

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
重要提示: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...

中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

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十二条 C 项本基金投资于股票资产占基金资产的 30%-80%...

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name) and 中银价值混合 (Zhangyin Value Mix). Includes details on fund code, type, and objectives.

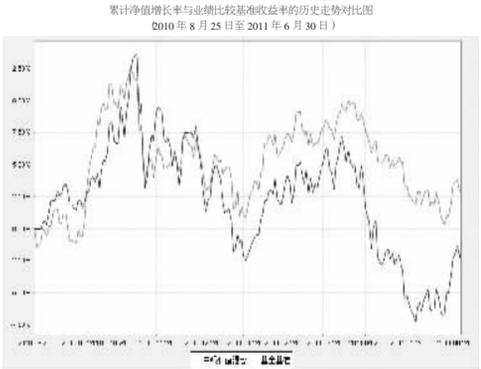
Table with 2 columns: 3.1 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 单位:人民币元 (Unit: RMB Yuan). Shows performance metrics for the reporting period.

注:1.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...

3.2 基金净值表现 (Fund Net Value Performance)
3.2.1 本报告期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

Table comparing fund performance with benchmark (沪深300) over three periods: 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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



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

4.1 基金经理 (基金经理小组 简介)

Table listing fund managers: 张余东 (Zhang Yuedong) and 彭程 (Peng Cheng), including their roles and tenure.

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...

4.3 公平交易专项说明 (Fair Trading Statement)
4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年第二季度国内证券市场面临着一系列的内外因素。从国内经济形势看,主要表现为通胀的超预期上行...

2.行情回顾 (Market Review)
二季度,由于担心经济下行,投资者逐步转向有估值有安全边际的行业和资产...

3.基金运作分析 (Fund Operation Analysis)
中银价值基金在二季度维持了第一季度末在建材、煤炭、家电和房地产等方面的配置...

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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 (Macroeconomic Analysis)
国内经济方面,二季度全球复苏进程陷入疲软,美国经济增长低于预期...

2.行情回顾 (Market Review)
二季度,由于担心经济下行,投资者逐步转向有估值有安全边际的行业和资产...

3.基金运作分析 (Fund Operation Analysis)
中银价值基金在二季度维持了第一季度末在建材、煤炭、家电和房地产等方面的配置...

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示: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...

中银中证 100 指数增强型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

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十二条 C 项本基金投资于股票资产占基金资产的 30%-80%...

Table with 2 columns: 基金简称 (Fund Name) and 中银中证 100 指数增强 (Zhangyin CSI 100 Index Enhance). Includes details on fund code, type, and objectives.

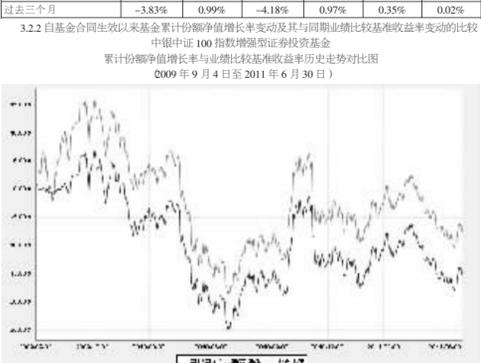
Table with 2 columns: 3.1 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 单位:人民币元 (Unit: RMB Yuan). Shows performance metrics for the reporting period.

注:1.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...

3.2 基金净值表现 (Fund Net Value Performance)
3.2.1 本报告期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

Table comparing fund performance with benchmark (沪深300) over three periods: 过去三个月, 过去六个月, 过去一年.

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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



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

4.1 基金经理 (基金经理小组 简介)

Table listing fund managers: 陈军 (Chen Jun) and 周小川 (Zhou Xiaochuan), including their roles and tenure.

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...

4.3 公平交易专项说明 (Fair Trading Statement)
4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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 (Macroeconomic Analysis)
国内经济方面,二季度全球复苏进程陷入疲软,美国经济增长低于预期...

2.行情回顾 (Market Review)
二季度,由于担心经济下行,投资者逐步转向有估值有安全边际的行业和资产...

3.基金运作分析 (Fund Operation Analysis)
中银中证100指数增强基金在二季度维持了第一季度末在建材、煤炭、家电和房地产等方面的配置...

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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 (Macroeconomic Analysis)
国内经济方面,二季度全球复苏进程陷入疲软,美国经济增长低于预期...

2.行情回顾 (Market Review)
二季度,由于担心经济下行,投资者逐步转向有估值有安全边际的行业和资产...

3.基金运作分析 (Fund Operation Analysis)
中银中证100指数增强基金在二季度维持了第一季度末在建材、煤炭、家电和房地产等方面的配置...

