

中银收益混合型证券投资基金
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：中国工商银行股份有限公司

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

基金托管人中国工商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	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	4,245,983,151.33 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上市的各种债券，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。 本基金的业绩比较基准 = 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	2012 年	2011 年
本期已实现收益	712,597,427.82	-46,220,945.53	43,622,186.09
本期利润	879,919,943.42	409,764,071.97	-742,181,900.66
加权平均基金份额本期利润	0.2475	0.1287	-0.2242
本期基金份额净值增长率	28.22%	16.02%	-22.06%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1960	-0.0672	-0.1960
期末基金资产净值	5,078,340,535.02	2,951,509,790.05	2,571,159,146.43
期末基金份额净值	1.1960	0.9328	0.8040

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	-5.48%	0.99%	0.45%	0.73%	-5.93%	0.26%
过去六个月	12.00%	1.07%	8.44%	0.75%	3.56%	0.32%
过去一年	28.22%	1.12%	-0.04%	0.74%	28.26%	0.38%
过去三年	15.93%	1.04%	-12.18%	0.71%	28.11%	0.33%
过去五年	99.28%	1.22%	40.31%	0.93%	58.97%	0.29%
自基金合同生效起至今	169.82%	1.41%	95.26%	1.23%	74.56%	0.18%

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的历史走势对比图

(2006年10月11日至2013年12月31日)

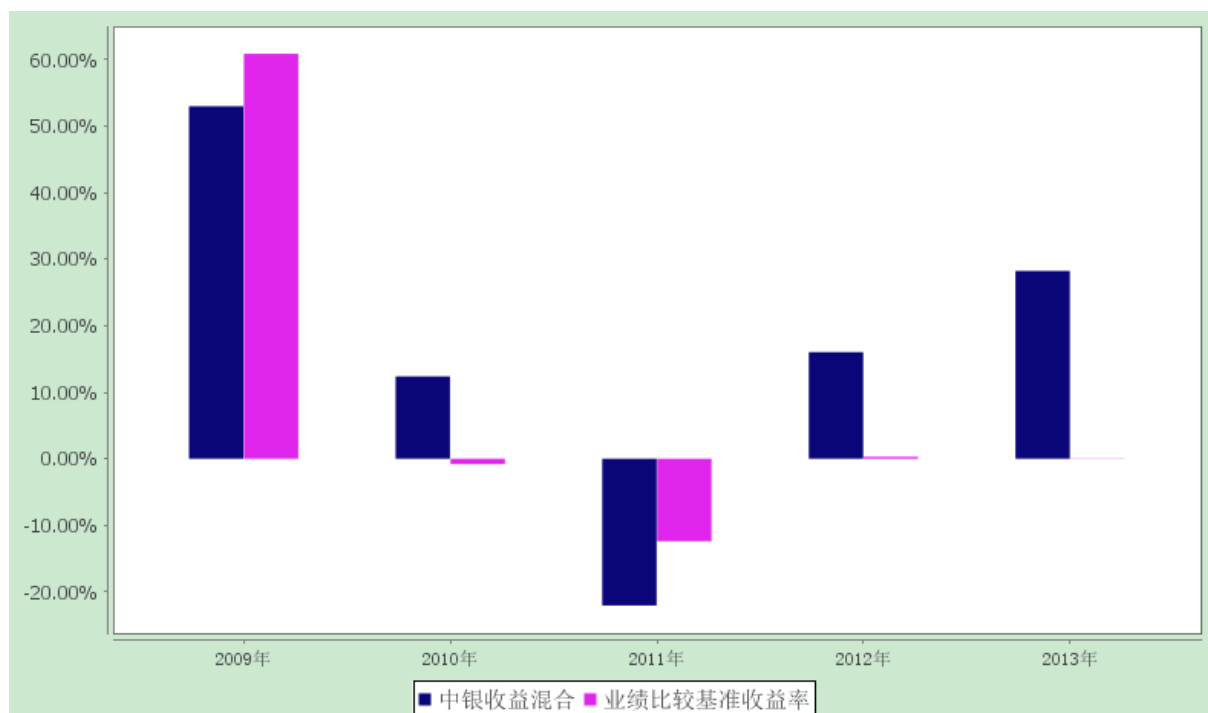


注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分(二)的规定，即本基金投资组合中股票资产投资比例为 30-90%，债券资产比例为 0-65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券类资产比例最低不低于 5%。

