# 中银持续增长股票型证券投资基金

## 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：二〇一一年八月二十六日**

## 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——中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011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2011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 | 中银增长股票 |
| 基金主代码 | 163803 |
| 交易代码 | 163803 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年3月17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 | 11,753,771,985.46份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 着重考虑具有可持续增长性的上市公司，努力为投资者实现中、长期资本增值的目标。 |
| 投资策略 | 本基金采取自上而下与自下而上相结合的主动投资管理策略，将定性与定量分析贯穿于公司价值评估、投资组合构建以及组合风险管理的全过程之中。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的整体业绩基准=MSCI中国A股指数×85%+上证国债指数×15% |
| 风险收益特征 | 本基金是主动型的股票基金，属于证券投资基金中风险偏上的品种。 |

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 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 程明 | 赵会军 |
| | 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

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.bocim.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 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(2011年1月1日至2011年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 192,722,027.55 |
| 本期利润 | -924,161,702.55 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0764 |
| 本期基金份额净值增长率 | -9.61% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | **报告期末(2011年6月30日)** |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0596 |
| 期末基金资产净值 | 8,392,875,890.94 |
| 期末基金份额净值 | 0.7141 |

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为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

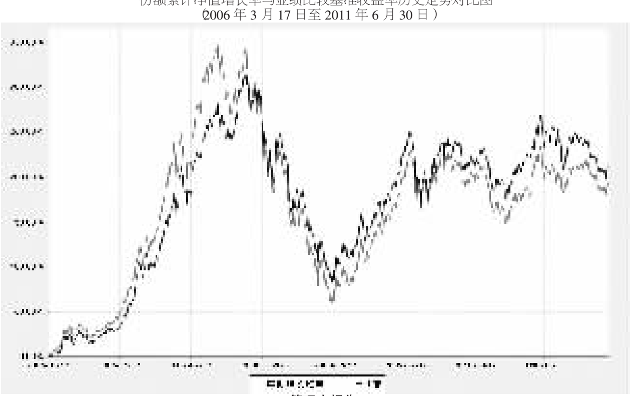
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 2.03% | 0.99% | 1.70% | 1.05% | 0.33% | -0.06% |
| 过去三个月 | -5.55% | 0.95% | -4.94% | 0.96% | -0.61% | -0.01% |
| 过去六个月 | -9.61% | 1.16% | -3.00% | 1.06% | -6.61% | 0.10% |
| 过去一年 | 13.88% | 1.26% | 18.44% | 1.20% | -4.56% | 0.06% |
| 过去三年 | 19.38% | 1.65% | 17.92% | 1.69% | 1.46% | -0.04% |
| 过去五年 | 149.23% | 1.73% | 120.90% | 1.82% | 28.33% | -0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 214.71% | 1.71% | 192.90% | 1.79% | 21.81% | -0.08% |

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

中银持续增长股票型证券投资基金

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

(2006年3月17日至2011年6月30日)



## 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有限公司合资组建(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2011年6月30日，本管理人共管理十四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、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及中银转债增强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 | | |
| 俞岱曦 | 中银增长基金经理，中银优选基金经理，公司副总经理 | 2008-04-03 | - | 13 | 中银基金管理有限公司副总经理，经济学硕士。曾任嘉实基金管理有限公司全国社保基金106组合基金经理、基金丰和基金经理助理，鹏华基金管理有限公司基金普润基金经理助理、行业分析师。2007年加入中银基金管理有限公司，2008年4月至今任中银增长基金经理，2009年4月至今任中银优选基金经理。具有13年证券从业年限。具备基金从业资格。 |
| 张琦 | 中银增长基金经理 | 2010-07-08 | - | 6 | 中银基金管理有限公司助理副总裁(AVP)，经济学硕士。2005年加入中银基金管理有限公司，先后担任研究员、中银增长基金经理助理等职。2010年7月至今任中银增长基金经理。具有6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

| 阶段 | 基金名称 | 净值增长率 |
|---|---|---|
| 2011年1月1日至 | 本基金 | -9.61% |
| 2011年6月30日 | 中银策略基金 | -6.96% |

