

---

中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金  
2015 年半年度报告  
2015 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：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一五年八月二十六日

---

## §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 24 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 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

---

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
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>	<b>6</b>
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>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
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 .....	39
7.12 投资组合报告附注 .....	39
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
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 .....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	41
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 .....	43
<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	中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中银优选混合
场内简称	中银优选
基金主代码	163807
交易代码	163807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月3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	350,810,174.32 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	依托中国良好的宏观经济发展形势和资本市场的高速成长，投资于能够分享中国经济长期增长的、在所属行业中处于领先地位的上市公司，在控制投资风险的前提下，为基金投资人寻求中长期资本增值机会。
投资策略	本基金的资产配置将贯彻“自上而下”的策略，根据全球宏观形势、中国经济发展（包括经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场动态等），对基金资产在股票、债券和现金三大类资产类别间的配置进行实时监控，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例。 本基金将按照“自上而下”和“自下而上”相结合的方式对各细分行业进行分类、排序和优选。通过对全球经济和产业格局的变化、国家经济政策取向、国内产业结构变动进行定性和定量的综合分析，把握行业基本面发展变化的脉络，评估行业的相对优势，从而对行业进行优选。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深 300 指数；债券投资部分的业绩比较基准为中信标普国债指数。 本基金的整体业绩基准 = 沪深 300 指数 × 65% + 中信标普国债指数 × 35% 。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中银基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	程明	蒋松云
	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
注册地址		上海市银城中路200号中银大厦 45层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市银城中路200号中银大厦 26层、45层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		白志中	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报
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（2015年1月1日至2015年6月30日）
本期已实现收益	421,154,685.93
本期利润	483,283,752.25
加权平均基金份额本期利润	0.8741
本期加权平均净值利润率	48.21%
本期基金份额净值增长率	57.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	338,255,756.55
期末可供分配基金份额利润	0.9642
期末基金资产净值	689,065,930.87
期末基金份额净值	1.9642

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	172.89%

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
过去一个月	-18.54%	3.72%	-4.67%	2.28%	-13.87%	1.44%
过去三个月	10.93%	2.81%	7.90%	1.70%	3.03%	1.11%
过去六个月	57.23%	2.22%	18.42%	1.47%	38.81%	0.75%
过去一年	84.86%	1.73%	64.98%	1.20%	19.88%	0.53%
过去三年	135.41%	1.39%	55.87%	0.97%	79.54%	0.42%
自基金合同生效起至今	172.89%	1.25%	60.65%	1.00%	112.24%	0.25%

#### 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

中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2009年4月3日至2015年6月30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，股票投资的比例范围为基金资产的30%—80%；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为20—70%；其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，持有权证的市场价值不超过基金资产净值的3%。对于中国证监会允许投资的创新金融产品，将依据有关法律法规进行投资管理。

## §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，注册资本为人民币一亿元，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2015年6月30日，本管理人共管理四十九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、中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金、中银新经济灵活配置混合型证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、中银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、中银恒利半年定期开放债券型证券投资基金、中银新动力股票型证券投资基金、中银宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、中银新趋势灵活配置混合型证券投资基金、中银智能制造股票型证券投资基金，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		
王伟	本基金的基金经理、中银美丽中国基金基金经理、中银中小盘基金基金经理、中银智能制造基金基金经理	2015-05-28	-	5	工学硕士。2010 年加入中银基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理。2015 年 2 月至今任中银美丽中国股票基金基金经理，2015 年 3 月至今任中银中小盘基金基金经理，2015 年 5 月至今任中银优选基金基金经理，2015 年 6 月至今任中银智能制造基金基金经理。具有 5 年证券从业年限。具备基金从业资格。
张琦	本基金的基金经理、中银策略基金基金经理、中银健康生活基金基金经理	2011-09-26	2015-05-28	10	中银基金管理有限公司副总裁 (VP)，经济学硕士。2005 年加入中银基金管理有限公司，先后担任研究员、基金经理助理等职。2010 年 7 月至 2014 年 1 月任中银增长基金基金经理，2011 年 9 月至 2015 年 5 月任中银优选基金基金经理，2013 年 5 月至 2015 年 5 月任中银策略基金基金经理，2014 年 5 月至 2015 年 5 月任中银健康生活基金基

