

**中银美丽中国混合型证券投资基金**  
**2019 年半年度报告摘要**  
**2019 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十六日

## 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 中银美丽中国混合        |
| 基金主代码      | 000120          |
| 交易代码       | 000120          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2013 年 6 月 7 日  |
| 基金管理人      | 中银基金管理有限公司      |
| 基金托管人      | 中国民生银行股份有限公司    |
| 报告期末基金份额总额 | 29,225,829.88 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金主要投资于美丽中国主题相关的上市公司股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的中长期稳定增值。   |
| 投资策略   | 本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行大类资产配置。其次，基于自上而下的投资主题框架，综合运用定量和定性的分析方法，针对经济转型过程中直接从事生态文明建设的行业，以及投资或受益于美丽中国发展的行业进行跟踪分析，不断发掘投资机会，精选出受惠于美丽中国发展的优质上市公司进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。  |

### 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                | 中国民生银行股份有限公司            |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                        | 薛文成                     |
|             | 联系电话                      | 021-38834999            |
|             | 电子邮箱                      | clientservice@bocim.com |
| 客户服务电话      | 021-38834788 400-888-5566 | 95568                   |
| 传真          | 021-68873488              | 010-58560798            |

### 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半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> |
| 基金半年度报告备置地点          | 上海市浦东新区银城中路 200 号 26 楼                                  |

## 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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|

|                      |                              |
|----------------------|------------------------------|
| 本期已实现收益              | 2,709,775.06                 |
| 本期利润                 | 7,483,175.37                 |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.2463                       |
| 本期基金份额净值增长率          | 22.35%                       |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末(2019 年 6 月 30 日)</b> |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.3140                       |
| 期末基金资产净值             | 38,401,883.16                |
| 期末基金份额净值             | 1.314                        |

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     | 6.48%    | 1.21%       | 4.37%      | 0.93%         | 2.11%   | 0.28% |
| 过去三个月     | 1.23%    | 1.58%       | -0.90%     | 1.22%         | 2.13%   | 0.36% |
| 过去六个月     | 22.35%   | 1.46%       | 21.47%     | 1.24%         | 0.88%   | 0.22% |
| 过去一年      | 5.80%    | 1.30%       | 8.21%      | 1.22%         | -2.41%  | 0.08% |
| 过去三年      | 6.48%    | 1.02%       | 17.58%     | 0.89%         | -11.10% | 0.13% |
| 自基金合同生效日起 | 35.89%   | 1.60%       | 44.75%     | 1.22%         | -8.86%  | 0.38% |

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

中银美丽中国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

（2013 年 6 月 7 日至 2019 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，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## 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

本基金管理人为中银基金管理有限公司，由中国银行股份有限公司和贝莱德投资管理有限公司两大全球著名领先金融品牌强强联合组建的中外合资基金管理公司，致力于长期参与中国基金业的发展，努力成为国内领先的基金管理公司。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理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等一百零八只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

#### 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 | 基金经理 | 2015-02-11      | -    | 9      | 中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），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 9 年证券从业年限。具备基金从业资格。   |
| 严菲 | 基金经理 | 2016-01-20 | - | 17 | 中银基金管理有限公司副总裁（VP），金融学硕士。曾任融通基金管理有限公司基金经理。2015 年加入中银基金管理有限公司。2016 年 1 月至今任中银美丽中国基金基金经理，2017 年 5 月至今任中银新蓝筹基金基金经理，2018 年 2 月至今任中银改革红利基金基金经理。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《中华人民共和国证券投资基金法》、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

