
建信新兴市场优选股票型证券投资基金 2011 年年度报告

2011 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：二〇一二年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2011 年 6 月 21 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告	7
§5 托管人报告	14
§6 审计报告	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告.....	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	42
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	42
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	43
8.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	57
8.7 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	57
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	57
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	57
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	57
8.11 投资组合报告附注.....	57
§9 基金份额持有人信息.....	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
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	58
§10 开放式基金份额变动.....	58
§11 重大事件揭示.....	58
§12 备查文件目录.....	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信新兴市场优选股票型证券投资基金
基金简称	建信新兴市场股票（QDII）
基金主代码	539002
交易代码	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	164,824,064.58 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	本基金为股票型基金，一般情况下基金投资风险收益水平高于债券型基金和混合型基金。同时，由于本基金主要投资于新兴市场上市公司股票，预期风险-收益水平高于一般的境外投资股票型基金。

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	95588

	010-66228000	
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	100032
法定代表人	江先周	姜建清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Principal Global Investors, LLC.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	信安环球投资有限公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		801 Grand Avenue, Des Moines	140 Broadway York
办公地址		801 Grand Avenue, Des Moines	140 Broadway York
邮政编码		IA 50392-0490	NY10005

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-20,178,409.94
本期利润	-26,830,563.37
加权平均基金份额本期利润	-0.1303
本期加权平均净值利润率	-13.73%
本期基金份额净值增长率	-15.10%

3.1.2 期末数据和指标	2011 年末
期末可供分配利润	-24,961,743.76
期末可供分配基金份额利润	-0.1514
期末基金资产净值	139,862,320.82
期末基金份额净值	0.849
3.1.3 累计期末指标	2011 年末
基金份额累计净值增长率	-15.10%

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

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

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

4、本基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，截至报告日未满一年。

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	-7.92%	1.08%	2.92%	1.53%	-10.84%	-0.45%
过去六个月	-15.10%	0.83%	-21.26%	1.75%	6.16%	-0.92%
自基金合同生效起至今	-15.10%	0.80%	-17.92%	1.71%	2.82%	-0.91%

注：1、本基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，截至报告日未满一年。

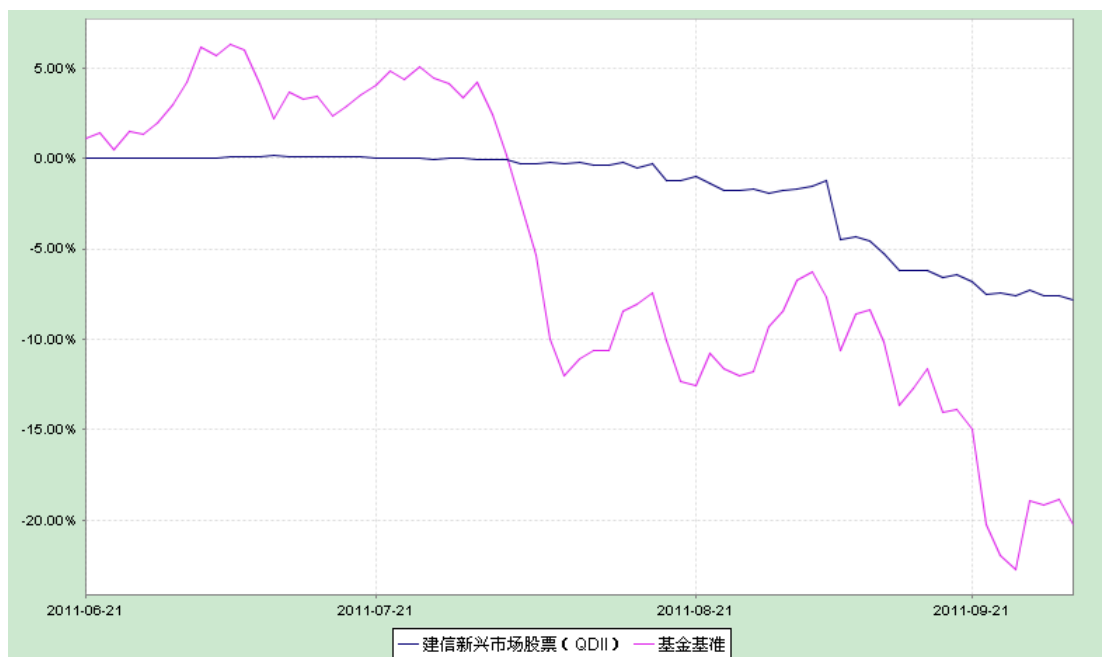
2、同期业绩比较基准以人民币计价。

3.2.2 自基金合同生效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

建信新兴市场优选股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 6 月 21 日至 2011 年 12 月 31 日)



注： 1、本基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，截至报告日未满一年。

2、本基金为股票型基金，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。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

