息          | 10.68                    | -             | -             | 10.68         |
| 资产合计          | 20,569,925.43            | 18,542,118.97 | 27,057,254.21 | 66,169,298.61 |
| 以外币计价的负债      |                          |               |               |               |
| 负债合计          | -                        | -             | -             | -             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 20,569,925.43            | 18,542,118.97 | 27,057,254.21 | 66,169,298.61 |

#### 6.4.12.7.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除外汇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（2017 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2016 年 12 月 31 日） |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5%   | -3,770,938.79               | -3,308,464.93          |
|    | 所有外币相对人民币升值 5%   | 3,770,938.79                | 3,308,464.93           |

#### 6.4.12.7.3 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的股票，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%。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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.12.7.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 64,587,047.94          | 83.78                    | 57,134,529.26            | 86.93                 |
| 交易性金融资产—基金投资  | 6,270,260.10           | 8.13                     | 3,394,425.51             | 5.16                  |
| 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            | 70,857,308.04          | 91.91                    | 60,528,954.77            | 92.09                 |

#### 6.4.12.7.3.2 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（2017年6月30日） | 上年度末（2016年12月31日） |
|--|-------------|-----------------|-------------------|
|  | 业绩比较基准上升 5% | 3,082,015.08    | 2,786,129.52      |
|  | 业绩比较基准下降 5% | -3,082,015.08   | -2,786,129.52     |

#### 6.4.12.7.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.13 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 2017 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 70,857,308.04 元，无属于第二层次或第三层次的余额(2016 年 6 月 30 日：第一层次 55,735,569.89 元，无第二层次或第三层次)。

##### (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 2017 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(2016 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）增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：（1）金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；（2）纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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              | 64,587,047.94 | 82.28         |
|    | 其中：普通股            | 55,082,752.53 | 70.17         |
|    | 存托凭证              | 9,504,295.41  | 12.11         |
|    | 优先股               | -             | -             |
|    | 房地产信托凭证           | -             | -             |
| 2  | 基金投资              | 6,270,260.10  | 7.99          |
| 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      | 7,267,093.23  | 9.26          |
| 8  | 其他各项资产            | 373,477.51    | 0.48          |
| 9  | 合计                | 78,497,878.78 | 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   | 18,818,519.18 | 24.41         |
| 美国     | 13,363,942.14 | 17.34         |
| 韩国     | 13,222,643.65 | 17.15         |
| 南非     | 5,010,660.40  | 6.50          |
| 泰国     | 3,461,628.16  | 4.49          |
| 巴西     | 3,146,321.54  | 4.08          |
| 印尼     | 2,750,020.68  | 3.57          |
| 英国     | 2,365,760.98  | 3.07          |



|      |               |       |
|------|---------------|-------|
| 墨西哥  | 1,477,361.99  | 1.92  |
| 马来西亚 | 970,189.22    | 1.26  |
| 合计   | 64,587,047.94 | 83.78 |

### 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 | 4,641,950.11  | 6.02          |
| 必需消费品  | 4,591,109.51  | 5.96          |
| 能源     | 4,985,616.70  | 6.47          |
| 金融     | 12,016,915.52 | 15.59         |
| 医疗保健   | 1,889,322.85  | 2.45          |
| 工业     | 1,625,034.00  | 2.11          |
| 信息技术   | 21,897,471.47 | 28.40         |
| 材料     | 2,717,008.75  | 3.52          |
| 电信服务   | 6,209,086.79  | 8.05          |
| 公用事业   | 4,013,532.24  | 5.21          |
| 合计     | 64,587,047.94 | 83.78         |

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  | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD  | 三星电子有限公司   | KR7005930003 | 韩国证券交易所 | 韩国       | 305    | 4,292,490.09 | 5.57          |
| 2  | TENCENT HOLDINGS LTD        | 腾讯控股有限公司   | KYG875721634 | 香港证券交易所 | 中国香港     | 15,200 | 3,683,313.61 | 4.78          |
| 3  | TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR | 台积电        | US8740391003 | 纽约证券交易所 | 美国       | 14,500 | 3,434,078.85 | 4.45          |
| 4  | HON HAI PRECISION-GDR REG S | 鸿海         | US4380902019 | 伦敦国际交易所 | 英国       | 39,953 | 2,084,063.54 | 2.70          |
| 5  | KB FINANCIAL GROUP INC      | 韩国国民银行金融集团 | KR7105560007 | 韩国证券交易所 | 韩国       | 5,890  | 2,012,201.13 | 2.61          |