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

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	-	-	-	-	-
2012	-	-	-	-	-
2011	0.100	17,786,472.91	18,526,125.10	36,312,598.01	-
合计	0.100	17,786,472.91	18,526,125.10	36,312,598.01	-

§ 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、中银美丽中国股票基金基金经理、中银中国基金基金经理	2006-10-11	-	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。

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、中银消费主题股票基金基金经理、公司权益投资部副总经理	2007-08-22	-	19	中银基金管理有限公司权益投资部副总经理，董事(Director)，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，2013 年 4 月至今任中银消费主题股票基金基金经理。具有 19 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

2013 年股票市场跌宕起伏，结构性分化特征异常明显，上证综指最终下跌 6.75%。从风格来看，代表大盘股的上证 50 指数下跌 15.23%，而代表中小盘的中证 500 指数上涨 16.89%，沪深 300 指数下跌 7.65%。从行业来看，涨跌互现，涨幅居前的主要为新兴行业，如互联网、传媒娱乐、环保、安防、软件、医疗保健、智能交通、云计算、电子支付和宽带提速等领域，跌幅居前的主要是传统的周期性行业，如煤炭、机械、有色、钢铁和建材。

3. 运行分析

2013 年，本基金采取了结构化的投资策略，保持中性的仓位，对一些成长类行业比如传媒、电子和医药等行业进行了重点配置。

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 1.1960 元，本基金的累计单位净值为 2.3960 元。报告期内本基金份额净值增长率为 28.22%，同期业绩比较基准收益率为-0.04%。

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，本基金会采取结构化的投资策略，精选行业和个股。投资策略：1) 维持传媒、医药和电子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，选择转型过程中受益和业绩相对稳定估值合理的个股；3) 积极关注主题投资，寻求主题投资的阶段性机会。

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

本基金基金合同第十五部分基金的收益与分配相关约定：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%。以 2013 年基金的已实现收益为基准，本基金在本报告期内应分配的金额为 249,707,215.11 元。2014 年 1 月 17 日本基金进行了第一次利润分配，向基金份额持有人每 10 份基金份额派发现金红利 0.6 元，分红总金额为 262,269,033.25 元，该次分配以 2013 年 12 月 31 日为收益分配基准日，属于 2013 年度利润分配事项。

§ 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

本报告期内，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，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 2013 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。

中国工商银行资产托管部

2014 年 3 月 25 日

§ 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、许培菁签字出具了安永华明（2014）审字第 61062100_B05 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：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	7.4.7.1	160,667,896.37	192,840,215.55
结算备付金	-	5,090,593.89	2,284,020.83
存出保证金	-	935,115.88	1,727,938.69
交易性金融资产	7.4.7.2	3,546,655,260.80	2,552,574,741.04
其中：股票投资	-	2,815,624,540.00	2,120,972,796.04
基金投资	-	-	-
债券投资	-	731,030,720.80	431,601,945.00

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	1,238,723,476.36	229,831,384.75
应收证券清算款	-	154,201,008.07	-
应收利息	7.4.7.5	17,010,623.45	7,484,895.51
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	11,091,034.91	267,592.89
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	7.4.7.6	300,000.00	-
资产总计	-	5,134,675,009.73	2,987,010,789.26
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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-
应付证券清算款	-	42,105,252.26	24,041,814.34
应付赎回款	-	4,868,810.07	4,402,478.85
应付管理人报酬	-	6,038,105.28	3,569,108.53
应付托管费	-	1,006,350.89	594,851.41
应付销售服务费	-	-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,102,657.35	1,676,395.64
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	213,298.86	1,216,350.44
负债合计	-	56,334,474.71	35,500,999.21

所有者权益：	-	-	-
实收基金	7.4.7.9	4,245,983,151.33	3,164,242,838.70
未分配利润	7.4.7.10	832,357,383.69	-212,733,048.65
所有者权益合计	-	5,078,340,535.02	2,951,509,790.05
负债和所有者权益总计	-	5,134,675,009.73	2,987,010,789.26