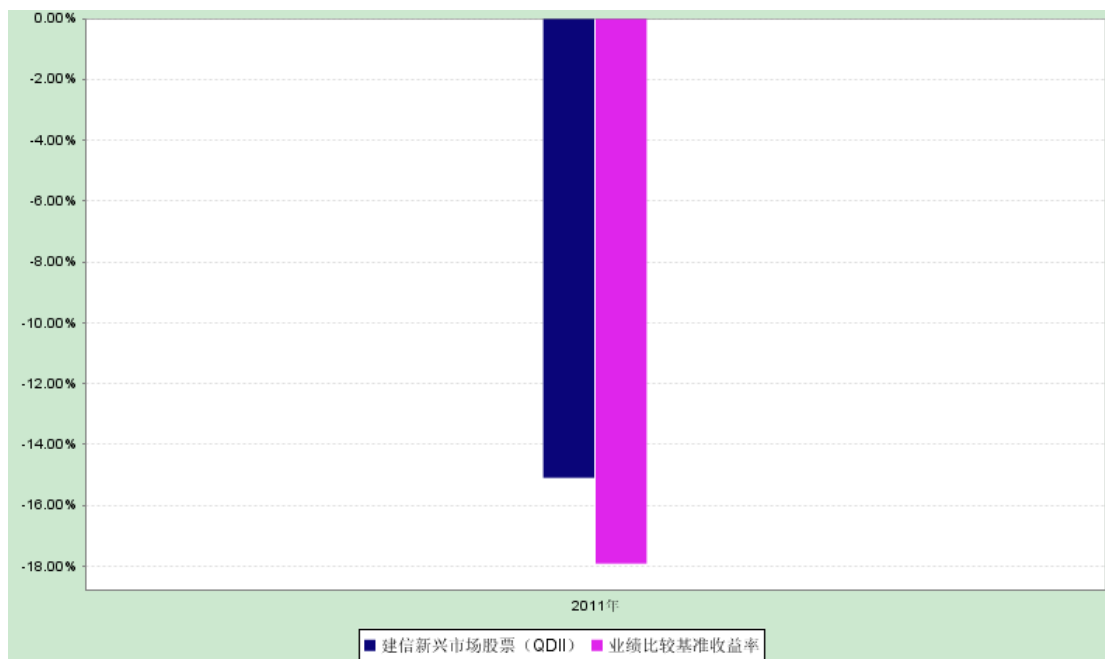
3、同期业绩比较基准以人民币计价。

4、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 合同生效日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

建信新兴市场优选股票型证券投资基金

合同生效日以来净值收益率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：本基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，截至报告日未满一年，2011 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

本基金自 2011 年 6 月 21 日(基金合同生效日)起至 2011 年 12 月 31 日未实施利润分配。

§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、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司。自成立以来，公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价

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 2011 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、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金（ETF）及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信保本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、建信新兴市场优选股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金（ETF）及其联接基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金 19 只开放式基金和建信优势动力股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金 2 只封闭式基金，管理的基金资产规模共计为 486.93 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵英楷先生	海外投资部总监，本基金基金经理	2011-06-21	-	15	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（主持工作）、总监。2011 年 4 月 20 日起任建信全球机遇股票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务	证券从业年限	说明
Michael L. Reynal	在信安环球担任投资组合经理	21	达特茅斯学院 Amos Tuck 商学院 MBA 毕业。1991 年-1993 年，在 Barclays de Zoete Wedd 先后担任兼并与收购部门分析师，拉丁美洲

		<p>股票销售。1993 年-1997 年，在 Paribas Capital Markets 担任股票销售总监。1998 年在花旗集团参加暑期实习。1999 年-2001 年，在 Wafra 投资顾问集团担任副总裁，投资组合经理和分析师。2001 年至今，在信安环球投资担任投资组合经理。负责领导新兴市场团队，他同时分管分散投资的新兴市场组合和专门的亚洲区域股票策略。他同时也进行公司研究，主要侧重于全球制药公司以及拉美/东欧/中东/非洲的消费品和不动产。</p>
--	--	---

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》、《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 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。

4.4.3 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。

4.5 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

2011 年上半年新兴市场比较平稳，进入三季度后，受到欧洲债务危机、发达国家经济数据欠佳，新兴市场国家通胀持续上行等风险影响，市场大幅下跌，四季度市场触底，走出一段不错的反弹行情。回顾 2011 年，新兴市场行情主要围绕三个主题：一是欧债危机和成熟市场经济数据疲软引起市场恐慌，并进而造成短期流动性趋紧；二是新兴市场主要国家均出现通货膨胀风险，通胀率处于近几年的最高位；三是为了对抗通货膨胀，新兴市场主要国家采取紧缩政策，上调利率，控制市场流动性。从 2011 年 2 季度起，降风险是全球投资人的主旋律，新兴市场亦不例外。但 2011 年 4 季度，新兴市场也出现了一些重要转变：通货膨胀从高位下行，向下趋势基本确定；大多数国家经济政策紧缩转向放松，中国降低存款准备金率，巴西、俄罗斯下调利率；经济下滑也出现企稳迹象。另外发达国家也出现了比较正面的转变，首先，美国国债上限谈判的政治僵局在妥协中得到分布解决，市场也以平常心度过了美国国债降级带来的冲击。美联储的扭转操作进一步稳定了市场对流动性的担忧。然后欧债危机暂时性缓和，欧洲问题国家纷纷推出大规模削减赤字方案，欧盟、欧央行推出多项救市方案，特别是 LTRO 操作有效缓解了欧洲银行流动性问题，并且使得意大利、西班牙国债收益率大幅回落。虽然我们并不认为欧债危机就此得到解决，但至少市场恐慌的情绪得到缓解。其次是美国经济数据出现好转，例如就业、PMI、房屋销售等数据超出了经济学家早前比较悲观的预期。我们判断美国经济会继续缓慢复苏，但不会出现强劲增长。

本基金 2012 年 6 月成立，较好的控制了投资风险。3 季度我们对欧债问题持谨慎态度，市场大跌时基金较好地控制了建仓节奏，利用较低的仓位实现了相对于指数的超额收益。基金在 4 季度完成建仓，较好地参与了 4 季度的反弹行情。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本年度，本基金净值增长率-15.10%，波动率 0.80%，业绩比较基准收益率-17.92%，波动率 1.71%。

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 2012 年，我们认为新兴市场的基本面将好于 2011 年。通胀下行趋势比较确定，主要国家采取经济刺激政策，下调利率、改善流动性，经济基本面的改善对市场表现将起到比较积极的作用，今年新兴市场股票收益预期将会好于 2011 年。

目前我们观察到巴西、俄罗斯利息下调后，经济出现好转；中国通过降低存准率的方式提高市场流动性，并且通过积极的财政政策，例如增加保障房和水利建设等措施刺激促进经济增长，避免经济硬着陆。其他国家，例如印度央行在通胀率触顶后将存款准备金率从 6% 下调到 5.5%，智利两年来第一次将利率下调了 25 个基点。目前新兴市场估值较低，经济基本面的改善会对市场产生比较积极的推动作用。但是另一方面我们也必须清醒地认识到本次全球经济复苏的步伐是缓慢的，希望市场出现持续大幅上涨行情的愿望可能不太现实。我们认为未来比较大的风险依然来自欧洲，欧债危机可能出现反复，地域风险（如伊朗问题）上升时资金可能流出新兴市场国家，给市场带来较大的下行压力。目前中国、巴西、俄罗斯、印度出现的暂时的市场回暖是否形成趋势还需进一步确认，尤其是许多新兴市场国家经济对出口和大宗商品的依赖较高，在全球经济缓慢复苏的前提下，投资人密切需要关注这些国家经济的实际表现。我们认为新兴市场的低估值和经济基本面持续改善预期会为 2012 年的市场行情提供了上行动力，但风险也不容小视。本基金将保持谨慎的投资态度，合理控制仓位，精选个股，为投资人创造超额收益。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2011 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司监察稽核部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总经理和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制

