

中银收益混合型证券投资基金 2012 年年度报告摘要

2012 年 12 月 31 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年三月三十日

§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 2013 年 3 月 26 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。

本报告期自 2012 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	中银收益混合
基金主代码	163804
交易代码	163804
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 10 月 11 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,164,242,838.70 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在长期投资的基础上，将战略资产配置与择时相结合，通过投资于中国证券市场现金股息率高、分红稳定的上市公司和国内依法公开发行的各类债券，致力于为投资者提供稳定的当期收益和长期的资本增值。
投资策略	本基金采取自上而下的资产配置与自下而上相结合的主动投资管理策略，股票投资将运用量化的数量模型、严谨的财务、企业竞争力和治理能力分析以及价值评估，并配合持续深入的跟踪调研，精选兼具良好财务品质、稳定分红能力、高股息和持续盈利增长潜力的上市公司股票；债券投资将分析判断债券市场的走势，采取不同的收益率曲线策略、积极的久期管理、信用风险评估、收益率利差配置策略等投资策略，力求获取高于业绩基准的投资回报。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准为富时中国 A 股红利 150 指数；债券投资部分的业绩比较基准为中信标普国债指数。 本基金的整体业绩基准 = 富时中国 A 股红利 150 指数 × 60% + 中信标普国债指数 × 30% + 同业存款利率 × 10%
风险收益特征	本基金是主动型的混合基金，由于投资对象将包括上市公司证券及其它有价债券，因此本基金属于证券投资基金中等风险的品种。

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		中银基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	程明	赵会军
	联系电话	021-38834999	010-66105799
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95588
传真		021-68873488	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的基金管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金年度报告备置地点	上海市银城中路200号中银大厦45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	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-46,220,945.53	43,622,186.09	533,277,710.76
本期利润	409,764,071.97	-742,181,900.66	464,457,968.68
加权平均基金份额本期利润	0.1287	-0.2242	0.1083
本期基金份额净值增长率	16.02%	-22.06%	12.37%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0672	-0.1960	0.0421
期末基金资产净值	2,951,509,790.05	2,571,159,146.43	3,755,081,899.93
期末基金份额净值	0.9328	0.8040	1.0421

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配收益，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期未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未未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

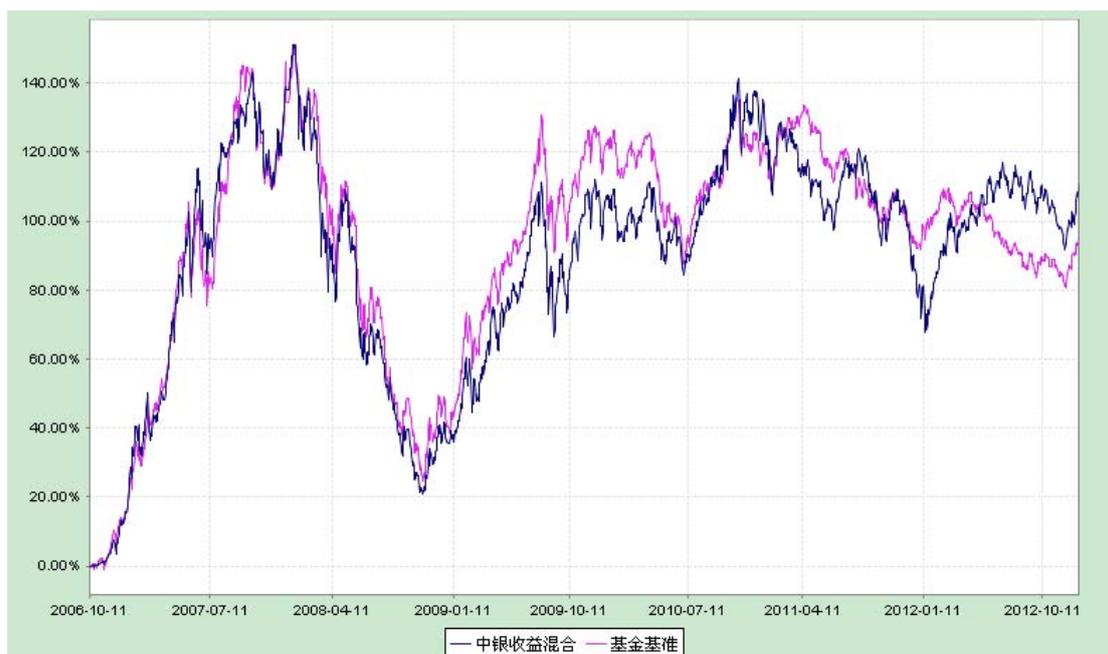
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.71%	0.74%	3.87%	0.60%	-2.16%	0.14%
过去六个月	0.32%	0.81%	-0.69%	0.62%	1.01%	0.19%
过去一年	16.02%	0.99%	0.29%	0.65%	15.73%	0.34%
过去三年	1.61%	1.06%	-12.79%	0.78%	14.40%	0.28%
过去五年	-11.67%	1.40%	-16.99%	1.23%	5.32%	0.17%
自基金合同	110.44%	1.45%	95.33%	1.29%	15.11%	0.16%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

