

---

**建信优选成长股票型证券投资基金**  
**2010 年年度报告摘要**  
**2010 年 12 月 31 日**

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月二十八日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所有限公司为基金财务出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	建信优选成长股票
基金主代码	530003
交易代码	530003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 9 月 8 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	3,396,937,538.08 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于具有良好业绩成长性和投资价值的上市公司，实现基金资产长期增值。
投资策略	综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例、调整原则和调整范围，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。
业绩比较基准	75%×富时中国 600 成长指数+20%×中国债券总指数+5%×1 年定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	赵会军
	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

### 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	276,572,128.38	450,824,624.66	-1,844,223,832.61
本期利润	156,234,959.68	1,693,597,880.66	-3,889,563,461.81
加权平均基金份额本期利润	0.0438	0.4104	-0.7852
本期基金份额净值增长率	4.49%	64.66%	-55.22%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0775	-0.1572	-0.3829
期末基金资产净值	3,606,658,236.57	3,807,104,942.73	2,767,191,050.62
期末基金份额净值	1.0617	1.0161	0.6171

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	6.30%	1.71%	6.33%	1.32%	-0.03%	0.39%
过去六个月	25.17%	1.47%	24.47%	1.19%	0.70%	0.28%
过去一年	4.49%	1.43%	-0.84%	1.22%	5.33%	0.21%
过去三年	-22.96%	1.85%	-23.99%	1.76%	1.03%	0.09%
自基金合同生效起至今	141.64%	1.83%	102.43%	1.69%	39.21%	0.14%

注：1、本基金合同自 2006 年 9 月 8 日生效，未满五年。

2、本基金投资业绩比较基准为：75%×富时中国 600 成长指数+20%×中国债券总指数+5%×1 年定期存款利率。其中：富时中国 600 成长指数收益率作为衡量股票投资部分的业绩基准，中国债券总指数收益率作为衡量基金债券投资部分的业绩基准，1 年定期存款利率

作为衡量现金或到期日在一年以内的政府债券部分的业绩基准。

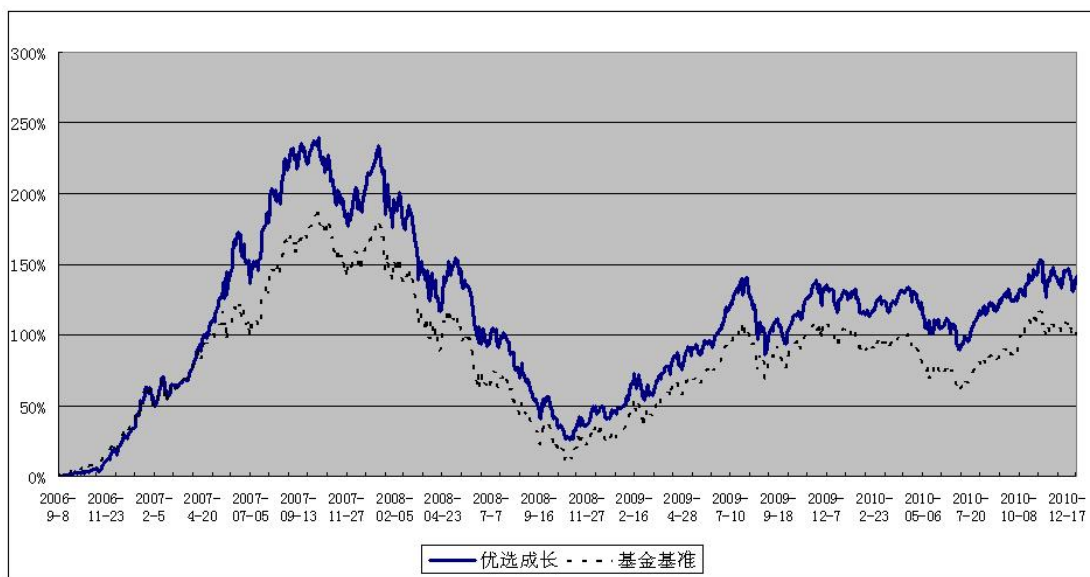
富时中国 600 成长指数是新华富时风格指数之一，富时风格指数以富时中国 600 指数为股票池，通过 7 个风格因子对股票进行测评，然后将综合测评的风格因子评分进行综合，进而决定股票在价值和成长指数中的市值分布。作为一个理想的工具，富时中国风格指数使得投资者能够方便地衡量不同风格特点的公司经历完整市场周期时的表现。中债系列指数由一个总指数（即中国债券总指数），若干个分指数构成。中国债券总指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债券等），理论上能客观反映中国债券总体情况。本基金现金或到期日在一年以内的政府债券部分则可以用 1 年定期存款利率来衡量。

