

中银收益混合型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 1 重要提示; 基金管理人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法律责任。

2.1 基金基本情况; 基金简称:中银收益混合; 基金主代码: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;

3.1.1 期间回报指标; 本报告期2011年1月1日至2011年6月30日; 本期已实现收益:535,888.30; 本期利润总额:-377,962,148.52;

3.2 基金合同生效以来基金业绩比较基准; 基金合同生效以来基金业绩比较基准净值增长率变动的比较; 2006年10月11日至2011年6月30日;

4 管理人报告; 4.1 基金管理人及基金托管人; 4.2 基金管理人及基金托管人的履职情况; 4.3 公平交易制度的执行情况;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:陈军; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2006-10-11;

基金管理人及基金托管人; 姓名:甘霖; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2007-08-22;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:陈军; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2006-10-11;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:甘霖; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2007-08-22;

中银收益混合型证券投资基金 2011 半年度 报告摘要

基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 基金合同生效以来基金业绩比较基准; 2006年10月11日至2011年6月30日;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:陈军; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2006-10-11;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:甘霖; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2007-08-22;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:陈军; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2006-10-11;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:甘霖; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2007-08-22;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:陈军; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2006-10-11;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:甘霖; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2007-08-22;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:陈军; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2006-10-11;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:甘霖; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2007-08-22;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:陈军; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2006-10-11;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:甘霖; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2007-08-22;

中银收益混合型证券投资基金 2011 半年度 报告摘要

基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 基金合同生效以来基金业绩比较基准; 2006年10月11日至2011年6月30日;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:陈军; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2006-10-11;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:甘霖; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2007-08-22;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:陈军; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2006-10-11;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:甘霖; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2007-08-22;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:陈军; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2006-10-11;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:甘霖; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2007-08-22;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:陈军; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2006-10-11;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:甘霖; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2007-08-22;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:陈军; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2006-10-11;

基金管理人及基金托管人; 基金管理人:中国银行股份有限公司; 基金托管人:中国工商银行股份有限公司; 姓名:甘霖; 职务:中银收益基金基金经理; 任职日期:2007-08-22;

7.4.2 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:600515; 股票名称:海螺水泥; 本期累计卖出金额:139,299,394.72; 占期初基金资产净值的比例:3.71;

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:600515; 股票名称:海螺水泥; 买入股票的成本总额:1,499,972,273.15; 卖出股票的收入总额:1,449,972,273.15;

7.5 期末按股票品种分类的债券投资组合; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.6 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; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名支持债券投资明细; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.9 本基金持有的前十名股票的发行人主体评级有未出具或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、处罚的情况; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.9.2 本基金持有的前十名股票有超出基金合同约定的备选股票库; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.9.3 期末其他各项资产余额; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.9.5 期末前十名股票中有处于流通受限情况的说明; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

8 基金份额持有人信息; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人数量; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

8.2 期末基金份额持有人的从业人员持有本基金开放式基金的情况; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

8.3 期末基金份额持有人的从业人员持有本基金开放式基金的情况; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

9 开放式基金份额变动; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

10 重大事件揭示; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

10.1 基金的持有人大会决议; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

10.2 基金管理人及基金托管人变更的公告; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

10.4 基金投资策略的改变; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

10.5 报告期末基金投资资产中的重大事件; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

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; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.4 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股票投资明细; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:600515; 股票名称:海螺水泥; 数量(股):17,868,843; 公允价值:235,153,973.88; 占基金资产净值的比例:7.74;

7.5 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; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

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支持债券投资明细; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.9 本基金持有的前十名股票的发行人主体评级有未出具或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、处罚的情况; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.9.2 本基金持有的前十名股票有超出基金合同约定的备选股票库; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.9.3 期末其他各项资产余额; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;

7.9.5 期末前十名股票中有处于流通受限情况的说明; 基金单位:人民币元; 序号:1; 股票代码:110011; 债券名称:11附息国债11; 数量(张):1,000,000; 公允价值:99,440,000.00; 占基金资产净值的比例:3.27;