|    |                              |                  |              |           |      |         |              |      |
|----|------------------------------|------------------|--------------|-----------|------|---------|--------------|------|
|    |                              |                  |              | 所         |      |         |              |      |
| 6  | BANK OF CHINA LTD-H          | 中国银行             | CNE1000001Z5 | 香港证券交易所   | 中国香港 | 513,000 | 1,705,280.54 | 2.21 |
| 7  | POSCO                        | 浦项制铁公司           | KR7005490008 | 韩国证券交易所   | 韩国   | 935     | 1,588,816.67 | 2.06 |
| 8  | QUALICORP SA                 | Qualicorp 股份有限公司 | BRQUALACNOR6 | 巴西证券交易所   | 巴西   | 26,400  | 1,549,205.42 | 2.01 |
| 9  | TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H   | 中国民航信息网络         | CNE1000004J3 | 香港证券交易所   | 中国香港 | 73,000  | 1,457,237.68 | 1.89 |
| 10 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 农业银行             | CNE100000Q43 | 香港证券交易所   | 中国香港 | 444,000 | 1,421,965.41 | 1.84 |
| 11 | AIR CHINA LTD-H              | 中国国航             | CNE1000001S0 | 香港证券交易所   | 中国香港 | 196,000 | 1,369,404.18 | 1.78 |
| 12 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 中国石化             | CNE1000002Q2 | 香港证券交易所   | 中国香港 | 250,000 | 1,321,408.20 | 1.71 |
| 13 | GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 广汽集团             | CNE100000Q35 | 香港证券交易所   | 中国香港 | 102,000 | 1,212,831.41 | 1.57 |
| 14 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF     | 三星电子有限公司         | KR7005931001 | 韩国证券交易所   | 韩国   | 110     | 1,212,697.95 | 1.57 |
| 15 | SANLAM LTD                   | 桑勒姆有限公司          | ZAE000070660 | 南非证券交易所   | 南非   | 35,802  | 1,198,243.55 | 1.55 |
| 16 | NETEASE INC-ADR              | 网易公司             | US64110W1027 | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 567     | 1,154,745.32 | 1.50 |
| 17 | SASOL LTD                    | 沙索有限公司           | ZAE000006896 | 南非证券交易所   | 南非   | 5,960   | 1,128,192.08 | 1.46 |
| 18 | CHINA TELECOM CORP LTD-H     | 中国电信             | CNE1000002V2 | 香港证券交易所   | 中国香港 | 342,000 | 1,101,234.25 | 1.43 |
| 19 | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 瑞声科技             | KYG2953R1149 | 香港证券交易所   | 中国香港 | 13,000  | 1,101,216.90 | 1.43 |
| 20 | KT CORP                      | KT 公司            | KR703020     | 韩国证       | 韩国   | 5,56    | 1,074,       | 1.39 |