### 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

建信优选成长股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2006 年 9 月 8 日至 2010 年 12 月 31 日）

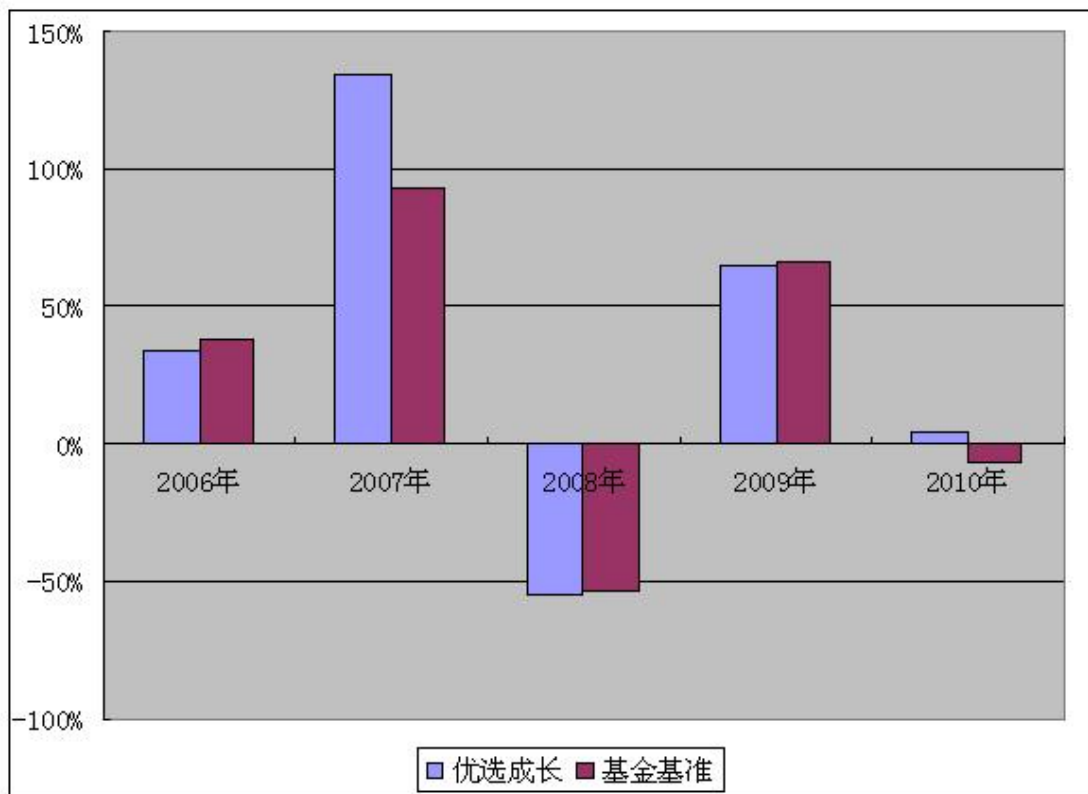


注：本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

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

建信优选成长股票型证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同自 2006 年 9 月 8 日生效，至 2010 年 12 月 31 日未满五年，2006 年净值增长率以实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年，本基金未实施利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团公司，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%，中国华电集团公司出资额占注册资本的 10%。公司下设综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司。自成立以来，公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“最可信赖、持续领先的资产管理公司”。

