

# 中银优秀企业股票型证券投资基金

## 2014 年半年度报告

### 2014 年 6 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年八月二十七日

## §1 重要提示及目录

### 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。本半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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 28 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | 7  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 7  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 9  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 9  |
| 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.....             | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 12 |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 12 |
| 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..... | 12 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 12 |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | 12 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 12 |
| 6.2 利润表.....                                 | 13 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 14 |
| 6.4 报表附注.....                                | 15 |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | 34 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 34 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 34 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 35 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 37 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 38 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....      | 39 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 39 |
| 7.8 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.....   | 39 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....      | 39 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 39 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 40 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 40 |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....                    | 41 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 41 |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 41        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 ..... | 41        |
| <b>§9 开放式基金份额变动</b> .....               | <b>41</b> |
| <b>§10 重大事件揭示</b> .....                 | <b>41</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 41        |
| 10.2 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 .....  | 41        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 42        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 42        |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....               | 42        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....     | 42        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 42        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 44        |
| <b>§11 备查文件目录</b> .....                 | <b>45</b> |
| 11.1 备查文件目录 .....                       | 45        |
| 11.2 存放地点 .....                         | 45        |
| 11.3 查阅方式 .....                         | 45        |

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 中银优秀企业股票型证券投资基金  |
| 基金简称       | 中银优秀企业股票         |
| 基金主代码      | 000432           |
| 交易代码       | 000432           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2014 年 1 月 28 日  |
| 基金管理人      | 中银基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 400,489,029.85 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

## 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 通过对公司治理结构良好、盈利能力强、具备核心竞争力和成长能力的优秀企业的投资，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略   | 本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。 |
| 业绩比较基准 | 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%。  |
| 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，其预期风险与预期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                | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 程明                        | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 021-38834999              | 0755-83199084          |
|             | 电子邮箱 | clientservice@bocim.com   | Yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 021-38834788 400-888-5566 | 95555                  |
| 传真          |      | 021-68873488              | 0755-83195201          |
| 注册地址        |      | 上海市银城中路200号中银大厦45层        | 深圳市深南大道7088 号招商银行大厦    |
| 办公地址        |      | 上海市银城中路200号中银大厦26层、45层    | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦     |

|       |        |        |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码  | 200120 | 518040 |
| 法定代表人 | 谭炯     | 傅育宁    |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                        |
|----------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 中国证券报、上海证券报、证券时报       |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.bocim.com   |
| 基金半年度报告备置地点          | 上海市银城中路 200 号中银大厦 26 层 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址             |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 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 | 报告期（2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至<br>2014 年 6 月 30 日） |
|---------------|---|
| 本期已实现收益       | 4,181,624.86                                      |
| 本期利润          | 10,650,603.98                                     |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0231  |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.30%   |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.60%   |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014 年 6 月 30 日)                             |
| 期末可供分配利润      | 3,637,457.41                                      |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0091  |
| 期末基金资产净值      | 410,740,959.08                                    |
| 期末基金份额净值      | 1.026   |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2014 年 6 月 30 日)                             |
| 基金份额累计净值增长率   | 2.60%   |

注：1、本基金合同于 2014 年 1 月 28 日生效。

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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月      | 2.29%    | 0.69%       | 0.41%      | 0.62%         | 1.88% | 0.07%  |
| 过去三个月      | 2.09%    | 0.45%       | 1.22%      | 0.70%         | 0.87% | -0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.60%    | 0.35%       | -1.12%     | 0.82%         | 3.72% | -0.47% |

#### 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

中银优秀企业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

(2014 年 1 月 28 日至 2014 年 6 月 30 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，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

## §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 2014 年 6 月 30 日，本管理人共管理四十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、中银优秀企业股票型证券投资基金、中银活期宝货币市场基金、中银多策略灵活配置混合型证券投资基金、中银健康生活股票型证券投资基金、中银聚利分级债券型证券投资基金、中银薪钱包货币市场基金，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 |        |   |
| 甘霖 | 本基金的基金经理、中银蓝筹基金基金经理、中银消费主题股票基金 | 2014-01-28      | -    | 20     | 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 2014 |



|  |                      |  |  |  |  |
|--|----------------------|--|--|--|--|
|  | 基金经理、公司权益投资部<br>副总经理 |  |  |  | 年 1 月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 2014 年 1 月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，2014 年 1 月至今任中银优秀企业股票基金基金经理。具有 20 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 公平交易制度的执行情况

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、《新股询价和申购管理制度》、《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。

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，本报告期内未发生异常交易行为。

#### 4.3.2 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

国外经济方面，美国经济逐步摆脱冬季暴风雪天气的扰动，恢复较为强劲的复苏势头，欧元区经济复苏态势持续放缓。美国是全球复苏前景最好的经济体，美联储稳步退出超宽松货币政策，国际资本流出新兴经济体的压力继续上升。