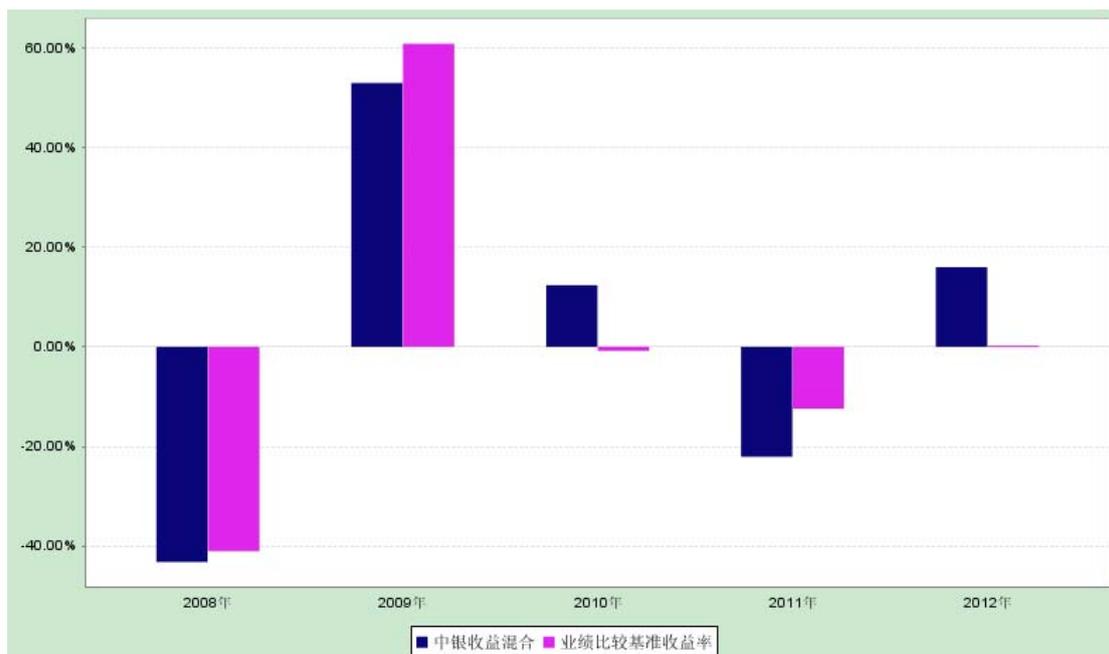
中银收益混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2006 年 10 月 11 日至 2012 年 12 月 31 日)



按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分（二）的规定，即本基金投资组合中股票资产投资比例为 30-90%，债券资产比例为 0-65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券类资产比例最低不低于 5%。

3.2.3 过去五年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

中银收益混合型证券投资基金
 过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：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
2012	-	-	-	-	-
2011	0.100	17,786,472.91	18,526,125.10	36,312,598.01	-
2010	0.100	18,768,625.26	18,659,253.64	37,427,878.90	-
合计	0.200	36,555,098.17	37,185,378.74	73,740,476.91	-

