

中银主题策略股票型证券投资基金 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：广发银行股份有限公司

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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 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 7 月 25 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	中银主题策略股票
基金主代码	163822
交易代码	163822
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月25日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	283,735,575.48份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以主题投资为核心，充分把握驱动中国经济发展和结构转型带来的主题性投资机会，并精选获益程度高的主题个股进行投资。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行大类资产配置。其次，基于自上而下的投资主题框架，综合运用定量和定性的分析方法，针对经济发展趋势及成长动因进行前瞻性的分析，挖掘市场的长期性和阶段性主题投资机会，精选与投资主题相符的行业和具有核心竞争力的上市公司进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

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		中银基金管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	程明	李春磊
	联系电话	021-38834999	010-65169830
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	lichunlei@cgbchina.com.cn
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95508
传真		021-68873488	010-65169555

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	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 7 月 25 日至 2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,520,287.99
本期利润	19,759,651.47
加权平均基金份额本期利润	0.0389
本期基金份额净值增长率	6.20%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0020
期末基金资产净值	301,269,561.80
期末基金份额净值	1.062

注：1.本基金合同于 2012 年 7 月 25 日生效，基金合同生效起至报告期末不满一年。

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

3.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	5.99%	0.39%	8.18%	1.02%	-2.19%	-0.63%
自基金合同生效起至今	6.20%	0.29%	5.34%	1.01%	0.86%	-0.72%

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

中银主题策略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

(2012 年 7 月 25 日至 2012 年 12 月 31 日)

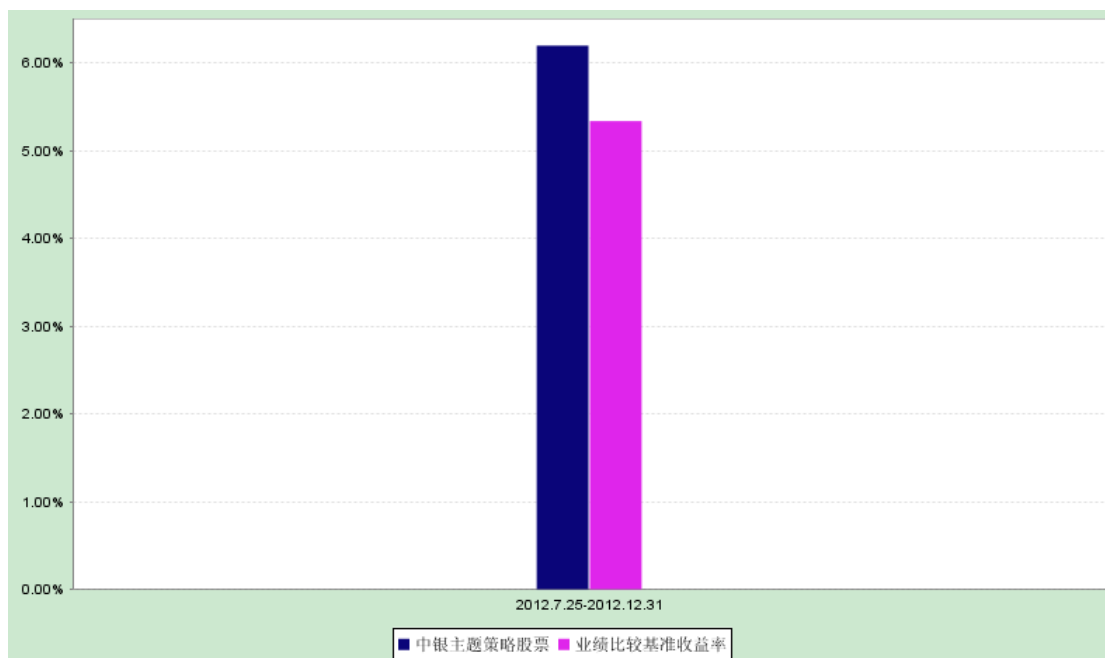


截至报告期末，本基金成立未满一年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

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

中银主题策略股票型证券投资基金

合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



本基金合同于 2012 年 7 月 25 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满五年。合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 自基金合同生效以来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	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金基金合同于 2012 年 7 月 25 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满三年，无利润分配情况。