					金经理。具有 10 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办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》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

今年上半年，主要经济体经济态势出现一些积极变化，各国货币政策也发生细微调整。美国经济一季度复苏放缓，但就业市场持续改善，通胀压力依然温和，美联储推迟加息，但仍维持逐步回归货币政策正常化轨道方向。欧洲经济重新恢复增长，通缩风险降低，欧央行继续宽松政策，但并未加码力度。欧美与俄罗斯就乌克兰关系略有缓和，但仍无和解。原油价格上半年探底后于二季度有明显回升，但仍在较低水平徘徊。国内方面，房地产销售企稳回升，房价开始止跌回升，但房地

---

产投资增速放缓趋势未变；消费增长依然徘徊不前，出口增长乏力，使得总需求不旺，宏观经济下行压力持续存在。受产能过剩、总需求不旺和国际大宗商品低位徘徊共同影响，物价维持低位，工业品价格连续通缩。央行上半年连续降息降准，但金融系统信用扩张动力减弱。

## 2. 行情回顾

上半年国内股市冲高后大幅回落，上证指数和创业板指数最高点分别越过 5000 点和 4000 点，两市日成交量也大幅放大到 2 万亿以上。但进入 6 月份后市场出现快速大幅下跌，截止 6 月底，上证指数上半年上涨 32.23%，创业板指数上涨 94.23%，尽管指数累计涨幅仍较大，但整体市场出现巨大波动，前期涨幅较大股票回调明显。特别是由于对场外配资等杠杆资金的清理，加剧了 6 月份市场下跌的速率。

## 3. 运行分析

报告期内，基金在上半年前期保持积极的投资策略，随着市场的变化，调整成较低的仓位，但由于市场下跌较快，净值有所回撤。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金的单位净值为 1.9642 元，本基金的累计单位净值为 2.3692 元。报告期内本基金份额净值增长率为 57.23%，同期业绩比较基准收益率为 18.42%。

## 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 2015 年下半年，全球经济整体将延续弱复苏与低通胀的格局，全球多数国家也将延续相对宽松的货币政策；但美国货币政策逐步趋紧，成为全球经济与宏观政策值得关注的分化。国内方面，经济有望逐步寻底企稳，通胀在低位水平回升是大概率事件。特别是猪周期也已温和启动，预计通胀或在下半年持续温和回升。因此在宏观层面，美元加息和猪肉价格引起的通胀回升将是我们关注的两个主要风险点。

A 股市场在 6 月份以来经历了前所未有的大幅调整，但管理层也出台了多项积极呵护市场的措施，我们预计市场有望逐步企稳。但经历过一轮资金去杠杆以后，我们判断市场风险偏好将有大幅下降，整体成交量也会下降，市场需要一定的时间来恢复信心，因此下半年市场可能整体呈震荡状态。

我们维持对中长期中国股市相对乐观的看法，并以积极的心态寻找未来的投资机会。同时我们会根据市场整体的变化，加大研究力度，进一步精选个股，继续站在行业景气度和产业链的角度，优选处于行业龙头地位、具有核心竞争力的优秀公司，同时加大对高景气度行业的配置力度，从而获得长期的投资回报。

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，由权益投资管理部、固定收益投资管理部、研究部、风险管理部、基金运营部、法律合规部和信息披露相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基

---

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

#### 4.6.2 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

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 50%。

本基金于 2015 年 1 月 14 日发布公告，以 2014 年 12 月 31 日可供分配收益为基准，按照 1.45 元/10 份基金份额的分配比例，对 2014 年利润进行分配。

权益登记日：2015 年 1 月 19 日；

除息日：2015 年 1 月 20 日（场内），2015 年 1 月 19 日（场外）；

现金红利发放日：2015 年 1 月 21 日。

本次利润分配共计分配利润 72,700,417.19 元，其中现金红利发放 51,303,040.21 元，红利再投 21,397,376.98 元。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §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，本基金托管人在对银行业优选灵活配置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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中银行业优选灵活配置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行业优选灵活配置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，中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配，分配金额为72,700,417.19元。