国内经济方面，年初经济增速以较低水平开局，随后在微刺激政策不断加码的支撑下逐步企稳回升。具体来看，领先指标制造业 PMI 指数探底回升，同步指标工业增加值同比增速触及 8.6% 低位后反弹至 9.2%。从经济增长动力来看，拉动经济的三驾马车涨跌不一：出口增速自低位稳步回升，消费增速基本保持平稳，而基建投资部分对冲房地产投资下滑，制造业投资增速持续处于下行周期，固定资产投资增速下行。通胀方面，CPI 同比增速在 1.8%-2.5% 的低位水平震荡，PPI 通缩幅度有所缓解。

###### 2. 行情回顾

上半年股市指数表现分化。上证综指窄幅震荡，下跌 3.2%，而创业板指数大幅上涨后又显著回落，最终上涨 7.69%。从行业来看，依然是代表经济转型的新兴产业表现较好，涨幅较大的行业依次是计算机、通信、传媒等。而基本面不佳或商业模式受到冲击的行业，如煤炭、农林牧渔、非银金融、商贸零售等下跌幅度居前。新能源汽车、军工、信息安全和软件国产化等主题投资较为活跃。

###### 3. 运行分析

本基金自成立后，在二季度初期市场和创业板调整时采取了等待时间窗口建仓的策略，把握了较好的建仓时机，并在新股开闸时积极参与了新股申购。基金建仓时参与了政策对经济托底带来的行情，并积极布局新经济相关领域的优质上市公司。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金的单位净值为 1.026 元，本基金的累计单位净值为 1.026 元。自基金合同生效起基金份额净值增长率为 2.6%，同期业绩比较基准收益率为-1.12%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

鉴于对当前经济和通胀增速的判断，经济增速有所企稳，但需求疲弱、产能过剩、融资受限等根本性问题尚难解决，预计下半年经济增速仍将面临一定的下滑压力。国务院常务会议提出在当前经济平稳运行、但下行压力仍较大的情况下，要坚持稳健的货币政策，适时适度预调微调。央行货币政策执行报告提到坚持“总量稳定、结构优化”的取向，统筹稳增长、促改革、调结构、惠民生和防风险的关系。预计宏观总体波动有限，继续维持市场机会在价值修复和改革转型方面的判断。

针对目前和未来的形势判断，基金将继续布局服务消费、节能环保、新能源和移动互联网方向的投资机会，同时根据宏观政策和行业景气的变化，结合公司基本面选择业绩良好、估值合理的优质股票。

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

##### 4.6.1 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。

##### 4.6.2 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。

##### 4.6.3 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。

4.6.4 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

根据相关法律法规和基金合同的要求，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%；本基金本报告期末可供分配利润为 3,637,457.41 元，未进行收益分配。

### §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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中银优秀企业股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产      | 附注号     | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 |
|---------|---------|------------------------|
| 资产：     |         | -                      |
| 银行存款    | 6.4.7.1 | 23,222,345.60          |
| 结算备付金   |         | 15,680,683.11          |
| 存出保证金   |         | 65,943.09              |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 375,390,891.52         |
| 其中：股票投资 |         | 295,250,891.52         |

|                 |            |                           |
|-----------------|------------|---------------------------|
| 基金投资            |            | -                         |
| 债券投资            |            | 80,140,000.00             |
| 资产支持证券投资        |            | -                         |
| 贵金属投资           |            | -                         |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                         |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                         |
| 应收证券清算款         |            | -                         |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 519,607.53                |
| 应收股利            |            | -                         |
| 应收申购款           |            | 1,280.79                  |
| 递延所得税资产         |            | -                         |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>414,880,751.64</b>     |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2014年6月30日</b> |
| 负债：             |            | -                         |
| 短期借款            |            | -                         |
| 交易性金融负债         |            | -                         |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                         |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                         |
| 应付证券清算款         |            | -                         |
| 应付赎回款           |            | 3,021,714.62              |
| 应付管理人报酬         |            | 519,482.24                |
| 应付托管费           |            | 86,580.37                 |
| 应付销售服务费         |            | -                         |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 313,062.71                |
| 应交税费            |            | -                         |
| 应付利息            |            | -                         |
| 应付利润            |            | -                         |
| 递延所得税负债         |            | -                         |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 198,952.62                |
| 负债合计            |            | 4,139,792.56              |
| <b>所有者权益：</b>   |            | <b>-</b>                  |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 400,489,029.85            |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 10,251,929.23             |
| 所有者权益合计         |            | 410,740,959.08            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 414,880,751.64            |

注：1、报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.026 元，基金份额总额 400,489,029.85 份。

