

**中银收益混合型证券投资基金**  
**2015 年年度报告摘要**  
**2015 年 12 月 31 日**

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月二十五日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金简称       | 中银收益混合             |
| 场内简称       | 中银收益               |
| 基金主代码      | 163804             |
| 交易代码       | 163804             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2006 年 10 月 11 日   |
| 基金管理人      | 中银基金管理有限公司         |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 1,224,953,379.75 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

## 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在长期投资的基础上，将战略资产配置与择时相结合，通过投资于中国证券市场现金股息率高、分红稳定的上市公司和国内依法公开发行上市的各种债券，致力于为投资者提供稳定的当期收益和长期的资本增值。   |
| 投资策略   | 本基金采取自上而下的资产配置与自下而上相结合的主动投资管理策略，股票投资将运用量化的数量模型、严谨的财务、企业竞争力和治理能力分析以及价值评估，并配合持续深入的跟踪调研，精选兼具良好财务品质、稳定分红能力、高股息和持续盈利增长潜力的上市公司股票；债券投资将分析判断债券市场的走势，采取不同的收益率曲线策略、积极的久期管理、信用风险评估、收益率利差配置策略等投资策略，力求获取高于业绩基准的投资回报。 |
| 业绩比较基准 | 本基金股票投资部分的业绩比较基准为富时中国 A 股红利 150 指数；债券投资部分的业绩比较基准为中证国债指数。本基金的整体业绩基准 = 富时中国 A 股红利 150 指数×60% + 中证国债指数×30% + 同业存款利率×10%  |
| 风险收益特征 | 本基金是主动型的混合基金，由于投资对象将包括上市公司证券及其它有  |

|  |                           |
|--|---------------------------|
|  | 价债券，因此本基金属于证券投资基金中等风险的品种。 |
|--|---------------------------|

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                     | 基金托管人               |
|-------------|------|---------------------------|---------------------|
| 名称          |      | 中银基金管理有限公司                | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 薛文成                       | 洪渊                  |
|             | 联系电话 | 021-38834999              | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | clientservice@bocim.com   | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 021-38834788 400-888-5566 | 95588               |
| 传真          |      | 021-68873488              | 010-66105798        |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址 | <a href="http://www.bocim.com">http://www.bocim.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市银城中路 200 号中银大厦 26 层                                  |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2015 年           | 2014 年           | 2013 年           |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 1,387,257,891.04 | 432,780,263.33   | 712,597,427.82   |
| 本期利润          | 1,340,221,411.58 | 428,437,270.57   | 879,919,943.42   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.8038           | 0.1230           | 0.2475           |
| 本期基金份额净值增长率   | 46.44%           | 13.45%           | 28.22%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末          | 2014 年末          | 2013 年末          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.7620           | 0.2896           | 0.1960           |
| 期末基金资产净值      | 2,158,418,361.48 | 3,241,203,179.19 | 5,078,340,535.02 |
| 期末基金份额净值      | 1.7620           | 1.2896           | 1.1960           |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平

要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配收益，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

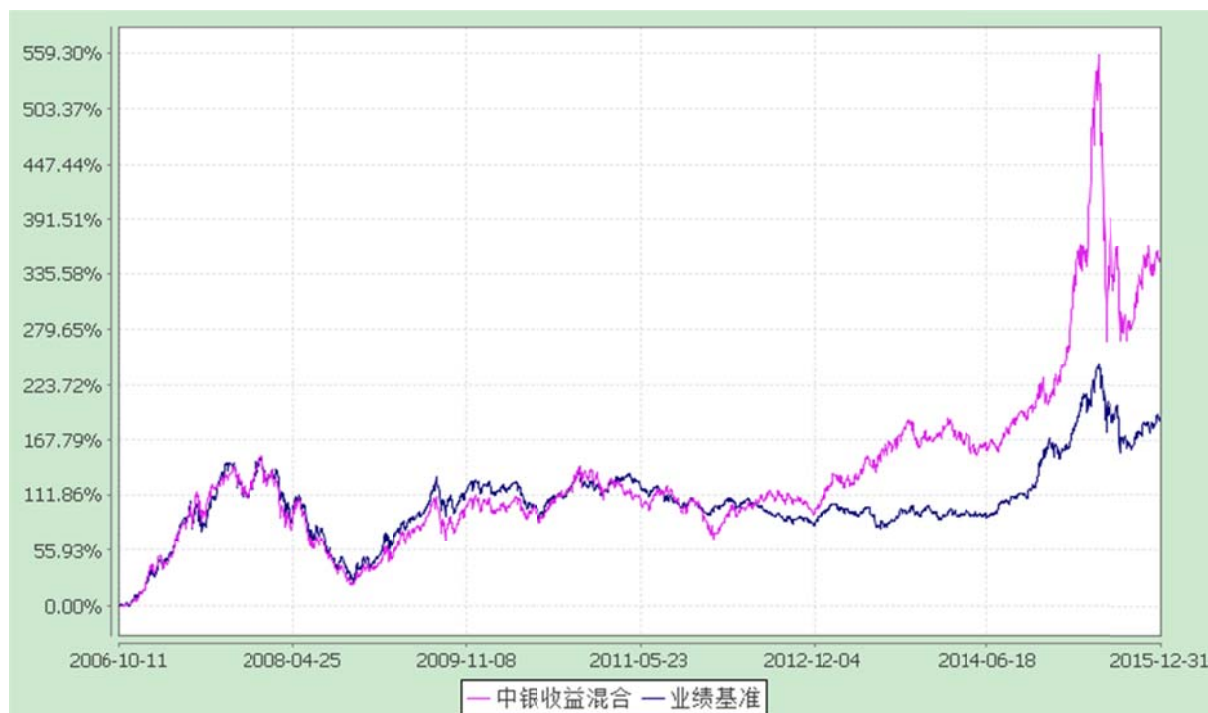
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 17.39%   | 1.51%       | 11.25%     | 0.94%         | 6.14%   | 0.57% |
| 过去六个月      | -9.81%   | 2.62%       | -9.04%     | 1.65%         | -0.77%  | 0.97% |
| 过去一年       | 46.44%   | 2.55%       | 10.28%     | 1.54%         | 36.16%  | 1.01% |
| 过去三年       | 113.01%  | 1.71%       | 47.85%     | 1.07%         | 65.16%  | 0.64% |
| 过去五年       | 92.61%   | 1.46%       | 29.90%     | 0.94%         | 62.71%  | 0.52% |
| 自基金合同生效起至今 | 348.26%  | 1.54%       | 188.80%    | 1.22%         | 159.46% | 0.32% |

