中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金 2010 年年度报告摘要

2010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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年三月三十日

§1 重要提示

1.1 重要提示

本基金管理人的董事会及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。

本基金的托管人——招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

本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,投资者在做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2010年8月25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	中银价值混合
基金主代码	163810
交易代码	163810
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年8月25日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,317,054,527.78份

2.2 基金产品说明

投资目标	在主动灵活的资产配置和动态行业配置基础上,精选价值相对低估的优质上市公司股票,力求获得基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用灵活积极的资产配置和股票投资策略。在资产配置中,通过以宏观经济及宏观经济政策分析为核心的情景分析法来确定投资组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例,并结合对市场估值、流动性、投资主体行为、市场情绪等因素的综合判断进行灵活调整;在行业选择中,基于动态的行业相对价值比较,发掘估值优势行业;在股票投资中,采取"自下而上"的策略,优选价值相对低估的优质公司股票构建投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得长期持续稳健的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60% + 上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金,预期风险收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	程明	张燕
	联系电话	021-38834999	0755-83199084
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	Yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95555
传真		021-68873488	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金年度报告备置地点	上海市银城中路200号中银大厦45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	2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日
本期已实现收益	151,130,588.73
本期利润	209,490,877.20
加权平均基金份额本期利润	0.0684
本期基金份额净值增长率	3.94%
3.1.2 期末数据和指标	**2010年末**
期末可供分配基金份额利润	0.0197
期末基金资产净值	2,362,650,523.54
期末基金份额净值	1.020

注:1、本基金合同于2010年8月25日生效,截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.91%	1.34%	4.00%	1.06%	-2.09%	0.28%
自基金合同生效起至今	3.94%	1.16%	4.57%	0.98%	-0.63%	0.18%

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

中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年8月25日至2010年12月31日)

注:截至报告期末,本基金成立未满一年。按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,目前,本基金尚在建仓期内。

3.2.3 自基金合同生效以来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

中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:本基金合同于2010年8月25日生效,截至报告日本基金合同生效未满五年。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

金额单位: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
2010年	0.200	47,757,863.95	2,964,616.39	50,722,480.34	-
合计	0.200	47,757,863.95	2,964,616.39	50,722,480.34	-

注:本基金合同于2010年8月25日生效,截至报告日本基金合同生效未满三年。

§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7月29日正式开业,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2010年12月31日,本管理人共管理十一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及中银稳健双利债券型证券投资基金,同时管理着多个特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张发余	中银价值基金经理	2010-08-25	-	9	中银基金管理有限公司投资管理部研究总监,副总裁(VP),经济学博士。曾任长江证券研究员、长江证券研究所投资策略分析师。2006年9月加入中银基金管理有限公司,现任研究总监,2010年8月起担任中银价值基金基金经理。具有9年证券从业年限。具备基金、证券从业资格。
彭砚	中银价值基金经理、中银策略基金经理	2010-08-25	-	4	南开大学金融学硕士。曾任联合证券并购私募融资总部研究员。2006年8月加入中银基金管理有限公司,先后担任研究员、中银优选基金基金经理助理等职,2010年6月至今担任中银策略基金基金经理,2010年8月至今担任中银价值基金基金经理。具有4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"为公司公告之日,基金经理的"离任日期"均为公司公告之日;

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遵规守信情况的说明

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

本报告期内,本基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

在本报告期内,本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和《中银基金管理公司公平交易管理制度》,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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无投资风格相似基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

无。

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

如果说2009年全球经济确立了复苏的趋势的话,那么2010年,则表现为全球经济复苏的不同步性,这种差异导致了各国经济刺激政策退出的时候需要更多的协调。

从具体表现来看,发达经济体的复苏充满了曲折,2010年上半年欧洲复苏的步伐快过美国,而在下半年,则表现为欧洲债务危机的再度爆发引发了全球对欧洲经济恢复不平衡性的担忧。新兴经济体在复苏过程中表现出了相对稳定性,并率先实施政策退出计划。