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，未发现违背公平交易的相关情况。

##### 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，上半年全球经济普遍下行，美国经济的韧性也有所松动。从领先指标来看，美国经济景气度显著下降，上半年美国 ISM 制造业 PMI 指数从 54.3 下滑至 51.7，个人消费支出增速下行，核心 PCE 依旧不达 2% 的目标，但劳动力市场整体稳健，薪资增速温和放缓至 3.1%，美元指数由于美强欧弱格局的维持震荡走高至 97 上方。欧元区经济下行风险加大，上半年制造业 PMI 指数从 51.4 显著下行至 47.6，不过内部经济存在分化，德国 PMI 大幅下滑至荣枯线 50 以下，法国、意大利 PMI 在下行后有所回升；欧元区通胀表现疲软，欧央行立场向鸽派调整，下一步大概率进行降息及重启 QE。日本经济延续放缓，上半年制造业 PMI 指数从 52.6 回落至荣枯线 50 以下，通胀逐渐回暖但工业产出仍在延续下行，日本央行预计维持宽松基调。综合来看，美国经济增速预计继续放缓，贸易不确定性依然给经济前景蒙上阴影，美联储 2019 年下半年预计降息 1-2 次；欧洲经济景气度继续低迷，德国经济增长前景仍受外需拖累；日本经济在通胀低迷、外需下行的影响下复苏前景不佳。

国内经济方面，在外需持续偏弱和贸易摩擦升级背景下，经济下行压力再度体现。具体来看，上半年领先指标中采制造业 PMI 指数短暂回升后又重新回落至 49.4，同步指标工业增加值 1-6 月累计同比增长 6.0%，较 2018 年末回落 0.2 个百分点。从经济增长动力来看，出口继续受贸易摩擦和外需走弱冲击，消费企稳回升，投资小幅回落：1-6 月美元计价累计出口增速较 2018 年末回落 9.8 个百分点至 0.1% 左右，6 月社会消费品零售总额增速较 2018 年末回升 1.6 个百分点至 9.8%，制造业投资大幅下滑，房地产投资高位回落，基建投资低位震荡，1-6 月固定资产投资增速较 2018 年末小幅回落 0.1 个百分点至 5.8% 的水平。通胀方面，CPI 小幅攀升但阶段性见顶，6 月同比增速从 2018 年末的 1.9% 上升 0.8 个百分点至 2.7%，PPI 震荡回落，6 月同比增速从 2018 年末的 0.9% 下行 0.9 个百分点至 0%。

#### 2. 市场回顾

2019 年上半年，A 股市场先扬后抑，一季度上证综指上涨 23.93%，代表大盘股表现的沪深 300 指数上涨 28.62%，中小板综合指数上涨 33.79%，创业板综合指数上涨 33.43%。二季度，上证综指下跌 3.62%，代表大盘股表现的沪深 300 指数下跌 1.21%，中小板综合指数下跌 10.31%，创业板综合指数下跌 9.36%。

#### 3. 运行分析

本基金在上半年对持仓结构进行了调整，增配了基建、大消费、非银金融、电子等行业，在公

司选择上，侧重行业龙头。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金份额净值增长率为 22.35%，同期业绩比较基准收益率为 21.47%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年下半年，预计全球经济继续走弱，虽然中美贸易谈判重回正轨，但是第二批 2000 亿美元商品关税已经上调至 25%，国内经济基本面仍面临一定下行压力，固定资产投资增速保持低位震荡，出口持续承压，消费较为稳定。国内宏观政策保持定力，货币政策主要根据国内经济增长、价格形势的变化及时进行预调微调，保持流动性合理充裕和市场利率水平合理稳定。财政政策继续托底，地方政府专项债券新规助力提升基建投资增速。通货膨胀方面，下半年存在一定压力，CPI 同比增速预计三季度见顶回落，PPI 同比增速预计三季度延续回落，但两者均预计在四季度明显抬升。全球需求下滑背景下，美国经济边际下行风险逐渐加大，美债收益率维持低位，中美利差仍处于较高水平，对于国内长端利率不构成限制。

2019 年下半年，企业盈利在贸易摩擦和 PPI 趋势回落的背景下承压，但在国内逆周期政策对冲下不至于失速，同时国内外偏松的货币环境将引导无风险利率下行从而支撑估值，中美贸易战仍是影响风险偏好的重要变量，但对 A 股的边际冲击力相比上半年有下降。A 股市场预计以结构性行情为主，受益于逆周期政策发力的基建行业、稳定的消费行业 and 高端装备制造、科技类行业的优质公司需要重点关注。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，由研究部、风险管理部、基金运营部及投资相关部门的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。估值委员会审议并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环境相适应的估值方法，基金运营部应征询会计师事务所、托管行的相关意见。公司按特殊流程改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，应就基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见，会计师事务所应对公司所采用的