2、本基金合同于 2014 年 1 月 28 日生效。

## 6.2 利润表

会计主体：中银优秀企业股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号      | 本期<br>2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2014<br>年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|--|
| <b>一、收入</b>                |          | <b>14,689,573.73</b>                               |
| 1.利息收入                     |          | 5,847,802.48                                       |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11 | 3,184,105.49                                       |
| 债券利息收入                     |          | 411,303.75   |
| 资产支持证券利息收入                 |          | -  |
| 买入返售金融资产收入                 |          | 2,252,393.24                                       |
| 其他利息收入                     |          | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | 2,106,094.98                                       |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12 | 477,985.34   |
| 基金投资收益                     |          | -  |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13 | -  |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -  |
| 贵金属投资收益                    |          | -  |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -  |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | 1,628,109.64                                       |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | 6,468,979.12                                       |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -  |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17 | 266,697.15   |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>4,038,969.75</b>                                |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2 | 2,912,446.44                                       |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2 | 485,407.75   |
| 3. 销售服务费                   |          | -  |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 409,670.59   |
| 5. 利息支出                    |          | 32,405.32  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 32,405.32  |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 199,039.65   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>10,650,603.98</b>                               |
| 减：所得税费用                    |          | -  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>10,650,603.98</b>                               |

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：中银优秀企业股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|  | 2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 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）                        | 487,813,731.90                            | -             | 487,813,731.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 10,650,603.98 | 10,650,603.98  |
| 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）      | -87,324,702.05                            | -398,674.75   | -87,723,376.80 |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,796,861.27                              | 4,240.52      | 1,801,101.79   |
| 2.基金赎回款                                | -89,121,563.32                            | -402,915.27   | -89,524,478.59 |
| 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）                        | 400,489,029.85                            | 10,251,929.23 | 410,740,959.08 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中银优秀企业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[2013]1382 号文《关于核准中银优秀企业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《中银优秀企业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基金，存续期限为不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 487,651,698.25 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），安永华明(2014)验字第 61062100\_B02 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银优秀企业股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 01 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 487,813,731.90 份基金份额，其中认购资金利息折合 162,033.65 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银优秀企业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（包括中小板、创业板及其它中国证监会核准上市的股票）、债券、股指期货、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他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监

管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合中，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%，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%；任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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不低于基金资产净值的 5%。本基金将不低于 80% 的非现金基金资产投资于优秀企业股票。本基金定义的优秀企业股票主要是指公司治理结构良好、盈利能力强、具备核心竞争力和成长能力的上市公司。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%。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年上半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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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。

##### 6.4.4.2 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。

##### 6.4.4.3 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包括股票投资和债券投资；

## (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。

### 6.4.4.4 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。

### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)”。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值 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 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。

#### 6.4.4.11 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间没有需说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 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。

##### 6.4.6.2 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。

#### 6.4.6.3 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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 23,222,345.60          |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 23,222,345.60          |

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 |                |               |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 288,825,350.25         | 295,250,891.52 | 6,425,541.27  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场                  | -              | -             |
|               | 银行间市场                  | 80,096,562.15  | 80,140,000.00 |
|               | 合计                     | 80,096,562.15  | 80,140,000.00 |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -             |
| 基金            | -                      | -              | -             |
| 其他            | -                      | -              | -             |
| 合计            | 368,921,912.40         | 375,390,891.52 | 6,468,979.12  |

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 7,379.93               |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 7,056.30               |
| 应收债券利息     | 505,141.60             |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 其他         | 29.70                  |
| 合计         | 519,607.53             |



**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 312,799.86             |
| 银行间市场应付交易费用 | 262.85                 |
| 合计          | 313,062.71             |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 7,592.22               |
| 应付审计费       | 27,336.54              |
| 应付信息披露费     | 164,023.86             |
| 其他          | -                      |
| 合计          | 198,952.62             |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---|----------------|
|               | 基金份额（份）   | 账面金额           |
| 基金合同生效日       | 487,813,731.90                                  | 487,813,731.90 |
| 本期申购          | 1,796,861.27                                    | 1,796,861.27   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -89,121,563.32                                  | -89,121,563.32 |
| 本期末           | 400,489,029.85                                  | 400,489,029.85 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|----------------|--------------|--------------|---------------|
| 本期利润           | 4,181,624.86 | 6,468,979.12 | 10,650,603.98 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -544,167.45  | 145,492.70   | -398,674.75   |
| 其中：基金申购款       | 10,960.04    | -6,719.52    | 4,240.52      |
| 基金赎回款          | -555,127.49  | 152,212.22   | -402,915.27   |
| 本期已分配利润        | -            | -            | -             |
| 本期末            | 3,637,457.41 | 6,614,471.82 | 10,251,929.23 |