## 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

本托管人依法对中银基金管理有限公司编制和披露的中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金2015年半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

2015年8月20日

## §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：中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	114,859,605.55	28,004,252.14
结算备付金		415,848.73	1,801,083.23
存出保证金		332,712.94	189,860.93
交易性金融资产	6.4.7.2	639,314,867.58	654,895,152.73
其中：股票投资		526,175,832.98	564,682,176.13
基金投资		-	-
债券投资		113,139,034.60	90,212,976.60
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	-	69,750,224.63
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,402,949.58	2,192,202.26

应收股利		-	-
应收申购款		1,596,136.26	2,160,933.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>757,922,120.64</b>	<b>758,993,708.95</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014年12月31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		4,630,486.24	16,953,105.82
应付赎回款		61,256,839.10	4,002,957.19
应付管理人报酬		1,196,547.58	952,656.62
应付托管费		199,424.59	158,776.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,233,482.54	797,191.49
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	339,409.72	81,041.10
负债合计		68,856,189.77	22,945,728.34
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	6.4.7.9	350,810,174.32	532,383,559.74
未分配利润	6.4.7.10	338,255,756.55	203,664,420.87
所有者权益合计		689,065,930.87	736,047,980.61
负债和所有者权益总计		757,922,120.64	758,993,708.95

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.9642 元，基金份额总额 350,810,174.32 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>495,249,233.76</b>	<b>31,334,095.69</b>
1.利息收入		3,006,773.45	932,649.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	509,079.88	80,226.73
债券利息收入		2,035,399.80	850,534.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		462,293.77	1,888.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		428,506,301.01	15,454,132.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	423,545,842.82	14,113,175.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,103,009.61	-
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	2,857,448.58	1,340,957.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	62,129,066.32	14,924,134.85
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	1,607,092.98	23,178.31
<b>减：二、费用</b>		<b>11,965,481.51</b>	<b>3,023,054.43</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	7,419,582.28	2,105,378.78
2. 托管费	6.4.10.2	1,236,597.04	350,896.47
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,154,359.31	417,745.96
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	154,942.88	149,033.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>483,283,752.25</b>	<b>28,311,041.26</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>483,283,752.25</b>	<b>28,311,041.26</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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	532,383,559.74	203,664,420.87	736,047,980.61

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	483,283,752.25	483,283,752.25
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)	-181,573,385.42	-275,991,999.38	-457,565,384.80
其中: 1.基金申购款	543,538,193.71	412,525,776.93	956,063,970.64
2.基金赎回款	-725,111,579.13	-688,517,776.31	-1,413,629,355.44
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)	-	-72,700,417.19	-72,700,417.19
五、期末所有者权益(基金净值)	350,810,174.32	338,255,756.55	689,065,930.87
项目	上年度可比期间		
	2014年1月1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)	242,638,238.94	31,936,074.52	274,574,313.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,311,041.26	28,311,041.26
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)	49,580,548.95	7,992,128.01	57,572,676.96
其中: 1.基金申购款	92,542,644.12	14,260,861.82	106,803,505.94
2.基金赎回款	-42,962,095.17	-6,268,733.81	-49,230,828.98
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)	-	-16,847,919.35	-16,847,919.35
五、期末所有者权益(基金净值)	292,218,787.89	51,391,324.44	343,610,112.33

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

中银行业优选灵活配置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”）证监许可[2009]7 号文《关于核准中银行业优选灵活配置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 2009 年 4 月 3 日正式生效，首次设立募集规模为 1,997,370,143.50 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、各类有价债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。本基金的股票投资主要集中在具有行业领先地位的上市公司股票。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×65% + 中信标普国债指数×35%

#### 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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

1、为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），经与相关托管银行、会计师事务所协商一致，自 2015 年 3 月 30 日起，本公司对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。于 2015 年 3 月 30 日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