§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**

中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		
史彬	本基金的基金经理	2012-07-25	-	5	上海财经大学金融学硕士。2007 年加入中银基金管理有限公司，先后担任股票交易员、研究员、基金经理助理等职。2012 年 7 月至今任中银主题策略基金基金经理。具有 5 年证券从业年限。具备基金、证券、银行间本币市场交易员从业资格。
甘霖	本基金的基金经理、中银蓝筹基金基金经理、中银收益基金基金经理、公司权益投资部副总经理	2012-07-25	-	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》、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心艰难突围的一年。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。从国内来看，全年经济增速在第三季度筑底后弱势回升，12 月份工业增加值增速恢复至 10.3%，PMI 指数恢复至 50.6%；与此同时，通胀水平在上半年一路下行，下半年筑底后温和回升，12 月份 CPI 受短期波动因素影响反弹至 2.5%。全球经济金融环境不确定性犹存、国内经济与通胀相继见底但未明显回升、利率市场化及人民币国际化继续推进，成为 2012 年国内宏观调控政策趋于稳健的大背景，货币政策通过价格型调控工具放松的节奏减缓，转而通过数量型调控工具维持相对平稳宽松的货币环境。

从国外的经济情况来看，2012 年美国继续艰难复苏，欧元区经济衰退的步伐有所趋缓。具体来看，进入 2012 年一季度后，美国经济延续缓慢复苏势头，GDP 环比增长 4.2%，失业率也进一步降至 4 月份的 8.1% 水平；第二季度，欧债危机发酵导致全球担忧升温，美国经济复苏步伐放缓，GDP 环比增长 2.8%，失业率也回升至 8.2% 水平；第三季度，美国推出新一轮量化宽松政策，经济复苏势头恢复，GDP 环比增长 5.9%，失业率也明显回落至 7.8%；第四季度，在财政问题及天气因素影响下，美国经济复苏步伐再次放缓，GDP 环比增长仅 0.5%，失业率也停滞于 7.8% 水平。从领先指标来看，美国 ISM 发布的制造业 PMI 在 2012 年 11-12 月份勉强在 50% 荣枯线附近波动，预计一季度美国经济复苏步伐仍将较为艰难。欧元区方面，债务危机担忧在 2012 年上半年持续升温，随后 ESM 机制的生效与银行统一监管协议的达成缓解了欧元区崩溃的系统性风险，但欧债危机根本性问题尚未解决。在此情况下，欧元区经济仍处于衰退泥潭之中，但衰退势头有趋缓迹象。欧元区 GDP 同比增速在 2012 年二三季度维持于萎缩水平 -0.9% 与 -0.8%，全年失业率缓慢攀升至 12 月份 11.8% 的新高水平，制造业 PMI 指数在下半年缓慢恢复至 12 月份的 46.1% 水平，但仍处于萎缩区间。展望 2013 年，3-5 月份美国仍将面临关于削减支出、预算方案及债务上限的谈判，总体仍将维持“宽货币、紧财政”的环境；欧元区将在寻求进一步债务危机解决方案的同时，维持宽松的货币政策以防止经济进一步滑向衰退深渊。

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% 附近水平，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

2012 年上证综指整体上涨了 3.17%，分季度看，上半年市场整体震荡，三季度市场处于下跌趋势，四季度在 12 月份市场强劲反弹。从行业指数看，地产金融板块领涨，市场呈现结构性机会。

3. 运行分析

本基金在 2012 年 7 月发行，成立之后在三季度基本上处于空仓，寻找个股机会，在四季度进行了大比例的加仓。行业配置上，主要配置医药、房地产、建筑建材等行业。

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 1.062 元，本基金的累计单位净值 1.062 元。年内本基金净值增长率为 6.20%，同期业绩基准增长率为 5.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年市场整体小幅上涨，展望 2013 年，我们对市场整体相对乐观，并认为市场机会大于风险，主要原因在于：

首先，十八大提出的新型城镇化是中国未来经济增长的最大动力，为未来的投资确定了较为明确的方向，市场会依据城镇化的概念、发展，依托城镇化寻找更多的热点。

其次，国内政治、经济相关政策的落实，为市场提供了较好的投资环境。从整个货币政策的走向和操作看，未来维持低利率的概率较大，货币层面相对宽松，积极的财政政策为国内经济增长提供了支撑。