相关估值模型、假设、参数及输入的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.6.2 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。

4.6.3 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

本基金基金合同第十六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，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%。本报告期末可供分配利润为 9,176,053.28 元，未进行利润分配。

#### 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

截至本报告期末，本基金已连续超过 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中银美丽中国混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      | -                              | -                                |
| 银行存款            | 3,910,836.04                   | 11,248,542.01                    |
| 结算备付金           | 5,608.96                       | 62,649.78                        |
| 存出保证金           | 36,292.06                      | 25,012.23                        |
| 交易性金融资产         | 34,297,937.05                  | 22,849,217.83                    |
| 其中：股票投资         | 32,223,693.25                  | 22,849,217.83                    |
| 基金投资            | -                              | -                                |
| 债券投资            | 2,074,243.80                   | -                                |
| 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        | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         | 182,317.29                     | -                                |
| 应收利息            | 53,132.11                      | 2,636.44                         |
| 应收股利            | -                              | -                                |
| 应收申购款           | 53,755.54                      | 4,008.16                         |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     | <b>38,539,879.05</b>           | <b>34,192,066.45</b>             |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      | -                              | -                                |
| 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         | -                              | 100,898.94                       |
| 应付赎回款           | 13,600.87                      | 9,584.47                         |
| 应付管理人报酬         | 44,983.39                      | 43,723.09                        |
| 应付托管费           | 7,497.24                       | 7,287.20                         |
| 应付销售服务费         | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 21,269.29                      | 29,021.63                        |
| 应交税费            | -                              | -                                |
| 应付利息            | -                              | -                                |
| 应付利润            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         | -                              | -                                |
| 其他负债            | 50,645.10                      | 40,000.04                        |
| <b>负债合计</b>     | <b>137,995.89</b>              | <b>230,515.37</b>                |
| <b>所有者权益：</b>   | -                              | -                                |
| 实收基金            | 29,225,829.88                  | 31,617,857.71                    |
| 未分配利润           | 9,176,053.28                   | 2,343,693.37                     |
| <b>所有者权益合计</b>  | <b>38,401,883.16</b>           | <b>33,961,551.08</b>             |

|            |               |               |
|------------|---------------|---------------|
| 负债和所有者权益总计 | 38,539,879.05 | 34,192,066.45 |
|------------|---------------|---------------|

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.314 元，基金份额总额 29,225,829.88 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中银美丽中国混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018<br>年 6 月 30 日 |
|----------------------------|--|---|
| <b>一、收入</b>                | <b>8,022,972.47</b>                      | <b>-3,682,325.62</b>                          |
| 1.利息收入                     | 42,329.73                                | 51,572.74                                     |
| 其中：存款利息收入                  | 27,498.88                                | 51,572.74                                     |
| 债券利息收入                     | 14,830.85                                | -   |
| 资产支持证券利息收入                 | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入                 | -  | -   |
| 其他利息收入                     | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 3,201,522.69                             | 640,455.90                                    |
| 其中：股票投资收益                  | 2,875,835.00                             | 464,531.86                                    |
| 基金投资收益                     | -  | -   |
| 债券投资收益                     | 4,687.03                                 | -   |
| 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                       | 321,000.66                               | 175,924.04                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 4,773,400.31                             | -4,380,947.33                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 5,719.74                                 | 6,593.07                                      |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>539,797.10</b>                        | <b>650,043.80</b>                             |
| 1. 管理人报酬                   | 274,617.64                               | 327,627.56                                    |
| 2. 托管费                     | 45,769.67                                | 54,604.61                                     |
| 3. 销售服务费                   | -  | -   |
| 4. 交易费用                    | 168,723.22                               | 213,888.70                                    |
| 5. 利息支出                    | -  | -   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -  | -   |
| 6.税金及附加                    | 0.04                                     | -   |
| 7. 其他费用                    | 50,686.53                                | 53,922.93                                     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>7,483,175.37</b>                      | <b>-4,332,369.42</b>                          |
| 减：所得税费用                    | -  | -   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>7,483,175.37</b>                      | <b>-4,332,369.42</b>                          |