2、本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 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。

#### 6.4.6 税项

##### (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。

#### (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。

#### (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 2015年6月30日
活期存款	114,859,605.55
定期存款	-

其他存款	-
合计	114,859,605.55

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	394,016,123.77	526,175,832.98	132,159,709.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,563,000.00	2,393,034.60
	银行间市场	110,185,210.00	110,746,000.00
	合计	111,748,210.00	113,139,034.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	505,764,333.77	639,314,867.58	133,550,533.81

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	18,662.76
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	168.48
应收债券利息	1,383,983.52
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	134.82
合计	1,402,949.58

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,233,232.54
银行间市场应付交易费用	250.00
合计	1,233,482.54

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	196,061.00
预提费用	143,348.72
其他	-
合计	339,409.72

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	532,383,559.74	532,383,559.74
本期申购	543,538,193.71	543,538,193.71
本期赎回（以“-”号填列）	-725,111,579.13	-725,111,579.13
本期末	350,810,174.32	350,810,174.32

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
上年度末	149,538,281.67	54,126,139.20	203,664,420.87

本期利润	421,154,685.93	62,129,066.32	483,283,752.25
本期基金份额交易产生的变动数	-142,348,271.96	-133,643,727.42	-275,991,999.38
其中：基金申购款	163,863,575.18	248,662,201.75	412,525,776.93
基金赎回款	-306,211,847.14	-382,305,929.17	-688,517,776.31
本期已分配利润	-72,700,417.19	-	-72,700,417.19
本期末	355,644,278.45	-17,388,521.90	338,255,756.55

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月1日至2015年6月30日	
活期存款利息收入	484,077.69	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	17,463.23	
其他	7,538.96	
合计	509,079.88	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月1日至2015年6月30日	
卖出股票成交总额	1,223,296,671.56	
减：卖出股票成本总额	799,750,828.74	
买卖股票差价收入	423,545,842.82	

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月1日至2015年6月30日	
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,103,009.61	
债券投资收益——赎回差价收入	-	
债券投资收益——申购差价收入	-	

合计	2,103,009.61
----	--------------

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	93,782,028.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	88,458,248.15
减：应收利息总额	3,220,771.04
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,103,009.61

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,857,448.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,857,448.58

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	62,129,066.32
——股票投资	62,620,164.84
——债券投资	-491,098.52
——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	62,129,066.32

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	1,535,368.14
转换费收入	71,724.84
合计	1,607,092.98

注：1、本基金场内的赎回费率为0.5%，场外的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

2、2010年3月15日前，本基金的转换费总额的25%归入转出基金的基金资产。根据《中银基金管理有限公司关于调整旗下基金转换业务规则的公告》，自2010年3月15日起，本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	3,153,484.31
银行间市场交易费用	875.00
合计	3,154,359.31

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	99,177.14
银行间账户维护费	13,500.00
银行汇划费	2,394.16
其他	200.00
合计	154,942.88

#### 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

无。

##### 6.4.8.2资产负债表日后事项

无。

#### 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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 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 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,419,582.28	2,105,378.78
其中：支付销售机构的客户维护费	647,913.09	299,879.40

注：支付基金管理人中银基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计

提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,236,597.04	350,896.47

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

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 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

单位：人民币元

本期						
2015年1月1日至2015年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2014年1月1日至2014年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	10,072,909.45	-	-	-	-	-

#### 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固有资金投资本基金的情况

无。

##### 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

无。

#### 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30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	114,859,605.55	484,077.69	41,735,621.30	76,069.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

报告期内本基金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

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2015-01-19	2015-01-20	2015-01-19	1.450	51,303,040.21	21,397,376.98	72,700,417.19	-
合计				1.450	51,303,040.21	21,397,376.98	72,700,417.19	-

#### 6.4.12 期末（2015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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000008	神州高铁	2015-03-12	重大事项停牌	31.45	2015-07-02	29.56	1,000,358	15,617,149.19	31,461,259.10	-
600872	中炬高新	2015-05-04	重大事项停牌	23.17	-	-	1,300,828	11,427,698.02	30,140,184.76	-
300012	华测检	2015-06-1	重大事	30.80	2015-07	38.76	544,031	12,297,868.76	16,756,154.80	-