再次，外围货币政策依然宽松，日本宣布了扩张性的货币政策和财政政策，为全球经济注入流动性，美国经济已经走在了增长的趋势上，欧洲经济开始逐步走出危机，全球经济整体趋稳向上。

本基金未来的投资策略：1) 选取受益新型城镇化相关的行业 2) 选取业绩确定性较强的、成长性突出的个股进行配置。

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

根据基金合同，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每

次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 20%。

本报告期末可供分配利润为 578,716.80 元，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

本报告期内，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中银主题策略股票型证券投资基金（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

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方面进行了必要的监督，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

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 20491 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：中银主题策略股票型证券投资基金

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	39,898,568.61	-
结算备付金		2,410,534.97	-
存出保证金		250,000.00	-
交易性金融资产	7.4.7.2	268,181,304.55	-
其中：股票投资		228,233,304.55	-
基金投资		-	-
债券投资		39,948,000.00	-
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	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	511,092.02	-
应收股利		-	-
应收申购款		16,321.62	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		311,267,821.77	-
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		-	-
应付赎回款		8,809,742.83	-
应付管理人报酬		417,950.90	-
应付托管费		69,658.48	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	272,205.28	-
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	428,702.48	-
负债合计		9,998,259.97	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	283,735,575.48	-

未分配利润	7.4.7.10	17,533,986.32	-
所有者权益合计		301,269,561.80	-
负债和所有者权益总计		311,267,821.77	-

注：1. 报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.062 元，基金份额总额 283,735,575.48 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2012 年 7 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：中银主题策略股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 7 月 25 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2012年7月25日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入		24,082,382.22	-
1. 利息收入		5,059,873.79	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,228,415.69	-
债券利息收入		1,231,671.27	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,599,786.83	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,975.59	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	84,044.61	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-99,010.00	-
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	28,940.98	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	18,239,363.48	-
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	769,169.36	-
减：二、费用		4,322,730.75	-
1. 管理人报酬		3,263,638.43	-
2. 托管费		543,939.73	-
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.18	365,752.59	-
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	149,400.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,759,651.47	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,759,651.47	-

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银主题策略股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 7 月 25 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012年7月25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）	895,045,013.12	-	895,045,013.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,759,651.47	19,759,651.47
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）	-611,309,437.64	-2,225,665.15	-613,535,102.79
其中：1. 基金申购款	1,646,960.28	14,063.56	1,661,023.84
2. 基金赎回款	-612,956,397.92	-2,239,728.71	-615,196,126.63
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）	283,735,575.48	17,533,986.32	301,269,561.80
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）	-	-	-
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）	-	-	-

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

中银主题策略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 805 号《关于核准中银主题策略股票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依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银主题策略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 894,801,217.67 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 255 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银主题策略股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 7 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 895,045,013.12 份基金份额，其中认购资金利息折合 243,795.45 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，基金托管人为广发银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银主题策略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(包含中小板、创业板)、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

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》、《中银主题策略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 2012 年 7 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 7 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 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 2012 年 7 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 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。

本基金以交易目的目前持有的股票投资和债券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。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其他各类应收款项等。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其他各类应付款项等。

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债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

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和债券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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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分红除权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为正数，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，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，即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 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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
广发银行股份有限公司（“广发银行”）	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	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**

无。

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7月25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	3,263,638.43	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1,142,795.26	-

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 1.5% 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 × 1.5% / 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7月25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	543,939.73	-

注：支付基金托管人广发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		上年度可比期间	
	2012 年 7 月 25 日至 2012 年 12 月 31 日		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
广发银行	39,898,568.61	416,180.11	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人广发银行保管，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

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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	1,182,700	11,486,596.74	11,968,924.00	-

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)。

(ii) 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工具中属于第一层级的余额为 216,264,380.55 元,属于第二层级的余额为 51,916,924.00 元,无属于第三层级的余额。