截至 2010 年 12 月 31 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金 12 只开放式基金和建信优势动力股票型证券投资基金一只创新封闭式基金，管理的基金资产规模共计为 485.66 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李涛先生	本基金的基金经理	2008-11-27	-	11	学士。先后就职于中国经济开发信托投资公司、西南证券、国泰君安证券公司、新时代证券、中海基金管理公司等单位，曾担任投资银行部经理、行业研究员、基金经理等职。李涛于 2005 年 6 月至 2007 年 7 月期间担任中海分红增利混合型证券投资基金基金经理；于 2007 年 7 月至 2008 年 7 月期间担任中海优质成长证券投资基金基金经理。李涛于 2008 年 9 月加入本公司。
田擎先生	本基金基金经理	2007-10-23	2010-04-27	8	硕士。2001 年硕士毕业后就职于华夏基金管理公司，先后担任交易员、研究员、华夏成长证券投资基金的基金经理助理，于 2004 年 2 月至 2005 年 10 月任华夏成长证券投资基金基金经理。2006 年 8 月加入建信基金管理有限责任公司。2010 年 4 月因个人原因从本公司离职。

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，本基金管理人不存在与本基金投资风格相似的投资组合。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在过去的一年中，世界经济在全球政府空前一致的货币、财政刺激下逐步从金融海啸中走出来，当世界经济迅速反弹时，人们以为金融危机已经远去，然而就在此时，反危机的扩张性财政政策和货币政策的后遗症开始逐步显现。观察 2010 年的中国经济，在经历了明显的复苏后，泛滥的流动性直接推动了资产价格的上涨，黄金、地产、古玩、农产品价格轮番上涨，被 08 年金融危机打掉的通胀再次出现。

2010 年 CPI 的节节盘升，导致中央政府货币政策回归正常化，控制泛滥的流动性重新成为央行货币政策的目标。通胀无牛市，在流动性不断收缩的过程中，资本市场在过去的 2010 年无明显的趋势性机会，但结构性仍然存在。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010 年本基金净值增长率 4.49%，波动率 1.43%，业绩比较基准收益率-0.84%，波动率 1.22%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年，货币政策回归正常化将导致流动性最好的时期已经过去，经济结构的调整将成为中国经济在未来的 2—3 年的主旋律，同时伴随着流动性的持续收缩，股票市场估值重心的下移将成为可能，市场的主要投资机会将集中在能推动中国经济未来成长的行业和



结构上，当然我们也要清晰地认识到，结构调整将是个长期痛苦而艰巨的过程。

本基金基于上述观点，我们将中长期看好受益于经济结构调整的行业，努力寻找具有持续成长能力的公司，我们认为“新兴蓝筹”必然从受益于结构调整的行业中产生，同时较低的估值使传统周期股仍存在一定的投资价值。

2011 年是“十二五规划”的开局之年，“十二五”在着力于国内经济结构调整的同时，也将给予我们机构投资者更多的投资机会，例如大消费、节能环保、产业升级、新能源等相关行业在未来都有可能会有精彩的表现。就上市公司的选择而言，我们会更加聚焦于在内需经济发展过程中竞争优势逐步显现、强化的公司。当前中国资本市场的整体估值水平仍然处于比较健康的状态，具备价值支持的蓝筹公司以及在未来有潜力成长为新一代蓝筹公司者都是较好的投资标的，长期投资终将获得良好的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

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

本报告期内，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）。

#### **4.7 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，本报告期内本基金未达到进行利润分配的条件，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**