中采取了以下措施：

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备季度监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由监察稽核部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司 2011 年度监察稽核工作计划，实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发“三条底线”违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与外方股东信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的核心价值观，树立并坚持诚信、规范、专业、创新的经营理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

大利益冲突。

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。

4.9 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

2011 年，本基金托管人在对建信新兴市场优选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2011 年，建信新兴市场优选股票型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限公司在建信新兴市场优选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。

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公司编制和披露的建信新兴市场优选股票型证券投资基金 2011 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

二〇一二年三月二十日

§6 审计报告

普华永道中天审字(2012)第 20617 号

建信新兴市场优选股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的建信新兴市场优选股票型证券投资基金(以下简称“建信新兴市场股票基金”)的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间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。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是建信新兴市场股票基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述建信新兴市场股票基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了建信新兴市场股票基金 2011 年 12 月 31 日的

财务状况以及 2011 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 薛竞 张鸿
中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
2012-03-21

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信新兴市场优选股票型证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	14,572,618.22
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	125,962,456.11
其中：股票投资		124,456,402.43
基金投资		1,506,053.68
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	2,617.70
应收股利		54,523.35
应收申购款		31,599.25
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		140,623,814.63

负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		264,079.99
应付管理人报酬		218,430.44
应付托管费		42,472.59
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	236,510.79
负债合计		761,493.81
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	164,824,064.58
未分配利润	7.4.7.10	-24,961,743.76
所有者权益合计		139,862,320.82
负债和所有者权益总计		140,623,814.63

注：1、报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.849 元，基金份额总额 164,824,064.58 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2011 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：建信新兴市场优选股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
----	-----	----

		2011年6月21日(基金合同生效日)至2011年12月31日
一、收入		-23,123,046.99
1.利息收入		1,399,287.44
其中：存款利息收入	7.4.7.11	237,077.17
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		1,162,210.27
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-8,663,235.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-8,153,074.18
基金投资收益	7.4.7.13	-900,934.55
债券投资收益	7.4.7.14	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.15	87,297.63
股利收益	7.4.7.16	303,475.75
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-6,652,153.43
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-9,533,024.38
5.其他收入(损失以“-”号填列)		326,078.73
减：二、费用		3,707,516.38
1.管理人报酬		1,849,110.46
2.托管费		359,549.32
3.销售服务费		-
4.交易费用		973,790.17
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用		525,066.43
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-26,830,563.37
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-26,830,563.37

注：本财务报表的实际编制期间为 2011 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：建信新兴市场优选股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2011 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2011 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）	426,647,075.13	-	426,647,075.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-26,830,563.37	-26,830,563.37
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）	-261,823,010.55	1,868,819.61	-259,954,190.94
其中：1.基金申购款	956,142.82	-51,074.88	905,067.94
2.基金赎回款	-262,779,153.37	1,919,894.49	-260,859,258.88
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）	164,824,064.58	-24,961,743.76	139,862,320.82

注：本财务报表的实际编制期间为 2011 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4.1 基金基本情况

建信新兴市场优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 316 号《关于核准建信新兴市场优选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集，本基金募集期限自 2011 年 5 月 23 日起至 2011 年 6 月 17 日止。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 426,628,617.18 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 426,647,075.13 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,457.95

份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)，境外投资顾问为信安环球投资有限公司(Principal Global Investors, LLC.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信新兴市场优选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新兴市场经济体证券市场及其他证券市场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。其中，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，“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))。

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》、

《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2011 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、基金投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变

动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资和衍生工具(主要为权证投资)投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法

有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资和基金投资在持有期间应取得的现金股利扣除适用的境内及境外代扣代缴所得税后，于除息日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实

现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《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》及其他境内外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) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日
活期存款	14,572,618.22
定期存款	-
其他存款	-
合计	14,572,618.22

注：本基金基金合同自2011年6月21日生效，至本报告截止日2011年12月31日未满一年。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	131,103,200.48	124,456,402.43	-6,646,798.05
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	债券合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	1,511,409.06	1,506,053.68	-5,355.38

其他	-	-	-
合计	132,614,609.54	125,962,456.11	-6,652,153.43

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,617.70
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	-
其他	-
合计	2,617.70

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末没有应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	995.24
预提费用	235,515.55
应付未起息外汇交易	-
合计	236,510.79

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	426,647,075.13	426,647,075.13
本期申购	956,142.82	956,142.82
本期赎回（以“-”号填列）	-262,779,153.37	-262,779,153.37
本期末	164,824,064.58	164,824,064.58

注：1. 本基金自 2011 年 5 月 23 日至 2011 年 6 月 17 日止期间公开发售，共募集有效
净认购资金 426,628,617.18 元。根据《建信新兴市场优选股票型证券投资基金招募说明书》
的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 18,457.95 元在本基金成立后，折算
为 18,457.95 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《建信新兴市场优选股票型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于
2011 年 6 月 21 日(基金合同生效日)至 2011 年 7 月 5 日止期间暂不向投资人开放基金交易。
申购和赎回业务自 2011 年 7 月 6 日起开始办理。

3、本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-20,178,409.94	-6,652,153.43	-26,830,563.37
本期基金份额交易 产生的变动数	1,692,048.65	176,770.96	1,868,819.61

其中：基金申购款	-43,605.08	-7,469.80	-51,074.88
基金赎回款	1,735,653.73	184,240.76	1,919,894.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,486,361.29	-6,475,382.47	-24,961,743.76

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	188,510.27
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	48,566.90
其他	-
合计	237,077.17

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	170,895,495.82
减：卖出股票成本总额	179,048,570.00
买卖股票差价收入	-8,153,074.18