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银收益混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年10月11日至2015年12月31日)

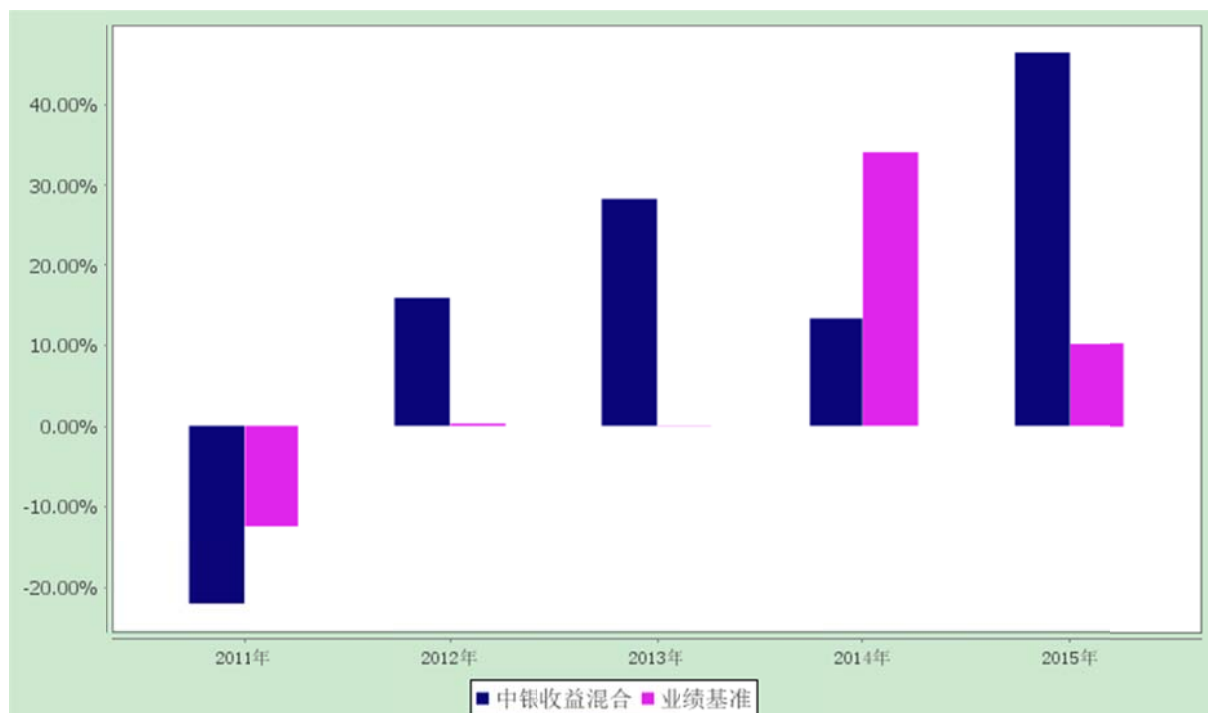


注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分（二）的规定，即本基金投资组合中股票资产投资比例为 30-90%，债券资产比例为 0-65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券类资产比例最低不低于 5%。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银收益混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度    | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发放总额      | 年度利润分配合计       | 备注 |
|-------|-------------|----------------|----------------|----------------|----|
| 2015年 | 0.900       | 142,304,196.69 | 78,507,435.38  | 220,811,632.07 | -  |
| 2014  | 0.600       | 162,219,377.52 | 100,049,655.73 | 262,269,033.25 | -  |
| 2013  | -           | -              | -              | -              | -  |
| 合计    | 1.500       | 304,523,574.21 | 178,557,091.11 | 483,080,665.32 | -  |

