建信全球机遇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标准无保留意见的审计报告。

本报告期自2010年9月14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	建信全球机遇股票(QDII)
基金主代码	539001
交易代码	539001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月14日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	557,627,789.53份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过全球化的资产配置和组合管理,在分散和控制投资风险的同时追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金采取“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的投资策略进行投资组合的构建。
业绩比较基准	标准普尔全球BMI市场指数总收益率(S&P Global BMI)×70%+标准普尔BMI中国(除A、B股)指数总收益率(S&P BMI China ex-A-B-Shares)×30%
风险收益特征	本基金是全球股票型基金,其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。

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 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 New York
办公地址		801 Grand Avenue, Des Moines	140 Broadway New York
邮政编码		IA 50392-0490	NY10005

2.5 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	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

§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9月14日至2010年12月31日	2009年	2008年
本期已实现收益	-11,579,933.04	-	-
本期利润	-9,339,850.76	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0150	-	-
本期基金份额净值增长率	-1.60%	-	-
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	-0.0196	-	-
期末基金资产净值	548,603,397.82	-	-
期末基金份额净值	0.984	-	-

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2010年9月14日成立,合同生效当期未满一年。

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	-1.60%	0.62%	7.12%	0.87%	-8.72%	-0.25%
自基金合同生效起至今	-1.60%	0.57%	10.35%	0.83%	-11.95%	-0.26%

注:1、本基金合同自2010年9月14日生效,未满六个月。

2、本基金的业绩比较基准为:标准普尔全球BMI市场指数总收益率(S&P Global BMI)×70%+标准普尔BMI中国(除A、B股)指数总收益率(S&P BMI China ex-A-B-Shares)×30%。

标准普尔全球市场指数(S&P Global BMI)是市场中首只采用自由流通市值进行加权的全市场指数。该指数覆盖全球47个市场的12,000多家上市公司,其中包括26个发达市场和21个发展中市场;涵盖全球上市股票约97%的市值,在国际上被广泛采用为有关投资产品的业绩基准。

标准普尔BMI中国(除A、B股)指数(S&P BMI China ex-A-B-Shares)是由标准普尔指数公司于2007年11月15日推出的标准普尔QDII系列指数之一,旨在为中国境内合格机构投资者(QDII)在海外资本市场进行投资提供广泛的市场比较基准和投资方案。该指数反映在香港证券市场、美国证券市场、新加坡证券市场、日本证券市场上市的以外币计价的中国公司股票价格走势。

3、同期业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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

建信全球机遇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
(2010年9月14日至2010年12月31日)

注:1、本基金合同自2010年9月14日生效,至2010年12月31日未满六个月,仍处于建仓期。

2、本基金为股票型基金,投资组合中股票及其他权益类证券市值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%。

本基金投资于境外上市的中国公司股票的股票投资组合称为“海外中国组合”,投资于其他上市公司股票的股票投资组合称为“全球(中国除外)组合”。其中,境外上市的中国公司是指在香港、美国、英国、新加坡等地上市的公司,这些公司注册于中国大陆境内,或者虽注册于中国大陆境外,但其主要控股股东或主要业务收入源自中国大陆。

海外中国组合占本基金股票投资的目标比例为30%(比例范围0%-60%);全球(中国除外)组合占本基金股票投资的目标比例为70%(比例范围40%-100%)。

3、同期业绩比较基准以美元计价,不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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 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

建信全球机遇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2010年9月14日生效,至2010年12月31日未满一年,2010年净值增长率以实际存续期计算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本基金基金合同自2010年9月14日起生效,至本报告期截止日2010年12月31日未满一年。自基金合同生效以来未进行利润分配。

§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		
高茜女士	海外投资部副总监,本基金的基金经理	2010-09-14	-	12	注册金融分析师(CFA),获清华大学建筑学学士学位及美国俄亥俄州克利夫兰州立大学城市研究学硕士学位,先后任职于美国美林证券公司、美国基石房地产投资管理公司、英国阿特金斯顾问(北京)有限公司、美国信安金融集团等公司,担任证券研究员、研究总监、首席投资顾问、助理基金经理、投资风险管理顾问等职,于2007年12月加入我公司,担任海外投资部副总监。