中国2010年全年经济和政策也充满了戏剧性变化。尽管年初管理层定调以积极财政财政政策和宽松货币政策退出,表现为制定了相对收缩的新增货币供应量,清查地方融资平台。但到2010年中期之后,管理层开始担忧经济二次探底,因此相对于年初政策收紧而言,略微出现了放松。从全年来看,货币供应量超过了年初的预期,经济增长速度也超过了年初预期,从四季度角度观察,通胀出现了明显加速,显示了未来经济紧缩的力度可能会超过预期。

2.基金运作分析

中银价值基金自2010年8月25日正式成立并开始运作,投资理念的核心是选出中长期有投资价值的股票,体现为成长价值、分红价和转折中的价值三类。自成立以来,基金采取了相对较为保守的运作策略,选择低估值和成长性可预期的行业,如汽车、煤炭和TMT行业,也选择了一些化工行业的股票,取得了一定的收益。从成立以来到2010年年底,整个基金运作既有成功的经历,也有需要反思和总结经验。主要经验和教训体现为对仓位的控制、板块轮动的把握,以及对投资周期中短期、中期和长期的平衡等等,对这些经验和教训的总结有助于在未来投资中减少基金向下的波动性,为投资人获得长期价值增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年12月31日为止,本基金的累计单位净值为1.040元,基金成立(2010年8月)至年底本基金净值增长为3.94%,同期业绩基准增长率为4.57%。

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2011年,经济、政策和投资者结构可能更趋于复杂化,虽然占绝大多数的投资者相信实体经济的趋势更好,但需要更加深入地理解政策退出的大背景,以及在流动性相对充裕情况下,提醒不定的通胀对中长期经济政策的扰动,我们需要在相对不确定的环境中寻找相对确定的投资,也需要仔细甄别自2008年以来证券市场的投资模式和投资逻辑,2008年以来的主题投资应该逐步走到了尾声阶段,需要真实的实体经济好转来保证其"软着陆"。毫无疑问,各种主题最终会分化,而那些具有扎实基本面支持的行业或公司,最终会在下一轮经济中胜出。

2011年,我们将把握阶段性机会,冷静地看待市场中的各种主题,注意各种政策变化带来的机会和风险,主要关注的焦点在可持续的内需驱动行业、财政政策支持的行业以及阶段性把握海外复苏拉动的行业。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

根据证监会的相关规定,本公司为建立健全有效的估值政策和程序,经公司执行委员会批准,公司成立估值委员会,明确参与估值流程各方的人员分工和职责,由投资管理部、风险管理部、基金运营部、法律合规与稽核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,由投资部中央交易室做出提示,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,并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,与估值委员会共同商定估值原则和政策。

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 本公司现没有签订任何与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的10%,报告期内应分配的金额是9,631,847.61元。本基金于2010年11月12日进行了分红(以2010年10月21日已实现的可分配收益为基准),每10份基金份额派发现金红利0.2元,分红金额总计50,722,480.34元,其中现金红利47,757,863.95元,红利再投2,964,616.39元。除息日为2010年10月28日,红利发放日为2010年11月1日。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所审计,注册会计师汪棣、金毅签字出具了普华永道中天审字(2011)第20230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:中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2010年12月31日
资产:	
银行存款	643,794,668.78
结算备付金	5,224,410.88
存出保证金	1,366,585.93
交易性金融资产	1,585,542,774.12
其中:股票投资	1,335,237,774.12
基金投资	-
债券投资	250,305,000.00
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	199,980,419.97
应收证券清算款	-
应收利息	8,004,961.86
应收股利	-
应收申购款	4,591,458.95
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	2,448,505,280.49
负债和所有者权益	**本期末 2010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	76,910,628.59
应付赎回款	1,221,916.33
应付管理人报酬	2,925,113.11
应付托管费	487,518.84
应付销售服务费	-
应付交易费用	4,204,974.90
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	104,605.18
负债合计	85,854,756.95
所有者权益:	
实收基金	2,317,054,527.78
未分配利润	45,595,995.76
所有者权益合计	2,362,650,523.54
负债和所有者权益总计	2,448,505,280.49

