

中银美丽中国股票型证券投资基金

2013 年年度报告摘要

2013 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年三月二十八日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 27 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 2013 年 6 月 7 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	中银美丽中国股票
基金主代码	000120
交易代码	000120
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 6 月 7 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	464,158,568.52 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于美丽中国主题相关的上市公司股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的中长期稳定增值。
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，针对经济转型过程中直接从事生态文明建设的行业，以及投资或受益于美丽中国发展的行业进行跟踪分析，不断发掘投资机会，精选出受惠于美丽中国发展的优质上市公司进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×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、债券型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	中国民生银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	程明	关悦
	联系电话	021-38834999	010-58560666
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	guanyue2@cmbc.com.cn
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95568
传真		021-68873488	010-58560789

2.4 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.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 26 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

3.1.1 期间数据和指标	2013 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日
本期已实现收益	12,207,951.48
本期利润	46,223,650.76
加权平均基金份额本期利润	0.0551
本期基金份额净值增长率	1.50%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0150
期末基金资产净值	471,104,358.48
期末基金份额净值	1.015

注：1、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。

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、本基金合同于 2013 年 6 月 7 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

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

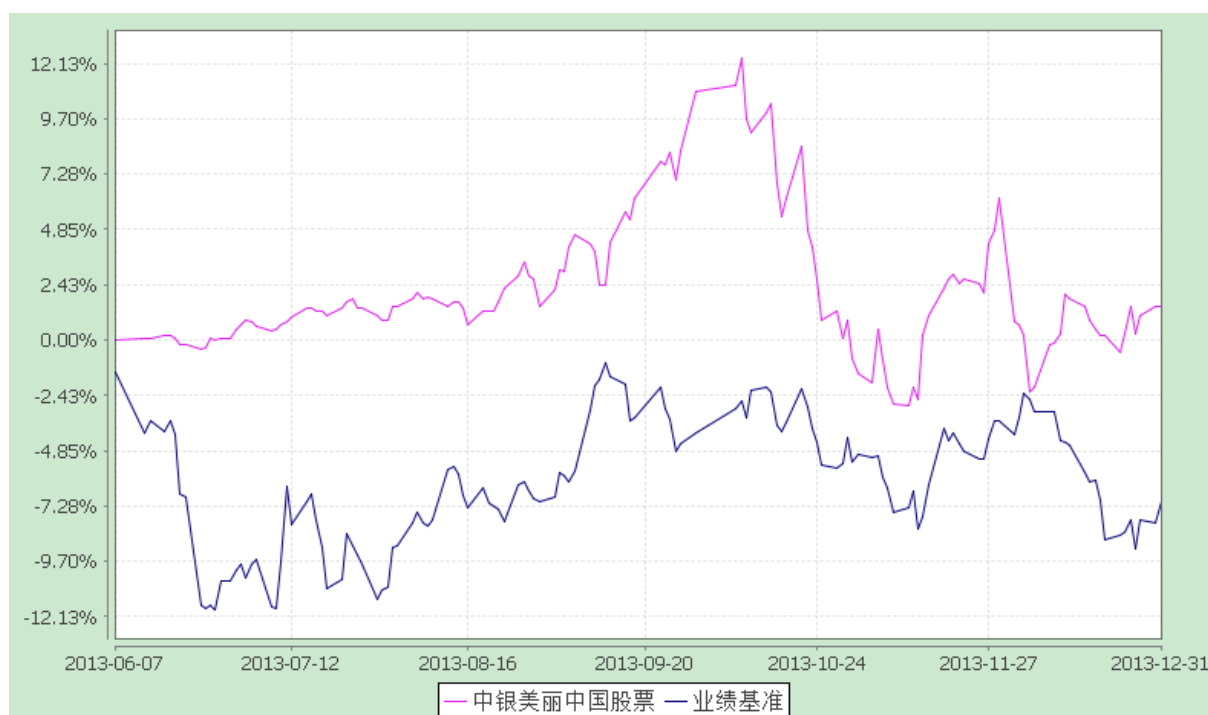
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.48%	1.41%	-3.10%	0.90%	-5.38%	0.51%
过去六个月	1.40%	1.09%	3.88%	1.03%	-2.48%	0.06%
自基金合同生效起至今	1.50%	1.04%	-7.07%	1.14%	8.57%	-0.10%