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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 (Macroeconomic Analysis)
国内经济方面,二季度全球复苏进程陷入疲软,美国经济增长低于预期...

于前期影响,实体经济层面的下滑估计还会延续一段时间,这会影响到上市公司的业绩...

5.1 报告期末基金资产组合情况 (Fund Asset Portfolio)
Table with 4 columns: 序号 (No.), 项目 (Item), 金额(元) (Amount), 占基金总资产的比例(%) (Ratio).

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 (Stock Investment by Industry)
Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Ratio).

5.3 报告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 (Top 10 Stocks by Fair Value)

Table listing top 10 stocks by fair value, including 1. 601699 嘉友环境, 2. 600690 青岛啤酒, etc.

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细 (Top 10 Bonds by Fair Value)

Table listing top 10 bonds by fair value, including 1. 100226 10国债开26, 2. 120268 11国债01, etc.

5.5 报告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 (Top 5 Bonds by Fair Value)

Table listing top 5 bonds by fair value, including 1. 100226 10国债开26, 2. 120268 11国债01, etc.

5.6 报告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 (Top 10 ABS by Fair Value)

5.7 报告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 (Top 5 Warrants by Fair Value)

5.8 投资组合报告附注 (Notes to Investment Portfolio)
5.8.1 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...

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

Table showing the composition of other assets, including 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

7.1 备查文件目录 (Available Documents)
1. 中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同

7.2 存放地点 (Storage Location)
基金管理人及基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人网站 www.bocim.com

7.3 查阅方式 (Access Method)
投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人办公场所免费查阅,也可登录基金管理人网站 www.bocim.com 查询。

中银基金管理有限公司
二〇一一年七月二十一日

中银中证 100 指数增强型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30日

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十二条 C 项本基金投资于股票资产占基金资产的 30%-80%...

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

重要提示: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...

4.1 基金经理 (基金经理小组 简介)

Table listing fund managers: 陈军 (Chen Jun) and 周小川 (Zhou Xiaochuan), including their roles and tenure.

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...

4.3 公平交易专项说明 (Fair Trading Statement)
4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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 (Macroeconomic Analysis)
国内经济方面,二季度全球复苏进程陷入疲软,美国经济增长低于预期...

2.行情回顾 (Market Review)
二季度,由于担心经济下行,投资者逐步转向有估值有安全边际的行业和资产...

3.基金运作分析 (Fund Operation Analysis)
中银中证100指数增强基金在二季度维持了第一季度末在建材、煤炭、家电和房地产等方面的配置...

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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 (Macroeconomic Analysis)
国内经济方面,二季度全球复苏进程陷入疲软,美国经济增长低于预期...

2.行情回顾 (Market Review)
二季度,由于担心经济下行,投资者逐步转向有估值有安全边际的行业和资产...

3.基金运作分析 (Fund Operation Analysis)
中银中证100指数增强基金在二季度维持了第一季度末在建材、煤炭、家电和房地产等方面的配置...

本基金将严格按照契约约定,被动投资为主,主动投资为辅,保持跟踪误差在较小范围内;同时,本基金的主要投资策略为“控制仓位,采取自上而下策略,力求超额回报”。

5.1 报告期末基金资产组合情况 (Fund Asset Portfolio)
Table with 4 columns: 序号 (No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Ratio).

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 (Stock Investment by Industry)
Table with 4 columns: 代码 (Code), 行业类别 (Industry), 公允价值(元) (Fair Value), 占基金资产净值比例(%) (Ratio).

5.3 报告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 (Top 10 Stocks by Fair Value)

Table listing top 10 stocks by fair value, including 1. 601699 嘉友环境, 2. 600690 青岛啤酒, etc.

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细 (Top 10 Bonds by Fair Value)

Table listing top 10 bonds by fair value, including 1. 600256 广汇股份, 2. 000425 徐工机械, etc.

5.5 报告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 (Top 5 Bonds by Fair Value)

Table listing top 5 bonds by fair value, including 1. 600256 广汇股份, 2. 000425 徐工机械, etc.

5.6 报告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 (Top 10 ABS by Fair Value)

5.7 报告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 (Top 5 Warrants by Fair Value)

5.8 投资组合报告附注 (Notes to Investment Portfolio)
5.8.1 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...

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

Table showing the composition of other assets, including 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, etc.

7.1 备查文件目录 (Available Documents)
1. 中银中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同

7.2 存放地点 (Storage Location)
基金管理人及基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站 www.bocim.com

7.3 查阅方式 (Access Method)
投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅,也可登录基金管理人网站 www.bocim.com 查询。

中银基金管理有限公司
二〇一一年七月二十一日