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
Mustafa Sagun	信安环球投资有限公司首席投资官(CIO)	14	南佛罗里达大MagnaCumLaude博士,注册金融分析师(CFA)。1996年-1997年,所罗门兄弟有限公司 股权衍生品做市商,担任联系交易室与后台部门的职能;为指数套利、风险套利、可转换债券以及拉美衍生品交易室提供支持。1997年-2000年,PNC金融服务集团 副总裁、数量研究员,向总裁办公室以及管理财提供信息及相关工具以供公司决策。2000年至今,信安环球投资有限公司首席投资官(CIO),担任信安环球投资公司股票投资部首席投资官,负责管理所有国外、国内及全球股票投资组合管理和研究情况;同时,管理资产配置并担任全球股票组合的首席基金经理。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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

在各国政府强劲的财政刺激与极度宽松的流动性支持下,2010年全球经济整体出现了金融危机后的复苏,但相对而言危机之后的余波抑制了成熟市场的复苏力度,但在蓬勃发展的中国经济推动下,新兴市场经济强劲增长。成熟市场经济全年实现了2.6%的增长,远远低于经历了严重衰退之后经济复苏可能出现的增长率,而新兴市场则实现了7.4%的增长,其中中国经济增长10.2%。

2010年全球有两个重大事件,分别是欧元区爆发了主权债务危机和美联储推出第二轮量化宽松政策。 伴随这两大事件全球股票市场2010年出现了巨幅波动,但总体表现强劲,中国及欧洲少数国家除外。中国股市受到宏观调控和通胀上升的影响全年表现不佳,而少数欧洲国家股市则是受主权债务危机影响全年表现不好。

从全球股市看,受欧洲主权债务危机影响,全球股市在二季度出现大幅下挫,但受二次量化宽松的影响,全球股市在四季度出现大幅上扬, 投资者于四季度加大了对于风险资产的配置。 持续超市场预期的公司盈利增长为市场情绪的改观提供了坚实的支撑,宏观经济数据和领先指标总体比较正面,显示出积极的趋势,特别是在全球贸易,零售和资本开支等方面。与此同时各新兴经济体,包括中国在内则开始采取紧缩政策,以防止发达国家向市场注入的资金流入新兴经济体,引发通胀和资产泡沫,对本国经济造成危害。

本基金自成立以来一直处于建仓期。秉承建仓期的谨慎原则,基金执行了稳步建仓的策略。

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-1.60%,波动率0.57%,业绩比较基准收益率10.35%,波动率0.83%。

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2011年,我们认为全球股票市场机会与风险并存。从主要国家和地区来看,我们认为以美国为代表的成熟经济体的相对宽松的货币政策可以振兴成熟经济体并稳定通胀预期,随着经济复苏迈入更稳固的阶段,企业和个人对经济前景更有信心,从而推动资本支出及改善就业。但是由于持续的去杠杆化、财政紧缩和其他危机后遗留问题的影响,成熟市场的复苏将保持相对疲软的态势。而对于以中国为代表的新兴经济体而言,由于基本面大幅改善以及遗留问题较少,大部分新兴经济体将继续快速增长。

在货币政策方面,成熟经济体的通胀总体不太严重,成熟经济体的财政政策会保持相对宽松。而由于资金持续流入,新兴市场的通胀压力较大,因此新兴经济体国家将会进一步采取紧缩政策应对通胀风险。

按照目前的盈利增长水平, 全球股市总体估值水平仍然不高。我们预计随着资金逐渐流出债券市场流入股票市场,全球股票市场在2011年能有较好的正收益。未来一年股票市场的下行风险包括欧元区财政危机的升级和蔓延、中国通胀失控和投资萎缩及新兴市场经济过热出现问题。上行风险主要是应对危机的宽松货币政策可能帮助成熟市场超预期地恢复需求和经济增长。

