基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2014年3月27日

# 建信全球资源股票型证券投资基金

## 2013 年度 报告摘要

2013年12月31日

### §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计,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。

本报告期自2013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 | 建信全球资源股票(QDII) |
| 基金主代码 | 539003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年6月26日 |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 12,939,360.18份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 通过全球化的资产配置和组合管理,优选资源类相关行业的股票进行投资,在控制风险的同时,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 | 50%×MSCI全球能源行业净总收益指数收益率 (MSCI ACWI Energy Net Total Return Index )+50%×MSCI全球原材料行业净总收益指数收益率 (MSCI ACWI Material Net Total Return Index )。 |
| 风险收益特征 | 本基金是主动管理的全球配置型股票基金,其风险和预期收益高于债券型基金和混合型基金,本基金主要投资方向为资源类相关行业,属于具有较高风险和较高预期收益的证券投资基金品种。 |

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 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 路彩营 | 唐州徽 |
| | 联系电话 | 010-66228888 | 95566 |
| | 电子邮箱 | xinxipilu@ccbfund.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-81-95533 010-66228000 | 95566 |
| 传真 | | 010-66228001 | 010-66594942 |

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. | Deutsche Bank AG, Singapore Branch |
| | 中文 | 信安环球投资有限公司 | 德意志银行新加坡分行 |
| 注册地址 | | 801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490 | One Raffles Quay, Level 17, South Tower, Singapore |
| 办公地址 | | 801 Grand Avenue, Des Moines, IA 50392-0490 | One Raffles Quay, #16-00, South Tower, Singapore |
| 邮政编码 | | IA 50392-0490 | 048583 |

2.5 信息披露方式

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

### §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 | 2013年 | 2012年6月26日(基金合同生效日)-2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 50,617.79 | 67,443.03 |
| 本期利润 | 498,464.28 | 1,069,555.00 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0163 | 0.0126 |
| 本期基金份额净值增长率 | 4.70% | 1.60% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2013年末 | 2012年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0016 | -0.0109 |
| 期末基金资产净值 | 13,337,217.22 | 34,474,078.47 |
| 期末基金份额净值 | 1.031 | 1.016 |

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2012年6月26日生效,合同生效当期未满一年。

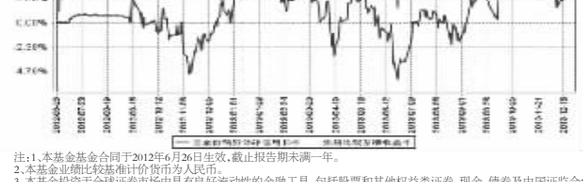
3.2 基金净值表现

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 | 4.70% | 0.74% | 3.60% | 0.62% | 1.10% | 0.12% |
| 过去六个月 | 10.57% | 0.70% | 13.38% | 0.64% | -2.81% | 0.06% |
| 过去一年 | 4.70% | 0.78% | 3.26% | 0.78% | 1.44% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.37% | 0.71% | 16.91% | 0.87% | -10.54% | -0.16% |

注:本基金的业绩比较基准为:50%×MSCI全球能源行业净总收益指数收益率(MSCI ACWI Energy Net Total Return Index )+50%×MSCI全球原材料行业净总收益指数收益率 (MSCI ACWI Material Net Total Return Index )。MSCI是全球领先的指数公司,具有超过40年的计算编制国际股票指数的丰富经验。MSCI全球指数系列自编制以来,已经成为国际大型机构投资者及各种媒体广泛使用的业绩比较基准。MSCI全球能源行业净总收益指数和MSCI全球原材料行业净总收益指数是MSCI全球指数系列中的两个行业指数。MSCI全球指数系列的编制方法遵循客观、规则为本和自由流通市值加权的原则,从而使该指数系列能够捕捉到更为广泛的投资机会,指数的维护和调整公开透明,满足了投资者在使用该指数系列时的不同需求;MSCI全球指数系列具有全面期实的历史数据,包括指数层面数据、成份股层面数据和各种估值数据,为分析研究全球市场提供了有力支持;MSCI全球指数系列能及时反映公司事件和市场变化,每年4次的指数审核及每日的公司事件审议保证了指数及时准确反映市场变化。

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




注:1.本基金基金合同于2012年6月26日生效,截止报告期末满一年。

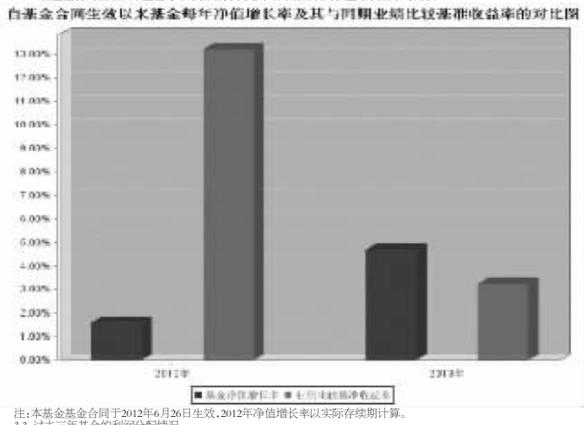
2.本基金业绩比较基准计价货币为人民币。

3.本基金投资于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普通股、优先股、存托凭证、公募股票型基金等;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,以及中国证监会认可的金融衍生产品等。