注:1、报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.020元,基金份额总额2,317,054,527.78份。

2、本财务报表的实际编制期间为2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日
一、收入	242,227,184.74
1.利息收入	11,723,127.55
其中:存款利息收入	1,880,075.39
债券利息收入	8,255,631.07
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,587,421.09
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	168,688,254.28
其中:股票投资收益	154,958,788.72
基金投资收益	-
债券投资收益	13,729,465.56
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	58,360,288.47
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	3,455,514.44
减:二、费用	32,736,307.54
1.管理人报酬	17,128,581.12
2.托管费	2,854,763.54
3.销售服务费	-
4.交易费用	12,536,472.72
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	216,490.16
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	209,490,877.20
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	209,490,877.20

注:本财务报表的实际编制期间为2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年8月25日(基金合同生效日)至2010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)	4,093,175,622.03	-	4,093,175,622.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	209,490,877.20	209,490,877.20
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)	-1,776,121,094.25	-113,172,401.10	-1,889,293,495.35
其中:1.基金申购款	767,363,424.33	42,580,520.52	809,943,944.85
2.基金赎回款	-2,543,484,518.58	-155,752,921.62	-2,699,237,440.20
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)	-	-50,722,480.34	-50,722,480.34
五、期末所有者权益(基金净值)	2,317,054,527.78	45,595,995.76	2,362,650,523.54

注:本财务报表的实际编制期间为2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分

本报告7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:贾建平,主管会计工作负责人:陈儒,会计机构负责人:乐妮

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2010]第748号《关于核准中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由中银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,091,977,265.49元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第216号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2010年8月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,093,175,622.03份基金份额,其中认购资金利息折合1,198,356.54份基金份额。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为:股票投资的比例范围为基金资产的30%-80%;债券投资的比例范围为基金资产的0%-65%,其中,基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,基金持有的现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60% + 上证国债指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于2011年3月24日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日止期间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2010年12月31日的财务状况以及2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。场内投资人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若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(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金管理人的股东、基金代销机构
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、基金代销机构
中银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、基金代销机构
贝莱德投资管理(英国)有限公司	基金管理人的股东

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

无。

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 2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	17,128,581.12
其中:支付销售机构的客户维护费	5,095,430.88

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 X 1.50%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,854,763.54

注:支付基金托管人招商银行股份有限公司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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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 2010年8月25日(基金合同生效日)至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	643,794,668.78	1,765,919.52

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2010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

无。

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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600664	哈药股份	2010-12-29	重大重组事项	22.57	2011-02-16	24.83	3,316,534	67,462,403.45	74,854,172.38	-

注:本基金截至2010年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)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应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2010年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为1,260,383,601.74元,属于第二层级的余额为325,159,172.38元,无属于第三层级的余额。本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	1,335,237,774.12	54.53
	其中:股票	1,335,237,774.12	54.53
2	固定收益投资	250,305,000.00	10.22
	其中:债券	250,305,000.00	10.22
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	199,980,419.97	8.17
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	649,019,079.66	26.51
6	其他各项资产	13,963,006.74	0.57
7	合计	2,448,505,280.49	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	80,121,385.75	3.39
B	采掘业	116,595,532.13	4.93
C	制造业	615,622,153.99	26.06
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	38,761,048.38	1.64
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	14,383,805.56	0.61
C5	电子	48,761,461.04	2.06
C6	金属、非金属	43,669,459.25	1.85
C7	机械、设备、仪表	330,382,758.15	13.98
C8	医药、生物制品	139,663,621.61	5.91
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	14,697,739.90	0.62
E	建筑业	50,380,790.87	2.13
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	164,168,405.94	6.95
H	批发和零售贸易	147,006,629.38	6.22
I	金融、保险业	112,261,182.36	4.75
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	34,383,953.80	1.46
	合计	1,335,237,774.12	56.51