本着价值投资的原则,基于对全球宏观、行业与公司竞争力的深入研究,我们将努力寻找具备获取超额收益的投资品种,努力为持有人获得更好的回报。

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。

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国内银行间固定收益品种进行估值。

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,本基金本报告期末达到利润分配条件,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

2010年,本基金托管人在对建信全球机遇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

2010年, 建信全球机遇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全球机遇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责任公司编制和披露的建信全球机遇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全球机遇股票型证券投资基金(以下简称“建信全球机遇股票基金”)的财务报表,包括2010年12月31日的资产负债表、2010年9月14日(基金合同生效日)至2010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,并出具了普华永道中天审字(2011)第21489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:建信全球机遇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
资产:			
银行存款		42,390,401.01	-
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		484,610,982.68	-
其中:股票投资		453,289,110.63	-
基金投资		31,321,872.05	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		28,200,162.30	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		20,444.10	-
应收股利		237,971.56	-
应收申购款		23,628.26	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		6,186.40	-
资产总计		555,489,776.31	-
负债和所有者权益		本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
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		5,608,919.20	-
应付管理人报酬		856,154.39	-
应付托管费		166,474.47	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,652.08	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		253,178.35	-
负债合计		6,886,378.49	-
所有者权益:			
实收基金		557,627,789.53	-
未分配利润		-9,024,391.71	-
所有者权益合计		548,603,397.82	-
负债和所有者权益总计		555,489,776.31	-

1、报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.984元,基金份额总额557,627,789.53份。

2、本基金基金合同自2010年9月14日起生效,至本报告截止日2010年12月31日未满一年。

3、股票投资所列金额中包括存托凭证。

7.2 利润表

会计主体:建信全球机遇股票型证券投资基金

本报告期:2010年9月14日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2010年9月14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
一、收入		-3,774,717.02	-
1.利息收入		1,766,498.71	-
其中:存款利息收入		190,222.88	-
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		1,576,275.83	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-7,457,968.85	-
其中:股票投资收益		-8,125,942.25	-
基金投资收益		-464,978.34	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		201,965.76	-
股利收益		930,985.98	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		2,240,082.28	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-480,431.12	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		157,101.96	-
减:二、费用		5,565,133.74	-
1.管理人报酬		3,327,264.11	-
2.托管费		646,968.09	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,357,270.57	-
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		233,630.97	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-9,339,850.76	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列		-9,339,850.76	-

注:本基金基金合同自2010年9月14日起生效,至本报告截止日2010年12月31日未满一年。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信全球机遇股票型证券投资基金

本报告期:2010年9月14日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年9月14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)	681,944,805.65	-	681,944,805.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,339,850.76	-9,339,850.76
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)	-124,317,016.12	315,459.05	-124,001,557.07
其中:1.基金申购款	1,680,746.14	-7,538.72	1,673,207.42
2.基金赎回款	-125,997,762.26	322,997.77	-125,674,764.49
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)	557,627,789.53	-9,024,391.71	548,603,397.82
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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持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)	-	-	-

注:本基金基金合同自2010年9月14日起生效,至本报告截止日2010年12月31日未满一年。

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码(序号)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

建信全球机遇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[2010]第982号《关于核准建信全球机遇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《建信全球机遇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2010年8月11日起至2010年9月10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681,859,858.00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(2010)第232号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》于2010年9月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为681,944,805.65份基金份额,其中认购资金利息折合84,947.65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《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为全球证券市场中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的其他金融工具。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、货币市场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及其他权益类证券市值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%。本基金的业绩比较基准为标准普尔全球BMI市场指数总收益率(S&P Global BMI)×70% + 标准普尔BMI中国(除A、B股)指数总收益率(S&P BMI China ex-A-B-Shares)×30%。

根据《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资组合应在基金成立6个月内达到基金合同规定的比例限制。截至2010年12月31日止,本基金尚处于建仓期。