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

中银美丽中国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的历史走势对比图

(2013 年 6 月 7 日至 2013 年 12 月 31 日)



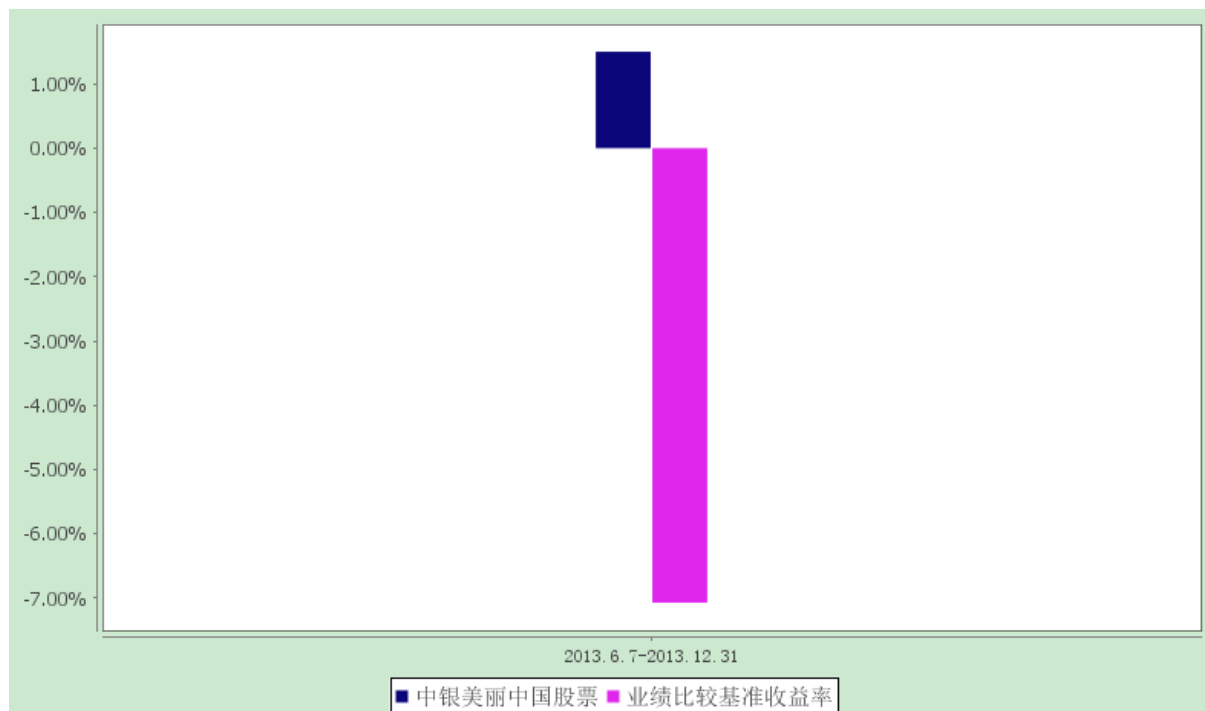
注：截至报告期末，本基金成立未满一年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）的规定，即本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%，其中投资于本基金定义的美丽中国主题相关的股票不低于基金非现金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中，基金保留的现金或者投资于到期日

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%。

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

中银美丽中国股票型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2013 年 6 月 7 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 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 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金合同于 2013 年 6 月 7 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满三年，未发生利润分配的情况。

§ 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 2013 年 12 月 31 日，本管理人共管理三十四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、中银理财 7 天债券型证券投资基金、中银理财 30 天债券型证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金、中银消费主题股票型证券投资基金、中银美丽中国股票型证券投资基金、中银盛利纯债一年定期开放债券型证券投资基金 (LOF)、中银保本二号混合型证券投资基金、中银互利分级债券型证券投资基金、中银惠利纯债半年定期开放债券型证券投资基金、中银中高等级债券型证券投资基金、中银理财 21 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、中银收	2013-06-07	-	15	中银基金管理有限公司执行董事 (ED)，金融学硕士。曾任中信证