2010 年，本基金托管人在对建信优选成长股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2010 年，建信优选成长股票型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信优选成长股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，建信优选成长股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信优选成长股票型证券投资基金 2010 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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2011 年 3 月 23 日

### **§6 审计报告**

普华永道中天会计师事务所有限公司审计了后附的建信优选成长股票型证券投资基金

(以下简称“建信优选成长基金”)的财务报表,包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,并出具了普华永道中天审字(2011)第 21250 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:建信优选成长股票型证券投资基金

报告截止日:2010 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款		200,339,173.61	122,286,411.14
结算备付金		11,249,926.27	7,386,675.95
存出保证金		2,013,524.77	2,656,070.76
交易性金融资产		3,418,984,752.63	3,622,019,038.44
其中:股票投资		3,216,006,592.63	3,417,248,736.04
基金投资		-	-
债券投资		202,978,160.00	204,770,302.40
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	76,923,776.82
应收利息		6,446,725.89	3,346,712.02
应收股利		-	-
应收申购款		141,687.49	531,248.90
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,639,175,790.66	3,835,149,934.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2010年12月31日</b>	<b>上年度末 2009年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,174,312.12	-
应付赎回款		1,622,823.35	9,026,718.68
应付管理人报酬		4,360,752.57	4,828,973.33

应付托管费		726,792.13	804,828.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		17,325,903.05	12,168,104.86
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,306,970.87	1,216,365.56
负债合计		32,517,554.09	28,044,991.30
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		3,396,937,538.08	3,746,760,648.74
未分配利润		209,720,698.49	60,344,293.99
所有者权益合计		3,606,658,236.57	3,807,104,942.73
负债和所有者权益总计		3,639,175,790.66	3,835,149,934.03

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0617 元，基金份额总额 3,396,937,538.08 份。

## 7.2 利润表

会计主体：建信优选成长股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年 12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年 12月31日
<b>一、收入</b>		<b>244,725,311.77</b>	<b>1,788,456,882.93</b>
1. 利息收入		10,006,795.20	8,150,300.59
其中：存款利息收入		1,956,861.64	2,682,726.75
债券利息收入		7,707,025.09	5,467,573.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		342,908.47	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		354,763,996.99	536,758,026.04
其中：股票投资收益		336,468,599.27	514,866,425.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益		726,068.99	721,110.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		17,569,328.73	21,170,490.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-120,337,168.70	1,242,773,256.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号		-	-

填列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)		291,688.28	775,300.30
<b>减: 二、费用</b>		<b>88,490,352.09</b>	<b>94,859,002.27</b>
1. 管理人报酬		52,308,085.93	52,916,527.37
2. 托管费		8,718,014.25	8,819,421.19
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		26,946,031.53	32,667,370.37
5. 利息支出		72,703.91	7,669.64
其中: 卖出回购金融资产支出		72,703.91	7,669.64
6. 其他费用		445,516.47	448,013.70
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>156,234,959.68</b>	<b>1,693,597,880.66</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>156,234,959.68</b>	<b>1,693,597,880.66</b>

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 建信优选成长股票型证券投资基金

本报告期: 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	3,746,760,648.74	60,344,293.99	3,807,104,942.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	156,234,959.68	156,234,959.68
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)	-349,823,110.66	-6,858,555.18	-356,681,665.84
其中: 1. 基金申购款	484,584,023.53	-828,990.89	483,755,032.64
2. 基金赎回款	-834,407,134.19	-6,029,564.29	-840,436,698.48
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)	3,396,937,538.08	209,720,698.49	3,606,658,236.57
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	4,484,023,843.15	-1,716,832,792.53	2,767,191,050.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	1,693,597,880.66	1,693,597,880.66
三、本期基金份额交易产生的基金净	-737,263,194.41	83,579,205.86	-653,683,988.55

值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	751,925,632.76	-84,108,511.89	667,817,120.87
2. 基金赎回款	-1,489,188,827.17	167,687,717.75	-1,321,501,109.42
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）	3,746,760,648.74	60,344,293.99	3,807,104,942.73