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》、《建信全球机遇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2010年9月14日(基金合同生效日)至2010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2010年12月31日的财务状况以及2010年9月14日(基金合同生效日)至2010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2010年9月14日(基金合同生效日)至2010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也可按直线法计算。

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 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

本基金本报告期内未发生会计政策的变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生会计估计的变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错。

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[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 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
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。

7.4.8 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 2010年9月14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
当期发生的基金应支付的管理费	3,327,264.11	-
其中:支付销售机构的客户维护费	1,615,393.28	-

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2010年9月14日起生效,至本报告截止日2010年12月31日未满一年。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年9月14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
当期发生的基金应支付的托管费	646,968.09	-

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2010年9月14日起生效,至本报告截止日2010年12月31日未满一年。

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

本基金本报告期未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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。

7.4.8.5 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9月14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	9,389,972.68	129,848.21	-	-
布朗兄弟哈里曼银行	33,000,428.33	3,244.03	-	-

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2010年9月14日起生效,至本报告截止日2010年12月31日未满一年。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未通过关联方购买其承销的证券。

7.4.8.7 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。

7.4.9 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

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。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 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

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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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484,610,982.68元,无属于第二层级和第三层级的余额。于本期内,本基金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。

(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	453,289,110.63	81.60
	其中:股票	427,267,118.77	76.92
	存托凭证	26,021,991.86	4.68
2	基金投资	31,321,872.05	5.64
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	28,200,162.30	5.08
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	42,390,401.01	7.63
6	其他各项资产	288,230.32	0.05
7	合计	555,489,776.31	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(%)
中国香港	214,176,995.82	39.04
美国	124,125,634.75	22.63
日本	26,697,664.20	4.87
英国	22,459,043.77	4.09
加拿大	15,299,350.30	2.79
德国	12,972,370.75	2.36
法国	11,910,280.44	2.17
澳大利亚	7,445,710.87	1.36
瑞士	6,968,823.66	1.27
瑞典	4,623,526.32	0.84
意大利	3,674,124.63	0.67
荷兰	2,935,585.12	0.54
合计	453,289,110.63	82.63

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	98,724,439.60	18.00
信息技术	61,995,978.26	11.30
能源	56,380,586.81	10.28
非必需消费品	53,989,350.32	9.84
工业	51,870,392.74	9.45
材料	36,010,225.85	6.56
电信服务	30,196,245.68	5.50
必需消费品	28,948,771.02	5.28
保健	22,765,963.88	4.15
公用事业	12,407,156.47	2.26
合计	453,289,110.63	82.63

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前十名权益投资明细

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	CHINA MOBILE LTD	中国移动	HK0941009539	香港证券交易所	中国香港	265,000	17,408,325.91	3.17
2	CNOOC LTD	中国海洋石油	HK0883013259	香港证券交易所	中国香港	1,094,000	17,166,117.20	3.13
3	BANK OF CHINA LTD	中国银行	CNE1000001Z5	香港证券交易所	中国香港	3,813,300	13,303,890.59	2.43
4	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	中国人寿保险	CNE1000002L3	香港证券交易所	中国香港	359,000	9,699,112.85	1.77
5	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	KYG875721485	香港证券交易所	中国香港	60,200	8,652,069.02	1.58
6	PING AN INSURANCE GROUP CO OF	中国平安	CNE1000003X6	香港证券交易所	中国香港	105,500	7,801,283.68	1.42
7	PETROCHINA CO LTD	中国石油天然气	CNE1000003W8	香港证券交易所	中国香港	818,000	7,071,977.10	1.29
8	CHINA OILFIELD SERVICES LTD	中海油服	CNE1000002P4	香港证券交易所	中国香港	448,000	6,419,688.21	1.17
9	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	农业银行	CNE100000Q43	香港证券交易所	中国香港	1,643,000	5,452,504.14	0.99
10	AAC ACOUSTIC TECHNOLOGIES HOLD	瑞声声学	KYG2953L1095	香港证券交易所	中国香港	290,000	5,120,471.27	0.93