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1960 元，基金份额总额 4,245,983,151.33 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：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	上年度可比期间
		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
一、收入	-	965,597,268.18	468,874,666.83
1. 利息收入	-	34,296,742.70	23,741,691.04
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,715,165.56	3,924,155.90
债券利息收入	-	19,231,350.16	11,869,946.66
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	10,350,226.98	7,947,588.48
其他利息收入	-	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	762,170,648.19	-10,992,828.92
其中：股票投资收益	7.4.7.12	744,912,171.80	-28,865,186.78
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,268,469.09	2,251,462.05
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	15,990,007.30	15,620,895.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”	7.4.7.16	167,322,515.60	455,985,017.50

号填列)			
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	1,807,361.69	140,787.21
减: 二、费用	-	85,677,324.76	59,110,594.86
1. 管理人报酬	7.4.10.2	58,897,909.97	42,322,693.21
2. 托管费	7.4.10.2	9,816,318.31	7,053,782.31
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	16,468,398.07	9,245,261.23
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	494,698.41	488,858.11
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	-	879,919,943.42	409,764,071.97
减: 所得税费用	-	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-	879,919,943.42	409,764,071.97

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: 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)	3,164,242,838.70	-212,733,048.65	2,951,509,790.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	879,919,943.42	879,919,943.42
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)	1,081,740,312.63	165,170,488.92	1,246,910,801.55
其中: 1. 基金申购款	2,875,681,958.65	408,157,553.92	3,283,839,512.57

2. 基金赎回款	-1, 793, 941, 646. 02	-242, 987, 065. 00	-2, 036, 928, 711. 02
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）	4, 245, 983, 151. 33	832, 357, 383. 69	5, 078, 340, 535. 02
项目	上年度可比期间		
	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

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”)，系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 号文《关于同意中银国际收益混合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向社会公开发行募集，基金合同于 2006 年 10 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为

2,410,621,616.42 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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、各类有价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 and 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。

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×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×60%+中信标普国债指数×30%+同业存款利率×10%。

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，对于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 年度的经营成果和净值变动情况。

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一致。

7.4.5 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
贝莱德投资管理（英国）有限公司	基金管理人的股东

注：以下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1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	1,365,800,233.48	12.63%	695,991,968.46	11.57%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中银证券	-	-	46,135,429.27	18.68%

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

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1月1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	1,215,274.79	12.55%	17,202.40	0.83%
关联方名称	上年度可比期间 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%

注：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	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	58,897,909.97	42,322,693.21
其中：支付销售机构的客户维护费	4,943,070.20	5,029,623.63

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。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	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,816,318.31	7,053,782.31

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2013年1月1日至2013年12月31日		2012年1月1日至2012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	160,667,896.37	4,580,173.77	192,840,215.55	3,882,206.94

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年度获得的利息收入为人民币87,747.37元(2012年度：人民币37,645.63元)，2013年末结算备付金余额为人民币5,090,593.89元(2012年末：人民币2,284,020.83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

金额单位：人民币元

本期					
2013年1月1日至2013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	-	-	-	-	-
上年度可比期间					
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

注：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。

7.4.8.7 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（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
002004	华邦颖泰	2013-02-07	2014-02-10	非公开发行	14.03	15.04	850,000	11,925,500.00	12,784,000.00	-
002341	新纶科技	2013-03-25	2014-03-27	非公开发行	8.68	14.78	6,500,000	56,420,000.00	96,070,000.00	-
300315	掌趣科技	2013-08-14	2014-08-15	非公开发行	33.10	22.30	470,624	15,577,654.40	10,494,915.20	-
300315	掌趣科技	-	2014-08-15	非公开发行-转增	-	22.30	376,499	-	8,395,927.70	注 1

注：1、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 376,499 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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000625	长安汽车	2013-12-31	重大事项停牌	11.45	2014-01-03	11.72	15,438,957	161,679,694.81	176,776,057.65	-
300071	华谊嘉信	2013-11-25	重大资产重组	29.00	-	-	3,240,191	76,593,246.06	93,965,539.00	-
300291	华录百纳	2013-12-09	重大资产重组	34.99	-	-	2,086,499	86,639,337.41	73,006,600.01	-