	益基金基金经理、中银中国基金基金经理				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 2013 年 10 月任中银中证 100 指数基金基金经理，2013 年 6 月至今任中银美丽中国股票基金基金经理，2013 年 8 月至今任中银中国基金基金经理。特许金融分析师（CFA），香港财经分析师学会会员。具有 15 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、交易占优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 2013 年，是全球各国在应对经济危机的道路上出现分化的一年。欧美经济率先走出危机，欧元区经济摆脱衰退泥潭，美国经济复苏步伐加速，欧美货币政策边际趋紧；受到美联储缩减 QE 的冲击，新兴经济体大多增长乏力。从国内来看，全年经济增速低位窄幅波动，经济增长对投资与债务的依赖度继续上升；通胀水平上升后回落，整体压力较小。全球流动性环境不确定性上升、国内经济与通胀压力有限、金融体系与社会融资创新扩张动力较强，成为 2013 年国内宏观调控政策趋于谨慎的大背景，货币政策在以数量调控为主的情况下，兼顾维稳短期价格。

从国外的经济情况来看，2013 年欧元区经济走出衰退，美国经济加速复苏。具体来看，美国经济在 2013 年上半年延续缓慢复苏势头，GDP 环比折年率处于 3.0%附近，失业率缓慢降至 6 月份的 7.5%水平；下半年，美国经济复苏步伐明显加快，第三、四季度 GDP 环比折年率分别为 6.2%与 4.6%，

失业率加速下降至 12 月份的 6.7%水平。从领先指标来看，美国 ISM 发布的制造业 PMI 持续稳定在扩张区间，预计一季度美国经济复苏步伐仍将延续。欧元区方面，上半年经济衰退势头进一步缓解，制造业 PMI 指数上升至 6 月份的 48.8 水平；下半年，欧元区经济走出衰退，制造业 PMI 指数维持于扩张区间，并于 12 月份升至 52.7 水平。

从国内的经济情况来看，“稳中求进”依然是全年经济工作重点，积极的财政政策与稳健的货币政策延续，经济增速与通胀均整体处于相对较低水平。具体来看，上半年，经济增速缓慢下滑，二季度 GDP 同比增速降至 7.5%的水平；与此同时，货币供应与信用扩张加速，M2 同比增速一度超过 16%。下半年，小库存周期与货币供应的滞后效应使得经济出现了短暂的小幅反弹，三季度 GDP 增速反弹至 7.8%水平；同时，央行货币政策持续保持谨慎，严格把控流动性总闸门，市场利率大幅上升。通胀方面，由于基数原因，1-5 月份通胀水平低位震荡，6-10 月份冲高超过 3.0%水平，但随后受到实体经济需求疲弱、高利率环境持续、居民消费受抑制、生猪存栏量充裕、暖冬等多重因素影响，通胀水平在 11-12 月份加速下滑。当前来看，中性谨慎的政策环境延续，货币供应与信用扩张受到抑制，地产销量下滑，经济短期内或将延续下滑态势。

2. 行情回顾

股票指数 2013 年呈结构性大幅分化的走势。上证综指全年震荡，最终下跌 6.75%，而创业板指数全年一路上扬，上涨 82.73%。从风格来看，中小盘股尤其是创业板股票大幅跑赢大盘股。从行业来看，代表经济转型的新兴产业表现较好，涨幅最大行业是传媒和计算机。而受经济结构调整影响，传统周期股表现较差，跌幅居前的行业主要有煤炭、有色等。

3. 运行分析

报告期内，基金始终把仓位控制在较低水平，规避强周期行业，超配传媒和医药等行业，尤其是大幅超配传媒行业。从投资效果看，对成长股的超配继续贡献超额回报。组合将继续通过增持行业景气向上、成长确定性高的股票获得稳健的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 12 月 31 日为止，本基金的单位净值为 1.015 元，本基金的累计单位净值为 1.015 元。报告期内本基金份额净值增长率为 1.50%，同期业绩比较基准收益率为-7.07%。

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 2014 年，全球经济的分化或将延续，美国经济复苏的基础仍较为牢固，欧元区经济整体扩张动力尚显疲弱，新兴经济体经济发展模式调整还在进行，随着美国逐步退出量化宽松政策，长期