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	600312	平高电气	6,995,939	95,354,648.57	4.04
2	002065	东华软件	2,694,412	82,907,057.24	3.51
3	000998	隆平高科	2,459,975	80,121,385.75	3.39
4	600664	哈药股份	3,316,534	74,854,172.38	3.17
5	601601	中国太保	2,842,350	65,089,815.00	2.75
6	000759	武汉中百	4,996,677	62,558,396.04	2.65
7	600690	青岛海尔	2,193,604	61,881,568.84	2.62
8	601989	中国重工	4,827,725	56,918,877.75	2.41
9	601318	中国平安	839,946	47,171,367.36	2.00
10	002063	远光软件	1,461,069	45,439,245.90	1.92

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www.bocim.com网站的年度报告/半年度报告正文。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000983	西山煤电	190,371,308.49	8.06
2	600309	烟台万华	168,439,372.58	7.13
3	000001	深发展A	127,319,594.22	5.39
4	000998	隆平高科	124,694,996.06	5.28
5	000800	一汽轿车	122,943,113.12	5.20
6	601601	中国太保	109,532,158.02	4.64
7	600312	平高电气	104,414,512.17	4.42
8	600329	中新药业	97,280,919.28	4.12
9	601939	建设银行	88,372,621.58	3.74
10	000537	广宇发展	85,950,819.56	3.64
11	601009	南京银行	85,386,947.52	3.61
12	000612	焦作万方	84,474,413.95	3.58
13	600435	中兵光电	84,188,946.05	3.56
14	600426	华鲁恒升	83,794,441.99	3.55
15	600256	广汇股份	82,558,239.17	3.49
16	000059	辽通化工	82,400,715.38	3.49
17	000786	北新建材	82,042,278.84	3.47
18	600660	福耀玻璃	81,918,628.68	3.47
19	600066	宇通客车	81,888,361.55	3.47
20	600481	双良节能	81,655,644.55	3.46
21	002106	莱宝高科	81,383,335.91	3.44
22	000933	神火股份	79,639,725.24	3.37
23	002386	天原集团	78,176,465.57	3.31
24	002065	东华软件	76,998,644.95	3.26
25	601168	西部矿业	76,409,925.30	3.23
26	600123	兰花科创	75,558,400.29	3.20
27	600500	中化国际	73,719,608.83	3.12
28	002063	远光软件	71,109,014.16	3.01
29	000759	武汉中百	70,523,332.39	2.98
30	600664	哈药股份	67,462,403.45	2.86
31	600487	亨通光电	63,118,196.06	2.67
32	002132	恒星科技	62,997,385.11	2.67
33	600138	中青旅	62,591,315.02	2.65
34	000028	一致药业	61,553,048.08	2.61
35	600141	兴发集团	60,275,390.09	2.55
36	600690	青岛海尔	59,042,857.88	2.50
37	601989	中国重工	58,317,804.84	2.47
38	002041	登海种业	57,602,939.46	2.44
39	600104	上海汽车	54,083,725.73	2.29
40	601318	中国平安	48,301,732.03	2.04
41	600031	三一重工	48,241,162.62	2.04
42	600095	哈高科	47,696,819.13	2.02