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	2,815,624,540.00	54.84
	其中: 股票	2,815,624,540.00	54.84
2	固定收益投资	731,030,720.80	14.24
	其中: 债券	731,030,720.80	14.24
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,238,723,476.36	24.12
	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	165,758,490.26	3.23
6	其他各项资产	183,537,782.31	3.57
7	合计	5,134,675,009.73	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	-	-
C	制造业	1,786,495,167.50	35.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,341,890.00	0.22
E	建筑业	126,186,753.55	2.48
F	批发和零售业	130,420,576.16	2.57
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	303,441,004.21	5.98
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	328,085,623.85	6.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,640,964.20	0.31
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	114,012,560.53	2.25
S	综合	-	-
	合计	2,815,624,540.00	55.44

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	14,333,470	258,002,460.00	5.08
2	300058	蓝色光标	3,589,727	185,947,858.60	3.66
3	000625	长安汽车	15,438,957	176,776,057.65	3.48
4	300315	掌趣科技	5,229,470	144,576,554.86	2.85
5	600315	上海家化	2,745,187	115,929,247.01	2.28
6	600887	伊利股份	2,961,942	115,752,693.36	2.28
7	600352	浙江龙盛	8,615,419	113,895,839.18	2.24
8	002341	新纶科技	6,947,724	103,488,786.68	2.04
9	300071	华谊嘉信	3,240,191	93,965,539.00	1.85
10	600066	宇通客车	5,158,757	90,587,772.92	1.78

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	300058	蓝色光标	265,715,839.50	9.00
2	300251	光线传媒	183,715,174.60	6.22
3	000625	长安汽车	164,037,558.81	5.56
4	300027	华谊兄弟	162,764,648.22	5.51
5	002325	洪涛股份	157,733,249.77	5.34
6	600315	上海家化	138,477,985.87	4.69
7	600066	宇通客车	137,869,489.08	4.67
8	300315	掌趣科技	134,471,785.58	4.56
9	600880	博瑞传播	124,412,697.70	4.22
10	600016	民生银行	119,827,165.74	4.06
11	600352	浙江龙盛	108,898,921.28	3.69
12	002358	森源电气	106,157,271.32	3.60
13	600887	伊利股份	105,567,344.00	3.58
14	600048	保利地产	93,881,913.85	3.18
15	300104	乐视网	91,435,065.38	3.10
16	002317	众生药业	88,160,646.73	2.99
17	601318	中国平安	87,782,721.86	2.97
18	002400	省广股份	87,242,412.37	2.96
19	300291	华录百纳	86,639,337.41	2.94
20	002261	拓维信息	85,798,531.55	2.91

21	300071	华谊嘉信	76,593,246.06	2.60
22	300147	香雪制药	74,978,441.20	2.54
23	002431	棕榈园林	71,988,355.14	2.44
24	002241	歌尔声学	70,885,074.90	2.40
25	600596	新安股份	65,691,046.23	2.23
26	300070	碧水源	64,469,623.21	2.18
27	600000	浦发银行	63,691,807.51	2.16
28	002037	久联发展	61,482,246.39	2.08

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300027	华谊兄弟	368,873,822.86	12.50
2	002037	久联发展	177,214,247.24	6.00
3	300058	蓝色光标	168,700,799.14	5.72
4	002341	新纶科技	158,523,154.46	5.37
5	002273	水晶光电	149,785,613.89	5.07
6	002306	湘鄂情	146,070,641.77	4.95
7	600880	博瑞传播	142,901,147.31	4.84
8	300251	光线传媒	137,512,105.08	4.66
9	002482	广田股份	129,390,829.09	4.38
10	600016	民生银行	115,950,466.93	3.93
11	000625	长安汽车	112,435,502.33	3.81
12	300315	掌趣科技	100,449,255.72	3.40
13	000800	一汽轿车	99,206,208.72	3.36
14	600138	中青旅	98,709,421.04	3.34
15	600048	保利地产	97,392,153.74	3.30
16	600518	康美药业	92,930,440.41	3.15
17	002325	洪涛股份	91,081,809.56	3.09
18	002421	达实智能	85,025,485.74	2.88
19	601318	中国平安	83,235,158.42	2.82
20	002375	亚厦股份	81,496,051.41	2.76
21	300104	乐视网	80,039,476.76	2.71
22	600596	新安股份	74,490,660.47	2.52
23	002004	华邦颖泰	73,427,360.65	2.49
24	000581	威孚高科	72,629,431.48	2.46
25	300300	汉鼎股份	71,204,437.73	2.41