## §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2015年12月31日，本管理人共管理五十六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、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金、中银动态策略混合型证券投资基金、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、中银中小盘成长混合型证券投资基金、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)、中银主题策略混合型证券投资基金、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、中银消费主题混合型证券投资基金、中银美丽中国混合型证券投资基金、中银盛利纯债一年定期开放债券型证券投资基金 (LOF)、中银新回报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、中银优秀企业混合型证券投资基金、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、中银健康生活混合型证券投资基金、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、中银互联网+股票型证券投资基金、中银国有企业债债券型证券投资基金、中银新财富灵活配置混合型证券投资基金、中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中银战略新兴产业股票型证券投资基金、中银机构现金管理货币市场基金、中银美元债债券型证券投资基金 (QDII)，同时管理着多个特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务                 | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                       |
|----|--------------------|-----------------|------|--------|--|
|    |                    | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 陈军 | 本基金的基金经理、中银中国基金基金经 | 2006-10-11      | -    | 17     | 中银基金管理有限公司副执行总裁，金融学硕士。曾任中信证券股份有限公司资产管理部项 |



|  |         |  |  |  |
|--|---------|--|--|--|
|  | 理、副执行总裁 |  |  | 目经理。2004 年加入中银基金管理有限公司, 2006 年 10 月至今任中银收益基金基金经理, 2009 年 9 月至 2013 年 10 月任中银中证 100 指数基金基金经理, 2013 年 6 月至 2016 年 1 月任中银美丽中国基金基金经理, 2013 年 8 月至今任中银中国基金基金经理。特许金融分析师 (CFA), 香港财经分析师协会会员。具有 17 年证券从业年限。具备基金从业资格。 |
|--|---------|--|--|--|

注: 1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日, 非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期, 基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期;

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定, 严格遵循本基金基金合同, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内, 本基金运作合法合规, 无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》, 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。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

本报告期内，本公司通过对公司管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，并对连续四个季度的不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资合同向交易的交易价差进行分析，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

##### 1. 宏观经济分析

刚刚过去的 2015 年，主要经济体经济态势出现明显分化，各国货币政策也分化明显。欧央行多措并举，加大了宽松力度。美国经济整体维持复苏态势，制造业 PMI 全年都处于较强的扩张区域，消费者信心指数依然保持较高水平，就业市场持续改善，实现了低通胀，较高增长的宏观局面。美联储逐步退出量化宽松，货币政策在正常化通道中。新兴市场经济体货币政策出现分化，外部环境复杂性增加导致政策制定难度进一步加大。

从国内具体情况看，宏观经济步入微通缩周期，经济增速呈现托底式下滑。稳定经济区间运行，以调结构、促改革释放经济增长动力成为共识，积极的财政政策和稳健的货币政策内涵与以往也有所不同，宏观经济调控方式、宏观经济指标与实体经济相互关系都发生变化，经济环境和政策方式进入新常态。

##### 2. 行情回顾

全年股票市场经历了前所未有的巨幅波动。上半年在外围杠杆资金的涌入下，上证指数一度大涨越过 5000 点，但随后又在 6 月和 8 月出现了两次快速大幅下跌，最终在四季度企稳反弹后，指数

全年上涨 9.4%，创业板指数更是大涨逾 80%。整体来看，中小市值和新兴产业股票取得了较大的涨幅，期间波动也更加明显。

### 3.运行分析

报告期内，基金上半年整体维持较高仓位，结构全面转向成长类行业，为组合贡献了超额回报。6 月份起，伴随着市场的调整，基金逐步降低仓位，持仓结构逐步均衡化，采取较为防守的投资策略，以较低的仓位和质地较好的品种应对下跌。四季度在市场企稳后，主动把握市场的反弹，为基金净值争取了一定的恢复。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日为止，本基金的单位净值为 1.762 元，本基金的累计单位净值为 3.112 元。报告期内本基金份额净值增长率为 46.44%，同期业绩比较基准收益率为 10.28%。

#### 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 2016 年，全球经济仍将继续处于动荡期。美国经济一枝独秀，欧洲持续低迷，日本负利率凶悍，新兴市场经济压力显现，各政府相互博弈的加剧使各主要商品、货币和权益市场都处于大幅波动阶段。经济不稳与地缘政治不稳相互影响，值得密切关注。

国内在新常态下，积极财政政策将发挥更大作用。而货币政策整体稳健。供给侧改革的实施是值得重视的变化。今后一段时间，我们继续关注汇率的波动，以及在汇率因素影响下货币政策的变化。在经历了三年的新兴产业结构性牛市后，我们对估值和风险偏好继续大幅扩张的空间相对谨慎，着重寻找业绩能够兑现或者有超预期利润弹性的细分行业以及龙头公司。