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期  |
|-----------|---|
|           | 2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入  | 248,527.98                                |
| 定期存款利息收入  | 2,847,608.33                              |
| 其他存款利息收入  | -   |
| 结算备付金利息收入 | 87,844.10                                 |
| 其他        | 125.08                                    |
| 合计        | 3,184,105.49                              |

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

| 项目         | 本期  |
|------------|---|
|            | 2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额   | 38,586,675.56                             |
| 减：卖出股票成本总额 | 38,108,690.22                             |
| 买卖股票差价收入   | 477,985.34                                |

**6.4.7.13 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期  |
|-------------|---|
|             | 2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 1,628,109.64                              |
| 基金投资产生的股利收益 | -   |
| 合计          | 1,628,109.64                              |

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期  |
|------------|---|
|            | 2014 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日 |
| 1.交易性金融资产  | 6,468,979.12                              |
| ——股票投资     | 6,425,541.27                              |
| ——债券投资     | 43,437.85                                 |
| ——资产支持证券投资 | -   |
| ——基金投资     | -   |
| ——贵金属投资    | -   |
| 2.衍生工具     | -   |
| ——权证投资     | -   |
| 3.其他       | -   |
| 合计         | 6,468,979.12                              |

**6.4.7.15 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2014年1月28日（基金合同生效日）至2014年6月30日 |
|---------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 266,190.72                           |
| 转换费收入   | 491.40                               |
| 其他      | 15.03                                |
| 合计      | 266,697.15                           |

**6.4.7.16 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2014年1月28日（基金合同生效日）至2014年6月30日 |
|-----------|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 409,670.59                           |
| 银行间市场交易费用 | -                                    |
| 合计        | 409,670.59                           |

**6.4.7.17 其他费用**

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2014年1月28日（基金合同生效日）至2014年6月30日 |
|-------|--------------------------------------|
| 审计费用  | 27,336.54                            |
| 信息披露费 | 164,023.86                           |
| 银行汇划费 | 6,779.25                             |
| 其他    | 900.00                               |
| 合计    | 199,039.65                           |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

**6.4.8.2资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 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 |
| 招商银行股份有限公司(“招商银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |

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。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

1、本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

2、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。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期                             |
|-----------------|--------------------------------|
|                 | 2014年1月28日（基金合同生效日）至2014年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,912,446.44                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,163,629.93                   |

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期                             |
|----------------|--------------------------------|
|                | 2014年1月28日（基金合同生效日）至2014年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 485,407.75                     |

注：基金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

基金托管费每日计提，按月支付。

**6.4.10.3 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。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 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<br>2014年1月28日（基金合同生效日）至2014年6月30日 |            |
|------------|--------------------------------------|------------|
|            | 期末余额                                 | 当期利息收入     |
| 招商银行股份有限公司 | 23,222,345.60                        | 248,527.98 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 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。

**6.4.10.7 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。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期末进行利润分配。

**6.4.12 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 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

| 6.4.12.1.1 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 |
| 002727               | 一心堂  | 2014-06-25 | 2014-07-02 | 网下中签   | 12.20 | 12.20  | 2,152    | 26,254.40 | 26,254.40 | -  |

|        |      |            |            |          |       |       |        |            |            |   |
|--------|------|------------|------------|----------|-------|-------|--------|------------|------------|---|
| 603328 | 依顿电子 | 2014-06-23 | 2014-07-01 | 网下<br>中签 | 15.31 | 15.31 | 14,120 | 216,177.20 | 216,177.20 | - |
|--------|------|------------|------------|----------|-------|-------|--------|------------|------------|---|

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部、法律合规部、稽核部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存

放在本基金的托管行招商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2014 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

**6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

**6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

| 本期末<br>2014年6月30日 | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
|-------------------|----------------|------|------|----------------|----------------|
| 资产                |                |      |      |                |                |
| 银行存款              | 23,222,345.60  | -    | -    | -              | 23,222,345.60  |
| 结算备付金             | 15,680,683.11  | -    | -    | -              | 15,680,683.11  |
| 存出保证金             | 65,943.09      | -    | -    | -              | 65,943.09      |
| 交易性金融资产           | 80,140,000.00  | -    | -    | 295,250,891.52 | 375,390,891.52 |
| 买入返售金融资产          | -              | -    | -    | -              | -              |
| 应收证券清算款           | -              | -    | -    | -              | -              |
| 应收利息              | -              | -    | -    | 519,607.53     | 519,607.53     |
| 应收股利              | -              | -    | -    | -              | -              |
| 应收申购款             | -              | -    | -    | 1,280.79       | 1,280.79       |
| 其他资产              | -              | -    | -    | -              | -              |
| 资产总计              | 119,108,971.80 | 0.00 | 0.00 | 295,771,779.84 | 414,880,751.64 |
| 负债                |                |      |      |                |                |
| 卖出回购金融资产款         | -              | -    | -    | -              | -              |
| 应付证券清算款           | -              | -    | -    | -              | -              |
| 应付赎回款             | -              | -    | -    | 3,021,714.62   | 3,021,714.62   |
| 应付管理人报酬           | -              | -    | -    | 519,482.24     | 519,482.24     |
| 应付托管费             | -              | -    | -    | 86,580.37      | 86,580.37      |
| 应付销售服务费           | -              | -    | -    | -              | -              |
| 应付交易费用            | -              | -    | -    | 313,062.71     | 313,062.71     |
| 应交税费              | -              | -    | -    | -              | -              |
| 应付利息              | -              | -    | -    | -              | -              |
| 应付利润              | -              | -    | -    | -              | -              |
| 其他负债              | -              | -    | -    | 198,952.62     | 198,952.62     |
| 负债总计              | -              | -    | -    | 4,139,792.56   | 4,139,792.56   |