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：孙志晨，主管会计工作负责人：何斌，会计机构负责人：秦绪华

## 7.4 报表附注（摘要）

### 7.4.1 基金基本情况

建信优选成长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”)证监基金字[2006]第 147 号《关于同意建信优选成长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》和《建信优选成长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 6,113,360,965.39 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(2006)第 119 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信优选成长股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 9 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,114,724,726.60 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,363,761.21 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信优选成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券以及经国家证券监管机构允许基金投资的权证及其他金融工具。本基金投资组合中股票占基金资产的 60%-95%，其中投资于具有良好业绩成长潜力并具备投资价值的上市公司发行的股票占非现金资产的比例不低于 80%；现金、债券、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中，基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为富时中国 A600 成长指数 X75% + 中国债券总指数 X20% + 1 年期定期存款利率 X5%。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2011 年 3 月 21 日批准

报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信优选成长股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 7.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期内未发生会计差错。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (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。

**7.4.7 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	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、基金代销机构
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、基金代销机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立

**7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

**7.4.8.2 关联方报酬****7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	52,308,085.93	52,916,527.37
其中：支付销售机构的客户维护费	7,059,268.17	7,297,513.83

注：1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

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

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,718,014.25	8,819,421.19

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。



**7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	21,331,157.35	-	-	-	-

**7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

单位：份

项目	本期 2010年1月1日至2010年 12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年 12月31日
期初持有的基金份额	-	53,794,482.79
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	-	53,794,482.79
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总 份额比例	-	-

注：本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2009 年度赎回本基金的交易委托中国建设银行办理，适用费率为 0.16%。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	200,339,173.61	1,859,747.71	122,286,411.14	2,559,146.75

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期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。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本报告期末及上年度末，本基金未发生其他关联交易事项。

**7.4.9 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

至报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600829	三精制药	2010-12-29	母公司正在研究涉及公司重大事项	21.18	2011-02-16	23.30	1,883,488	40,069,517.54	39,892,275.84	-
600991	广汽长丰	2010-10-28	母公司正在研究涉及公司重大事项	14.07	-	-	3,049,150	34,205,579.80	42,901,540.50	-
000903	云内动力	2010-12-08	母公司正在商讨股权转让事宜	17.60	2011-01-07	18.80	1,083,070	14,539,064.34	19,062,032.00	-

注：本基金截至 2010 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

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

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

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

**7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****(1) 公允价值****(a) 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。

**(b) 以公允价值计量的金融工具**

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值, 公允价值层级可  
分为:

第一层级: 相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级: 直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级  
中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级: 以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可  
观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余  
额为 3,116,378,904.29 元, 属于第二层级的余额为 302,605,848.34 元, 无属于第三层级的余  
额(2009 年 12 月 31 日: 第一层级 3,391,045,789.98 元, 第二层级 230,973,248.46 元, 无第三  
层级)。

对于持有的重大事项停牌股票, 本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一  
层级转入第二层级, 并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年度: 同)。

对于持有的认购新发证券, 本基金将相关证券公允价值所属层级于流通受限期间列入第  
二层级, 待其可流通后从第二层级转入第一层级(2009 年度: 对于持有的认购新发和增发证  
券, 本基金将相关证券公允价值所属层级于流通受限期间列入第二层级, 待其可流通后从第  
二层级转入第一层级)。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,216,006,592.63	88.37
	其中: 股票	3,216,006,592.63	88.37
2	固定收益投资	202,978,160.00	5.58
	其中: 债券	202,978,160.00	5.58
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	211,589,099.88	5.81