经历过 2015 年的大幅波动以后，我们认为 A 股市场仍然是面临机遇与挑战的环境。我们维持对中国股市短期谨慎，中长期相对乐观的看法。长期看好医疗、教育、军工等刚需强劲的行业，密切关注传统周期行业产能缩减带来的投资机会。2016 年我们会加大研究力度，以更严的要求去寻求高品质个股，与优秀上市公司一同成长。

作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.7.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由研究部、风险管理部、基金运营部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方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金运营部做出提示，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，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值委员会审议，同时按流程对外公布。

#### 4.7.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

#### 4.7.3 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

#### 4.7.4 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同第十五部分基金的收益与分配相关约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 30%。以 2015 年基金的可供分配利润为基准，本基金在本报告期内应分配的金额为 280,039,494.52 元。2016 年 1 月 19 日本基金进行了第一次利润分配，向基金份额持有人每 10 份基金份额派发现金红利 2.50 元，分红总金额为 349,455,483.37 元，该次分配以 2015 年 12 月 31 日为收益分配基准日，属于 2015 年度利润分配事项。

### 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，本基金托管人在对中银收益混合型证券投资基金更新招募说明书的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中银收益混合型证券投资基金更新招募说明书的管理人——中银基金管理有限公司在中银收益混合型证券投资基金更新招募说明书的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中银收益混合型证券投资基金更新招募说明书对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 220,811,632.07 元。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中银基金管理有限公司编制和披露的中银收益混合型证券投资基金更新招募说明书 2015 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

2016 年 3 月 24 日

## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 汤骏 许培菁签字出具了安永华明（2016）审字第 61062100\_B04 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中银收益混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产          | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：         | -                       | -                        |
| 银行存款        | 293,967,334.53          | 83,833,310.22            |
| 结算备付金       | 16,862,460.29           | 5,659,747.89             |
| 存出保证金       | 781,912.28              | 887,384.09               |
| 交易性金融资产     | 1,552,930,887.89        | 2,795,142,747.33         |
| 其中：股票投资     | 1,421,973,737.89        | 2,525,664,444.23         |
| 基金投资        | -                       | -                        |
| 债券投资        | 130,957,150.00          | 269,478,303.10           |
| 资产支持证券投资    | -                       | -                        |
| 贵金属投资       | -                       | -                        |
| 衍生金融资产      | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产    | 436,900,270.00          | 378,170,087.26           |
| 应收证券清算款     | -                       | 15,616,580.50            |
| 应收利息        | 358,463.30              | 8,599,051.95             |
| 应收股利        | -                       | -                        |
| 应收申购款       | 303,181.63              | 11,096,232.23            |
| 递延所得税资产     | -                       | -                        |
| 其他资产        | 300,000.00              | 300,000.00               |
| <b>资产总计</b> | <b>2,302,404,509.92</b> | <b>3,299,305,141.47</b>  |
| 负债和所有者权益    | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
| 负债：         | -                       | -                        |
| 短期借款        | -                       | -                        |
| 交易性金融负债     | -                       | -                        |
| 衍生金融负债      | -                       | -                        |
| 卖出回购金融资产款   | -                       | -                        |

|                   |                         |                         |
|-------------------|-------------------------|-------------------------|
| 应付证券清算款           | 136,900,000.00          | 25,816,767.53           |
| 应付赎回款             | 1,746,303.71            | 24,547,391.64           |
| 应付管理人报酬           | 2,828,330.48            | 4,410,490.07            |
| 应付托管费             | 471,388.43              | 735,081.69              |
| 应付销售服务费           | -                       | -                       |
| 应付交易费用            | 1,937,980.31            | 2,482,463.99            |
| 应交税费              | -                       | -                       |
| 应付利息              | -                       | -                       |
| 应付利润              | -                       | -                       |
| 递延所得税负债           | -                       | -                       |
| 其他负债              | 102,145.51              | 109,767.36              |
| <b>负债合计</b>       | <b>143,986,148.44</b>   | <b>58,101,962.28</b>    |
| <b>所有者权益：</b>     | <b>-</b>                | <b>-</b>                |
| 实收基金              | 1,224,953,379.75        | 2,513,430,348.21        |
| 未分配利润             | 933,464,981.73          | 727,772,830.98          |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>2,158,418,361.48</b> | <b>3,241,203,179.19</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>2,302,404,509.92</b> | <b>3,299,305,141.47</b> |

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7620 元，基金份额总额 1,224,953,379.75 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中银收益混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