|    |                              |                     |              |            |       |         |              |      |
|----|------------------------------|---------------------|--------------|------------|-------|---------|--------------|------|
| 0  |                              |                     | 0000         | 券交易所       |       | 6       | 338.36       |      |
| 21 | THAI OIL PCL-FRGN            | 泰国石油股份有限公司          | TH0796010013 | 泰国证券交易所    | 泰国    | 67,500  | 1,064,614.17 | 1.38 |
| 22 | TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER | 印尼电信股份有限公司          | ID1000129000 | 印度尼西亚证券交易所 | 印度尼西亚 | 462,900 | 1,061,891.77 | 1.38 |
| 23 | PTT PCL/FOREIGN              | PTT 股份有限公司          | TH0646010015 | 泰国证券交易所    | 泰国    | 14,100  | 1,041,555.02 | 1.35 |
| 24 | MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR    | 移动通信系统公众股份有限公司      | US6074091090 | 纽约证券交易所    | 美国    | 18,205  | 1,033,488.24 | 1.34 |
| 25 | GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 吉利汽车                | KYG3777B1032 | 香港证券交易所    | 中国香港  | 70,000  | 1,023,104.10 | 1.33 |
| 26 | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 美洲电信可变动资本额股份有限      | MXP001691213 | 墨西哥证券交易所   | 墨西哥   | 187,100 | 1,022,977.58 | 1.33 |
| 27 | TENAGA NASIONAL BHD          | 马来西亚国家能源有限公司        | MYL534700009 | 马来西亚证券交易所  | 马来西亚  | 43,500  | 970,189.22   | 1.26 |
| 28 | CORONATION FUND MANAGERS LTD | Coronation 基金管理有限公司 | ZAE000047353 | 南非证券交易所    | 南非    | 27,749  | 934,310.27   | 1.21 |
| 29 | LUKOIL PJSC-SPON ADR         | 卢克石油公司              | US69343P1057 | 纽约证券交易所    | 美国    | 2,763   | 913,234.98   | 1.18 |
| 30 | KT&G CORP                    | KT&G 公司             | KR7033780008 | 韩国证券交易所    | 韩国    | 1,310   | 907,480.78   | 1.18 |
| 31 | CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN  | 卜蜂食品股份有限公司          | TH0101A10Z19 | 泰国证券交易所    | 泰国    | 181,000 | 896,172.54   | 1.16 |
| 32 | BANK NEGARA INDONESIA PERSER | 印尼国家银行股份有限公司        | ID1000096605 | 印度尼西亚证券交易所 | 印度尼西亚 | 266,700 | 893,349.89   | 1.16 |
| 33 | CHINA POWER INTERNATIONAL    | 中国电力                | HK2380027329 | 香港证券交易所    | 中国香港  | 367,000 | 882,318.79   | 1.14 |
| 3  | MMI HOLDINGS                 | MMI 控股有限            | ZAE00014     | 南非证        | 南非    | 83,9    | 877,16       | 1.14 |

|        |                               |                             |              |            |       |         |            |      |
|--------|-------------------------------|-----------------------------|--------------|------------|-------|---------|------------|------|
| 4      | LTD                           | 公司/南非                       | 9902         | 券交易所       |       | 09      | 6.14       |      |
| 3<br>5 | TIGER BRANDS LTD              | 虎牌有限公司                      | ZAE000071080 | 南非证券交易所    | 南非    | 4,593   | 872,748.36 | 1.13 |
| 3<br>6 | HANA FINANCIAL GROUP          | 韩亚金融集团公司                    | KR7086790003 | 韩国证券交易所    | 韩国    | 3,061   | 820,091.28 | 1.06 |
| 3<br>7 | CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H  | 龙源电力                        | CNE100000HD4 | 香港证券交易所    | 中国香港  | 163,000 | 803,555.05 | 1.04 |
| 3<br>8 | GUDANG GARAM TBK PT           | 蔡氏家族盐仓集团股份有限公司              | ID1000068604 | 印度尼西亚证券交易所 | 印度尼西亚 | 20,000  | 794,779.02 | 1.03 |
| 3<br>9 | FAR EAST HORIZON LTD          | 远东宏信                        | HK0000077468 | 香港证券交易所    | 中国香港  | 132,000 | 780,190.65 | 1.01 |
| 4<br>0 | BANK OF COMMUNICATIONS CO-H   | 交通银行                        | CNE100000205 | 香港证券交易所    | 中国香港  | 161,000 | 769,940.51 | 1.00 |
| 4<br>1 | KOREA ELECTRIC POWER CORP     | 韩国电力公司                      | KR7015760002 | 韩国证券交易所    | 韩国    | 3,012   | 727,604.56 | 0.94 |
| 4<br>2 | TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF | 巴西电信公司                      | BRVIVTACNPR7 | 巴西证券交易所    | 巴西    | 6,900   | 633,459.15 | 0.82 |
| 4<br>3 | CIA ENERGETICA DE SP-PREF B   | Cia Energetica de Sao Paulo | BRCESPACNPB4 | 巴西证券交易所    | 巴西    | 19,900  | 629,864.62 | 0.82 |
| 4<br>4 | KIA MOTORS CORP               | 起亚汽车公司                      | KR7000270009 | 韩国证券交易所    | 韩国    | 2,595   | 586,922.83 | 0.76 |
| 4<br>5 | IRPC PCL - FOREIGN            | IRPC 股份有限公司                 | TH0471010Y12 | 泰国证券交易所    | 泰国    | 430,000 | 459,286.43 | 0.60 |
| 4<br>6 | WALMART DE MEXICO SAB DE CV   | 沃尔玛墨西哥可变动资本额股份              | MX01WA000038 | 墨西哥证券交易所   | 墨西哥   | 28,800  | 454,384.41 | 0.59 |
| 4<br>7 | APPLE INC                     | 苹果公司                        | US0378331005 | 纳斯达克证券交易所  | 美国    | 445     | 434,163.84 | 0.56 |
| 4<br>8 | ALIBABA GROUP HOLDING-SP      | 阿里巴巴集团控股有限公司                | US01609W1027 | 纽约证券交易所    | 美国    | 421     | 401,849.96 | 0.52 |