|         |                |   |   |                |                |
|---------|----------------|---|---|----------------|----------------|
| 利率敏感度缺口 | 119,108,971.80 | - | - | 291,631,987.28 | 410,740,959.08 |
|---------|----------------|---|---|----------------|----------------|

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 19.51%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括特定指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 |               |
|--------------|------------------------|---------------|
|              | 公允价值                   | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 295,250,891.52         | 71.88         |
| 交易性金融资产—基金投资 | -                      | -             |

|               |                |       |
|---------------|----------------|-------|
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -              | -     |
| 衍生金融资产—权证投资   | -              | -     |
| 合计            | 295,250,891.52 | 71.88 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2014 年 6 月 30 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 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              | 295,250,891.52 | 71.17         |
|    | 其中：股票             | 295,250,891.52 | 71.17         |
| 2  | 固定收益投资            | 80,140,000.00  | 19.32         |
|    | 其中：债券             | 80,140,000.00  | 19.32         |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 38,903,028.71  | 9.38          |
| 7  | 其他各项资产            | 586,831.41     | 0.14          |
| 8  | 合计                | 414,880,751.64 | 100.00        |

### 7.2 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              | 718,170.00     | 0.17  |
| C | 制造业              | 201,854,997.86 | 49.14 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -     |
| E | 建筑业              | 5,902,840.80   | 1.44  |
| F | 批发和零售业           | 13,672,452.97  | 3.33  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,448,353.07   | 0.60  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 30,189,294.08  | 7.35  |
| J | 金融业              | 8,921,403.90   | 2.17  |
| K | 房地产业             | 19,620,901.28  | 4.78  |
| L | 租赁和商务服务业         | 11,922,477.56  | 2.90  |
| 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        | -              | -     |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 295,250,891.52 | 71.88 |