	测	5	项停牌		-27					
000558	莱茵置业	2015-06-15	重大事项停牌	26.11	2015-07-13	29.52	440,668	10,467,489.80	11,505,841.48	-
300431	暴风科技	2015-06-11	重大事项停牌	307.56	2015-07-13	276.80	273	1,949.22	83,963.88	-

### 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

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临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以上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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与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 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.35%(2014 年 12 月 31 日：2.73%)。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年末 2014年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	110,746,000.00	-
合计	110,746,000.00	-

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年末 2014年12月31日
AAA	2,393,034.60	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	2,393,034.60	-

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。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公司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 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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因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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产及部分应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	114,859,605.55	-	-	-	114,859,605.55
结算备付金	415,848.73	-	-	-	415,848.73
存出保证金	332,712.94	-	-	-	332,712.94
交易性金融资产	113,139,034.60	-	-	526,175,832.98	639,314,867.58
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,402,949.58	1,402,949.58
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	256,659.47	-	-	1,339,476.79	1,596,136.26
<b>资产总计</b>	<b>229,003,861.29</b>	-	-	<b>528,918,259.35</b>	<b>757,922,120.64</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	4,630,486.24	4,630,486.24
应付赎回款	-	-	-	61,256,839.10	61,256,839.10
应付管理人报酬	-	-	-	1,196,547.58	1,196,547.58
应付托管费	-	-	-	199,424.59	199,424.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,233,482.54	1,233,482.54
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	339,409.72	339,409.72

负债总计	-	-	-	68,856,189.77	68,856,189.77
利率敏感度缺口	229,003,861.29	-	-	460,062,069.58	689,065,930.87
<b>上年度末 2014年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1至5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	28,004,252.14	-	-	-	28,004,252.14
结算备付金	1,801,083.23	-	-	-	1,801,083.23
存出保证金	189,860.93	-	-	-	189,860.93
交易性金融资产	70,099,000.00	20,113,976.60	-	564,682,176.13	654,895,152.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	69,750,224.63	-	-	-	69,750,224.63
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,192,202.26	2,192,202.26
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	948,102.68	-	-	1,212,830.35	2,160,933.03
<b>资产总计</b>	<b>170,792,523.61</b>	<b>20,113,976.60</b>	-	<b>568,087,208.74</b>	<b>758,993,708.95</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	16,953,105.82	16,953,105.82
应付赎回款	-	-	-	4,002,957.19	4,002,957.19
应付管理人报酬	-	-	-	952,656.62	952,656.62
应付托管费	-	-	-	158,776.12	158,776.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	797,191.49	797,191.49
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	81,041.10	81,041.10
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>22,945,728.34</b>	<b>22,945,728.34</b>
利率敏感度缺口	170,792,523.61	20,113,976.60	-	545,141,480.40	736,047,980.61

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

假设	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；</li> <li>2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；</li> <li>3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；</li> <li>4. 银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益和卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影</li> </ol>
----	--

	响；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	市场利率上升25个基点	减少约18	减少约21
	市场利率下降25个基点	增加约18	增加约22

#### 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，股票投资的比例范围为基金资产的30%—80%；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具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比例范围为20—70%，持有权证的市值不超过基金资产净值的3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。对于中国证监会允许投资的创新金融产品，将依据有关法律法规进行投资管理。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，通过特定指标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 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	526,175,832.98	76.36	564,682,176.13	76.72

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	113,139,034.60	16.42	90,212,976.60	12.26
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>639,314,867.58</b>	<b>92.78</b>	<b>654,895,152.73</b>	<b>88.97</b>

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约 3,327	增加约 3,104
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	减少约 3,327	减少约 3,104