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：中银美丽中国混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 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）                        | 31,617,857.71                              | 2,343,693.37  | 33,961,551.08  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 7,483,175.37  | 7,483,175.37   |
| 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）      | -2,392,027.83                              | -650,815.46   | -3,042,843.29  |
| 其中：1.基金申购款                             | 3,888,012.68                               | 961,026.51    | 4,849,039.19   |
| 2.基金赎回款                                | -6,280,040.51                              | -1,611,841.97 | -7,891,882.48  |
| 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）                        | 29,225,829.88                              | 9,176,053.28  | 38,401,883.16  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 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）                        | 35,240,485.11                              | 13,354,564.52 | 48,595,049.63  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | -4,332,369.42 | -4,332,369.42  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -3,695,804.31                              | -1,399,154.13 | -5,094,958.44  |
| 其中：1.基金申购款                             | 5,009,676.71                               | 1,972,578.84  | 6,982,255.55   |
| 2.基金赎回款                                | -8,705,481.02                              | -3,371,732.97 | -12,077,213.99 |
| 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）                        | 31,544,680.80                              | 7,623,040.97  | 39,167,721.77  |

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：王圣明，会计机构负责人：乐妮

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中银美丽中国混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，原中银美丽中国股票型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]313 号文《关于核准中银美丽中国股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2013 年 6 月 7 日正式生效，首次设立募集规模为 1,258,334,107.17 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据中国证券监督管理委员会于 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，中银基金管理有限公司决定自 2015 年 8 月 7 日起将本基金变更为混合基金，并相应修改本基金的《基金合同》。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其它中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 3 号《半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。

### 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 2019 年 6 月 30 日的财务

状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间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

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。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间没有需作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[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 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### 6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 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。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 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。

##### 6.4.7.2 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 |
| 中国民生银行股份有限公司(“民生银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |

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。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

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交易。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 274,617.64           | 327,627.56           |



|                 |            |            |
|-----------------|------------|------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 104,167.71 | 124,432.96 |
|-----------------|------------|------------|

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

#### 6.4.8.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 45,769.67            | 54,604.61            |

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

#### 6.4.8.3 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。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.8.4.2 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。

#### 6.4.8.5 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              |                      |
|--------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
|              | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年1月1日至2018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               |
| 中国民生银行股份有限公司 | 3,910,836.04         | 26,377.26            | 15,140,967.35        | 50,336.89            |
| 合计           | 3,910,836.04         | 26,377.26            | 15,140,967.35        | 50,336.89            |

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，2019 年上半年获得的利息收入为人民币 872.27 元（2018 年上半年获得的利息收入为人民币 864.54 元），2019 年上半年末结算备付金余额为人民币 5,608.96 元(2018 年上半年末：人民币 123,712.05 元)。

#### 6.4.8.6 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。

#### 6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.9.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |      |        |          |           |           |    |
|---------------------|------|------------|------------|--------|------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 601236              | 红塔证券 | 2019-06-26 | 2019-07-05 | 新股未上市  | 3.46 | 3.46   | 8,810    | 30,482.60 | 30,482.60 | -  |

##### 6.4.9.2 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。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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。

###### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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。