|    | ADR                                | 公司                      |                  | 所                 |    |            |                |      |
|----|------------------------------------|-------------------------|------------------|-------------------|----|------------|----------------|------|
| 49 | ALPHABET<br>INC-CL C               | Alphabet 公<br>司         | US02079K<br>1079 | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 58         | 357,05<br>3.83 | 0.46 |
| 50 | JBS SA                             | JBS 股份公司                | BRJBSSAC<br>NOR8 | 巴西证<br>券交易<br>所   | 巴西 | 25,0<br>00 | 333,79<br>2.35 | 0.43 |
| 51 | BERKSHIRE<br>HATHAWAY<br>INC-CL B  | 伯克希尔哈<br>撒韦公司           | US084670<br>7026 | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 267        | 306,35<br>0.49 | 0.40 |
| 52 | JPMORGAN<br>CHASE & CO             | 摩根大通                    | US46625H<br>1005 | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 481        | 297,82<br>5.66 | 0.39 |
| 53 | MICROSOFT<br>CORP                  | 微软                      | US594918<br>1045 | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 632        | 295,11<br>8.34 | 0.38 |
| 54 | PRICELINE<br>GROUP INC/THE         | Priceline 集<br>团        | US741503<br>4039 | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 23         | 291,44<br>7.97 | 0.38 |
| 55 | SISTEMA<br>JSFC-REG S<br>SPONS GDR | 西斯特能源<br>公司             | US48122U<br>2042 | 伦敦国<br>际交易<br>所   | 英国 | 9,94<br>8  | 281,69<br>7.44 | 0.37 |
| 56 | ACTIVISION<br>BLIZZARD INC         | 动视暴雪股<br>份有限公司          | US00507V<br>1098 | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 722        | 281,58<br>1.59 | 0.37 |
| 57 | FACEBOOK<br>INC-A                  | Facebook 公<br>司         | US30303M<br>1027 | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 265        | 271,04<br>1.71 | 0.35 |
| 58 | AMAZON.COM<br>INC                  | 亚马逊公司                   | US023135<br>1067 | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 41         | 268,86<br>2.39 | 0.35 |
| 59 | MASTERCARD<br>INC - A              | 万事达股份<br>有限公司           | US57636Q<br>1040 | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 318        | 261,63<br>4.78 | 0.34 |
| 60 | EXPEDIA INC                        | 艾派迪公司                   | US30212P<br>3038 | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 258        | 260,33<br>4.10 | 0.34 |
| 61 | HOME DEPOT<br>INC                  | 家得宝                     | US437076<br>1029 | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 248        | 257,71<br>9.85 | 0.33 |
| 62 | PAYPAL<br>HOLDINGS INC             | Paypal 控股<br>股份有限公<br>司 | US70450Y<br>1038 | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 702        | 255,23<br>4.60 | 0.33 |
| 6  | JOHNSON &                          | 强生                      | US478160         | 纽约证               | 美国 | 280        | 250,93         | 0.33 |