本基金为股票型基金,投资于股票的比例不低于基金资产的60%,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%,股票资产中投资于资源类相关行业的比例不低于80%。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

4.本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

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




注:本基金基金合同于2012年6月26日生效,2012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

单位:人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2013 | 0.320 | 412,287.68 | 23,983.69 | 436,271.37 | |
| 合计 | 0.320 | 412,287.68 | 23,983.69 | 436,271.37 | |

### §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,并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来,公司秉持“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、持续领先的综合性、专业化资产管理公司”。

截至2013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、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、建信深证100指数增强型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信全球资源股票型证券投资基金、建信社会责任股票型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信优势动力股票型证券投资基金(LOF)、建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信创新中国股票型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金37只开放式基金和建信信用增强债券型证券投资基金1只封闭式基金,管理的基金资产规模共计为730.45亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 赵英楷 | 海外投资部总监、本基金的基金经理 | 2012年6月26日 | - | 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、总监。2011年4月2013起任建信全球机遇股票基金基金经理,2011年6月21日起任建信新兴市场股票基金基金经理,2012年6月26日起任建信全球资源股票型证券投资基金基金经理。 |
| 李博涵 | 本基金的基金经理 | 2013年8月5日 | - | 8 | 李博涵先生,硕士,加拿大籍华人,曾就职于美国联邦快递北京分公司、美国联合航空公司北京分公司和美国万事达卡国际组织北京分公司。2005年2月起加入加拿大蒙特利尔银行,任全球资本市场投资助理;2006年8月起加入加拿大帝国商业银行,任全球资本市场投资顾问;2008年8月加入我公司海外投资部,任高级研究员兼基金经理助理。2013年8月5日起任建信全球资源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位 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|
| Christopher Ilbach | 投资组合经理 | 19 | Christopher Ilbach负责监督支持所有股票策略的全球研究&发展,包括全球量化研究、股票选择模型发展、投资组合构建和风险管理。他作为共同基金经理,专精于主动核心、机会型的和专业全球组合。Chris也监督公司的系统策略团队,负责被动增强和被动股票组合。他在2000年作为股票研究分析师加入公司,专精于分析国际不同行业公司并在2002年成为基金经理。在此之前,Chris在Motorola, Inc取得了6年的相关行业经验。Chris从University of Iowa获得了金融学MBA学位和电子工程学士学位。Chris获得了使用特许金融分析师称号的权利并且是CFA Institute的成员。 |
| Mustafa Sagun | 首席投资官 | 22 | Mustafa Sagun是信安环球股票的首席投资官,他负责监督所有国际、国内和全球股票策略的投资组合管理和研究。Mustafa在2000年加入公司。他从2002年开始就担任全球股票组合的主管基金经理,而在2006年开始担任首席投资官。他之前也担任公司资产配置策略团队的成员。Mustafa的职业生涯开始于1991年,曾担任过投资管理、研究和风险管理的职位。在加入信安之前,他是PNC金融服务集团的副总裁和分析师和Salomon Brothers的股票衍生品专家。Mustafa从University of South Florida取得金融学Ph.D.学位和国际经济学MA学位。他从土耳其的Bogazici University取得电子和工程的学士学位。Mustafa获得了使用特许金融分析师称号的权利,他是CFA Institute和CFA Society of Iowa的成员。 |
| 李晓西 | 投资组合经理 | 14 | 李晓西是信安环球股票定量研究部总经理,负责所有股票策略的量化研究。他的研究职责包括为公司专属的全球研究平台(GRP)股票选择模型,投资组合构建和风险管理进行全球股票量化研究并实施模型开发。他也担任全球核心、全球全部国家、全球机遇、全球价值&收入和其它专门的全球基金的基金经理。晓西在2006年加入公司,此前,晓西是Hantang Securities Co., Ltd., Beijing的高级经理,他的经历还包括Yinjian Industrial Co., Ltd., Beijing的投资组合经理。他从杜克大学获得MBA学位,从北京工商大学获得会计学硕士学位并从对外经济贸易大学会计学专业毕业。晓西是金融风险管理师持证人和Global Association of Risk Professionals成员。他获得了使用特许金融分析师称号的权利并且是CFA Institute的成员。 |