§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

银基金管理有限公司前身为中银国际基金管理有限公司，于2004年8月12日正式成立，由中银国际和美林投资管理合资组建（2006年9月29日美林投资管理有限公司与贝莱德投资管理有限公司合并，合并后新公司名称为“贝莱德投资管理有限公司”）。2007年12月25日，经中国证券监督管理委员会批复，同意中国银行股份有限公司直接控股中银基金。公司注册地为中国上海市，注册资本为一亿元人民币，其中中国银行拥有83.5%的股权，贝莱德投资管理拥有16.5%的股权。截至2012年12月31日，本管理人共管理二十三只开放式证券投资基金：中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长股票型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金、中银动态策略股票型证券投资

资基金、中银稳健增利债券型证券投资基金、中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金、中银中证 100 指数增强型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、中银全球策略证券投资基金 (FOF)、上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、中银中小盘成长股票型证券投资基金、中银信用增利债券型证券投资基金、中银沪深 300 等权重指数证券投资基金 (LOF)、中银主题策略股票型证券投资基金、中银保本混合型证券投资基金、中银理财 14 天债券型证券投资基金、中银理财 60 天债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金及中银理财 7 天债券型证券投资基金，同时管理着多个特定客户资产管理投资组合。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈军	本基金的基金经理、中银中证 100 指数增强基金基金经理	2006-10-11	-	14	中银基金管理有限公司副总裁 (VP)，金融学硕士。曾任中信证券股份有限公司资产管理部项目经理。2004 年加入中银基金管理有限公司，2006 年 10 月至今任中银收益基金基金经理，2009 年 9 月至今任中银中证 100 指数基金基金经理。特许金融分析师 (CFA)，香港财经分析师学会会员。具有 14 年证券从业年限。具备基金从业资格。
甘霖	本基金的基金经理、中银蓝筹基金基金经理、中银主题策略基金基金经理、公司权益投资部副总经理	2007-08-22	-	18	中银基金管理有限公司权益投资部副总经理，副总裁 (VP)，工商管理硕士。曾任武汉证券公司交易部经理。2004 年加入中银基金管理有限公司，2007 年 8 月至今任中银收益基金基金经理，2010 年 2 月至今任中银蓝筹基金基金经理，2012 年 7 月至今任中银主题策略基金基金经理。具有 18 年证券从业年限。具备基金从业资格。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理制度》，建立了《投资研究管理制度》及细则、《新股询价申购和参与公开增发管理制度》、《债券询价申购管理制度》、《集中交易管理制度》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

本报告期内，本公司通过对公司管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，并对连续四个季度的不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1. 宏观经济分析

刚刚过去的 2012 年，是国内外经济从危机中艰难突围的一年。欧债危机系统性风险在年中达到顶峰后缓和，美国“财政悬崖”在年底化为“缓坡”。在欧美财政政策被迫紧缩的情况下，全球各主要货币当局持续放松货币政策以支撑经济摆脱困局。欧元区经济衰退趋缓，美国经济继续艰难复苏，新兴经济体经济逐步筑底。

从国内的经济情况来看，在“稳中求进”的经济工作重点下，积极的财政政策与愈发稳健的货币政策贯穿全年，经济增速与通胀水平在下半年缓慢筑底。具体来看，第一季度，季节性因素及小库存周期支撑经济显现出了“假复苏”的迹象，GDP 与工业增加值同比增速分别维持于 8.1% 及 12% 附近平台，制造业 PMI 指数更是持续回升至 53.0% 之上水平。第二季度，在需求未明显恢复、企业库存未明显下降的情况下，经济出现超预期下滑，GDP 与工业增加值同比增速分别降至 7.6% 及略高于 9.0% 水平；“稳增长”政策出台，货币政策进一步下调存款利率及存款准备金率，财政政策支撑基建投资增速见底，房地产销量开始明显增长。第三季度，货币政策进一步放松的空间与节奏受限，实体经济需求回暖也较为疲弱，经济增长继续寻底，GDP 与工业增加值同比增速回落至 7.4% 及 9.0% 附近水平；第四季度，政策放松的累积效应显现，加之出口增速的阶段性反弹，经济增速弱势企稳，GDP 与工业增加值同比增速小幅回升至 7.9% 与 10.0% 附近水平。通胀方面，上半年通胀水平在周期因素影响下确定性回落，随后由于实体经济需求疲弱，加之猪肉价格上涨周期启动乏力，CPI 同比增速在 7-11 月份反复震荡于 1.7%-2.0% 之间的低位，最终在天气及节日因素影响下反弹至 12 月份的 2.5% 水平。当前来看，稳定的政策环境有望延续，地产及汽车等下游需求继续恢复，经济短期内有望延续弱势回暖态势。