(iii) 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。

(iv) 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	228,233,304.55	73.32
	其中：股票	228,233,304.55	73.32
2	固定收益投资	39,948,000.00	12.83
	其中：债券	39,948,000.00	12.83
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	42,309,103.58	13.59
6	其他各项资产	777,413.64	0.25
7	合计	311,267,821.77	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	102,862,948.44	34.14
C0	食品、饮料	25,931,222.08	8.61
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	10,311,326.77	3.42
C6	金属、非金属	6,158,438.65	2.04
C7	机械、设备、仪表	11,253,734.35	3.74
C8	医药、生物制品	49,208,226.59	16.33
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	29,600,564.68	9.83
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,107,323.87	0.70
H	批发和零售贸易	11,683,542.40	3.88
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	35,673,634.30	11.84

K	社会服务业	31,761,370.40	10.54
L	传播与文化产业	13,069,899.16	4.34
M	综合类	1,474,021.30	0.49
	合计	228,233,304.55	75.76

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	600383	金地集团	2,380,965	16,714,374.30	5.55
2	000069	华侨城 A	2,088,600	15,664,500.00	5.20
3	600518	康美药业	1,187,508	15,603,855.12	5.18
4	000002	万科 A	1,182,700	11,968,924.00	3.97
5	600519	贵州茅台	48,600	10,158,372.00	3.37
6	600079	人福医药	412,613	9,651,018.07	3.20
7	002375	亚厦股份	309,881	8,205,648.88	2.72
8	600809	山西汾酒	196,400	8,182,024.00	2.72
9	000596	古井贡酒	221,436	7,590,826.08	2.52
10	002482	广田股份	358,500	7,403,025.00	2.46

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600518	康美药业	16,200,656.48	5.38
2	600383	金地集团	14,762,738.08	4.90
3	000069	华侨城 A	14,683,196.81	4.87
4	000002	万科 A	11,486,596.74	3.81
5	600519	贵州茅台	9,974,816.00	3.31
6	600079	人福医药	8,823,016.71	2.93
7	000789	江西水泥	8,284,109.12	2.75
8	002586	围海股份	7,573,448.40	2.51
9	002375	亚厦股份	7,172,247.74	2.38
10	000888	峨眉山 A	7,131,314.67	2.37
11	600809	山西汾酒	6,665,701.26	2.21
12	002325	洪涛股份	6,654,640.73	2.21
13	000540	中天城投	6,570,689.98	2.18
14	002273	水晶光电	6,547,980.42	2.17
15	600422	昆明制药	6,199,812.52	2.06

16	002304	洋河股份	6,182,677.52	2.05
17	600111	包钢稀土	6,182,057.64	2.05
18	000596	古井贡酒	6,135,203.19	2.04
19	600138	中青旅	6,018,479.85	2.00
20	600637	百视通	6,005,526.58	1.99

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600111	包钢稀土	6,109,375.43	2.03
2	002304	洋河股份	5,915,088.32	1.96
3	000540	中天城投	5,193,947.07	1.72
4	600199	金种子酒	4,934,728.06	1.64
5	000789	江西水泥	4,322,432.03	1.43
6	300251	光线传媒	4,177,220.73	1.39
7	601888	中国国旅	3,930,938.67	1.30
8	600141	兴发集团	3,823,005.05	1.27
9	600143	金发科技	3,524,872.04	1.17
10	600276	恒瑞医药	3,414,802.60	1.13
11	300110	华仁药业	3,364,847.09	1.12
12	002586	围海股份	1,760,847.70	0.58

注：“卖出金额”按卖出成交金额(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	260,383,881.25
卖出股票的收入（成交）总额	50,472,104.79

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	39,948,000.00	13.26
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	39,948,000.00	13.26

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	1001060	10 央票 60	400,000	39,948,000.00	13.26

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 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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	511,092.02
5	应收申购款	16,321.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	777,413.64

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000002	万科A	11,968,924.00	3.97	重大事项停牌

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
4,680	60,627.26	14,044,630.05	4.95%	269,690,945.43	95.05%

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	118,608.58	0.0418%

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为 0。

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 万份（含）。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	895,045,013.12
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,646,960.28
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	612,956,397.92
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	283,735,575.48

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转出份额。

§11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期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 81,000.00 元，目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 1 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	169,853,564.23	54.64%	150,303.69	53.94%	-
东方证券	1	141,002,421.81	45.36%	128,368.37	46.06%	-

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》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：报告期内新增东方证券上海交易单元一个、申银万国深圳交易单元一个。

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	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	3,885,000,000.00	100.00%	-	-

中银基金管理有限公司

二〇一三年三月三十日