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 6 月 21 日（基金合同生效日）至 2011
----	--------------------------------------

	年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	25,577,405.36
减：卖出/赎回基金成本总额	26,478,339.91
基金投资收益	-900,934.55

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.7.14 债券投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年6月21日（基金合同生效日）至2011年12 月31日
卖出权证成交金额	87,297.63
减：卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	87,297.63

注：1、本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日
未
满一年。

2、本基金本报告期的权证投资为获赠权证。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年6月21日（基金合同生效日）至2011年12 月31日
股票投资产生的股利收益	291,012.83
基金投资产生的股利收益	12,462.92
合计	303,475.75

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期

	2011年6月21日（基金合同生效日）至2011年12月31日
1.交易性金融资产	-6,652,153.43
——股票投资	-6,646,798.05
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-5,355.38
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-6,652,153.43

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年6月21日（基金合同生效日）至2011年 12月31日
基金赎回费收入	326,078.73
合计	326,078.73

注：1、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。

2、本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年6月21日（基金合同生效日）至2011 年12月31日
交易所市场交易费用	973,790.17
银行间市场交易费用	-
合计	973,790.17

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年6月21日（基金合同生效日）至2011 年12月31日
审计费用	72,000.00
信息披露费	159,015.81
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	12,716.84
金融交易税	268,911.80
其他	3,421.98
合计	525,066.43

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金未存在或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至报表批准报出日，本基金未存在资产负债表日后发生的利润分配、基金
拆分、基金转型等非调整事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
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
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东(2011年6月2日起)
布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)	境外资产托管人
信安环球投资有限公司(Principal Global Investors, LLC.) (“信安环球”)	境外投资顾问

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2011年6月21日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,849,110.46
其中：支付销售机构的客户维护费	745,103.63

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。

3、本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未满一年。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2011年6月21日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	359,549.32

注：1、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。

2、本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未满一年。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2011年6月21日（基金合同生效日）至2011年12月31日
基金合同生效日（2011年6月21日）持有的基金份额	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
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.07%

注：本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司在本年度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。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2011年6月21日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	11,358,119.14	183,718.14
布朗兄弟哈里曼银行	3,214,499.08	4,792.13

注：1、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，按适用利率计息。

2、本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未滿一年。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末通过关联方购买其承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期未发生其他需要说明的关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型证券投资基金，其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金。同时，由于本基金主要投资于新兴市场上市公司股票，预期风险-收益水平高于一般的境外投资股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、基金投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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，在分散投资风险的同时追求基金资产的长期增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计与风险控制委员会，根据公司总体战略负责拟订公司风险战略和风险管理政策，并对其实施情况及效果进行监督和评价，指导公司的风险管理和内控制度建设；对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估；监

督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评估公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责制定公司经营管理中的风险控制政策，组织制定公司经营管理中的内部风险控制制度；对公司管理层在投资、市场、信用、操作等方面的风险控制情况进行监督，管理层应如实向风险管理委员会汇报有关风险控制情况；以及对公司经营管理过程中的风险状况进行定期或不定期评估。在业务操作层面，风险管理部负责公司旗下基金及其它受托资产投资中的风险识别、评估和控制；监察稽核部承担其他风险的管理职责，负责在各业务部门一线风险控制的基础上实施风险再控制。

本基金的基金管理人建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的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，与该银行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与境外当地授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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。于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券公允

价值占基金资产净值的比例为 0.00%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过风险管理委员会设定流动性比例要求，独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动

的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011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	14,572,618.22	-	-	-	14,572,618.22
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	125,962,456.11	125,962,456.11
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	-	-	-	2,617.70	2,617.70
应收股利	-	-	-	54,523.35	54,523.35
应收申购款	-	-	-	31,599.25	31,599.25
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,572,618.22	-	-	126,051,196.41	140,623,814.63
负债					
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	264,079.99	264,079.99
应付管理人报酬	-	-	-	218,430.44	218,430.44
应付托管费	-	-	-	42,472.59	42,472.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	236,510.79	236,510.79
负债总计	-	-	-	761,493.81	761,493.81
利率敏感度缺口	14,572,618.22	-	-	125,289,702.60	139,862,320.82

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	2,995,864.91	0.01	255,325.43	3,251,190.35
交易性金融资产	34,238,242.69	25,055,510.42	66,668,703.00	125,962,456.11
应收股利	6,819.72	-	47,703.63	54,523.35
资产合计	37,240,927.32	25,055,510.43	66,971,732.06	129,268,169.81
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	37,240,927.32	25,055,510.43	66,971,732.06	129,268,169.81

注：本基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至报告截止日 2011 年 12 月 31 日未满一年。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2011 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	增加约 6,993,116.04 -
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 6,993,116.04 -

注：本基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至报告截止日 2011 年 12 月 31 日未满一年。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票、基金和衍生工具，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。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	124,456,402.43	88.98
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	1,506,053.68	1.08
合计	125,962,456.11	90.06

注：本基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至报告截止日 2011 年 12 月 31 日未满一年。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2011 年 12 月 31 日，本基运营期限不满一年，尚无足够经验数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于2011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125,962,456.11元，无属于第二层级和第三层级的余额。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具。

(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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	124,456,402.43	88.50
	其中：普通股	89,117,699.89	63.37
	存托凭证	31,312,721.46	22.27
	优先股	4,025,981.08	2.86

2	基金投资	1,506,053.68	1.07
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	14,572,618.22	10.36
8	其他各项资产	88,740.30	0.06
9	合计	140,623,814.63	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	27,109,326.10	19.38
香港	25,055,510.45	17.91
韩国	20,699,511.99	14.80
南非	16,098,181.73	11.51
巴西	12,376,001.58	8.85
英国	7,329,083.44	5.24
泰国	4,383,734.44	3.13
马来西亚	4,645,893.78	3.32
印尼	3,571,421.87	2.55
墨西哥	2,572,801.57	1.84
波兰	614,935.48	0.44
合计	124,456,402.43	88.98

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例
------	------	-----------

		(%)
金融	27,965,599.89	20.00
信息技术	21,051,697.91	15.05
能源	17,348,861.74	12.40
材料	14,471,324.59	10.35
非必需消费品	14,593,568.35	10.43
电信服务	12,630,390.89	9.03
必需消费品	10,206,637.18	7.30
工业	5,466,227.74	3.91
公用事业	722,094.14	0.52
合计	124,456,402.43	88.98