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行,报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人对过去四个季度不同时间窗口下(日内、3日内、5日内)管理的不同投资组合(包括封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合等)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)、平均溢价率、贡献率、正溢价率占优频率等几个方面进行了专项分析。具体分析结果如下:

当时间窗为1日时,配了1984对投资组合,有496对投资组合未通过T检验,其中190对投资组合的正溢价率占优频率小于55%,其它306对正溢价率占优频率大于55%的投资组合中,有29对投资组合的平均溢价率超过2%,但其组合贡献率低于5%,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为3日时,配了2484对投资组合,有558对投资组合未通过T检验,其中78对投资组合的溢价率占优频率小于55%,其它480对正溢价率占优频率大于55%的投资组合,有9对投资组合的平均溢价率超过5%,但其组合贡献率低于5%,因此未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为;

当时间窗为5日时,配了2548对投资组合,有673对投资组合未通过T检验,其中92对投资组合的溢价率占优频率小于55%,其它581对正溢价率占优频率大于55%的投资组合,有1对投资组合的平均溢价率超过10%,但其组合贡献率低于5%,同样未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

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

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年全球资源市场温和上涨,其中石油板块上涨幅度较大,原材料板块涨幅有所滞后。总结全年,成熟市场国家的经济基本面,美国QE退出和中国经济是全球资源市场的主要推动因素。2013年主要成熟市场国家经济表现较好,美国继续稳健复苏,欧洲经济在年中触底回升,目前其弱复苏趋势基本形成。成熟市场国家较好的经济状况对资源市场起到了较好的支持作用,一是经济复苏有利于全球对原材料的需求增长,二是成熟市场的牛市推高了投资人的风险偏好,进而在13年下半年推高了资源类商品的现货价格和相关股票的市场价格。在第二、第三季度,中国的经济数据也开始走弱,13年6月底还出现了短暂的“钱荒”,再加上对美国QE退出预期的不确定性叠加,全球资源相关的股票市场经历了一定幅度的震荡。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率4.70%,波动率0.78%,业绩比较基准收益率3.26%,波动率0.78%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们认为全球资源市场可能继续震荡上行。我们认为当前全球经济基本面较好;经济温和增长,成熟市场主要经济体通胀可控。另外由于流动性相对宽松,估值处于历史中值附近,成熟市场赢利有进一步提高的可能,所以市场仍然处于相对宽松的环境。我们相对看好能源板块,认为石油的未来供需平衡仍然比较紧张,虽然美国不断增产,但成熟市场的经济复苏将增加石油的需求;石油的地缘政治属性较强,不排除未来某些局部冲突带来的短期石油价格上涨;另外美国页岩气的开采公司也为市场提供了许多投资机会。原材料方面我们对铁矿石相关板块相对谨慎,尽管中国经济“软着陆”成为市场的主流观点,经济增速依然保持7%以上的增速,但目前中国面临经济转型,中国是全球铁矿石最大的进口国,钢铁行业严重产能过剩,并且产生较大的环境污染问题,未来中国铁矿石需求的增长很可能将放缓,而全球主要铁石的生产商将在2014年扩大产能,可能带来铁矿石的供给过剩。我们认为市场的主要风险来自全球经济基本面的波动以及中国未来的经济走势。我们认为欧洲经济的复苏可能比较缓慢,经济数据的起伏将带来市场的波动,中国当前较高的社会资金成本也值得关注,持续的高利率环境可能对经济增长产生负面作用,同时也会影响原材料冶炼和库存的经营决定,对市场价格产生压力。我们预期美国QE将于14年下半年全部退出,市场对流动性降低的预期也将成为市场的扰动因素。综上所述,我们对能源和大宗商品市场保持谨慎乐观,我们将在仓位、行业配置、选股等方面认真把握,力争为投资人带来超额收益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策;对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督;对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、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监控可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件,发现估值问题;提议基金估值调整的相关方案并进行校验;根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案,报基金估值委员会审议批准。

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规及本基金基金合同中关于收益分配相关条款的规定,本报告期内实施了1次收益分配,于2013年11月12日向基金份额持有人每10份基金份额分配0.32元,收益分配基准日为2013年10月28日,共发放红利人民币436,271.37元(包含现金和红利再投资形式),达到基金合同约定的利润分配要求。