|    |                            |                    |              |           |      |        |            |      |
|----|----------------------------|--------------------|--------------|-----------|------|--------|------------|------|
| 3  | JOHNSON                    |                    | 1046         | 券交易所      |      |        | 1.91       |      |
| 64 | ELECTRONIC ARTS INC        | 电子艺界               | US2855121099 | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 350    | 250,666.35 | 0.33 |
| 65 | NETFLIX INC                | 奈飞公司               | US64110L1061 | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 243    | 245,955.63 | 0.32 |
| 66 | VISA INC-CLASS A SHARES    | 维萨公司               | US92826C8394 | 纽约证券交易所   | 美国   | 378    | 240,144.62 | 0.31 |
| 67 | IAC/INTERACTIVE CORP       | IAC/Interactive 公司 | US44919P5089 | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 326    | 228,000.83 | 0.30 |
| 68 | CONSTELLATION BRANDS INC-A | 星座公司               | US21036P1084 | 纽约证券交易所   | 美国   | 171    | 224,421.17 | 0.29 |
| 69 | BAIDU INC - SPON ADR       | 百度                 | US0567521085 | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 166    | 201,137.08 | 0.26 |
| 70 | STARBUCKS CORP             | 星巴克                | US8552441094 | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 500    | 197,507.63 | 0.26 |
| 71 | CNOOC LTD                  | 中国海洋石油             | HK0883013259 | 香港证券交易所   | 中国香港 | 25,000 | 185,517.90 | 0.24 |
| 72 | COMCAST CORP-CLASS A       | 康卡斯特               | US20030N1019 | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 656    | 172,960.73 | 0.22 |
| 73 | ROCKWELL AUTOMATION INC    | 罗克韦尔自动化            | US7739031091 | 纽约证券交易所   | 美国   | 137    | 150,313.91 | 0.19 |
| 74 | NIKE INC -CL B             | 耐克公司               | US6541061031 | 纽约证券交易所   | 美国   | 311    | 124,303.47 | 0.16 |
| 75 | BROWN-FORMAN CORP-CLASS B  | 布朗福曼               | US1156372096 | 纽约证券交易所   | 美国   | 326    | 107,330.88 | 0.14 |
| 76 | LOCKHEED MARTIN CORP       | 洛克希德马丁             | US5398301094 | 纽约证券交易所   | 美国   | 56     | 105,315.91 | 0.14 |
| 77 | GILEAD SCIENCES INC        | 吉利德科学              | US3755581036 | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 186    | 89,185.52  | 0.12 |

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  | HANA FINANCIAL GROUP            | KR7086790003 | 664,642.20 | 1.01           |
| 2  | GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS<br>LT | KYG3777B1032 | 630,443.31 | 0.96           |
| 3  | APPLE INC                       | US0378331005 | 411,224.28 | 0.63           |
| 4  | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL<br>B  | US0846707026 | 304,484.61 | 0.46           |
| 5  | JPMORGAN CHASE & CO             | US46625H1005 | 286,472.57 | 0.44           |
| 6  | MICROSOFT CORP                  | US5949181045 | 284,724.35 | 0.43           |
| 7  | JOHNSON & JOHNSON               | US4781601046 | 253,477.66 | 0.39           |
| 8  | COMCAST CORP-CLASS A            | US20030N1019 | 179,744.41 | 0.27           |
| 9  | ROCKWELL AUTOMATION INC         | US7739031091 | 149,999.96 | 0.23           |
| 10 | BROWN-FORMAN CORP-CLASS B       | US1156372096 | 109,389.10 | 0.17           |
| 11 | LOCKHEED MARTIN CORP            | US5398301094 | 107,062.73 | 0.16           |
| 12 | GILEAD SCIENCES INC             | US3755581036 | 90,806.03  | 0.14           |

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。

### 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  | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | CNE1000002N9 | 1,032,603.41 | 1.57      |
| 2  | NVIDIA CORP                  | US67066G1040 | 405,746.20   | 0.62      |
| 3  | PANERA BREAD COMPANY-CLASS A | US69840W1080 | 335,888.45   | 0.51      |
| 4  | TENCENT HOLDINGS LTD         | KYG875721634 | 265,780.26   | 0.40      |
| 5  | WELLS FARGO & CO             | US9497461015 | 260,768.08   | 0.40      |
| 6  | DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | US2547091080 | 250,255.08   | 0.38      |
| 7  | IAC/INTERACTIVECORP          | US44919P5089 | 178,563.57   | 0.27      |
| 8  | MICHAEL KORS HOLDINGS LTD    | VGG607541015 | 159,909.00   | 0.24      |
| 9  | SASOL LTD                    | ZAE000006896 | 123,105.50   | 0.19      |
| 10 | UNDER ARMOUR INC-CLASS A     | US9043111072 | 108,359.14   | 0.16      |
| 11 | NETEASE INC-ADR              | US64110W1027 | 108,350.78   | 0.16      |
| 12 | MMI HOLDINGS LTD             | ZAE000149902 | 106,302.48   | 0.16      |
| 13 | CHINA POWER INTERNATIONAL    | HK2380027329 | 102,375.61   | 0.16      |
| 14 | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | KYG2953R1149 | 99,900.86    | 0.15      |
| 15 | CORONATION FUND MANAGERS LTD | ZAE000047353 | 93,752.98    | 0.14      |
| 16 | TENAGA NASIONAL BHD          | MYL534700009 | 92,637.55    | 0.14      |
| 17 | TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER | ID1000129000 | 90,457.92    | 0.14      |
| 18 | BANK OF COMMUNICATIONS CO-H  | CNE100000205 | 87,162.77    | 0.13      |
| 19 | TIGER BRANDS LTD             | ZAE000071080 | 86,581.92    | 0.13      |
| 20 | NIKE INC -CL B               | US6541061031 | 82,760.37    | 0.13      |