利率可能继续上升，新兴经济体面临资本流动和融资成本变化的冲击。

国内经济方面，经济增长对投资与债务的依赖性依然较强，经济结构调整步伐缓慢，经济在缺乏增长动力的同时，还将面临融资受限的拖累；相对乐观的因素是欧美经济的复苏有望使得出口对经济增长的拉动作用增强。通胀方面，2013 年 11-12 月份通胀的下滑明显拉低了 2014 年通胀的翘尾因素，加之国内实体经济需求疲弱、消费受限、货币政策维持谨慎、生猪存栏量充裕，预计通胀水平全年整体压力有限，仅将在基数效应影响下在年中和年末小幅反弹。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连续性，政策仍将以稳为主。由于经济将长期处于降杠杆、降产能的过程，而金融体系与社会融资创新扩张的动力较强，预计央行总体仍将谨慎调控流动性的总闸门。央行将继续实施稳健的货币政策，处理好稳增长、调结构、促改革、防风险的关系。预计货币政策将主要依靠央行公开市场操作，在控制总量的同时，维稳短期资金面；积极的财政政策将以盘活存量及结构性减税为主，通过加速改革，在促进经济结构调整的同时，支撑经济维持较为平稳的增长。

针对目前和未来的形势判断，本基金会采取相对积极的投资策略，精选行业和个股。投资策略：1) 围绕“创新”方向的深入选股。主要关注新技术、新模式、新思路、新市场所带来的投资机会，尤其看好移动互联网及其与诸多行业的融合渗透，包括对传统产业和传统企业的改造和提升。同时关注智慧城市、移动支付、信息安全、信息消费等相关投资方向。2) 持续关注“改革”的进展和相关投资机会，譬如国企改革、金融改革及要素市场化改革等；另外重点发掘与民生密切相关的、未来公共投资会持续加大的领域，如养老、教育、医疗保健等。3) 与生态文明建设和“建设美丽中国”的相关行业会是我们的基础配置，包括环保行业和企业，医药、电子、传媒、旅游等与美好生活相关的基础行业和企业，为美丽中国提供持续推动力的新能源和新服务相关行业和企业等。

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，由运营部做出提示，风险管理部相关人员对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。其他特殊情形，可由基金经理做出提示，并由研究员提供估值研究报告，交估值委员会审议，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

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，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本报告期末可供分配利润为 6,945,789.96 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

中国民生银行根据《中银美丽中国股票型证券投资基金基金合同》和《中银美丽中国股票型证券投资基金托管协议》，托管中银美丽中国股票型证券投资基金（以下简称“中银美丽中国基金”）。

本报告期，中国民生银行在中银美丽中国基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，按照国家相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人——中银基金管理有限公司在中银美丽中国基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期，基金管理人——中银基金管理有限公司严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规，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

由中银美丽中国基金管理人——中银基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师陈露、汤骏签字出具了安永华明（2014）审字第 61062100_B29 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：中银美丽中国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
资产：	-	-
银行存款	7.4.7.1	104,702,794.22
结算备付金	-	92,635.39
存出保证金	-	350,612.06
交易性金融资产	7.4.7.2	317,505,614.01

其中：股票投资	-	317,505,614.01
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款	-	50,045,972.21
应收利息	7.4.7.5	30,515.32
应收股利	-	-
应收申购款	-	11,347.67
递延所得税资产	-	-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计	-	472,739,490.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013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	-	738,740.14
应付管理人报酬	-	604,643.78
应付托管费	-	100,773.95
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7.4.7.7	103,690.37
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	87,284.16
负债合计	-	1,635,132.40
所有者权益：	-	-
实收基金	7.4.7.9	464,158,568.52
未分配利润	7.4.7.10	6,945,789.96
所有者权益合计	-	471,104,358.48
负债和所有者权益总计	-	472,739,490.88

注：（1）报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.015 元，基金份额总额 464,158,568.52 份。

（2）本基金合同于 2013 年 6 月 7 日生效。

7.2 利润表

会计主体：中银美丽中国股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2013 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日
一、收入	-	55,711,696.96
1. 利息收入	-	8,048,330.11
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,901,240.78
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	-	1,147,089.33
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	12,508,839.30
其中：股票投资收益	7.4.7.12	12,339,240.76
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-

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	169,598.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	34,015,699.28
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	1,138,828.27
减：二、费用	-	9,488,046.20
1. 管理人报酬	7.4.10.2	7,250,040.67
2. 托管费	7.4.10.2	1,208,340.08
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	729,112.88
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	300,552.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	46,223,650.76
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	46,223,650.76