2. 行情回顾

股票指数 2012 年呈现先抑后扬走势，并且后期的涨幅大于之前的跌幅，上证综指最终上涨 3.17%。从风格来看，大盘股大幅跑赢中小盘股。代表大盘股的上证 50 指数上涨 14.84%，而代表中小盘股的中证 500 指数仅上涨 0.28%，沪深 300 指数上涨 7.55%。从行业来看，涨

跌互现，涨幅最大的是券商和地产，分别上涨 36.33% 和 31.85%。跌幅最大的是电信服务和电气设备，分别下跌 30.68% 和 20.06%。

3. 运行分析

2012 年国内宏观经济前 3 季度一路下滑，企业盈利不断恶化，但从 4 季度开始，在积极的财政政策刺激下，宏观经济明显触底回升，企业盈利也随之改善。

报告期内，本基金在前三季度采取了相对防御的投资策略，保持较低的仓位，对一些防御性的行业比如食品饮料、医药等行业进行了重点配置。在第四季度，尤其是指数创新低之后逐步提高仓位，积极配置业绩确定并且估值相对较低的行业和个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日为止，本基金的单位净值为 0.9328 元，本基金的累计单位净值为 2.1328 元。年内本基金净值增长率为 16.02%，同期业绩基准增长率为 0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2013 年，全球经济在寻求复苏的道路上仍将面临不少阻碍。相比之下，美国经济内生动力恢复的现状较好，房地产市场新一轮的健康周期启动，而失业率的持续下降也对消费者信心形成较为有力的支撑，其货币刺激政策也将延续至经济或通胀明显回升之时，但财政紧缩政策将对经济复苏形成一定拖累；欧元区债务危机问题的根本解决方案仍是财政紧缩，由此引发的福利削减等措施将对消费者及企业信心形成持续拖累，欧元区经济难以明显回暖。

国内经济方面，积极的财政政策与稳健的货币政策有望为稳定经济增长营造较为有利的环境，地产及汽车等下游需求也正拉动经济的内生动力持续恢复，但考虑到工业企业产能依然过剩，加之管理层严控财政金融系统性风险的态度可能限制社会融资总量的增长，故经济回暖的持续性有待观察。通胀方面，食品价格受天气及节日因素影响自 2012 年 12 月份有所反弹，但较为疲弱的实体经济需求、较为稳定的货币环境及较为充裕的生猪存栏量使得中短期内通胀回升的压力并不明显，预计 1-2 月份的通胀水平将在基数因素影响下明显波动，随后进入周期性温和回升的通道。党的十八大、中央经济工作会议及央行四季度货币政策例会均表示保持政策的稳定性与延续性，政策仍将以稳为主。房价反弹、就业稳定、通胀回升及国际资本流动限制国内货币政策放松的力度，而适当扩大社会融资总规模、保持贷款适度增加及切实降低实体经济发展融资成本的目标要求货币政策延续放松周期，央行将继续实施稳健的货币政策，处理好稳增长、调结构、控通胀、防风险的关系。预计货币政策将主要依靠央行常态化的公开市场操作，准确、灵活地维持市场流动性；积极的财政政策将以结构性减

税为主，同时配以适度的支出增长，以在支撑经济增长的同时，促进经济结构调整。

针对目前和未来的形势判断，本基金将采取相对积极的投资策略，精选行业和个股。投资策略：1) 维持本基金先导行业和医药，建筑装饰和 TMT 等消费成长行业的配置 2) 侧重个股选择，发挥研究团队优势，选择宏观调控中受益和业绩相对稳定估值合理的个股抵御市场风险 3) 积极关注政策变化，寻求周期股的阶段性机会。