#### 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	526,175,832.98	69.42
	其中：股票	526,175,832.98	69.42
2	固定收益投资	113,139,034.60	14.93
	其中：债券	113,139,034.60	14.93
	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	115,275,454.28	15.21
7	其他各项资产	3,331,798.78	0.44
8	合计	757,922,120.64	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	-	-
C	制造业	290,021,715.10	42.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,402,940.25	1.22
F	批发和零售业	6,866,844.00	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	10,134,424.00	1.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	128,515,024.35	18.65
J	金融业	-	-
K	房地产业	19,473,461.48	2.83
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	26,480,834.80	3.84
N	水利、环境和公共设施管理业	19,807,093.00	2.87
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	16,473,496.00	2.39
S	综合	-	-
	合计	526,175,832.98	76.36

## 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	000008	神州高铁	1,000,358	31,461,259.10	4.57
2	600271	航天信息	470,000	30,413,700.00	4.41
3	600872	中炬高新	1,300,828	30,140,184.76	4.37
4	002055	得润电子	449,980	26,044,842.40	3.78
5	000555	神州信息	325,203	24,325,184.40	3.53
6	600446	金证股份	185,495	22,901,212.70	3.32
7	600570	恒生电子	182,922	20,496,410.10	2.97
8	002008	大族激光	600,130	17,235,733.60	2.50
9	300012	华测检测	544,031	16,756,154.80	2.43
10	002405	四维图新	379,266	16,611,850.80	2.41
11	002699	美盛文化	419,600	16,473,496.00	2.39
12	002690	美亚光电	407,272	15,993,571.44	2.32
13	002402	和而泰	532,604	15,498,776.40	2.25
14	600571	信雅达	143,967	15,238,906.95	2.21
15	000802	北京文化	516,300	15,029,493.00	2.18
16	002376	新北洋	813,023	14,553,111.70	2.11
17	603008	喜临门	734,026	13,829,049.84	2.01
18	000558	莱茵置业	440,668	11,505,841.48	1.67
19	300351	永贵电器	298,160	11,434,436.00	1.66
20	600422	昆药集团	283,743	10,478,628.99	1.52
21	600125	铁龙物流	656,800	10,134,424.00	1.47
22	002488	金固股份	310,411	10,082,149.28	1.46
23	300332	天壕节能	385,900	9,724,680.00	1.41
24	300358	楚天科技	217,374	9,297,085.98	1.35
25	300314	戴维医疗	213,024	8,516,699.52	1.24

26	000090	天健集团	346,513	8,402,940.25	1.22
27	002318	久立特材	158,743	8,314,958.34	1.21
28	600325	华发股份	440,200	7,967,620.00	1.16
29	300295	三六五网	67,219	7,756,400.41	1.13
30	002126	银轮股份	364,000	7,338,240.00	1.06
31	600596	新安股份	507,200	7,070,368.00	1.03
32	600122	宏图高科	418,200	6,866,844.00	1.00
33	300167	迪威视讯	182,900	6,791,077.00	0.99
34	002273	水晶光电	215,931	6,747,843.75	0.98
35	002331	皖通科技	214,500	6,302,010.00	0.91
36	300356	光一科技	113,500	5,743,100.00	0.83
37	000971	蓝鼎控股	224,500	5,354,325.00	0.78
38	000888	峨眉山 A	320,000	4,777,600.00	0.69
39	002280	联络互动	89,500	4,770,350.00	0.69
40	002188	新嘉联	108,400	3,388,584.00	0.49
41	002315	焦点科技	33,699	3,235,104.00	0.47
42	300326	凯利泰	38,900	1,083,365.00	0.16
43	300431	暴风科技	273	83,963.88	0.01
44	002373	千方科技	59	2,554.11	0.00
45	600597	光明乳业	74	1,702.00	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	300059	东方财富	26,942,379.60	3.66