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银美丽中国股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 6 月 7 日（基金合同生效日）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）	1,258,334,107.17	-	1,258,334,107.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	46,223,650.76	46,223,650.76
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）	-794,175,538.65	-39,277,860.80	-833,453,399.45

其中：1. 基金申购款	74,270,709.73	3,309,488.06	77,580,197.79
2. 基金赎回款	-868,446,248.38	-42,587,348.86	-911,033,597.24
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）	464,158,568.52	6,945,789.96	471,104,358.48

报表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：

基金管理人负责人：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

中银美丽中国股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系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[2013]313 号文《关于核准中银美丽中国股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人中银基金管理有限公司于 2013 年 5 月 13 日至 2013 年 6 月 5 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字第 60778298_B21 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 6 月 7 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 1,257,929,258.01 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 404,849.16 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 1,258,334,107.17 元，折合 1,258,334,107.17 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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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(含中小板、创业板及其它中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核

算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2013 年 6 月 7 日（基金合同生效日）起至 2013 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要为股票投资；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其

他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证

据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

C. 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

D. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的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，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公

允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 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，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3%调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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。

7.4.6.3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收

个人所得税：

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金管理人的控股股东、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
中银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	基金托管人、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	
	2013年6月7日（基金合同生效日）至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中银证券	60,544,076.23	10.53%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年6月7日（基金合同生效日）至2013年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中银证券	590,000,000.00	100.00%

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年6月7日（基金合同生效日）至2013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	55,119.31	10.80%	6,693.89	6.57%

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

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 2013年6月7日（基金合同生效日）至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,250,040.67
其中：支付销售机构的客户维护费	2,893,633.99

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2013年6月7日（基金合同生效日）至2013年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	1,208,340.08	

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

本基金本报告期末与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

本基金的基金管理人本报告期末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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

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	
	2013年6月7日（基金合同生效日）至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
民生银行	104,702,794.22	2,025,135.85
合计	104,702,794.22	2,025,135.85

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2013 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日获得的利息收入为人民币 10,216.97 元，2013 年末结算备付金余额为人民币 92,635.39 元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9 期末（2013 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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300315	掌趣科技	2013-08-14	2014-08-15	非公开发行	33.10	22.30	78,438	2,596,297.80	1,749,167.40	-
300315	掌趣科技	-	2014-08-15	非公开发行-转增	-	22.30	62,750	-	1,399,325.00	-

注：本基金持有的非公开发行股票掌趣科技，于 2013 年 9 月实施 2013 年半年度利润分配及资本公积转增股本的方案，股权登记日为 2013 年 9 月 18 日，除权除息日为 2013 年 9 月 23 日，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 8 股，本基金新增 62,750 股。

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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300071	华谊嘉信	2013-11-25	重大资产重组	29.00	-	-	550,574	9,553,699.48	15,966,646.00	-
300291	华录百纳	2013-12-09	重大资产重组	34.99	-	-	358,850	14,577,588.55	12,556,161.50	-

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

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

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、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2、其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

3、财务报表的批准

本财务报表已于 2014 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§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	317,505,614.01	67.16
	其中：股票	317,505,614.01	67.16
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	104,795,429.61	22.17
6	其他各项资产	50,438,447.26	10.67
7	合计	472,739,490.88	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	采矿业	3,658,645.55	0.78
C	制造业	147,635,880.19	31.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,220,940.00	0.26
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,284,056.72	16.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	45,814,681.85	9.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	39,891,409.70	8.47
S	综合	-	-
	合计	317,505,614.01	67.40

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	300017	网宿科技	274,852	23,279,964.40	4.94
2	300182	捷成股份	476,154	18,941,406.12	4.02
3	300315	掌趣科技	604,058	16,423,604.00	3.49
4	300071	华谊嘉信	550,574	15,966,646.00	3.39
5	300058	蓝色光标	306,547	15,879,134.60	3.37
6	002236	大华股份	365,145	14,927,127.60	3.17
7	002400	省广股份	385,349	13,968,901.25	2.97
8	300291	华录百纳	358,850	12,556,161.50	2.67
9	600880	博瑞传播	733,036	12,446,951.28	2.64
10	300027	华谊兄弟	444,006	12,352,246.92	2.62