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 600557 | 康缘药业 | 382,781 | 10,985,814.70 | 2.67         |
| 2  | 002241 | 歌尔声学 | 407,840 | 10,873,014.40 | 2.65         |
| 3  | 600276 | 恒瑞医药 | 300,630 | 9,968,890.80  | 2.43         |
| 4  | 002317 | 众生药业 | 479,832 | 9,582,245.04  | 2.33         |
| 5  | 000625 | 长安汽车 | 749,320 | 9,224,129.20  | 2.25         |
| 6  | 601888 | 中国国旅 | 275,226 | 9,093,467.04  | 2.21         |
| 7  | 600332 | 白云山  | 316,940 | 7,888,636.60  | 1.92         |
| 8  | 600872 | 中炬高新 | 734,973 | 7,842,161.91  | 1.91         |
| 9  | 002392 | 北京利尔 | 835,735 | 7,680,404.65  | 1.87         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 10 | 002376 | 新北洋  | 669,700 | 7,366,700.00 | 1.79 |
| 11 | 600686 | 金龙汽车 | 820,717 | 7,345,417.15 | 1.79 |
| 12 | 600998 | 九州通  | 546,397 | 7,316,255.83 | 1.78 |
| 13 | 600104 | 上汽集团 | 468,700 | 7,171,110.00 | 1.75 |
| 14 | 600804 | 鹏博士  | 477,800 | 6,899,432.00 | 1.68 |
| 15 | 601318 | 中国平安 | 167,085 | 6,573,123.90 | 1.60 |
| 16 | 002358 | 森源电气 | 258,772 | 6,433,071.92 | 1.57 |
| 17 | 002318 | 久立特材 | 354,122 | 6,271,500.62 | 1.53 |
| 18 | 300337 | 银邦股份 | 453,177 | 5,923,023.39 | 1.44 |
| 19 | 603288 | 海天味业 | 161,316 | 5,458,933.44 | 1.33 |
| 20 | 300005 | 探路者  | 320,285 | 4,945,200.40 | 1.20 |
| 21 | 000049 | 德赛电池 | 122,689 | 4,928,417.13 | 1.20 |
| 22 | 002410 | 广联达  | 184,332 | 4,873,738.08 | 1.19 |
| 23 | 600767 | 运盛实业 | 671,400 | 4,827,366.00 | 1.18 |
| 24 | 600271 | 航天信息 | 227,110 | 4,739,785.70 | 1.15 |
| 25 | 000671 | 阳光城  | 538,700 | 4,735,173.00 | 1.15 |
| 26 | 002051 | 中工国际 | 287,084 | 4,650,760.80 | 1.13 |
| 27 | 300127 | 银河磁体 | 339,400 | 4,629,416.00 | 1.13 |
| 28 | 002501 | 利源精制 | 335,620 | 4,561,075.80 | 1.11 |
| 29 | 600153 | 建发股份 | 794,126 | 4,327,986.70 | 1.05 |
| 30 | 600887 | 伊利股份 | 124,335 | 4,117,975.20 | 1.00 |
| 31 | 600305 | 恒顺醋业 | 271,669 | 4,061,451.55 | 0.99 |
| 32 | 002146 | 荣盛发展 | 409,200 | 3,875,124.00 | 0.94 |
| 33 | 002236 | 大华股份 | 140,351 | 3,782,459.45 | 0.92 |
| 34 | 000513 | 丽珠集团 | 79,200  | 3,740,616.00 | 0.91 |
| 35 | 300182 | 捷成股份 | 183,300 | 3,675,165.00 | 0.89 |
| 36 | 000002 | 万科 A | 400,700 | 3,313,789.00 | 0.81 |
| 37 | 300057 | 万顺股份 | 334,978 | 3,239,237.26 | 0.79 |
| 38 | 600596 | 新安股份 | 329,800 | 3,017,670.00 | 0.73 |
| 39 | 600048 | 保利地产 | 578,518 | 2,869,449.28 | 0.70 |
| 40 | 300034 | 钢研高纳 | 172,116 | 2,858,846.76 | 0.70 |
| 41 | 002022 | 科华生物 | 123,254 | 2,841,004.70 | 0.69 |
| 42 | 002400 | 省广股份 | 115,094 | 2,829,010.52 | 0.69 |
| 43 | 601058 | 赛轮股份 | 228,400 | 2,681,416.00 | 0.65 |
| 44 | 300104 | 乐视网  | 59,900  | 2,629,610.00 | 0.64 |
| 45 | 300322 | 硕贝德  | 164,614 | 2,610,778.04 | 0.64 |
| 46 | 002649 | 博彦科技 | 75,400  | 2,503,280.00 | 0.61 |
| 47 | 600079 | 人福医药 | 83,435  | 2,490,534.75 | 0.61 |
| 48 | 300275 | 梅安森  | 158,000 | 2,433,200.00 | 0.59 |
| 49 | 601601 | 中国太保 | 132,000 | 2,348,280.00 | 0.57 |
| 50 | 600066 | 宇通客车 | 138,276 | 2,231,774.64 | 0.54 |
| 51 | 601766 | 中国南车 | 493,000 | 2,218,500.00 | 0.54 |
| 52 | 600519 | 贵州茅台 | 15,510  | 2,202,109.80 | 0.54 |
| 53 | 600446 | 金证股份 | 71,400  | 2,194,836.00 | 0.53 |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 54 | 000423 | 东阿阿胶 | 65,600  | 2,185,792.00 | 0.53 |
| 55 | 601299 | 中国北车 | 480,900 | 2,183,286.00 | 0.53 |
| 56 | 000651 | 格力电器 | 74,100  | 2,182,245.00 | 0.53 |
| 57 | 600809 | 山西汾酒 | 160,311 | 2,128,930.08 | 0.52 |
| 58 | 600406 | 国电南瑞 | 158,700 | 2,115,471.00 | 0.52 |
| 59 | 600976 | 武汉健民 | 100,198 | 2,001,956.04 | 0.49 |
| 60 | 600787 | 中储股份 | 147,001 | 1,921,303.07 | 0.47 |
| 61 | 300037 | 新宙邦  | 47,894  | 1,738,552.20 | 0.42 |
| 62 | 002309 | 中利科技 | 86,797  | 1,509,399.83 | 0.37 |
| 63 | 002023 | 海特高新 | 78,600  | 1,501,260.00 | 0.37 |
| 64 | 600588 | 用友软件 | 99,240  | 1,396,306.80 | 0.34 |
| 65 | 002065 | 东华软件 | 65,400  | 1,315,848.00 | 0.32 |
| 66 | 002375 | 亚厦股份 | 55,500  | 1,252,080.00 | 0.30 |
| 67 | 300003 | 乐普医疗 | 56,700  | 1,185,030.00 | 0.29 |
| 68 | 600894 | 广日股份 | 73,480  | 810,484.40   | 0.20 |
| 69 | 300157 | 恒泰艾普 | 55,500  | 718,170.00   | 0.17 |
| 70 | 601333 | 广深铁路 | 207,500 | 527,050.00   | 0.13 |
| 71 | 002563 | 森马服饰 | 10,471  | 284,287.65   | 0.07 |
| 72 | 603328 | 依顿电子 | 14,120  | 216,177.20   | 0.05 |
| 73 | 300386 | 飞天诚信 | 2,640   | 152,407.20   | 0.04 |
| 74 | 002727 | 一心堂  | 2,152   | 26,254.40    | 0.01 |
| 75 | 603006 | 联明股份 | 1,135   | 16,230.50    | 0.00 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 002241 | 歌尔声学 | 11,225,084.06 | 2.73            |
| 2  | 002317 | 众生药业 | 9,354,170.62  | 2.28            |
| 3  | 601006 | 大秦铁路 | 9,346,365.58  | 2.28            |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 9,217,195.62  | 2.24            |
| 5  | 600557 | 康缘药业 | 9,145,627.49  | 2.23            |
| 6  | 000625 | 长安汽车 | 8,753,922.30  | 2.13            |
| 7  | 601888 | 中国国旅 | 8,700,635.49  | 2.12            |
| 8  | 600028 | 中国石化 | 8,492,348.00  | 2.07            |
| 9  | 600998 | 九州通  | 7,650,915.86  | 1.86            |
| 10 | 600332 | 白云山  | 7,575,133.74  | 1.84            |
| 11 | 600872 | 中炬高新 | 7,553,957.91  | 1.84            |
| 12 | 002376 | 新北洋  | 7,363,607.32  | 1.79            |
| 13 | 002392 | 北京利尔 | 7,002,291.42  | 1.70            |
| 14 | 600686 | 金龙汽车 | 6,963,938.72  | 1.70            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 15 | 600104 | 上汽集团 | 6,955,406.47 | 1.69 |
| 16 | 601318 | 中国平安 | 6,572,545.50 | 1.60 |
| 17 | 600804 | 鹏博士  | 6,570,155.66 | 1.60 |
| 18 | 002358 | 森源电气 | 6,535,961.61 | 1.59 |
| 19 | 002318 | 久立特材 | 6,057,143.35 | 1.47 |
| 20 | 603288 | 海天味业 | 5,681,101.80 | 1.38 |