6	其他各项资产	8,601,938.15	0.24
7	合计	3,639,175,790.66	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	88,568,945.40	2.46
B	采掘业	104,868,590.12	2.91
C	制造业	2,048,428,954.11	56.80
C0	食品、饮料	317,986,708.96	8.82
C1	纺织、服装、皮毛	56,779,657.35	1.57
C2	木材、家具	74,030,009.39	2.05
C3	造纸、印刷	69,406,357.12	1.92
C4	石油、化学、塑胶、塑料	32,131,996.82	0.89
C5	电子	312,960,421.09	8.68
C6	金属、非金属	488,552,562.73	13.55
C7	机械、设备、仪表	434,909,260.24	12.06
C8	医药、生物制品	223,565,539.21	6.20
C99	其他制造业	38,106,441.20	1.06
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	259,260,996.67	7.19
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	225,825,019.35	6.26
H	批发和零售贸易	140,841,918.36	3.91
I	金融、保险业	164,926,547.07	4.57
J	房地产业	79,467,867.21	2.20
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	706,000.00	0.02
M	综合类	103,111,754.34	2.86
	合计	3,216,006,592.63	89.17

注：以上行业分类以 2010 年 12 月 31 日的证监会行业分类标准为依据。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002008	大族激光	8,598,240	192,600,576.00	5.34
2	002073	软控股份	5,280,032	140,924,054.08	3.91
3	600887	伊利股份	3,599,671	137,723,412.46	3.82
4	000568	泸州老窖	2,849,670	116,551,503.00	3.23
5	000425	徐工机械	2,009,806	114,960,903.20	3.19
6	600487	亨通光电	2,703,306	109,754,223.60	3.04

7	600970	中材国际	2,630,603	107,091,848.13	2.97
8	002444	巨星科技	2,747,278	105,989,985.24	2.94
9	600489	中金黄金	2,599,618	104,868,590.12	2.91
10	000650	仁和药业	4,453,399	101,982,837.10	2.83

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

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600000	浦发银行	279,871,784.20	7.35
2	002008	大族激光	200,998,907.59	5.28
3	601601	中国太保	189,529,554.71	4.98
4	601318	中国平安	184,969,674.67	4.86
5	600489	中金黄金	140,892,414.42	3.70
6	600362	江西铜业	122,654,728.05	3.22
7	000002	万科 A	121,761,666.90	3.20
8	000858	五粮液	121,668,340.63	3.20
9	600117	西宁特钢	120,599,562.44	3.17
10	000001	深发展 A	117,467,569.38	3.09
11	600970	中材国际	114,980,870.12	3.02
12	600529	山东药玻	114,502,526.39	3.01
13	000425	徐工机械	108,681,090.40	2.85
14	600271	航天信息	106,986,186.86	2.81
15	600487	亨通光电	106,298,965.33	2.79
16	000568	泸州老窖	105,240,717.36	2.76
17	601918	国投新集	101,250,619.66	2.66
18	601111	中国国航	101,083,396.91	2.66
19	600325	华发股份	101,080,700.71	2.66
20	600888	新疆众和	97,489,314.28	2.56

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	272,981,682.82	7.17
2	600000	浦发银行	250,153,862.05	6.57
3	600036	招商银行	226,803,127.60	5.96
4	600016	民生银行	170,177,513.60	4.47

5	600117	西宁特钢	137,018,263.10	3.60
6	000858	五粮液	136,369,809.41	3.58
7	000001	深发展 A	127,340,669.04	3.34
8	601918	国投新集	125,378,789.37	3.29
9	600502	安徽水利	120,856,011.39	3.17
10	600410	华胜天成	118,447,759.42	3.11
11	601601	中国太保	114,370,318.67	3.00
12	600252	中恒集团	107,857,632.16	2.83
13	600271	航天信息	107,440,154.37	2.82
14	601166	兴业银行	106,498,524.83	2.80
15	600325	华发股份	105,471,172.14	2.77
16	000009	中国宝安	102,445,574.21	2.69
17	601111	中国国航	99,450,081.66	2.61
18	600267	海正药业	97,960,183.41	2.57
19	000983	西山煤电	91,080,844.12	2.39
20	601006	大秦铁路	86,777,728.28	2.28