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	300058	蓝色光标	35,221,740.41	7.48
2	300027	华谊兄弟	33,461,799.93	7.10
3	002004	华邦颖泰	23,696,688.09	5.03
4	300182	捷成股份	17,152,546.40	3.64
5	300157	恒泰艾普	15,970,146.38	3.39
6	002236	大华股份	15,778,883.32	3.35
7	300017	网宿科技	14,852,676.25	3.15
8	300291	华录百纳	14,577,588.55	3.09
9	002400	省广股份	14,461,398.93	3.07
10	600880	博瑞传播	13,906,328.76	2.95
11	002241	歌尔声学	12,973,579.02	2.75
12	300251	光线传媒	12,282,151.74	2.61
13	600389	江山股份	11,026,048.01	2.34
14	002440	闰土股份	10,669,639.52	2.26
15	300315	掌趣科技	10,552,999.70	2.24
16	600887	伊利股份	10,296,362.57	2.19
17	300075	数字政通	9,822,076.38	2.08
18	300071	华谊嘉信	9,553,699.48	2.03
19	002415	海康威视	9,462,615.88	2.01
20	300034	钢研高纳	8,884,714.23	1.89

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	300027	华谊兄弟	39,030,428.04	8.28
2	300058	蓝色光标	18,922,375.55	4.02
3	002004	华邦颖泰	16,889,599.57	3.59
4	300157	恒泰艾普	12,157,350.04	2.58
5	300251	光线传媒	11,173,746.45	2.37
6	002038	双鹭药业	8,066,365.56	1.71
7	002313	日海通讯	7,150,311.77	1.52
8	300070	碧水源	6,765,453.00	1.44
9	002051	中工国际	4,292,318.11	0.91
10	600332	白云山	3,862,260.26	0.82
11	300205	天喻信息	3,776,291.11	0.80
12	300104	乐视网	3,704,414.96	0.79
13	300212	易华录	3,429,404.65	0.73
14	600686	金龙汽车	3,030,344.58	0.64
15	002241	歌尔声学	2,679,312.15	0.57
16	600066	宇通客车	2,577,440.00	0.55
17	300074	华平股份	2,545,360.40	0.54
18	600566	洪城股份	1,465,174.14	0.31
19	002482	广田股份	1,426,620.00	0.30
20	601607	上海医药	279,705.00	0.06

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	424,374,949.31
卖出股票的收入(成交)总额	153,224,275.34

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	350,612.06
2	应收证券清算款	50,045,972.21
3	应收股利	-
4	应收利息	30,515.32
5	应收申购款	11,347.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,438,447.26

8.12.4 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。

8.12.5 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	300071	华谊嘉信	15,966,646.00	3.39	重大资产重组停牌
2	300291	华录百纳	12,556,161.50	2.67	重大资产重组停牌
3	300315	掌趣科技	3,148,492.40	0.67	非公开发行锁定期

8.12.6 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
5,532	83,904.30	2,778,487.54	0.60%	461,380,080.98	99.40%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	26,647.19	0.0057%

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；

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(2013年6月7日)基金份额总额	1,258,334,107.17
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	74,270,709.73
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	868,446,248.38
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	464,158,568.52

§ 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，宁敏女士不再担任本基金管理人副执行总裁职务，相关事项已向中国证券投资基金业协会备案，详情参见 2013 年 8 月 20 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》。

本报告期内，经本基金管理人董事会审议通过，聘任张家文先生担任本基金管理人副执行总裁。张家文先生的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券投资基金业协会备案，详情参见 2013 年 11 月 6 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，本基金管理人原职工监事陈宇先生因个人原因离任，由本公司基金运营部总经理乐妮女士担任职工监事，乐妮女士的简历详见本基金最新披露的招募说明书。

本基金托管人 2013 年 7 月 13 日发布公告，根据业务需要，聘任杨春萍为中国民生银行资产托管部副总经理（主持工作），同时解聘刘涓棠中国民生银行资产托管部总经理职务。

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，本基金管理人改聘了为基金进行审计的会计师事务所，为基金进行审计的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所股份有限公司变更为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 80,000.00 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。

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	
海通证券	1	514,458,850.62	89.47%	455,245.60	89.20%	-
中银证券	1	60,544,076.23	10.53%	55,119.31	10.80%	-

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：报告期内新租海通证券上海交易单元一个，中银证券上海交易单元一个。

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
海通证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	590,000,000.00	100.00%	-	-

中银基金管理有限公司

二〇一四年三月二十八日