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	SAMSUNG ELECTRONIC CO LTD	三星电子	KR7005930003	韩国证券交易所	韩国	1,196	6,918,267.37	4.95
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	台积电	US8740391003	纽约证券交易所	美国	56,900	4,628,508.71	3.31
3	CHINA MOBILE LTD	中国移动有限公司	HK0941009539	香港证券交易所	中国香港	65,500	4,030,354.53	2.88
4	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	-	BRITUBACNPR1	巴西圣保罗股票交易所	巴西	28,800	3,303,886.94	2.36
5	PETRO	巴西石	US71654	纽约证	美国	21,000	3,288,124.59	2.35

	LEO BRASI LEIRO S.A.-A DR	油股份 公司	V4086	券交易 所				
6	GAZP ROM OAO-S PON ADR	俄罗斯 天然气 工业公 司	US36828 72078	美国 OTC 市 场	美国	45,700	3,075,605.94	2.20
7	VALE SA-SP ADR	淡水河 谷公司	US91912 E1055	纽约证 券交易 所	美国	21,300	2,878,786.62	2.06
8	CNOO C LTD	中国海 洋石油	HK08830 13259	香港证 券交易 所	中国香 港	251,000	2,763,335.81	1.98
9	SASOL LTD	-	ZAE0000 06896	南非证 券交易 所	南非	8,607	2,589,570.15	1.85
10	BANK RAKY AT INDON ESIA PERSE RO TBK	-	ID10001 18201	印尼证 券交易 所	印尼	522,000	2,448,034.08	1.75
11	LENO VO GROU PLTD	联想集 团	HK09920 09065	香港证 券交易 所	中国香 港	566,000	2,376,875.12	1.70
12	GENTI NG BHD	-	MYL318 200002	马来西 亚证券 交易所	马来西 亚	106,800	2,335,698.99	1.67
13	LUKOI L OAO-S PON ADR	卢克石 油公司	US67786 21044	美国 OTC 市 场	美国	6,800	2,279,413.53	1.63
14	KIA MOTO RS CORP	起亚汽 车	KR70002 70009	韩国证 券交易 所	韩国	6,053	2,207,379.49	1.58

	ORATI ON							
15	HYUN DAI MOTO R CO	现代汽 车	KR70053 80001	韩国证 券交易 所	韩国	1,890	2,201,009.42	1.57
16	BANC O DO BRASI L S.A.	巴西银 行股份 公司	BRBBAS ACNOR 3	巴西圣 保罗股 票交易 所	巴西	27,400	2,191,696.60	1.57
17	ICICI BANK LTD-S PON ADR	ICICI 银行	US45104 G1040	纽约证 券交易 所	美国	13,100	2,181,579.46	1.56
18	SBERB ANK-S PONS ORED ADR	俄罗 联邦储 蓄银行	US80585 Y3080	伦敦国 际证券 交易所	英国	33,871	2,117,104.36	1.51
19	VODA COM GROU P LTD	-	ZAE0001 32577	南非证 券交易 所	南非	30,445	2,114,742.44	1.51
20	GOLD FIELD S LTD	-	ZAE0000 18123	南非证 券交易 所	南非	21,420	2,082,998.73	1.49
21	CIELO SA	-	BRCIEL ACNOR 3	巴西圣 保罗股 票交易 所	巴西	12,800	2,082,277.15	1.49
22	PETRO CHINA CO LTD-H	中国石 油天然 气	CNE100 0003W8	香港证 券交易 所	中国香 港	262,000	2,053,940.88	1.47
23	PICC PROPE RTY & CASU ALTY -H	中国人 民财产 保险	CNE100 000593	香港证 券交易 所	中国香 港	237,600	2,022,534.36	1.45
24	CHAR OEN	卜蜂食 品公司	TH01010 10Z14	泰国证 券交易	泰国	293,500	1,932,468.86	1.38

	POKP HAND FOOD- FORG N			所				
25	GREAT WALL MOTO R COMP ANY-H	长城汽 车	CNE100 000338	香港证 券交易 所	中国香 港	203,500	1,870,844.28	1.34
26	MTN GROU PLTD	-	ZAE0000 42164	南非证 券交易 所	南非	16,600	1,862,117.19	1.33
27	CHINA COMM UNICA TIONS CONST -H	中国交 通建设	CNE100 0002F5	香港证 券交易 所	中国香 港	367,000	1,805,988.28	1.29
28	BANK OF CHINA LTD-H	中国银 行	CNE100 0001Z5	香港证 券交易 所	中国香 港	767,000	1,778,367.74	1.27
29	ANTOF AGAST A PLC	-	GB00004 56144	伦敦证 券交易 所	英国	14,460	1,706,221.36	1.22
30	SANL AM LTD	-	ZAE0000 70660	南非证 券交易 所	南非	74,387	1,674,921.12	1.20
31	TIM PARTI CIPAC OES SA-AD R	-	US88706 P2056	纽约证 券交易 所	美国	10,100	1,641,888.49	1.17
32	INFOS YS LTD-S PADR	INFOS YS 科 技	US45678 81085	纳斯达 克证券 交易所	美国	5,000	1,618,701.17	1.16
33	SOUZ A CRUZ	-	BRCRU ZACNO R0	巴西圣 保罗股 票交易	巴西	19,400	1,500,059.02	1.07