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 | 3,472,471.20 |
| 卖出收入（成交）总额 | 4,929,262.41 |

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<br>净值比例<br>(%) |
|----|------------------------------|------|----------|-------------------------------------|--------------|----------------------|
| 1  | ISHARES MSCI EMERGING MARKET | ETF  | 交易型开放式指数 | BlackRock Fund Advisors             | 2,803,924.16 | 3.64                 |
| 2  | HANG SENG H-SHARE INDEX ETF  | ETF  | 交易型开放式指数 | Hang Heng Investment Management Ltd | 2,455,866.43 | 3.19                 |
| 3  | VANECK VECTORS RUSSIA ETF    | ETF  | 交易型开放式指数 | VanEck Vectors ETF Trust            | 779,191.49   | 1.01                 |
| 4  | ISHARES MSCI BRAZIL CAPPEDE  | ETF  | 交易型开放式指数 | BlackRock Fund Advisors             | 231,278.02   | 0.30                 |

**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    | 279,167.20 |
| 4  | 应收利息    | 663.11     |
| 5  | 应收申购款   | 22,226.87  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | 71,420.33  |
| 9  | 合计      | 373,477.51 |

qtZCDGCBai

**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。

**7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 4,246        | 20,643.53     | 10,004,447.69 | 11.41%     | 77,647,962.20 | 88.59%     |

### 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 | 1,611.88  | 0.00%    |

### 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

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              | 84,707,202.33  |
| 本报告期基金总申购份额               | 13,909,862.23  |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 10,964,654.67  |
| 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              | 87,652,409.89  |

## § 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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 |
|------|------|-----------|
|------|------|-----------|

|                                      | 交易单<br>元数量 | 成交金额         | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 佣金       | 占当期佣金<br>总量的比例 | 备注 |
|--------------------------------------|------------|--------------|----------------------|----------|----------------|----|
| CITIGROUP-ASIA ALGO                  | -          | 709,975.99   | 8.45%                | 224.58   | 4.42%          | -  |
| CONVERGEX-ALGORITHMS                 | -          | 681,279.26   | 8.11%                | 162.96   | 3.21%          | -  |
| CREDIT SUISSE-ASIA<br>PROGRAM        | -          | 157,500.74   | 1.87%                | 110.19   | 2.17%          | -  |
| GOLDMAN SACH-ASIA<br>PROGRAM         | -          | 894,309.21   | 10.64%               | 237.38   | 4.67%          | -  |
| ITG-CSA                              | -          | 114,700.75   | 1.37%                | 229.40   | 4.52%          | -  |
| ITG-EUROPE CSA                       | -          | 56,819.13    | 0.68%                | 113.63   | 2.24%          | -  |
| JP MORGAN-ASIA                       | -          | 806,865.98   | 9.60%                | 403.44   | 7.94%          | -  |
| MACQUARIE EQUITIES                   | -          | 612,634.31   | 7.29%                | 87.16    | 1.72%          | -  |
| MERRILL LYNCH-ASIA<br>PROGRAM        | -          | 1,461,567.62 | 17.40%               | 1,714.66 | 33.75%         | -  |
| MORGAN STANLEY -ASIA                 | -          | 409,742.88   | 4.88%                | 122.92   | 2.42%          | -  |
| SANFORD BERNSTEIN_ASIA               | -          | 2,327,688.93 | 27.70%               | 1,629.38 | 32.08%         | -  |
| UBS SECURITIES -GLOBAL<br>PROGRAM    | -          | 168,648.78   | 2.01%                | 44.10    | 0.87%          | -  |
| BLOOMBERG<br>TRADEBOOK-ASIA CREDIT   | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| CANTOR FITZGERALD AND<br>CO., INC    | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| CREDIT LYONNAIS<br>SEC. INC-PROGRAMS | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| DAIWA SECURITIES<br>AMERICA INC.     | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| DEUTSCHE BANK-ASIA                   | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| HSBC, INC-ASIA PROGRAM               | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| INSTINET<br>CORP, ASIA-PROGRAM       | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| INVESTEC BANK (UK)<br>LIMITED        | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| JEFFERIES&CO, INC. -ASIA             | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| LIQUIDNET                            | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| MACQUARIE_ASIA<br>ALGORITHMS         | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| MIZUHO                               | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| BANK OF NEW YORK                     | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| BARCLAYS                             | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |
| BARCLAYS CAPITAL                     | -          | -            | -                    | -        | -              | -  |