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

上半年，从国外主要经济体的经济情况来看，欧美经济复苏呈现差异性，美国经济复苏情况不尽如人意，而欧洲经济延续复苏势头，但随后势头有所减弱。具体来看，美国的GDP增速低于预期，经济复苏步伐缓慢。油价的大幅上升导致了通胀压力的传导，对消费需求形成了抑制，也提升了供给端的成本，在供需双重夹击之下，美国企业生产活动二季度也有所放缓，PMI从一季度的60下滑到二季度的55.3，失业率也反弹至9.2%。从欧元区经济来看，欧元区的复苏则延续了2010年的强劲势头，一季度GDP增长3.2%，显著优于美国和日本，但是二季度以来，欧元区工业生产增速有所放缓，欧洲债务危机的实质性影响依然存在。

从国内宏观经济情况来看，国内通胀压力日益突出，CPI连创新高，为了抑制通胀，今年以来，央行连续六次提高准备金率、三次加息，配合公开市场放量、严格的信贷调节以及银行监管新规，货币政策大幅收紧。与此同时，宏观经济已经明显出现了放缓的势头，代表下游的汽车产量增速低位徘徊，中游粗钢、水泥产量增速均高位回落，而上游的发电增速也出现回落，这意味着下游回落的影响已经传导到了中上游，经济增速出现一定程度的回落。

从通胀形势来看，6月份的CPI同比增速创出新高，但全年来看，CPI前高后低的可能性较大。鉴于我们对当前通胀和经济形势的判断，宏观经济仍处于着陆过程中，考虑到中央财政的实力和储备项目，年内经济硬着陆的概率很小。从政策层面来看，目前已经进入了一个重要的政策观察期，宏观政策的针对性和灵活性有望得到加强，换言之，在通胀趋势尚未得到扭转之前，宏观政策紧缩的主基调不会改变，但是紧缩的力度将动态减轻。

2. 市场回顾

上半年，上证指数下跌了1.64%，CPI连创新高，货币政策不断收紧，经济增速平稳回落，新增股票供给不断增加，多重因素的叠加导致了市场估值中枢的下移，投资者信心受到了冲击。

3. 运行分析

上半年，在大类资产的配置上，本基金根据市场的变化降低了权益类资产的头寸，在市场寻底的过程中，又适时增加了权益类资产的头寸。在行业和板块的选择上，本基金增加了大市值的金融、煤炭以及大消费板块的配置比例。而在个股选择上，我们依然坚定持有那些能够在中长期战胜市场的优质标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年6月30日为止，本基金的单位净值为0.7141元，本基金的累计单位净值为2.8311元。2011年上半年本基金净值增长率为-9.61%，同期业绩基准增长率为-3.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

金融危机之后，全球经济秩序和金融格局都有重构的内在要求。以中国为代表的金砖国家的经济地位显著提升，新兴经济体和发展中国家的经济总量也首次超过了发达国家的经济总量，这是全球经济的一个深刻变化。

对于中国经济而言，在新的历史起点上，如何实现产业结构的转型和升级，实现宏观经济的可持续发展，是未来相当长的一段时间内所面临的重要使命。中国有庞大的腹地经济和消费市场，客观存在着区域差异和产业梯次，产业结构的转移和升级可以并行不悖，传统产业的发展和新兴产业的勃兴也可以相得益彰，这将在很大程度上熨平产业调整中的波动风险。制度的改革、创新和完善，也将进一步激发经济的内在活力。因此，我们对中国经济的长期转型和发展潜力持相对乐观的态度。在新的发展阶段，既有的粗放式的发展模式可能难以为继，企业需要在变革和创新中寻求突破，探索一条新的发展道路。我们坚信，在这一过程中，势必会诞生一批新的伟大企业，成为推动经济转型的微观基础。

具体到下半年，全球经济复苏仍然在波折中缓慢前行。不确定性因素仍然很多，欧洲债务危机的风险并未消除。对于美国经济而言，无论国债上限问题如何解决，都已经昭示出了美国财政政策回旋余地已经很小，货币政策仍然是可资利用的相对灵活和低成本的政策工具。我们无法明确判断美联储QE3推出的可能性和时点，但是货币政策总体宽松的局面不会改变。但从中长期来看，美元超发带来的信用风险将是美联储不得不面对的难题。