	SA			所				
34	KUMBA IRON ORE LTD	-	ZAE0000 85346	南非证 券交易 所	南非	3,829	1,494,193.57	1.07
35	CIA HERIN G	-	BRHGT XACNO R9	巴西圣 保罗股 票交易 所	巴西	12,700	1,391,341.58	0.99
36	COMP ANHIA DE BEBID AS-PR F ADR	-	US20441 W2035	纽约证 券交易 所	美国	6,100	1,387,136.81	0.99
37	IMPER IAL HOLDI NGS LTD	-	ZAE0000 67211	南非证 券交易 所	南非	13,769	1,327,152.57	0.95
38	TELEK OM MALA YSIA BHD	-	MYL486 300006	马来西 亚证券 交易所	马来西 亚	132,900	1,310,568.10	0.94
39	FIRST RAND LTD	-	ZAE0000 66304	南非证 券交易 所	南非	80,100	1,296,560.43	0.93
40	KASIK ORNB ANK PCL-F OREIG N	-	TH00160 10017	泰国证 券交易 所	泰国	52,100	1,294,188.50	0.93
41	AIR CHINA LTD-H	中国国 航	CNE100 0001S0	香港证 券交易 所	中国香 港	276,000	1,284,343.37	0.92
42	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	中信银 行	CNE100 0001Q4	香港证 券交易 所	中国香 港	359,000	1,271,850.48	0.91

43	CJ CHEIL JEDAN G CORP	-	KR70979 50000	韩国证 券交易 所	韩国	800	1,266,248.81	0.91
44	BUNG E LTD	邦基公 司	BMG169 621056	纽约证 券交易 所	美国	3,400	1,225,399.00	0.88
45	HDFC BANK LTD-A DR	HDFC 银行	US40415 F1012	纽约证 券交易 所	美国	7,300	1,208,789.83	0.86
46	AAC TECH NOLO GIES HOLDI NGS IN	瑞声科 技	KYG295 3R1065	香港证 券交易 所	中国香 港	84,000	1,187,643.08	0.85
47	COSA N SA INDUS TRIA COME RCIO	-	BRCSA NACNO R6	巴西圣 保罗股 票交易 所	巴西	13,000	1,184,646.15	0.85
48	ASIAN A AIRLI NES	韩亚航 空	KR70205 60009	韩国证 券交易 所	韩国	32,000	1,128,470.44	0.81
49	SAMP OERN A AGRO TBK PT	-	ID10001 06107	印尼证 券交易 所	印尼	543,500	1,123,387.79	0.80
50	INDUS TRIAL BANK OF KORE A	韩国中 小企业 银行	KR70241 10009	韩国证 券交易 所	韩国	15,600	1,066,142.14	0.76
51	HANK OOK	韩泰轮 胎	KR70002 40002	韩国证 券交易	韩国	4,300	1,063,818.49	0.76

	TIRE CO LTD			所				
52	LIG INSUR ANCE CO LTD	-	KR70025 50002	韩国证 券交易 所	韩国	8,300	1,039,187.87	0.74
53	HON HAI PRECI SION- GDR REG S	鸿海精 密	US43809 02019	伦敦国 际证券 交易所	英国	29,794	1,032,509.55	0.74
54	SISTE MA JSFC-R EG S SPONS GDR	西斯特 能源	US48122 U2042	伦敦国 际证券 交易所	英国	9,607	1,017,555.44	0.73
55	CIA DE MINAS BUEN AVEN TUR-A DR	-	US20444 81040	纽约证 券交易 所	美国	4,200	1,014,621.30	0.73
56	MALA YAN BANKI NG BHD	马来亚 银行	MYL115 500000	马来西 亚证券 交易所	马来西 亚	58,600	999,626.69	0.71
57	SEVER STAL - GDR REG S	谢韦尔 钢铁	US81815 03025	伦敦国 际证券 交易所	英国	13,267	952,136.09	0.68
58	GS HOLDI NGS	GS 控 股	KR70789 30005	韩国证 券交易 所	韩国	3,328	922,511.47	0.66
59	GRUP O MEXIC O SAB DE	-	MXP370 841019	墨西哥 证券交 易所	墨西哥	55,900	920,426.68	0.66

	CV-SE R B							
60	PING AN INSUR ANCE GROU P CO-H	中国平 安	CNE100 0003X6	香港证 券交易 所	中国香 港	22,000	913,172.48	0.65
61	WOOL WORT HS HOLDI NGS LTD	-	ZAE0000 63863	南非证 券交易 所	南非	29,604	901,086.53	0.64
62	SAMS UNG HEAV Y INDUS TRIES	三星重 工	KR70101 40002	韩国证 券交易 所	韩国	5,050	770,328.70	0.55
63	LEWIS GROU P LTD	-	ZAE0000 58236	南非证 券交易 所	南非	12,067	754,839.00	0.54
64	KORE A ZINC CO LTD	高丽亚 铝公司	KR70101 30003	韩国证 券交易 所	韩国	436	724,670.47	0.52
65	CIA PARA NAEN SE DE ENER GI-PFB	-	BRCPL ACNPB9	巴西圣 保罗股 票交易 所	巴西	5,500	722,094.14	0.52
66	ADVA NCED INFO SERVI CE-FO R RG	亿旺资 讯服务	TH02680 10Z11	泰国证 券交易 所	泰国	23,300	653,164.70	0.47
67	KGHM POLSK A MIEDZ	-	PLKGH M000017	华沙证 券交易 所	波兰	3,031	614,935.48	0.44

	SA							
68	GRUPO MODELO S.A.B.-SER C	-	MXP4833F1044	墨西哥证券交易所	墨西哥	14,700	587,290.74	0.42
69	DUKS AN HI-METAL CO LTD	-	KR7077360006	韩国科斯达克市场	韩国	4,054	562,986.47	0.40
70	INDUSTRIAS PENOL ES SAB DE CV	-	MXP554091415	墨西哥证券交易所	墨西哥	1,955	539,731.48	0.39
71	HONAM PETROCHEMICAL CORP	湖南石油化学	KR7011170008	韩国证券交易所	韩国	327	532,775.82	0.38
72	MEXICHEM SAB DE CV-*	-	MX01ME050007	墨西哥证券交易所	墨西哥	26,500	525,352.67	0.38
73	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	盘谷银行	TH0001010014	泰国证券交易所	泰国	15,400	503,912.38	0.36
74	MAHINDRA & MAHINDRA-SPON GDR	-	USY541641194	伦敦国际证券交易所	英国	6,059	503,556.64	0.36