作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全、有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由投资管理部、风险管理部、基金运营部、法律合规部和信息披露相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金运营部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值模型并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由交易部做出提示，风险管理部相关人员负责估值相关数值的处理和计算，待运营部人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。基金运营部将收到的公司估值委员会确认的公允价值数据传至托管银行，并提示托管银行认真核查，并通知会计师事务所审核。公司按上述规定原则进行估值时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，各方确认无误后，基金运营部可使用上述公允价值进行证券投资基金净值计算处理，与托管行核对无误后产生当日估值结果，并将结果反馈至公司估值委员会，同时按流程对外公布。

4.7.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

4.7.3 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.7.4 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同第十五部分基金的收益与分配相关约定：基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 30%。本基金本报告期期末可供分配利润 -212,733,048.65 元，本基金份额净值低于面值。根据本基金基金合同第十五部分基金的收益与分配相关约定，无相关收益分配事项。

§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

2012 年，本基金托管人在对中银收益混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 年，中银收益混合型证券投资基金的管理人——中银基金管理有限公司在中银收益混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中银收益混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中银基金管理有限公司编制和披露的中银收益混合型证券投资基金 2012 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。

二〇一三年三月二十六日

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所审计，注册会计师汪棣、刘颖签字出具了普华永道中天审字(2013)第 20477 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：中银收益混合型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	192,840,215.55	74,786,147.30
结算备付金		2,284,020.83	1,788,529.96
存出保证金		1,727,938.69	1,481,055.04
交易性金融资产	7.4.7.2	2,552,574,741.04	2,285,413,547.79
其中：股票投资		2,120,972,796.04	1,937,947,547.79
基金投资		-	-
债券投资		431,601,945.00	347,466,000.00
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	229,831,384.75	200,000,620.00
应收证券清算款		-	7,906,514.35
应收利息	7.4.7.5	7,484,895.51	8,329,639.15
应收股利		-	-
应收申购款		267,592.89	80,565.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,987,010,789.26	2,579,786,618.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 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		24,041,814.34	2,088,912.44
应付赎回款		4,402,478.85	463,094.45
应付管理人报酬		3,569,108.53	3,463,668.28
应付托管费		594,851.41	577,278.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,676,395.64	932,391.30
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	1,216,350.44	1,102,127.91
负债合计		35,500,999.21	8,627,472.40
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	3,164,242,838.70	3,197,957,857.78
未分配利润	7.4.7.10	-212,733,048.65	-626,798,711.35
所有者权益合计		2,951,509,790.05	2,571,159,146.43
负债和所有者权益总计		2,987,010,789.26	2,579,786,618.83

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9328 元，基金份额总额 3,164,242,838.70 份。

7.2 利润表

会计主体：中银收益混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12 月31日
一、收入		468,874,666.83	-677,196,823.42
1. 利息收入		23,741,691.04	17,480,942.32
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,924,155.90	3,316,701.23
债券利息收入		11,869,946.66	10,300,716.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,947,588.48	3,863,524.12
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,992,828.92	90,536,337.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-28,865,186.78	77,728,715.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,251,462.05	984,010.19
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	15,620,895.81	11,823,612.34
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	455,985,017.50	-785,804,086.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	140,787.21	589,983.47
减：二、费用		59,110,594.86	64,985,077.24

1. 管理人报酬		42,322,693.21	46,511,620.56
2. 托管费		7,053,782.31	7,751,936.70
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	9,245,261.23	10,243,995.46
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	488,858.11	477,524.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		409,764,071.97	-742,181,900.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		409,764,071.97	-742,181,900.66

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银收益混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1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）	3,197,957,857.78	-626,798,711.35	2,571,159,146.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	409,764,071.97	409,764,071.97
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）	-33,715,019.08	4,301,590.73	-29,413,428.35
其中：1. 基金申购款	302,282,092.60	-27,799,237.94	274,482,854.66
2. 基金赎回款	-335,997,111.68	32,100,828.67	-303,896,283.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,164,242,838.70	-212,733,048.65	2,951,509,790.05
项目	上年度可比期间 2011年1月1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）	3,603,328,047.31	151,753,852.62	3,755,081,899.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-742,181,900.66	-742,181,900.66
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）	-405,370,189.53	-58,065.30	-405,428,254.83
其中：1. 基金申购款	414,032,667.70	-25,566,346.70	388,466,321.00
2. 基金赎回款	-819,402,857.23	25,508,281.40	-793,894,575.83
四、本期向基金份额持有人分配利润	-	-36,312,598.01	-36,312,598.01