2	600685	中船防务	23,132,632.69	3.14
3	000802	北京文化	21,030,780.00	2.86
4	002273	水晶光电	20,944,074.64	2.85
5	600566	济川药业	20,805,995.83	2.83
6	002405	四维图新	20,754,607.62	2.82
7	002699	美盛文化	18,776,659.98	2.55
8	002366	丹甫股份	18,409,535.00	2.50
9	002055	得润电子	17,418,312.26	2.37
10	600594	益佰制药	17,411,874.21	2.37
11	600547	山东黄金	17,388,201.15	2.36
12	300351	永贵电器	16,830,952.08	2.29
13	300012	华测检测	16,225,736.49	2.20
14	300314	戴维医疗	15,203,614.50	2.07
15	000002	万科 A	14,669,350.00	1.99
16	002315	焦点科技	14,271,347.68	1.94
17	002262	恩华药业	14,134,701.31	1.92
18	300332	天壕节能	14,020,339.00	1.90
19	002293	罗莱家纺	13,984,612.84	1.90
20	300358	楚天科技	13,980,466.60	1.90

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	000002	万科 A	55,020,570.50	7.48
2	600446	金证股份	48,922,867.77	6.65

3	002657	中科金财	41,820,730.88	5.68
4	002366	丹甫股份	35,510,075.23	4.82
5	002281	光迅科技	32,527,212.37	4.42
6	002055	得润电子	29,097,902.76	3.95
7	002467	二六三	28,891,271.11	3.93
8	600597	光明乳业	27,385,063.52	3.72
9	600594	益佰制药	26,248,242.72	3.57
10	600685	中船防务	25,496,266.00	3.46
11	000977	浪潮信息	25,194,604.76	3.42
12	600398	海澜之家	24,866,166.45	3.38
13	600566	济川药业	24,190,615.72	3.29
14	300339	润和软件	23,729,136.93	3.22
15	002402	和而泰	23,338,618.00	3.17
16	300059	东方财富	23,040,604.98	3.13
17	600588	用友网络	22,942,566.39	3.12
18	002293	罗莱家纺	22,506,169.52	3.06
19	002373	千方科技	22,078,103.00	3.00
20	600875	东方电气	21,334,422.29	2.90
21	300351	永贵电器	21,211,782.00	2.88
22	601058	赛轮金宇	20,228,564.76	2.75
23	002315	焦点科技	19,712,083.61	2.68
24	600547	山东黄金	19,032,614.37	2.59
25	300295	三六五网	18,552,691.63	2.52
26	600287	江苏舜天	17,640,737.97	2.40
27	002438	江苏神通	17,444,123.39	2.37
28	600292	中电远达	17,122,183.00	2.33

29	002318	久立特材	16,933,449.12	2.30
30	600271	航天信息	16,613,148.31	2.26
31	601098	中南传媒	16,220,179.60	2.20
32	600869	智慧能源	16,077,796.00	2.18
33	300012	华测检测	15,727,436.43	2.14
34	600867	通化东宝	15,711,915.95	2.13
35	600570	恒生电子	15,609,524.70	2.12
36	002397	梦洁家纺	15,313,303.70	2.08
37	002262	恩华药业	15,257,603.41	2.07
38	600885	宏发股份	15,237,962.45	2.07
39	000513	丽珠集团	15,196,827.90	2.06

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	698,624,320.75
卖出股票的收入（成交）总额	1,223,296,671.56

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	110,746,000.00	16.07
	其中：政策性金融债	110,746,000.00	16.07
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,393,034.60	0.35
8	其他	-	-
9	合计	113,139,034.60	16.42

## 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	150202	15 国开 02	700,000	70,378,000.00	10.21
2	150206	15 国开 06	400,000	40,368,000.00	5.86
3	110031	航信转债	12,220	1,775,688.20	0.26
4	113008	电气转债	3,410	617,346.40	0.09

## 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

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

## 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	332,712.94
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	1,402,949.58
5	应收申购款	1,596,136.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,331,798.78

#### 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债。

#### 7.12.5 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	000008	神州高铁	31,461,259.10	4.57	重大事项停牌
2	600872	中炬高新	30,140,184.76	4.37	重大事项停牌
3	300012	华测检测	16,756,154.80	2.43	重大事项停牌