注:1、所用证券代码采用ISIN代码。

2、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的年度报告正文。

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	CNOOC LTD	HK0883013259	19,395,419.85	3.54
2	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	18,208,555.89	3.32
3	BANK OF CHINA LTD	CNE1000001Z5	14,998,742.96	2.73
4	BAIDU INC/CHINA	US0567521085	13,059,101.35	2.38
5	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	CNE1000002L3	12,013,568.47	2.19
6	TENCENT HOLDINGS LTD	KYG875721485	10,817,334.06	1.97
7	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	CNE1000003X6	9,293,060.88	1.69
8	YANZHOU COAL MINING CO LTD	CNE1000004Q8	8,901,542.16	1.62
9	PETROCHINA CO LTD	CNE1000003W8	8,287,613.60	1.51
10	LENOVO GROUP LTD	HK0992009065	7,077,353.45	1.29
11	AAC ACOUSTIC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	KYG2953L1095	6,229,263.84	1.14
12	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	CNE1000002Q2	5,997,007.60	1.09
13	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	CNE100000Q43	5,960,882.74	1.09
14	CHINA OILFIELD SERVICES LTD	CNE1000002P4	5,519,975.71	1.01
15	EXXON MOBIL CORP	US30231G1022	5,456,650.66	0.99
16	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	KYG9361V1086	5,231,395.63	0.95
17	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	CNE1000002M1	5,206,112.13	0.95
18	CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	CNE1000002R0	5,140,821.34	0.94
19	SOHO CHINA LTD	KYG826001003	4,781,408.23	0.87
20	BASF SE	DE000BASF111	4,712,620.03	0.86

注: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。

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	BAIDU INC/CHINA	US0567521085	7,644,324.36	1.39
2	YANZHOU COAL MINING CO LTD	CNE1000004Q8	4,623,183.79	0.84
3	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	CNE1000002Q2	4,554,321.39	0.83
4	CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	CNE1000002R0	4,517,814.21	0.82
5	CNOOC LTD	HK0883013259	3,946,296.60	0.72
6	BBMG CORP	CNE100000F20	3,597,738.51	0.66
7	GREAT WALL MOTOR CO LTD	CNE100000338	3,248,091.44	0.59
8	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	KYG9361V1086	3,223,317.65	0.59
9	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	KYG982771092	2,992,856.63	0.55
10	MAANSHAN IRON & STEEL	CNE1000003R8	2,778,676.44	0.51
11	CHINA TELECOM CORP LTD	CNE1000002V2	2,725,711.81	0.50
12	HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	BMG423131256	2,653,751.16	0.48
13	SHANDONG CHENMING PAPER HOLDINGS LTD	CNE100000BK2	2,573,904.05	0.47
14	LENOVO GROUP LTD	HK0992009065	2,533,696.26	0.46
15	SOHO CHINA LTD	KYG826001003	2,417,353.32	0.44
16	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	KYG810431042	2,394,302.62	0.44
17	LIANHUA SUPERMARKET HOLDINGS CO LTD	CNE1000003P2	2,390,908.29	0.44
18	HARBIN POWER EQUIPMENT CO LTD	CNE1000003C0	2,346,113.06	0.43
19	BASF SE	DE000BASF111	2,294,745.93	0.42
20	LORILLARD INC	US5441471019	2,286,578.60	0.42

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

金额单位:人民币元

买入成本(成交)总额	657,911,758.42
卖出收入(成交)总额	198,252,614.42

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。

8.9 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 S&P 500 INDEX FUND	ETF基金	交易型开放式指数	BlackRock Fund Advisors	12,541,737.92	2.29
2	ISHARES MSCI WORLD	ETF基金	交易型开放式指数	BLACKROCK ASSET MANAGEMENT IRELAND LTD/IRELAND	11,080,412.24	2.02
3	SPDR S&P 500 ETF TRUST	ETF基金	交易型开放式指数	SSGA FUNDS MANAGEMENT INC	4,998,019.15	0.91
4	HANG SENG H-SHARE ETF	ETF基金	交易型开放式指数	HANG SENG INVESTMENT MANAGEMENT LTD	2,701,702.74	0.49
5	-	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