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 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b> | <b>1,402,996,430.28</b>          | <b>516,459,796.43</b>            |
| 1.利息收入      | 13,315,868.54                    | 27,813,779.58                    |
| 其中：存款利息收入   | 2,748,611.59                     | 3,700,857.36                     |

|                            |                         |                       |
|----------------------------|-------------------------|-----------------------|
| 债券利息收入                     | 7,953,578.77            | 16,318,416.84         |
| 资产支持证券利息收入                 | -                       | -                     |
| 买入返售金融资产收入                 | 2,613,678.18            | 7,794,505.38          |
| 其他利息收入                     | -                       | -                     |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 1,433,593,945.97        | 490,288,378.83        |
| 其中：股票投资收益                  | 1,420,937,231.73        | 467,023,397.74        |
| 基金投资收益                     | -                       | -                     |
| 债券投资收益                     | 4,401,100.48            | 5,783,926.62          |
| 资产支持证券投资收益                 | -                       | -                     |
| 贵金属投资收益                    | -                       | -                     |
| 衍生工具收益                     | -                       | -                     |
| 股利收益                       | 8,255,613.76            | 17,481,054.47         |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | -47,036,479.46          | -4,342,992.76         |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                       | -                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 3,123,095.23            | 2,700,630.78          |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>62,775,018.70</b>    | <b>88,022,525.86</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 41,689,866.52           | 61,413,873.41         |
| 2. 托管费                     | 6,948,311.08            | 10,235,645.57         |
| 3. 销售服务费                   | -                       | -                     |
| 4. 交易费用                    | 13,699,417.90           | 15,911,655.12         |
| 5. 利息支出                    | 6,595.96                | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 6,595.96                | -                     |
| 6. 其他费用                    | 430,827.24              | 461,351.76            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>1,340,221,411.58</b> | <b>428,437,270.57</b> |
| 减：所得税费用                    | -                       | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>1,340,221,411.58</b> | <b>428,437,270.57</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银收益混合型证券投资基金



本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日      |                   |                   |
|--|---|-------------------|-------------------|
|  | 实收基金  | 未分配利润             | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 2,513,430,348.21                            | 727,772,830.98    | 3,241,203,179.19  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 1,340,221,411.58  | 1,340,221,411.58  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -1,288,476,968.46                           | -913,717,628.76   | -2,202,194,597.22 |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,246,626,228.62                            | 943,968,994.77    | 2,190,595,223.39  |
| 2.基金赎回款                                | -2,535,103,197.08                           | -1,857,686,623.53 | -4,392,789,820.61 |
| 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） | -   | -220,811,632.07   | -220,811,632.07   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,224,953,379.75                            | 933,464,981.73    | 2,158,418,361.48  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |                   |                   |
|  | 实收基金  | 未分配利润             | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 4,245,983,151.33                            | 832,357,383.69    | 5,078,340,535.02  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本                   | -   | 428,437,270.57    | 428,437,270.57    |

|  |                   |                 |                   |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|
| 期利润)                                   |                   |                 |                   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -1,732,552,803.12 | -270,752,790.03 | -2,003,305,593.15 |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,087,203,183.22  | 183,818,580.60  | 1,271,021,763.82  |
| 2.基金赎回款                                | -2,819,755,986.34 | -454,571,370.63 | -3,274,327,356.97 |
| 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) | -                 | -262,269,033.25 | -262,269,033.25   |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 2,513,430,348.21  | 727,772,830.98  | 3,241,203,179.19  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 李道滨, 主管会计工作负责人: 欧阳向军, 会计机构负责人: 乐妮

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中银收益混合型证券投资基金(原名为中银国际收益混合型证券投资基金, 以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 163 号文《关于同意中银国际收益混合型证券投资基金募集的批复》的核准, 由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行募集, 基金合同于 2006 年 10 月 11 日正式生效, 首次设立募集规模为 2,410,621,616.42 份基金份额。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票、各类有价债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于具有稳定 and 良好分红能力的国内优质企业的股票, 能够提供固定收益、具有良好流动性的国债、企业债、可转债等, 以及其他固定收益产品。

本基金的业绩比较基准为: 富时中国 A 股红利 150 指数×60%+中证国债指数×30%+同业存款利

率×10%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布<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>的通知》的规定，自 2015 年 3 月 30 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 7.4.6.2 营业税、企业所得税

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，免征营业税。

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。

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。

### 7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

个人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。

自 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-------|---------|
|-------|---------|

|                         |                  |
|-------------------------|------------------|
| 中银基金管理有限公司              | 基金管理人、基金销售机构     |
| 中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”) | 基金托管人、基金销售机构     |
| 中国银行股份有限公司 (“中国银行”)     | 基金管理人的股东、基金销售机构  |
| 中银国际证券有限责任公司 (“中银证券”)   | 受中国银行重大影响、基金销售机构 |
| 贝莱德投资管理 (英国) 有限公司       | 基金管理人的股东         |
| 中银资产管理有限公司              | 基金管理人的全资子公司      |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |                  | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12月31日 |                  |
|-------|-----------------------------|------------------|----------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                        | 占当期股票成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期股票成交总额的<br>比例 |
| 中银证券  | -                           | -                | 78,764,800.00                    | 0.77%            |