产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	3,197,957,857.78	-626,798,711.35	2,571,159,146.43

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署；

基金管理公司负责人：李道滨，主管会计工作负责人：乔炳亚，会计机构负责人：乐妮

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中银收益混合型证券投资基金(原名为中银国际收益混合型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 163 号《关于同意中银国际收益混合型证券投资基金募集的批复》核准，由中银基金管理有限公司(原名为中银国际基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银国际收益混合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证券投资基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,408,969,615.90 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 133 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银国际收益混合型证券投资基金基金合同》于 2006 年 10 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,410,621,616.42 份，其中认购资金利息折合 1,652,000.52 份基金份额。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于 2008 年 2 月 27 日发布的《中银基金管理有限公司关于变更旗下基金名称的公告》的有关规定，本基金正式更名为中银收益混合型证券投资基金，其基金合同相应更名为《中银收益混合型证券投资基金基金合同》，本次变更不影响本基金已签署的全部法律文件的效力及其履行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银收益混合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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于具有稳定和良好分红能力的国内优质企业的股票，能够提供固定收益、具有良好流动性的国债、企业债、可转债等，以及其他固定收益产品。投资组合中股票资产投资比例为 30%-90%，债券资产比例为 0%-65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的原业绩比较基准为：新华富时 150 红利指数×60% + 中信标普国债指数×30% + 同业存款

利率 $\times 10\%$ 。根据本基金的基金管理人发布的《中银基金管理有限公司关于旗下中银收益混合基金变更业绩比较基准名称的公告》，因富时集团已正式宣布成为新华富时指数有限公司的全资股东，新华富时指数系列于 2010 年 12 月 16 日正式更改名称为富时中国指数系列。本基金业绩比较基准中的指数相应更名，更名后业绩比较基准为“富时中国 A 股红利 150 指数 $\times 60\% +$ 中信标普国债指数 $\times 30\% +$ 同业存款利率 $\times 10\%$ ”。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2013 年 3 月 29 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》、《中银收益混合型证券投资基金 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 2012 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间没有需作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[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中银国际证券有限责任公司（“中银证券”）	受中国银行重大影响、基金销售机构
贝莱德投资管理（英国）有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
中银证券	695,991,968.46	11.57%	543,356,833.74	8.19%

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中银证券	588,869.82	11.36%	282,488.71	17.16%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中银证券	441,480.44	7.98%	122,190.29	13.13%

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券

登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	42,322,693.21	46,511,620.56
其中：支付销售机构的客户维护费	5,029,623.63	6,166,302.28

注：支付基金管理人中银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,053,782.31	7,751,936.70

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

无。

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

无。

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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	192,840,215.55	3,882,206.94	74,786,147.30	3,260,589.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中银证券	601965	中国汽研	网下新股中签	1,227,229	10,063,277.80
上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2012 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

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值 单价	复牌日期	复牌开盘 单价	数量（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000002	万科 A	2012-12-26	重大事项	10.12	2013-01-21	11.13	737,695	6,931,859.15	7,465,473.40	-

注：本基金截至 2012 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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

(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)。

各层级金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 2,175,158,267.64 元,属于第二层级的余额为 377,416,473.40 元,无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日:第一层级 2,009,454,555.66 元,第二层级 275,958,992.13 元,无第三层级)。

(ii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iii)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	2,120,972,796.04	71.01
	其中：股票	2,120,972,796.04	71.01
2	固定收益投资	431,601,945.00	14.45
	其中：债券	431,601,945.00	14.45
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	229,831,384.75	7.69
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	195,124,236.38	6.53
6	其他各项资产	9,480,427.09	0.32
7	合计	2,987,010,789.26	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	16,322,908.16	0.55
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,193,836,184.76	40.45
C0	食品、饮料	86,880,785.43	2.94
C1	纺织、服装、皮毛	3,796,277.12	0.13
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	320,965,019.11	10.87
C5	电子	81,340,954.44	2.76
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	279,031,260.56	9.45
C8	医药、生物制品	406,562,742.55	13.77
C99	其他制造业	15,259,145.55	0.52
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	183,306,646.52	6.21
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	179,054,582.47	6.07
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	33,259,500.00	1.13
J	房地产业	88,280,213.21	2.99