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	8,720,703,561.15
卖出股票的收入（成交）总额	9,141,971,177.53

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	200,750,000.00	5.57
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,228,160.00	0.06
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	202,978,160.00	5.63

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0801047	08 央行票据 47	1,700,000	170,663,000.00	4.73
2	0801035	08 央行票据 35	300,000	30,087,000.00	0.83
3	112006	08 万科 G2	21,120	2,228,160.00	0.06
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.9 投资组合报告附注

**8.9.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期除大族激光外，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。

深圳市大族激光科技股份有限公司（简称“大族激光”）2010年9月6日被深圳证券交易所给予通报批评的处分，具体违规行为如下：2010年2月26日，该公司刊登2009年度业绩快报，披露的归属于上市公司股东的净利润（以下简称“净利润”）为70,990,779.39元；2010年4月20日，公司刊登了业绩快报修正公告，修正后的净利润为3,024,526.81元；2010年4月27日，公司刊登了2009年年度报告，披露的净利润为3,024,526.81元，这与2010年2月26日刊登的2009年度业绩快报相比，差异绝对金额达到67,966,252.58元，差异幅度达到95.74%。

**8.9.2** 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.9.3 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	2,013,524.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,446,725.89
5	应收申购款	141,687.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,601,938.15

**8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**§9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
150,273	22,605.11	428,440,776.30	12.61%	2,968,496,761.78	87.39%

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员 持有本开放式基金	434,312.11	0.01%

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2006年9月8日)基金份额总额	6,114,724,726.60
本报告期期初基金份额总额	3,746,760,648.74
本报告期期间基金总申购份额	484,584,023.53
减：本报告期期间基金总赎回份额	834,407,134.19
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,396,937,538.08

注：上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内，经建信基金管理有限责任公司 2010 年度第一次临时股东会会议决议并备案中国证监会，殷红军先生当选为建信基金管理有限责任公司董事会股东董事，王曦先生不再担任公司董事。经建信基金管理有限责任公司第二届董事会第三次会议审议通过，并报经



中国证监会证监许可[2010]567 号文核准，公司决定聘任王新艳为公司副总经理。上述聘任事项已于 2010 年 5 月 18 日公告。

本报告期，经中国证监会核准，本基金托管人聘任晏秋生先生担任资产托管部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为人民币 108,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	2,133,317,321.85	11.98%	1,733,336.88	11.95%	-
华泰联合证券	1	1,237,140,807.24	6.95%	1,005,383.50	6.93%	-
长城证券	1	1,177,604,830.57	6.61%	956,811.01	6.60%	-
国金证券	1	1,226,424,555.08	6.89%	991,879.58	6.84%	-
申银万国证券	1	3,054,190,816.40	17.16%	2,496,361.78	17.22%	-
中信建投证券	2	1,833,960,197.61	10.30%	1,492,414.07	10.29%	-
银河证券	1	682,696,449.04	3.83%	559,220.13	3.86%	-
平安证券	1	1,911,670,233.45	10.74%	1,553,245.39	10.71%	-
安信证券	3	1,601,783,534.34	9.00%	1,301,459.38	8.98%	本期新增 2 个
广发证券	2	2,684,811,430.31	15.08%	2,194,392.35	15.13%	本期新增 1 个

红塔证券	1	259,292,246.55	1.46%	215,307.27	1.48%	本期新增
招商证券	1	-	-	-	-	本期新增 1 个
中国建银投资	1	-	-	-	-	本期新增
长江证券	1	-	-	-	-	本期新增
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
金通证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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

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

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

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

（4）佣金费率合理。

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

3、本期内，广发证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司各新增一个交易单元，安信证券股份有限公司新增两个单元，无剔除交易单元。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申银万国证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	2,636,408.07	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中国建银投资	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司

二〇一一年三月二十八日