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。

#### 7.4.2 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     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 601006 | 大秦铁路 | 9,656,046.75 | 2.35            |
| 2  | 600028 | 中国石化 | 8,777,891.94 | 2.14            |
| 3  | 600016 | 民生银行 | 4,557,382.62 | 1.11            |
| 4  | 600000 | 浦发银行 | 4,552,667.00 | 1.11            |
| 5  | 002664 | 信质电机 | 2,390,759.00 | 0.58            |
| 6  | 600690 | 青岛海尔 | 2,070,591.87 | 0.50            |
| 7  | 000002 | 万科 A | 1,622,000.00 | 0.39            |
| 8  | 600048 | 保利地产 | 1,497,000.00 | 0.36            |
| 9  | 002454 | 松芝股份 | 1,205,296.36 | 0.29            |
| 10 | 600376 | 首开股份 | 1,097,211.90 | 0.27            |
| 11 | 000024 | 招商地产 | 1,093,591.00 | 0.27            |
| 12 | 600066 | 宇通客车 | 66,237.12    | 0.02            |

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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|               |                |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 326,934,040.47 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 38,586,675.56  |

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。

#### 7.5 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      | 80,140,000.00 | 19.51 |
|   | 其中：政策性金融债 | 80,140,000.00 | 19.51 |
| 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        | 80,140,000.00 | 19.51 |

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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  | 090306 | 09 进出 06 | 400,000 | 40,072,000.00 | 9.76         |
| 2  | 140212 | 14 国开 12 | 400,000 | 40,068,000.00 | 9.76         |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 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。

**7.11.2 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。

**7.11.3 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。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 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。

**7.12.2** 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。

**7.12.3 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   | 65,943.09  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 519,607.53 |
| 5  | 应收申购款   | 1,280.79   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 586,831.41 |

**7.12.4 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。

**7.12.5 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。

**7.12.6 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。



## §8 基金份额持有人信息

## 8.1 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<br>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<br>比例 | 持有份额           | 占总份额<br>比例 |
| 3,024    | 132,436.85    | 3,856,620.75 | 0.96%      | 396,632,409.10 | 99.04%     |