#### 6.4.10 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  | 32,223,693.25 | 83.61         |
|    | 其中：股票 | 32,223,693.25 | 83.61         |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 2 | 基金投资              | -             | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 2,074,243.80  | 5.38   |
|   | 其中：债券             | 2,074,243.80  | 5.38   |
|   | 资产支持证券            | -             | -      |
| 4 | 贵金属投资             | -             | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -             | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -             | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 3,916,445.00  | 10.16  |
| 8 | 其他各项资产            | 325,497.00    | 0.84   |
| 9 | 合计                | 38,539,879.05 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 343,033.00    | 0.89         |
| B  | 采矿业              | 20,966.30     | 0.05         |
| C  | 制造业              | 18,488,334.64 | 48.14        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | 740,448.00    | 1.93         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,163,999.18  | 8.24         |
| J  | 金融业              | 7,301,671.64  | 19.01        |
| K  | 房地产业             | 659,729.00    | 1.72         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 240,800.00    | 0.63         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | 1,264,711.49  | 3.29         |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 32,223,693.25 | 83.91        |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 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  | 601318 | 中国平安 | 24,704  | 2,189,021.44 | 5.70         |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 58,153  | 2,092,344.94 | 5.45         |
| 3  | 600031 | 三一重工 | 127,654 | 1,669,714.32 | 4.35         |
| 4  | 300014 | 亿纬锂能 | 50,066  | 1,525,010.36 | 3.97         |
| 5  | 000425 | 徐工机械 | 328,500 | 1,465,110.00 | 3.82         |
| 6  | 002607 | 中公教育 | 92,113  | 1,264,711.49 | 3.29         |
| 7  | 600801 | 华新水泥 | 60,617  | 1,227,494.25 | 3.20         |
| 8  | 000401 | 冀东水泥 | 67,243  | 1,184,149.23 | 3.08         |
| 9  | 000338 | 潍柴动力 | 96,200  | 1,182,298.00 | 3.08         |
| 10 | 002832 | 比音勒芬 | 24,600  | 1,172,682.00 | 3.05         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

## 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  | 601318 | 中国平安 | 2,042,075.00 | 6.01           |
| 2  | 002439 | 启明星辰 | 1,943,618.13 | 5.72           |
| 3  | 600031 | 三一重工 | 1,777,962.70 | 5.24           |
| 4  | 300014 | 亿纬锂能 | 1,448,484.00 | 4.27           |
| 5  | 000401 | 冀东水泥 | 1,413,979.38 | 4.16           |
| 6  | 000425 | 徐工机械 | 1,412,575.00 | 4.16           |
| 7  | 601818 | 光大银行 | 1,335,355.00 | 3.93           |
| 8  | 002607 | 中公教育 | 1,247,441.00 | 3.67           |
| 9  | 601888 | 中国国旅 | 1,115,489.00 | 3.28           |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 1,112,480.00 | 3.28           |
| 11 | 002129 | 中环股份 | 1,107,581.00 | 3.26           |
| 12 | 600801 | 华新水泥 | 1,090,723.00 | 3.21           |
| 13 | 300406 | 九强生物 | 1,018,879.00 | 3.00           |
| 14 | 000338 | 潍柴动力 | 1,018,442.00 | 3.00           |
| 15 | 002271 | 东方雨虹 | 1,004,974.40 | 2.96           |
| 16 | 601636 | 旗滨集团 | 989,276.00   | 2.91           |
| 17 | 002475 | 立讯精密 | 942,610.40   | 2.78           |
| 18 | 600030 | 中信证券 | 912,141.00   | 2.69           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 19 | 002832 | 比音勒芬 | 908,680.00 | 2.68 |
| 20 | 002080 | 中材科技 | 847,357.20 | 2.50 |
| 21 | 603180 | 金牌厨柜 | 824,736.00 | 2.43 |
| 22 | 002035 | 华帝股份 | 821,093.51 | 2.42 |
| 23 | 002727 | 一心堂  | 811,125.00 | 2.39 |
| 24 | 002230 | 科大讯飞 | 753,990.00 | 2.22 |
| 25 | 002659 | 凯文教育 | 742,269.00 | 2.19 |
| 26 | 601688 | 华泰证券 | 737,552.00 | 2.17 |
| 27 | 300438 | 鹏辉能源 | 734,927.00 | 2.16 |
| 28 | 300188 | 美亚柏科 | 696,674.00 | 2.05 |
| 29 | 002384 | 东山精密 | 686,668.00 | 2.02 |
| 30 | 300724 | 捷佳伟创 | 680,632.58 | 2.00 |