|   |   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|---|
| INC-ASIA                                |   |   |   |   |   |   |
| BLOOMBERG TRADEBOOK                     | - | - | - | - | - | - |
| BRADESCO SECURITIES                     | - | - | - | - | - | - |
| BTIG LLC                                | - | - | - | - | - | - |
| CCB INTERNATIONAL<br>SECURITIES LTD.    | - | - | - | - | - | - |
| CIMB SECURITIES                         | - | - | - | - | - | - |
| CIMB-ASIA PROGRAM                       | - | - | - | - | - | - |
| CITIGROUP                               | - | - | - | - | - | - |
| CREDIT AGRICOLE SEC                     | - | - | - | - | - | - |
| CREDIT LYONNAIS SEC. INC                | - | - | - | - | - | - |
| CREDIT SUISSE                           | - | - | - | - | - | - |
| DEUTSCHE BANK<br>SECURITIES INC.        | - | - | - | - | - | - |
| GOLDMAN SACHS & CO. INC                 | - | - | - | - | - | - |
| HSBC ICN                                | - | - | - | - | - | - |
| HSBC INC                                | - | - | - | - | - | - |
| HYUNDAI SECURITIES                      | - | - | - | - | - | - |
| ING BANK                                | - | - | - | - | - | - |
| INSTINET CORP.                          | - | - | - | - | - | - |
| ITG                                     | - | - | - | - | - | - |
| ITG-ASIA                                | - | - | - | - | - | - |
| J. P. MORGAN                            | - | - | - | - | - | - |
| JEFFERIES & CO, INC                     | - | - | - | - | - | - |
| KINIGHT SECURITIES                      | - | - | - | - | - | - |
| KOREAN INVESTMENT                       | - | - | - | - | - | - |
| LIQUIDNET-CSA                           | - | - | - | - | - | - |
| MACQUARIE CAPITAL-EURO                  | - | - | - | - | - | - |
| MACQUARIE CAPTIAL                       | - | - | - | - | - | - |
| MERRILL LYNCH                           | - | - | - | - | - | - |
| MORGAN STANLEY                          | - | - | - | - | - | - |
| NOMURA SECURITIES<br>INTERNATIONAL INC. | - | - | - | - | - | - |
| PENSERRA SECURITIES LLC                 | - | - | - | - | - | - |
| REDBURN PARTNERS LLP                    | - | - | - | - | - | - |
| RENAISSANCE CAPITAL                     | - | - | - | - | - | - |
| SAMSUNG SECURITIES INC.                 | - | - | - | - | - | - |
| SANFORD BERNSTEIN                       | - | - | - | - | - | - |

|                               |   |   |   |   |   |   |
|-------------------------------|---|---|---|---|---|---|
| SANTANDER INVESTMENT          | - | - | - | - | - | - |
| SBERBANK CIB(UK) LTD          | - | - | - | - | - | - |
| SCOTIA CAPITAL MARKETS<br>INC | - | - | - | - | - | - |
| STANDARD BANK PLC             | - | - | - | - | - | - |
| STIFEL<br>NICOLAUS-PROGRAM    | - | - | - | - | - | - |
| UBS SECURITIES                | - | - | - | - | - | - |
| VTB CAPITAL PLC               | - | - | - | - | - | - |
| WELLS FARGO SECURITIES<br>LLC | - | - | - | - | - | - |
| WESTMINSTER RESEARCH          | - | - | - | - | - | - |
| WOORI SECURITIES              | - | - | - | - | - | - |
| WOORI_E SECURITIES            | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券                          | - | - | - | - | - | - |