### §5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对建信全球资源股票型证券投资基金证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### §6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了后附的建信全球资源股票型证券投资基金(以下简称“建信全球资源股票基金”)的财务报表,包括2013年12月31日的资产负债表、2013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(2014)第20104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:建信全球资源股票型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2013年12月31日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | | 1,206,122.39 | 9,384,998.30 |
| 结算备付金 | | - | 72,727.27 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | | 12,629,312.66 | 29,168,119.18 |
| 其中:股票投资 | | 12,055,800.45 | 29,168,119.18 |
| 基金投资 | | 573,512.21 | - |
| 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 | | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | | 56.08 | 420.85 |
| 应收股利 | | 18,767.83 | 36,909.91 |
| 应收申购款 | | 13,189.34 | 66,642.37 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 13,867,448.30 | 38,729,817.88 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2013年12月31日 | 上年度末 2012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 | | 189,486.49 | 3,950,526.55 |
| 应付管理人报酬 | | 20,904.90 | 62,774.88 |
| 应付托管费 | | 4,064.84 | 12,206.27 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 315,774.85 | 230,231.71 |
| 负债合计 | | 530,231.08 | 4,255,739.41 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 12,939,360.18 | 33,927,937.71 |
| 未分配利润 | | 397,857.04 | 546,140.76 |
| 所有者权益合计 | | 13,337,217.22 | 34,474,078.47 |
| 负债和所有者权益总计 | | 13,867,448.30 | 38,729,817.88 |

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.031元,基金份额总额12,939,360.18份。

7.2 利润表

会计主体:建信全球资源股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间 2012年6月26日(基金合同生效日)至2012年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 1,647,623.48 | 2,233,443.38 |
| 1.利息收入 | | 22,528.88 | 1,027,335.60 |
| 其中:存款利息收入 | | 22,528.88 | 102,664.25 |
| 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 | | - | 924,671.35 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 1,344,221.43 | -343,222.30 |
| 其中:股票投资收益 | | 759,573.89 | -573,589.78 |
| 基金投资收益 | | -95,443.94 | 4,512.74 |
| 债券投资收益 | | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 680,091.48 | 225,854.74 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | | 447,846.49 | 1,002,111.97 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | | -247,021.82 | -95,990.49 |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | | 80,048.50 | 643,208.60 |
| 减:二、费用 | | 1,149,159.20 | 1,163,888.38 |
| 1.管理人报酬 | | 559,815.74 | 751,439.72 |
| 2.托管费 | | 108,853.09 | 146,113.36 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | | 117,708.19 | 42,678.21 |
| 5.利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.其他费用 | | 362,782.18 | 223,657.09 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 498,464.28 | 1,069,555.00 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 498,464.28 | 1,069,555.00 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:建信全球资源股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013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) | 33,927,937.71 | 546,140.76 | 34,474,078.47 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 498,464.28 | 498,464.28 |
| 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) | -20,988,577.53 | -210,476.63 | -21,199,054.16 |
| 其中:1.基金申购款 | 41,069,749.37 | 985,298.53 | 42,055,047.90 |
| 2.基金赎回款 | -62,058,326.90 | -1,195,775.16 | -63,254,102.06 |
| 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) | - | -436,271.37 | -436,271.37 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 12,939,360.18 | 397,857.04 | 13,337,217.22 |
| 项目 | 上年度可比期间 2012年6月26日(基金合同生效日)至2012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) | 498,237,044.50 | - | 498,237,044.50 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 1,069,555.00 | 1,069,555.00 |
| 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) | -464,309,106.79 | -523,414.24 | -464,832,521.03 |
| 其中:1.基金申购款 | 49,487,247.28 | 245,335.91 | 49,732,583.19 |
| 2.基金赎回款 | -513,796,354.07 | -768,750.15 | -514,565,104.22 |
| 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) | 33,927,937.71 | 546,140.76 | 34,474,078.47 |

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:

孙志毅 何斌 秦绪华

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信全球资源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[2012]第322号《关于核准建信全球资源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《建信全球资源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498,213,122.75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(2012)第211号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《建信全球资源股票型证券投资基金基金合同》于2012年6月26日正式生效,基金合同生效的基金份额总额为498,237,044.50份基金份额,其中认购资金利息折合23,921.75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,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外资产托管人为摩根大通银行香港分行(JPMorgan Chase Bank, National Association, Hong Kong Branch),境外投资顾问为信安环球投资有限公司(Principal Global Investors, LLC.)。根据建信基金于2012年10月17日发布的公告及中国银行股份有限公司托管及投资者服务部《关于变更建信全球资源股票型基金境外托管人的函》(中银托(函)[2012]81号),中国银行股份有限公司决定自2012年10月15日起将本基金的境外托管人由摩根大通银行香港分行 (JPMorgan Chase Bank, National Association, Hong Kong Branch)变更为德意志银行新加坡分行(Deutsche Bank AG, Singapore Branch)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信全球资源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普通股、优先股、存托凭证、公募股票型基金等;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,以及中国证监会认可的金融衍生产品等。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%,股票资产中投资于资源类相关行业的比例不低于80%。本基金的业绩比较基准为50%×MSCI全球能源行业净总收益指数收益率(MSCI ACWI Energy Net Total Return Index)+50%×MSCI全球原材料行业净总收益指数收益率(MSCI ACWI Material Net Total Return Index)。

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2014年3月25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”),中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信全球资源股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监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

本基金2013年度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2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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的说明

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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关