26	601601	中国太保	70,729,447.78	2.40
27	002431	棕榈园林	68,887,026.66	2.33
28	601117	中国化学	68,125,040.36	2.31
29	600066	宇通客车	67,620,829.92	2.29
30	600000	浦发银行	67,618,769.72	2.29
31	300273	和佳股份	63,349,345.94	2.15
32	600315	上海家化	63,113,333.28	2.14
33	601169	北京银行	62,996,208.74	2.13
34	600208	新湖中宝	62,377,481.01	2.11
35	002051	中工国际	61,219,755.62	2.07

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	5,336,625,040.96
卖出股票的收入（成交）总额	5,558,514,336.87

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	48,180,000.00	0.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	279,381,000.00	5.50
	其中：政策性金融债	279,381,000.00	5.50
4	企业债券	48,990,000.00	0.96
5	企业短期融资券	349,715,000.00	6.89
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,764,720.80	0.09
8	其他	-	-

9	合计	731,030,720.80	14.40
---	----	----------------	-------

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	130201	13 国开 01	1,500,000	149,985,000.00	2.95
2	011322002	13 神华 SCP002	1,000,000	100,000,000.00	1.97
3	041361015	13 兵器 CP001	1,000,000	99,880,000.00	1.97
4	041361016	13 中电投 CP002	1,000,000	99,840,000.00	1.97
5	130210	13 国开 10	700,000	69,888,000.00	1.38

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	935,115.88
2	应收证券清算款	154,201,008.07
3	应收股利	-
4	应收利息	17,010,623.45
5	应收申购款	11,091,034.91
6	其他应收款	300,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	183,537,782.31

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110023	民生转债	4,764,720.80	0.09

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	000625	长安汽车	176,776,057.65	3.48	重大事项停牌
2	002341	新纶科技	96,070,000.00	1.89	非公开发行

3	300071	华谊嘉信	93,965,539.00	1.85	重大资产重组
4	300315	掌趣科技	18,890,842.90	0.37	非公开发行

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
112,443	37,761.20	2,104,216,330.47	49.56%	2,141,766,820.86	50.44%

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	61,210.94	0.0014%

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	3,164,242,838.70
本报告期基金总申购份额	2,875,681,958.65
减：本报告期基金总赎回份额	1,793,941,646.02

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,245,983,151.33

§ 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，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 100,000.00 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	
东海证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	2,474,114,746.79	22.88%	2,189,347.84	22.61%	-
广发证券	1	1,479,702,601.39	13.69%	1,309,389.97	13.52%	-
中银证券	1	1,365,800,233.48	12.63%	1,215,274.79	12.55%	-
安信证券	1	1,304,833,273.89	12.07%	1,187,917.02	12.27%	-
中信建投证券	1	1,231,480,763.55	11.39%	1,121,142.07	11.58%	-
光大证券	1	1,096,945,215.11	10.15%	970,689.38	10.03%	-
民生证券	1	932,086,405.69	8.62%	848,569.35	8.76%	-
长江证券	1	358,360,413.55	3.31%	326,249.63	3.37%	-
国金证券	1	350,368,458.35	3.24%	318,974.03	3.29%	-
中信证券	1	144,772,993.98	1.34%	128,109.59	1.32%	-
国信证券	1	72,469,122.65	0.67%	65,975.49	0.68%	-

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：增租长江证券的上海交易所交易单元和广发证券的深圳交易所交易单元。

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
东海证券	-	-	-	-	-	-

高华证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	103,603,287.67	89.91%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	11,622,805.26	10.09%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	100,000,000.00	5.06%	-	-
长江证券	-	-	300,000,000.00	15.19%	-	-
国金证券	-	-	450,000,000.00	22.78%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	1,125,000,000.00	56.96%	-	-

中银基金管理有限公司

二〇一四年三月二十八日