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、本报告期无新增和剔除的服务券商。



## 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 |
| CITIGROUP-ASIA ALGO               | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| CONVERGEX-ALGORITHMS              | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| CREDIT SUISSE-ASIA PROGRAM        | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| GOLDMAN SACH-ASIA PROGRAM         | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| ITG-CSA                           | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| ITG-EUROPE CSA                    | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| JP MORGAN-ASIA                    | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| MACQUARIE EQUITIES                | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| MERRILL LYNCH-ASIA PROGRAM        | -    | -            | -      | -              | -    | -            | 2,789,270.20 | 100.00%      |
| MORGAN STANLEY -ASIA              | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| SANFORD BERNSTEIN_ASIA            | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| UBS SECURITIES -GLOBAL PROGRAM    | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| BLOOMBERG TRADEBOOK-ASIA CREDIT   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| CANTOR FITZGERALD AND CO., INC    | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| CREDIT LYONNAIS SEC. INC-PROGRAMS | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| DAIWA SECURITIES AMERICA INC.     | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| DEUTSCHE BANK-ASIA                | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| HSBC, INC-ASIA PROGRAM            | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| INSTINET CORP, ASIA-PROGRAM       | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| INVESTEC BANK (UK) LIMITED        | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| JEFFERIES&CO, INC. -ASIA          | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |
| LIQUIDNET                         | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -            | -            |

|                                      |   |   |   |   |   |   |   |   |
|--------------------------------------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MACQUARIE_ASIA                       | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ALOGRITHMS                           | - | - | - | - | - | - | - | - |
| MIZUHO                               | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BANK OF NEW YORK                     | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BARCLAYS                             | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BARCLAYS CAPITAL<br>INC-ASIA         | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BLOOMBERG TRADEBOOK                  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BRDESCO SECURITIES                   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BTIG LLC                             | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CCB INTERNATIONAL<br>SECURITIES LTD. | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CIMB SECURITIES                      | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CIMB-ASIA PROGRAM                    | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CITIGROUP                            | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CREDIT AGRICOLE SEC                  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CREDIT LYONNAIS SEC. INC             | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CREDIT SUISSE                        | - | - | - | - | - | - | - | - |
| DEUTSCHE BANK<br>SECURITIES INC.     | - | - | - | - | - | - | - | - |
| GOLDMAN SACHS & CO. INC              | - | - | - | - | - | - | - | - |
| HSBC ICN                             | - | - | - | - | - | - | - | - |
| HSBC INC                             | - | - | - | - | - | - | - | - |
| HYUNDAI SECURITIES                   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ING BANK                             | - | - | - | - | - | - | - | - |
| INSTINET CORP.                       | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ITG                                  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ITG-ASIA                             | - | - | - | - | - | - | - | - |
| J. P. MORGAN                         | - | - | - | - | - | - | - | - |
| JEFFERIES & CO, INC                  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| KINIGHT SECURITIES                   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| KOREAN INVESTMENT                    | - | - | - | - | - | - | - | - |
| LIQUIDNET-CSA                        | - | - | - | - | - | - | - | - |
| MACQUARIE CAPITAL-EURO               | - | - | - | - | - | - | - | - |
| MACQUARIE CAPTIAL                    | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 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<br>INC | - | - | - | - | - | - | - | - |
| STANDARD BANK PLC             | - | - | - | - | - | - | - | - |
| STIFEL<br>NICOLAUS-PROGRAM    | - | - | - | - | - | - | - | - |
| UBS SECURITIES                | - | - | - | - | - | - | - | - |
| VTB CAPITAL PLC               | - | - | - | - | - | - | - | - |
| WELLS FARGO SECURITIES<br>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  | 建信基金管理有限责任公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告         | 指定报刊和/或公司网站 | 2017年6月12日 |
| 2  | 建信基金管理有限责任公司关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2017年4月24日 |
| 3  | 关于新增华融证券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 | 2017年4月20日 |
| 4  | 关于继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告                             | 指定报刊和/或公司网站 | 2017年3月31日 |
| 5  | 关于建信新兴市场混合型证券投资基金暂停大额申购业务的公告                                | 指定报刊和/或公司网站 | 2017年3月7日  |

|   |   |             |                 |
|---|---|-------------|-----------------|
| 6 | 关于公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2017 年 2 月 23 日 |
| 7 | 关于旗下部分开放式基金参加凤凰金信转换费率优惠活动的公告                    | 指定报刊和/或公司网站 | 2017 年 2 月 21 日 |
| 8 | 关于新增渤海银行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 | 2017 年 2 月 18 日 |
| 9 | 关于新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下开放式基金代销机构的公告              | 指定报刊和/或公司网站 | 2017 年 1 月 17 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

2017年8月26日