K	社会服务业	372,227,927.80	12.61
L	传播与文化产业	54,684,833.12	1.85
M	综合类	-	-
	合计	2,120,972,796.04	71.86

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600518	康美药业	17,573,398	230,914,449.72	7.82
2	002037	久联发展	6,512,029	159,870,311.95	5.42
3	002306	湘鄂情	13,187,056	130,815,595.52	4.43
4	002341	新纶科技	12,687,163	125,602,913.70	4.26
5	002051	中工国际	3,740,087	109,958,557.80	3.73
6	002375	亚厦股份	3,773,599	99,924,901.52	3.39
7	600138	中青旅	6,078,722	96,773,254.24	3.28
8	002273	水晶光电	3,923,828	81,340,954.44	2.76
9	600208	新湖中宝	16,989,651	73,225,395.81	2.48
10	002482	广田股份	3,347,637	69,128,704.05	2.34

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人官方网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600208	新湖中宝	116,466,775.70	4.53
2	000002	万科 A	114,513,910.89	4.45
3	000625	长安汽车	109,753,985.26	4.27
4	601318	中国平安	101,294,598.96	3.94
5	600048	保利地产	99,720,906.77	3.88
6	002375	亚厦股份	95,001,651.36	3.69
7	002482	广田股份	87,510,060.04	3.40
8	002306	湘鄂情	84,586,319.84	3.29
9	000800	一汽轿车	76,629,795.00	2.98
10	002273	水晶光电	76,150,080.98	2.96
11	000024	招商地产	70,691,433.27	2.75
12	600376	首开股份	65,371,461.65	2.54
13	002146	荣盛发展	61,117,307.12	2.38
14	601601	中国太保	55,578,810.76	2.16
15	601336	新华保险	55,029,554.46	2.14

16	600138	中青旅	52,462,491.82	2.04
17	600809	山西汾酒	51,877,229.32	2.02
18	300300	汉鼎股份	50,652,513.24	1.97
19	600519	贵州茅台	49,182,409.63	1.91
20	000581	威孚高科	48,008,240.53	1.87

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超初期基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002325	洪涛股份	205,977,717.13	8.01
2	600199	金种子酒	205,925,944.28	8.01
3	000858	五粮液	164,256,436.75	6.39
4	002310	东方园林	154,407,932.54	6.01
5	600809	山西汾酒	120,200,679.37	4.67
6	000002	万科 A	104,765,829.57	4.07
7	600048	保利地产	104,718,974.15	4.07
8	601318	中国平安	89,193,079.28	3.47
9	002296	辉煌科技	83,325,926.88	3.24
10	002044	江苏三友	67,454,342.10	2.62
11	000024	招商地产	61,999,475.13	2.41
12	601336	新华保险	61,874,723.76	2.41
13	000625	长安汽车	56,207,437.46	2.19
14	600376	首开股份	54,804,630.29	2.13
15	002146	荣盛发展	48,869,813.48	1.90
16	600208	新湖中宝	47,882,033.95	1.86
17	300068	南都电源	44,119,439.86	1.72
18	000998	隆平高科	43,669,170.38	1.70
19	600519	贵州茅台	43,542,420.55	1.69
20	002535	林州重机	41,658,067.78	1.62

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,903,951,187.11
卖出股票的收入（成交）总额	3,147,837,835.56

注：“买入股票成本”“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填

列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	170,051,000.00	5.76
	其中：政策性金融债	170,051,000.00	5.76
4	企业债券	61,650,945.00	2.09
5	企业短期融资券	199,900,000.00	6.77
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	431,601,945.00	14.62