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	237,971.56
4	应收利息	20,444.10
5	应收申购款	23,628.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	6,186.40
9	合计	288,230.32

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
24,322	22,926.89	4,896,739.61	0.88%	552,731,049.92	99.12%

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	4,926.16	0.00%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2010年9月14日)基金份额总额	681,944,805.65
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,680,746.14
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	125,997,762.26
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	557,627,789.53

注:本基金基金合同自2010年9月14日起生效,至本报告截止日2010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	
MORGAN STANLEY	-	157,199,280.48	18.37%	144,126.10	19.26%	-
CITIGROUP	-	141,551,084.46	16.54%	91,613.72	12.24%	-
UBS	-	137,103,363.18	16.03%	73,212.12	9.78%	-
CREDIT SUISSE FIRST BOSTON	-	100,265,937.00	11.72%	76,872.65	10.27%	-
MERRILL LYNCH	-	88,862,392.45	10.39%	63,356.83	8.47%	-
J.P. MORGAN SECURITIES	-	42,795,933.84	5.00%	47,121.64	6.30%	-
BANK OF NEW YORK	-	37,807,230.92	4.42%	25,114.47	3.36%	-
MACQUARIE	-	29,766,400.64	3.48%	15,013.30	2.01%	-
ABN AMRO SECURITIES	-	26,474,188.19	3.09%	52,948.37	7.08%	-
INSTINET	-	25,541,580.91	2.99%	20,328.02	2.72%	-
CREDIT LYONNAIS SEC. INC ASIA	-	11,887,893.38	1.39%	49,641.54	6.63%	-
DEUTSCHE BANK	-	11,691,640.99	1.37%	6,015.27	0.80%	-
HSBC	-	11,102,870.05	1.30%	21,137.17	2.83%	-
ITG	-	7,562,338.74	0.88%	8,438.20	1.13%	-
GOLDMAN SACHS	-	6,346,124.52	0.74%	20,226.28	2.70%	-
BARCLAYS CAPITAL INC.	-	3,564,325.09	0.42%	7,128.65	0.95%	-
MIZUHO	-	3,224,586.86	0.38%	4,836.66	0.65%	-
RBC CAPITAL MARKETS -ALGO	-	2,295,819.09	0.27%	1,021.14	0.14%	-
ICHIYOSHI	-	2,008,395.29	0.23%	3,012.45	0.40%	-
PIPER JAFFRAY PROGRAMS	-	1,683,574.03	0.20%	600.86	0.08%	-
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.	-	1,664,249.67	0.19%	8,381.53	1.12%	-
MITSUBISHI SECURITIES	-	1,164,976.33	0.14%	1,747.26	0.23%	-
FIDELITY	-	1,146,286.34	0.13%	559.00	0.07%	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC.	-	1,047,078.30	0.12%	1,594.58	0.21%	-
SCOTIA CAPITAL MARKETS INC.	-	905,314.50	0.11%	2,099.28	0.28%	-
NBF SECURITIES CORP	-	892,640.22	0.10%	2,070.54	0.28%	-
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
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	13,800,791.78	23.43%
CITIGROUP	-	-	-	-	-	-	4,996,882.05	8.48%
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	7,302,052.95	12.40%
J.P. MORGAN SECURITIES	-	-	-	-	-	-	11,149,519.79	18.93%
CREDIT LYONNAIS SEC. INC ASIA	-	-	-	-	-	-	12,932,871.55	21.96%
ITG	-	-	-	-	-	-	5,995,245.49	10.18%
DAIWA SECURITIES AMERICA INC.	-	-	-	-	-	-	2,726,895.47	4.63%
海通证券	-	-	9,892,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

建信基金管理有限责任公司
二〇一一年三月二十八日