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

##### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |                |          |                  |
|-------|-----------------------------|----------------|----------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                    | 占当期佣金总量的<br>比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的<br>比例 |
|       |                             |                |          |                  |

|       |                       |                |          |                  |
|-------|-----------------------|----------------|----------|------------------|
| -     | -                     | -              | -        | -                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间               |                |          |                  |
|       | 2014年1月1日至2014年12月31日 |                |          |                  |
|       | 当期<br>佣金              | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 中银证券  | 25,283.74             | 0.28%          | -        | -                |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2015年1月1日至2015年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12<br>月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 41,689,866.52                   | 61,413,873.41                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,640,399.12                    | 3,922,990.20                         |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015年1月1日至2015年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12<br>月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 6,948,311.08                    | 10,235,645.57                        |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率

计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
|                   | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 期初持有的基金份额         | -                     | -                     |
| 期间申购/买入总份额        | 9,423,850.21          | -                     |
| 期间因拆分变动份额         | -                     | -                     |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | -                     | -                     |
| 期末持有的基金份额         | 9,423,850.21          | -                     |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.77%                 | -                     |

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                    |        | 上年度可比期间               |        |
|-------|-----------------------|--------|-----------------------|--------|
|       | 2015年1月1日至2015年12月31日 |        | 2014年1月1日至2014年12月31日 |        |
|       | 期末余额                  | 当期利息收入 | 期末余额                  | 当期利息收入 |
|       |                       |        |                       |        |

|        |                |              |               |              |
|--------|----------------|--------------|---------------|--------------|
| 中国工商银行 | 293,967,334.53 | 2,556,248.88 | 83,833,310.22 | 3,470,456.71 |
| 合计     | 293,967,334.53 | 2,556,248.88 | 83,833,310.22 | 3,470,456.71 |

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015 年度获得的利息收入为人民币 148,654.02 元(2014 年度：人民币 177,861.02 元)，2015 年末结算备付金余额为人民币 16,862,460.29 元(2014 年末：人民币 5,659,747.89 元)。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

### 7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|-------|--------------|---------------|---------------|----|
| 300010 | 立思辰  | 2015-12-30 | 重大事项   | 31.90  | 2016-01-08 | 28.71 | 879,900      | 32,758,494.85 | 28,068,810.00 |    |
| 300235 | 方直科技 | 2015-11-16 | 重大资产重组 | 32.83  | 2016-03-16 | 29.55 | 363,988      | 11,853,130.58 | 11,949,726.04 |    |
| 600682 | 南京新百 | 2015-07-01 | 重大资产重组 | 32.98  | 2016-01-27 | 33.78 | 818,508      | 26,547,089.06 | 26,994,393.84 |    |
| 600749 | 西藏旅游 | 2015-11-30 | 重大资产重组 | 25.15  | -          | -     | 2,595,426    | 45,605,348.30 | 65,274,963.90 |    |

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的



债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止, 本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收款项以及其他金融负债, 因其剩余期限不长, 公允价值与账面价值相若。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具属于第一层次的余额为人民币 1,290,330,994.11 元, 属于第二层次的余额为人民币 262,599,893.78 元, 无划分为第三层次的余额 (于 2014 年 12 月 31 日, 第一层次的余额为人民币 1,952,316,079.73 元, 属于第二层次的余额为人民币 842,826,667.60 元, 无划分为第三层次的余额)。

###### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况, 本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布<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>的通知》的规定, 自 2015 年 3 月 30 日起, 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值, 相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

###### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具, 本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

##### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 1,421,973,737.89 | 61.76         |
|    | 其中：股票             | 1,421,973,737.89 | 61.76         |
| 2  | 固定收益投资            | 130,957,150.00   | 5.69          |
|    | 其中：债券             | 130,957,150.00   | 5.69          |
|    | 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          | 436,900,270.00   | 18.98         |
|    | 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      | 310,829,794.82   | 13.50         |
| 7  | 其他各项资产            | 1,743,557.21     | 0.08          |
| 8  | 合计                | 2,302,404,509.92 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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              | 659,525,340.74   | 30.56         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -             |
| E  | 建筑业              | 252,412,185.86   | 11.69         |
| F  | 批发和零售业           | 27,216,698.28    | 1.26          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 10,582,704.00    | 0.49          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 238,780,467.46   | 11.06         |
| J  | 金融业              | -                | -             |
| K  | 房地产业             | 34,868,647.04    | 1.62          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 12,606,911.00    | 0.58          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -                | -             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 88,406,790.57    | 4.10          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -             |
| P  | 教育               | 17,727,588.45    | 0.82          |
| Q  | 卫生和社会工作          | 15,157,642.08    | 0.70          |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 64,688,762.41    | 3.00          |
| S  | 综合               | -                | -             |
|    | 合计               | 1,421,973,737.89 | 65.88         |