75	MAAN SHAN IRON & STEEL-H	马钢股份	CNE1000003R8	香港证券交易所	中国香港	240,000	484,474.32	0.35
76	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	中国铁建	CNE100000981	香港证券交易所	中国香港	137,500	477,096.95	0.34
77	PHOENIX NEW MEDIA LTD-ADS	-	US71910C1036	纽约证券交易所	美国	11,530	405,383.52	0.29
78	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	CNE1000004Q8	香港证券交易所	中国香港	28,000	376,359.37	0.27
79	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	中国太平洋保险	CNE1000009Q7	香港证券交易所	中国香港	20,000	358,329.40	0.26
80	KB FINANCIAL GROUP INC	KB 金融集团	KR7105560007	韩国证券交易所	韩国	1,490	295,715.03	0.21
81	SINA CORP	新浪公司	KYG814771047	纳斯达克证券交易所	美国	400	131,058.72	0.09
82	SOHU.COM INC	搜狐公司	US83408W1036	纳斯达克证券交易所	美国	200	63,009.00	0.05
83	FOCUS	分众传	US34415	纳斯达克	美国	300	36,841.36	0.03

	MEDIA HOLDING-ADR	媒	V1098	克证券交易所				
84	21VIA NET GROUP INC-ADR	世纪互联数据公司	US90138A1034	纳斯达克证券交易所	美国	600	34,591.94	0.02
85	QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	奇虎 360	US74734M1099	纽约证券交易所	美国	100	9,886.11	0.01

注：所用证券代码采用 ISIN 代码。

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	US8740391003	10,436,899.37	7.46
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	KR7005930003	9,960,847.37	7.12
3	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	9,663,707.77	6.91
4	VALE SA	US91912E1055	7,791,567.00	5.57
5	GAZPROM OAO-SPON ADR	US3682872078	6,661,878.17	4.76
6	PETROLEO BRASILEIRO SA-ADR	US71654V4086	6,598,958.23	4.72
7	ICICI BANK LTD-SPON ADR	US45104G1040	5,585,434.23	3.99
8	LENOVO GROUP	HK0992009065	4,734,910.08	3.39

	LTD			
9	LUKOIL OAO-SPON ADR	US6778621044	4,479,660.29	3.20
10	BANCO DO BRASIL S.A.	BRBBASACNOR3	4,457,211.82	3.19
11	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	BRITUBACNPR1	4,343,179.98	3.11
12	CNOOC LTD	HK0883013259	4,342,039.23	3.10
13	SASOL LTD	ZAE000006896	4,329,273.18	3.10
14	PICC PROPERTY & CASUALTY CO LTD	CNE100000593	4,237,750.60	3.03
15	HYUNDAI MOTOR CO	KR7005380001	4,035,267.86	2.89
16	KIA MOTORS CORP	KR7000270009	4,006,308.75	2.86
17	BANK RAKYAT INDONESIA PERSERO TBK	ID1000118201	4,005,434.81	2.86
18	VODACOM GROUP LTD	ZAE000132577	3,891,557.32	2.78
19	PETROCHINA CO LTD	CNE1000003W8	3,871,161.69	2.77
20	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	TH0001010014	3,762,243.34	2.69
21	KUMBA IRON ORE LTD	ZAE000085346	3,598,193.61	2.57
22	GENTING BHD	MYL318200002	3,537,923.23	2.53
23	TIM PARTICIPACOE SA ADR	US88706P2056	3,468,048.84	2.48
24	CIELO SA	BRCIELACNOR3	3,411,188.39	2.44
25	CHAROEN POKPHAND FOOD-FORGN	TH0101010Z14	3,404,904.93	2.43
26	INFOSYS LTD- SP ADR	US4567881085	3,394,413.98	2.43
27	SANDS CHINA LTD	KYG7800X1079	3,365,790.46	2.41
28	BANK OF CHINA LTD	CNE1000001Z5	3,344,868.86	2.39

29	SANLAM LTD	ZAE000070660	3,220,950.49	2.30
30	GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDING	BMG3978C1249	2,994,522.35	2.14
31	GREAT WALL MOTOR CO LTD	CNE100000338	2,946,813.76	2.11
32	PING AN INSURANCE GROUP CO HOLDING	CNE1000003X6	2,926,319.89	2.09
33	ADVANCED INFO SERVICE-FOR RG	TH0268010Z11	2,832,340.40	2.03
34	URALKALI	US91688E2063	2,814,755.71	2.01
35	GOLD FIELDS LTD	ZAE000018123	2,801,576.19	2.00
36	KB FINANCIAL GROUP INC	KR7105560007	2,792,375.23	2.00

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

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金 资产净值比 例（%）
1	TAIWAN SEMICONDUCTO R-SP ADR	US8740391003	5,741,971.16	4.11
2	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	5,605,405.95	4.01
3	VALE SA	US91912E1055	4,027,025.16	2.88
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	KR7005930003	3,389,644.79	2.42
5	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	TH0001010014	3,312,197.86	2.37
6	SANDS CHINA LTD	KYG7800X1079	3,230,278.31	2.31
7	GAZPROM	US3682872078	2,971,623.98	2.12

	OAO-SPON ADR			
8	PETROLEO BRASILEIRO SA	US71654V4086	2,826,522.03	2.02
9	GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOL	BMG3978C1249	2,774,856.72	1.98
10	CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	CNE100000X44	2,652,475.79	1.90
11	ICICI BANK LTD-SPON ADR	US45104G1040	2,590,089.65	1.85
12	URALKALI	US91688E2063	2,532,863.25	1.81
13	ADVANCED INFO SERVICE PCL-FOR RG	TH0268010Z11	2,274,955.08	1.63
14	KB FINANCIAL GROUP INC	KR7105560007	2,247,612.84	1.61
15	FOCUS MEDIA HOLDING LTD-ADR	US34415V1098	2,125,755.51	1.52
16	PICC PROPERTY & CASUALTY CO LT	CNE100000593	2,062,726.54	1.47
17	GRUMA SAB DE CV	MXP4948K1056	2,057,647.60	1.47
18	LENOVO GROUP LTD	HK0992009065	2,023,361.46	1.45
19	KUMBA IRON ORE LTD	ZAE000085346	1,940,614.78	1.39
20	LUKOIL OAO-SPON ADR	US6778621044	1,883,796.82	1.35

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

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	309,967,671.05
卖出收入（成交）总额	170,895,495.82