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

#### 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  | 601398 | 工商银行 | 1,614,148.37 | 4.75            |
| 2  | 600547 | 山东黄金 | 1,560,589.82 | 4.60            |
| 3  | 001979 | 招商蛇口 | 1,463,286.70 | 4.31            |
| 4  | 601006 | 大秦铁路 | 1,412,455.29 | 4.16            |
| 5  | 601818 | 光大银行 | 1,361,041.94 | 4.01            |
| 6  | 601888 | 中国国旅 | 1,203,526.48 | 3.54            |
| 7  | 002129 | 中环股份 | 1,141,185.08 | 3.36            |
| 8  | 000002 | 万科 A | 1,122,827.70 | 3.31            |
| 9  | 601288 | 农业银行 | 1,121,424.00 | 3.30            |
| 10 | 002707 | 众信旅游 | 1,117,032.56 | 3.29            |
| 11 | 002439 | 启明星辰 | 1,093,862.48 | 3.22            |
| 12 | 600030 | 中信证券 | 1,032,576.10 | 3.04            |
| 13 | 000802 | 北京文化 | 1,032,525.01 | 3.04            |
| 14 | 000975 | 银泰资源 | 1,008,716.64 | 2.97            |
| 15 | 601186 | 中国铁建 | 939,705.53   | 2.77            |
| 16 | 601628 | 中国人寿 | 884,862.87   | 2.61            |
| 17 | 002281 | 光迅科技 | 863,167.84   | 2.54            |
| 18 | 300450 | 先导智能 | 839,248.77   | 2.47            |
| 19 | 300253 | 卫宁健康 | 835,823.60   | 2.46            |
| 20 | 002727 | 一心堂  | 804,198.02   | 2.37            |
| 21 | 300724 | 捷佳伟创 | 781,075.10   | 2.30            |
| 22 | 002384 | 东山精密 | 777,819.97   | 2.29            |
| 23 | 002142 | 宁波银行 | 758,959.70   | 2.23            |
| 24 | 600489 | 中金黄金 | 744,832.00   | 2.19            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 25 | 300122 | 智飞生物 | 744,800.00 | 2.19 |
| 26 | 300438 | 鹏辉能源 | 743,343.58 | 2.19 |
| 27 | 002410 | 广联达  | 716,654.08 | 2.11 |
| 28 | 601899 | 紫金矿业 | 707,843.09 | 2.08 |
| 29 | 601766 | 中国中车 | 689,535.52 | 2.03 |
| 30 | 002202 | 金风科技 | 687,278.48 | 2.02 |

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

#### 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 | 57,211,179.29 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 55,492,529.26 |

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      | 2,074,243.80 | 5.40         |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,074,243.80 | 5.40         |
| 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） | -            | -            |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 2,074,243.80 | 5.40         |

#### 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  | 108603 | 国开 1804 | 20,730 | 2,074,243.80 | 5.40         |

#### 7.7 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。

#### 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 报告期内，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   | 36,292.06  |
| 2  | 应收证券清算款 | 182,317.29 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 53,132.11  |
| 5  | 应收申购款   | 53,755.54  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 325,497.00 |

**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    |
| 2,264    | 12,908.94 | -     | -      | 29,225,829.88 | 100.0000% |

### 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 | 65,304.93 | 0.2234%  |

### 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                    | 0~10              |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                          |                  |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2013年6月7日)基金份额总额 | 1,258,334,107.17 |
| 本报告期期初基金份额总额             | 31,617,857.71    |
| 本报告期基金总申购份额              | 3,888,012.68     |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 6,280,040.51     |
| 本报告期基金拆分变动份额             | -                |
| 本报告期期末基金份额总额             | 29,225,829.88    |

## 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，经基金管理人 2019 年第一次股东会决议，宋福宁先生不再担任公司董事，荆新



先生、雷晓波先生不再担任公司独立董事。王卫东先生新任公司董事，付磊先生新任公司独立董事。

2019年7月19日基金管理人刊登《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更事宜的公告》，经基金管理人董事会决议通过闫黎平女士担任副执行总裁。

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。

### 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 为基金进行审计的会计师事务所情况

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      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 海通证券 | 1      | 65,249,977.50 | 58.13%       | 59,462.63 | 57.60%     | -  |
| 国泰君安 | 1      | 46,995,685.50 | 41.87%       | 43,767.23 | 42.40%     | -  |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低选择基金专用交易单元并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

#### 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 |
| 海通证券 | 2,118,628.75 | 100.00%      | -    | -            | -    | -            |

中银基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十六日