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 300003 | 乐普医疗 | 4,733,440 | 182,710,784.00 | 8.47         |
| 2  | 002325 | 洪涛股份 | 9,167,470 | 143,287,556.10 | 6.64         |
| 3  | 002539 | 新都化工 | 5,812,555 | 93,000,880.00  | 4.31         |
| 4  | 002659 | 中泰桥梁 | 3,627,230 | 84,695,820.50  | 3.92         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 5  | 300182 | 捷成股份 | 3,283,385 | 78,801,240.00 | 3.65 |
| 6  | 600749 | 西藏旅游 | 2,595,426 | 65,274,963.90 | 3.02 |
| 7  | 603686 | 龙马环卫 | 1,450,632 | 57,619,103.04 | 2.67 |
| 8  | 002230 | 科大讯飞 | 1,180,310 | 43,730,485.50 | 2.03 |
| 9  | 002421 | 达实智能 | 1,940,706 | 42,501,461.40 | 1.97 |
| 10 | 000969 | 安泰科技 | 2,853,795 | 37,042,259.10 | 1.72 |

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1  | 300248 | 新开普  | 101,565,015.98 | 3.13            |
| 2  | 600518 | 康美药业 | 95,934,716.81  | 2.96            |
| 3  | 601688 | 华泰证券 | 94,610,282.43  | 2.92            |
| 4  | 002659 | 中泰桥梁 | 89,957,615.54  | 2.78            |
| 5  | 300359 | 全通教育 | 77,910,964.99  | 2.40            |
| 6  | 002230 | 科大讯飞 | 74,454,177.92  | 2.30            |
| 7  | 600055 | 华润万东 | 55,165,129.78  | 1.70            |
| 8  | 600323 | 瀚蓝环境 | 54,630,344.24  | 1.69            |
| 9  | 601928 | 凤凰传媒 | 53,409,157.27  | 1.65            |
| 10 | 600749 | 西藏旅游 | 45,605,348.30  | 1.41            |
| 11 | 300273 | 和佳股份 | 44,018,761.99  | 1.36            |
| 12 | 601788 | 光大证券 | 41,848,084.32  | 1.29            |
| 13 | 002678 | 珠江钢琴 | 41,531,420.98  | 1.28            |
| 14 | 601199 | 江南水务 | 41,132,642.90  | 1.27            |
| 15 | 002672 | 东江环保 | 38,962,143.60  | 1.20            |
| 16 | 300224 | 正海磁材 | 38,236,347.97  | 1.18            |
| 17 | 000547 | 航天发展 | 37,425,395.16  | 1.15            |
| 18 | 000969 | 安泰科技 | 37,225,023.85  | 1.15            |
| 19 | 002421 | 达实智能 | 36,811,544.61  | 1.14            |
| 20 | 002654 | 万润科技 | 33,642,648.00  | 1.04            |

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

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产 |
|----|------|------|----------|---------|
|----|------|------|----------|---------|

|    |        |      |                | 产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|----------------|--------------|
| 1  | 300170 | 汉得信息 | 297,352,156.22 | 9.17         |
| 2  | 300315 | 掌趣科技 | 263,236,925.13 | 8.12         |
| 3  | 002051 | 中工国际 | 223,063,627.85 | 6.88         |
| 4  | 300003 | 乐普医疗 | 219,428,568.81 | 6.77         |
| 5  | 601688 | 华泰证券 | 199,707,808.56 | 6.16         |
| 6  | 600518 | 康美药业 | 142,753,044.97 | 4.40         |
| 7  | 002317 | 众生药业 | 133,542,371.88 | 4.12         |
| 8  | 300222 | 科大智能 | 129,898,386.48 | 4.01         |
| 9  | 300071 | 华谊嘉信 | 128,792,186.90 | 3.97         |
| 10 | 002358 | 森源电气 | 121,771,203.77 | 3.76         |
| 11 | 300199 | 翰宇药业 | 106,687,890.45 | 3.29         |
| 12 | 002375 | 亚厦股份 | 104,103,685.83 | 3.21         |
| 13 | 002589 | 瑞康医药 | 84,269,439.08  | 2.60         |
| 14 | 002400 | 省广股份 | 84,021,115.13  | 2.59         |
| 15 | 002325 | 洪涛股份 | 79,703,906.84  | 2.46         |
| 16 | 600009 | 上海机场 | 78,429,273.11  | 2.42         |
| 17 | 300127 | 银河磁体 | 70,910,444.56  | 2.19         |
| 18 | 300248 | 新开普  | 69,494,824.70  | 2.14         |
| 19 | 600323 | 瀚蓝环境 | 68,232,739.05  | 2.11         |
| 20 | 300182 | 捷成股份 | 64,049,312.54  | 1.98         |

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 2,899,015,637.45 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 5,379,289,821.62 |

注：“买入股票成本”“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比<br>例(%) |
|----|------|------|------------------|
| 1  | 国家债券 | -    | -                |

|    |           |                |      |
|----|-----------|----------------|------|
| 2  | 央行票据      | -              | -    |
| 3  | 金融债券      | 130,312,000.00 | 6.04 |
|    | 其中：政策性金融债 | 130,312,000.00 | 6.04 |
| 4  | 企业债券      | -              | -    |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -    |
| 6  | 中期票据      | -              | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | 645,150.00     | 0.03 |
| 8  | 同业存单      | -              | -    |
| 9  | 其他        | -              | -    |
| 10 | 合计        | 130,957,150.00 | 6.07 |