注：买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数

量)，不包括相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUND	ETF	交易型开放式指数	BlackRock Fund Adv isors	1,506,053.68	1.08

8.11 投资组合报告附注

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

8.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 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	54,523.35
4	应收利息	2,617.70
5	应收申购款	31,599.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	88,740.30

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
8,850	18,624.19	13,566,480.92	8.23%	151,257,583.66	91.77%

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	826,712.00	0.50%

§10 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	956,142.82
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	262,779,153.37
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	164,824,064.58

注：本基金基金合同自 2011 年 6 月 21 日生效，至本报告截止日 2011 年 12 月 31 日未
满一年。

§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 2011 年度第一次临时股东会会议决议并备案中国证监会，袁时奋先生当选为建信基金管理有限责任公司股东董事，欧阳伯权先生不再担任公司董事。

本报告期内托管人的基金托管部门未发生重大的人事变动。

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 72,000.00 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监管部门稽查或处罚等情况

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

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
BARCLAYS	-	19,089,819.60	3.97%	15,485.70	2.35%	-

BANK OF NEW YORK	-	22,931,020.13	4.77%	25,287.70	3.83%	-
BERNSTEIN	-	23,780,604.91	4.94%	17,170.50	2.60%	-
BLAYLOCK ROBERT VAN	-	1,059,727.78	0.22%	2,637.27	0.40%	-
CCB INTERNATIONAL	-	5,494,896.09	1.14%	10,989.79	1.67%	-
CITIGROUP	-	48,556,289.74	10.10%	74,045.63	11.22%	-
CREDIT AGRICOLE	-	524,869.53	0.11%	787.33	0.12%	-
CREDIT LYONNAIS	-	18,587,134.23	3.86%	36,444.39	5.52%	-
CREDIT SUISSE	-	35,234,991.43	7.33%	40,529.20	6.14%	-
DEUTSCHE BANK	-	31,915,144.82	6.64%	20,790.39	3.15%	-
GOLDMAN SACHS	-	18,603,294.82	3.87%	37,488.47	5.68%	-
HSBC	-	14,296,550.94	2.97%	31,096.30	4.71%	-
ING	-	18,475,871.74	3.84%	33,748.68	5.11%	-
INSTINET	-	2,161,265.68	0.45%	3,985.25	0.60%	-
ITG	-	19,810,892.88	4.12%	25,735.72	3.90%	-
J.P. MORGAN	-	26,348,719.20	5.48%	35,974.27	5.45%	-
KEEFE BRUYETTE	-	11,596,977.43	2.41%	23,193.97	3.51%	-
LIQUIDNET	-	2,196,958.45	0.46%	2,635.56	0.40%	-

MACQUARIE	-	3,579,375.71	0.74%	2,784.54	0.42%	-
MERRILL LYNCH	-	90,440,440.21	18.80%	104,632.73	15.86%	-
MORGAN STANLEY	-	8,603,592.05	1.79%	12,326.76	1.87%	-
NOMURA	-	8,333,904.29	1.73%	18,294.81	2.77%	-
SANTANDER INVESTMENT	-	628,979.68	0.13%	1,572.45	0.24%	-
STIFEL NICOLAUS	-	5,215,278.96	1.08%	4,881.60	0.74%	-
SUSQUEHANNA	-	6,175,202.70	1.28%	11,498.37	1.74%	-
UBS	-	37,319,162.72	7.76%	65,869.68	9.98%	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人制定了服务券商的选择标准，具体如下：

(1) 交易执行能力：能够公平对待所有客户，实现最佳价格成交，可靠、诚信、及时成交，具备充分流动性，交易差错少等；

(2) 研究支持服务：能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务，包括举办推介会、拜访公司、及时沟通市场情况、承接专项研究、协助交易评价等；

(3) 财务实力：净资产、总市值、受托资产等指标处于行业前列，或具有明显的安全边际；

(4) 后台便利性和可靠性：交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

(5) 组织框架和业务构成：具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(6) 其他有利于基金份额持有人利益的商业合作考虑。

海外投资部在根据以上标准进行评估后并结合海外投资顾问提供的建议，列出券商名单报海外投资决策委员会最终确定。

2、券商的服务评价

- (1) 海外投资部每半年组织“服务总结”及评分。
- (2) 若券商提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，经海外投资决策委员会批准，公司将提前终止租用其交易席位。

3、除海通证券的交易席位为与优化配置基、全球机遇基金共用的交易席位外，其他券商均为本报告期内新增的服务券商，本报告期无剔除的服务券商。

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		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
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-	18,406,786.21	34.36%
BLAYLOCK ROBERT VAN	-	-	-	-	-	-	2,050,970.45	3.83%
CITIGROUP	-	-	-	-	-	-	3,598,592.99	6.72%
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	10,824,367.19	20.21%
UBS	-	-	-	-	-	-	18,686,436.84	34.88%
海通证券	-	-	6,962,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于建信新兴市场股票型证券投资基金 2012 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-12-30

2	关于华泰联合证券退出开放式基金申购赎回代理券商的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-12-24
3	关于开通浦发银行借记卡基金网上交易业务并实施费率优惠的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-12-15
4	关于旗下开放式基金通过中信万通开办基金定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-12-09
5	关于新增天源证券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	2011-12-09
6	关于新增申银万国证券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	2011-08-24
7	关于建信基金管理有限责任公司与中国建设银行股份有限公司之间发生的关联交易的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-08-23
8	关于开展建设银行借记卡网上直销申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-07-28
9	关于建信新兴市场优选股票型证券投资基金 2011 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-07-19
10	关于新增宏源证券、上海证券及华泰证券为建信新兴市场优选股票型证券投资基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-07-16
11	关于开通汇付天下“天天盈”账户网上直销业务并实施费率优惠的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-07-15
12	建信新兴市场优选股票型证券投资基金开放日常申购、赎回的提示	指定报刊和/或公司网站	2011-07-05
13	建信新兴市场优选股票型证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告	指定报刊和/或公司网站	2011-07-04
14	建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同生效公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-22

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信新兴市场优选股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信新兴市场优选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信新兴市场优选股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

建信基金管理有限责任公司

二〇一二年三月三十日