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600309	烟台万华	180,938,348.91	7.66
2	000983	西山煤电	154,469,663.39	6.54
3	000800	一汽轿车	139,049,023.00	5.89
4	000001	深发展A	111,772,081.28	4.73
5	600123	兰花科创	94,912,735.91	4.02
6	600660	福耀玻璃	90,527,339.15	3.83
7	600481	双良节能	89,620,797.87	3.79
8	600066	宇通客车	88,672,838.72	3.75
9	600141	兴发集团	86,635,063.18	3.67
10	601009	南京银行	85,283,484.58	3.61
11	600256	广汇股份	84,996,043.10	3.60
12	601168	西部矿业	84,995,961.66	3.60
13	000612	焦作万方	82,065,568.80	3.47
14	601939	建设银行	81,285,674.29	3.44
15	600426	华鲁恒升	81,242,630.26	3.44
16	002106	莱宝高科	80,960,973.21	3.43
17	000786	北新建材	79,267,232.47	3.36
18	000059	辽通化工	79,003,801.08	3.34
19	600329	中新药业	77,167,324.04	3.27
20	600435	中兵光电	75,783,780.38	3.21
21	002386	天原集团	74,873,614.55	3.17
22	600500	中化国际	68,912,911.45	2.92
23	600487	亨通光电	68,790,619.33	2.91
24	000537	广宇发展	68,732,226.60	2.91
25	002041	登海种业	60,153,561.19	2.55
26	000933	神火股份	58,283,812.22	2.47
27	600104	上海汽车	56,760,162.67	2.40
28	000998	隆平高科	55,882,757.59	2.37
29	600138	中青旅	55,618,072.38	2.35
30	002086	东方海洋	52,140,083.72	2.21
31	600737	中粮屯河	49,780,528.60	2.11

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。

8.4.3 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	4,871,534,939.23
卖出股票的收入(成交)总额	3,751,862,842.30

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	200,450,000.00	8.48
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	49,855,000.00	2.11
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	250,305,000.00	10.59

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	0801029	08央行票据29	1,000,000	100,240,000.00	4.24
2	0801026	08央行票据26	1,000,000	100,210,000.00	4.24
3	1081306	10苏国信CP01	500,000	49,855,000.00	2.11

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	1,366,585.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,004,961.86
5	应收申购款	4,591,458.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,963,006.74

8.9.4 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。

8.9.5 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	600664	哈药股份	74,854,172.38	3.17	重大重组事项

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
35,769	64,778.29	744,886,076.93	32.15%	1,572,168,450.85	67.85%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,008,682.59	0.0435%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日基金份额总额	4,093,175,622.03
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	767,363,424.33
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,543,484,518.58
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,317,054,527.78

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未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

1、基金管理人在本报告期内无重大人事变动;

2、本基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,没有发生基金投资策略的改变。

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100,000.00元,目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为1年(基金成立至报告期末)。

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任何稽查或处罚。

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	
中金公司	1	2,817,603,433.66	32.69%	2,289,326.26	31.88%	-
东方证券	1	2,299,135,610.46	26.67%	1,954,251.98	27.22%	-
申银万国	1	1,484,235,714.48	17.22%	1,261,596.23	17.57%	-
华泰联合证券	1	1,089,593,365.67	12.64%	885,305.75	12.33%	-
安信证券	1	328,918,933.74	3.82%	279,580.34	3.89%	-
中信证券	1	297,110,617.08	3.45%	252,542.02	3.52%	-
国泰君安	1	238,662,873.14	2.77%	202,861.38	2.83%	-
光大证券	1	64,533,214.90	0.75%	54,852.72	0.76%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国联公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

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:报告期内新增申银万国、安信证券、中信证券、东方证券、光大证券、国泰君安、华泰证券、瑞银证券、广发证券、浙商证券、国联证券、齐鲁证券、首创证券、渤海证券、东兴证券和红塔证券上海交易单元各一个;华泰联合证券、中金公司和天风证券深圳交易单元各一个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	973,822.08	0.83%	-	-	-	-
东方证券	-	-	6,500,000,000.00	89.04%	-	-
申银万国	-	-	800,000,000.00	10.96%	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	116,100,354.70	99.17%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国联公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

中银基金管理有限公司

二〇一一年三月三十日