#### 8.6 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  | 150318 | 15 进出 18 | 1,300,000 | 130,312,000.00 | 6.04         |
| 2  | 132002 | 15 天集 EB | 5,610     | 645,150.00     | 0.03         |

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与股指期货投资。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 781,912.28   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 358,463.30   |
| 5  | 应收申购款   | 303,181.63   |
| 6  | 其他应收款   | 300,000.00   |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,743,557.21 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公<br>允价值 | 占基金资产净<br>值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-----------------|------------------|----------|
| 1  | 600749 | 西藏旅游 | 65,274,963.90   | 3.02             | 重大资产重组   |

**8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<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 |
| 48,444   | 25,285.97     | 331,868,668.83 | 27.09%     | 893,084,710.92 | 72.91%     |

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

| 项目               | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 2,178,304.70 | 0.1778%  |

**9.3 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 | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 10~50             |

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2006年10月11日)基金份额总额 | 2,410,621,616.42 |
|----------------------------|------------------|



|               |                  |
|---------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 2,513,430,348.21 |
| 本报告期基金总申购份额   | 1,246,626,228.62 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,535,103,197.08 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 1,224,953,379.75 |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经本基金管理人股东会审议通过，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。经本基金管理人第四届董事会第一次会议审议通过，选举白志中先生担任本基金管理人第四届董事会董事长，本基金管理人第三届董事会成员谭炯先生、梅非奇先生不再担任本基金管理人董事职务，葛礼（Gary Rieschel）先生不再担任本基金管理人独立董事职务，相关事项已按规定向监管机构报告。详情参见 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，经工商行政管理部门核准，本基金管理人法定代表人变更为白志中先生，详情参见 2015 年 7 月 29 日刊登的《中银基金管理有限公司关于公司法定代表人变更公告》。

本报告期内，本基金管理人原独立董事朱善利先生不幸因病逝世，不再担任我司的独立董事，相关事项已按规定向监管机构报告。

本报告期内，经本基金管理人董事会审议通过，聘任陈军先生担任本基金管理人副执行总裁。陈军先生的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会核准，详情参见 2015 年 12 月 8 日刊登的《中银基金管理有限公司关于副总经理变更事宜的公告》。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略没有发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 90,000.00 元，目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 3 年。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 应支付该券商的佣金    |            | 备注 |
|--------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
|        |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中信证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 中银证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 民生证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 高华证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 东海证券   | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 广发证券   | 1      | 3,069,478,235.26 | 37.10%       | 2,724,455.69 | 36.53%     | -  |
| 长江证券   | 2      | 2,424,754,110.66 | 29.30%       | 2,202,111.30 | 29.52%     | -  |
| 申银万国   | 1      | 929,808,944.59   | 11.24%       | 838,236.22   | 11.24%     | -  |
| 安信证券   | 1      | 517,464,003.12   | 6.25%        | 472,305.38   | 6.33%      | -  |
| 中信建投证券 | 1      | 458,993,439.20   | 5.55%        | 427,306.79   | 5.73%      | -  |
| 华泰证券   | 1      | 284,083,690.92   | 3.43%        | 260,568.69   | 3.49%      | -  |
| 国信证券   | 2      | 239,967,857.04   | 2.90%        | 216,154.67   | 2.90%      | -  |
| 光大证券   | 1      | 201,360,346.53   | 2.43%        | 182,844.31   | 2.45%      | -  |
| 国金证券   | 1      | 148,353,802.21   | 1.79%        | 135,060.03   | 1.81%      | -  |

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：无。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易          |                  | 回购交易             |                  | 权证交易 |                  |
|--------|---------------|------------------|------------------|------------------|------|------------------|
|        | 成交金额          | 占当期债券成交总额的<br>比例 | 成交金额             | 占当期回购成交总<br>额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总<br>额的比例 |
| 长江证券   | -             | -                | 1,436,900,000.00 | 8.55%            | -    | -                |
| 安信证券   | -             | -                | 7,630,000,000.00 | 45.43%           | -    | -                |
| 中信建投证券 | 6,680,339.90  | 11.01%           | 4,800,000,000.00 | 28.58%           | -    | -                |
| 华泰证券   | 52,553,360.18 | 86.60%           | 2,450,000,000.00 | 14.59%           | -    | -                |
| 国金证券   | 1,453,255.00  | 2.39%            | 480,000,000.00   | 2.86%            | -    | -                |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，经与托管行协商一致，本基金管理人决定变更本基金的业绩比较基准，相关事项已向中国证监会备案，具体可详见本基金管理人于 2015 年 9 月 30 日发布的《关于中银基金旗下三只公募基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》。

中银基金管理有限公司

二〇一六年三月二十五日