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	120211	12 国开 11	1,700,000	170,051,000.00	5.76
2	041259058	12 国电集 CP003	1,000,000	100,060,000.00	3.39
3	011201004	12 中石油 SCP004	1,000,000	99,840,000.00	3.38
4	122080	11 康美债	500,000	50,205,000.00	1.70
5	122068	11 海螺 01	113,890	11,445,945.00	0.39

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,727,938.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,484,895.51
5	应收申购款	267,592.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,480,427.09

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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
143,847	21,997.28	376,986,164.31	11.91%	2,787,256,674.39	88.09%

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	62,842.36	0.0020%

注：1、截止本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0-10 万份（含）；

2、截止本报告期末，本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年10月11日)基金份额总额	2,410,621,616.42
本报告期期初基金份额总额	3,197,957,857.78
本报告期期间基金总申购份额	302,282,092.60
减：本报告期期间基金总赎回份额	335,997,111.68
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,164,242,838.70

§11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内没有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，经本基金管理人董事会审议通过，聘任宁敏女士担任本基金管理人副执行总裁。宁敏女士的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会核准，详情参见 2012 年 2 月 1 日刊登的《中银基金管理有限公司关于副总经理变更事宜的公告》。

本报告期内，经本基金管理人股东会审议通过，选举李道滨先生为本基金管理人第三届董事会董事，陈儒先生不再担任本基金管理人第三届董事会董事职务，相关事项已按规定向监管机构报告。

本报告期内，经本基金管理人董事会审议通过，陈儒先生不再担任本基金管理人执行总裁职务，相关事项已按规定向监管机构报告，详情参见 2012 年 4 月 28 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

此外，本报告期内，经本基金管理人董事会审议通过，聘任李道滨先生担任本基金管理人执行总裁。李道滨先生的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会核准，详情参见 2012 年 8 月 10 日刊登的《中银基金管理有限公司关于总经理任职事宜的公告》。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略没有发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 102,000.00 元，目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 7 年（基金成立至报告期末）。

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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	
申银万国	1	1,608,778,077.97	26.75%	1,368,561.32	26.40%	-
安信证券	1	1,073,748,348.13	17.86%	951,780.89	18.36%	-
中银证券	1	695,991,968.46	11.57%	588,869.82	11.36%	-
中信建投证券	1	641,721,030.80	10.67%	558,245.77	10.77%	-
中信证券	1	580,537,523.25	9.65%	503,943.55	9.72%	-
国信证券	1	541,121,156.40	9.00%	476,601.69	9.19%	-
光大证券	1	471,624,548.63	7.84%	394,392.56	7.61%	-
民生证券	1	244,213,751.59	4.06%	207,646.51	4.01%	-
国金证券	1	155,927,077.44	2.59%	133,524.07	2.58%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	仅一 季度

注：1. 专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29 号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元并与其签订交易单元租用协议。

2. 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：因华泰联合证券不再具有证券经纪业务资

格，2012 年 4 月起本公司与华泰联合证券签署的交易单元租用以及证券综合服务相关协议项下华泰联合证券的权利义务由华泰证券继续履行。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	4,022,443.05	1.63%	-	-	-	-
安信证券	45,860,408.02	18.57%	-	-	-	-
中银证券	46,135,429.27	18.68%	-	-	-	-
中信建投证券	3,551,518.29	1.44%	400,000,000.00	88.89%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	8,424.00	0.00%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	9,855,214.22	3.99%	50,000,000.00	11.11%	-	-
国金证券	10,693,731.19	4.33%	-	-	-	-
华泰证券	126,833,274.60	51.36%	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（[2008]38 号文）以及中国证券业协会《关于发布中证协（SAC）基金行业股票估值指数的通知》（中证协发[2009]97 号）的有关规定，自 2011 年 12 月 15 日起，基金管理人对本基金持有的长期停牌股票中工国际（代码 002051）按照“指数收益法”进行估值，并对相关的基金资产净值进行了调整。2012 年 3 月 19 日，根据中工国际（代码 002051）复牌后的市场交易情况，经基金管理人与基金托管人协商一致，自 2012 年 3 月 19 日起对本基金所持有的中工国际采用交易当天收盘价进行估值。

上述调整已按要求进行公告。

中银基金管理有限公司

二〇一三年三月三十日