#### 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
16,286	21,540.60	71,772,595.31	20.46%	279,037,579.01	79.54%

### 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本基金	188,419.30	0.0537%

### 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
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（2009年4月3日）基金份额总额	1,997,370,143.50
本报告期期初基金份额总额	532,383,559.74
本报告期基金总申购份额	543,538,193.71
减：本报告期基金总赎回份额	725,111,579.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	350,810,174.32

### §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

本基金管理人第三届董事会任期届满，经公司 2015 年第一次股东会议审议通过，选举白志中先生、李道滨先生、赵春堂先生、宋福宁先生、葛岱炜（David Graham）先生担任公司第四届董事会董事，选举朱善利先生、荆新先生、赵欣舸先生、雷晓波（Edward Radcliffe）先生担任公司第四届董事会独立董事。其中，白志中先生、赵春堂先生、宋福宁先生为公司新任董事，赵欣舸先生、雷晓波（Edward Radcliffe）先生为公司新任独立董事。经公司第四届董事会第一次会议审议通过，选举白志中先生担任公司第四届董事会董事长。公司第三届董事会成员谭炯先生、梅非奇先生不再担任公司董事职务，葛礼（Gary Rieschel）先生不再担任公司独立董事职务。上述事项已报相关机构备案，详情请参见 2015 年 3 月 19 日刊登的《中银基金管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告》。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

#### 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	
中银证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	3	762,989,893.59	39.70%	675,170.66	39.31%	-
中金公司	2	488,751,084.68	25.43%	432,496.78	25.18%	-
东方证券	1	316,405,841.04	16.46%	288,055.79	16.77%	-
安信证券	2	104,453,772.94	5.44%	95,094.88	5.54%	-
国信证券	1	102,683,876.00	5.34%	93,483.03	5.44%	-
申银万国	1	82,132,059.87	4.27%	74,772.90	4.35%	-
国元证券	1	31,622,668.39	1.65%	28,789.06	1.68%	-
广发证券	1	23,330,124.94	1.21%	21,239.56	1.24%	-
中信建投证券	1	6,338,253.74	0.33%	5,770.25	0.34%	-
国泰君安	1	3,075,556.00	0.16%	2,799.88	0.16%	-

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：本报告期新增租赁华创证券深圳交易单元 396306。无退租。

### 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
中银证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	300,000,000.00	25.64%	-	-
国信证券	127,277.70	0.61%	-	-	-	-
申银万国	20,584,028.80	99.39%	770,000,000.00	65.81%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	100,000,000.00	8.55%	-	-

### 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》、www.bocim.com	2015-01-14
2	中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金分红公告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-01-14
3	中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金2014年第4季度报告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-01-20
4	中银基金管理有限公司关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构并开通基金定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-01-27
5	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》、www.bocim.com	2015-02-06
6	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》、www.bocim.com	2015-03-17
7	中银基金管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-03-19

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》、www.bocim.com	2015-03-24
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》、www.bocim.com	2015-03-26
10	中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金2014年年度报告（摘要）	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-03-27
11	中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金2014年年度报告	www.bocim.com	2015-03-27
12	中银基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-03-31
13	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行电子银行申购业务费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-04-01
14	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》、www.bocim.com	2015-04-01
15	中银基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-04-15
16	中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金2015年第1季度报告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-04-22
17	中银基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或身份证明文件的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-04-23
18	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》、www.bocim.com	2015-04-24
19	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业银行网银申购业务费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-04-30
20	中银基金管理有限公司关于在电子直销平台开通中国银行快捷支付业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-05-15
21	中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2015年第1号）	www.bocim.com	2015-05-18
22	中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2015年第1号）	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-05-18
23	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》、www.bocim.com	2015-05-21
24	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》、www.bocim.com	2015-05-29
25	中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-05-30
26	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》、www.bocim.com	2015-06-17
27	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》、www.bocim.com	2015-06-19
28	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估	《上海证券报》、《中国证	2015-06-20

	值方法变更的提示性公告	券报》、www.bocim.com	
29	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、www.bocim.com	2015-06-30

## §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行业优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中银行业优选灵活配置混合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  
二〇一五年八月二十六日