## 8.2 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<br>本基金 | 1,977.63  | 0.0005%  |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2014年1月28日）基金份额总额 | 487,813,731.90 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额     | 1,796,861.27   |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额   | 89,121,563.32  |
| 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               | 400,489,029.85 |

## §10 重大事件揭示

## 10.1 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。

## 10.2 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，基金管理人无重大人事变动。

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。

**10.3 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。

**10.4 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。

**10.5 报告期内改聘会计师事务所情况**

本报告期内没有改聘会计师事务所。

**10.6 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。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 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 |    |
| 招商证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 首创证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 安信证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 瑞银证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中金公司   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 红塔证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东方证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 齐鲁证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 光大证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 兴业证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 浙商证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 方正证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国联证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 渤海证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中信证券   | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 广发证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中银证券   | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 天风证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 民生证券   | 1      | 150,743,181.24 | 41.28%       | 133,392.75 | 40.62%     | -  |
| 国泰君安   | 2      | 100,535,994.98 | 27.53%       | 91,527.89  | 27.87%     | -  |
| 长江证券   | 1      | 94,818,265.50  | 25.96%       | 86,322.14  | 26.28%     | -  |
| 华泰证券   | 2      | 5,403,887.37   | 1.48%        | 4,781.96   | 1.46%      | -  |
| 财富里昂证券 | 1      | 4,093,268.54   | 1.12%        | 3,726.56   | 1.13%      | -  |
| 东兴证券   | 1      | 3,428,482.79   | 0.94%        | 3,121.20   | 0.95%      | -  |

|        |   |              |       |          |       |   |
|--------|---|--------------|-------|----------|-------|---|
| 申银万国   | 1 | 2,760,371.00 | 0.76% | 2,513.04 | 0.77% | - |
| 宏源证券   | 1 | 1,205,296.36 | 0.33% | 1,066.57 | 0.32% | - |
| 中信建投证券 | 1 | 1,097,211.90 | 0.30% | 998.94   | 0.30% | - |
| 国信证券   | 1 | 1,093,591.00 | 0.30% | 967.74   | 0.29% | - |

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：共用同一托管人的其他席位，无新租。

#### 10.7.2 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<br>比例 | 成交金额           | 占当期回购成交总额的<br>比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的<br>比例 |
| 招商证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 首创证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 安信证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 瑞银证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 中金公司 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 红塔证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 东方证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 齐鲁证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 光大证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 兴业证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 浙商证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 方正证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 国联证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 渤海证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 中信证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 广发证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 中银证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 天风证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 民生证券 | -    | -                | -              | -                | -    | -                |
| 国泰君安 | -    | -                | 930,000,000.00 | 7.17%            | -    | -                |

|        |   |   |                  |        |   |   |
|--------|---|---|------------------|--------|---|---|
| 长江证券   | - | - | 7,750,000,000.00 | 59.74% | - | - |
| 华泰证券   | - | - | -                | -      | - | - |
| 财富里昂证券 | - | - | -                | -      | - | - |
| 东兴证券   | - | - | 2,038,000,000.00 | 15.71% | - | - |
| 申银万国   | - | - | 305,000,000.00   | 2.35%  | - | - |
| 宏源证券   | - | - | -                | -      | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | 1,950,000,000.00 | 15.03% | - | - |
| 国信证券   | - | - | -                | -      | - | - |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式                                   | 法定披露日期     |
|----|---|--|------------|
| 1  | 中银优秀企业股票型证券投资基金基金合同生效公告                             | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、<br>www.bocim.com | 2014-01-29 |
| 2  | 中银基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或身份证明文件的公告              | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、<br>www.bocim.com | 2014-02-17 |
| 3  | 中银基金管理有限公司关于调整旗下公募基金对账单服务形式的公告                      | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、<br>www.bocim.com | 2014-03-27 |
| 4  | 中银优秀企业股票型证券投资基金开通网上直销申购、赎回、定期定额投资及基金转换业务并实施交易费率优惠公告 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、<br>www.bocim.com | 2014-03-28 |
| 5  | 中银优秀企业股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告              | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、<br>www.bocim.com | 2014-03-28 |
| 6  | 中银优秀企业股票型证券投资基金 2014 年第 1 季度报告                      | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、<br>www.bocim.com | 2014-04-19 |
| 7  | 中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值方法变更的提示性公告                      | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、<br>www.bocim.com | 2014-04-24 |
| 8  | 中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值方法变更的提示性公告                      | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、<br>www.bocim.com | 2014-04-26 |
| 9  | 中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值方法变更的提示性公告                      | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、<br>www.bocim.com | 2014-05-27 |

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中银优秀企业股票型证券投资基金募集的文件；
- 2、《中银优秀企业股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银优秀企业股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中银优秀企业股票型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人互联网站。

### 11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

中银基金管理有限公司  
二〇一四年八月二十七日