具体到下半年的国内经济，随着宏观调控政策逐步发挥效应，通胀压力有望渐次回落。尽管经济增速也出现了一定程度的平稳回落，但是增长势头仍然较为强劲，宏观经济出现硬着陆的风险很小。

从政策面来看，在国内通胀压力没有出现明显回落迹象之前，预期国内货币政策出现重大转向是不现实的。但由于国际形势仍然较为复杂，全球经济复苏的路径依然曲折，在这一背景下，我们认为，货币政策将保持相应的针对性和灵活性，政策收紧的节奏和力度将有所放松。当前已经进入一个重要的政策观察期，我们判断，在"十二五"的开局之年，宏观政策在"防通胀"的同时，将兼顾"保增长"和"促转型"的政策目标。

在投资策略上，下半年，我们将适度增加权益投资的比例。在行业和板块选择上，我们在现有配置的基础上，将加大对估值处在低位且盈利增长明确的成长股的配置，毕竟成长股的投资将成为未来相当长一个时期内的投资主线。在大的背景下，中小企业面临着转型的压力和困惑，原有发展模式的瓶颈已经出现，有好的商业模式、核心优势、治理结构、管理水平和激励机制的优质企业终将胜出。因而，在个股选择上，我们将继续遵循"自上而下"与"自下而上"相结合的方法，着重从企业的基本面出发挖掘投资价值，聚焦于企业盈利的成长性、稳定性和确定性。

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

本基金本报告期期末可供分配利润700,510,994.92元，2011年1月13日(以2010年12月31日为收益分配基准日)本基金进行了利润分配，向基金份额持有人每10份基金份额派发现金红利0.8元，分红总金额为948,516,565.81元。

## 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

2011年上半年，本基金托管人在对中银持续增长股票型证券投资基金的托管过程中，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

2011年上半年，中银持续增长股票型证券投资基金的管理人——中银基金管理有限公司在中银持续增长股票型证券投资基金的投资运作、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，中银持续增长股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为948,516,565.81元。

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

本托管人依法对中银基金管理有限公司编制和披露的中银持续增长股票型证券投资基金2011年半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。

## 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：中银持续增长股票型证券投资基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2011年6月30日 | 上年度末 2010年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 778,302,847.93 | 397,276,713.85 |
| 结算备付金 | 22,730,302.92 | 13,038,933.54 |
| 存出保证金 | 3,132,769.50 | 1,910,409.88 |
| 交易性金融资产 | 7,681,551,847.28 | 10,059,100,631.35 |
| 其中：股票投资 | 7,112,898,466.58 | 9,458,509,109.25 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 568,653,380.70 | 600,591,522.10 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 6,985,317.60 | 5,499,248.26 |
| 应收股利 | 420,000.00 | - |
| 应收申购款 | 118,707.97 | 1,103,277.80 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 8,493,241,793.20 | 10,477,929,214.68 |
| **负债和所有者权益** | **本期末 2011年6月30日** | **上年度末 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 | 79,502,085.50 | 74,945,570.20 |
| 应付赎回款 | 3,253,195.36 | 3,119,309.37 |
| 应付管理人报酬 | 10,121,374.12 | 13,333,380.60 |
| 应付托管费 | 1,686,895.70 | 2,222,230.11 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 3,948,980.16 | 8,902,033.54 |
| 应交税费 | 299,000.00 | 299,000.00 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 1,554,371.42 | 1,421,661.36 |
| 负债合计 | 100,365,902.26 | 104,243,185.18 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 4,617,996,808.71 | 4,672,550,189.90 |
| 未分配利润 | 3,774,879,082.23 | 5,701,135,839.60 |
| 所有者权益合计 | 8,392,875,890.94 | 10,373,686,029.50 |
| 负债和所有者权益总计 | 8,493,241,793.20 | 10,477,929,214.68 |

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值0.7141元，基金份额总额11,753,771,985.46份。

6.2 利润表

会计主体：中银持续增长股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | -825,979,446.32 | -2,019,587,579.29 |
| 1.利息收入 | 14,555,461.58 | 17,033,277.29 |
| 其中：存款利息收入 | 1,506,233.99 | 3,558,818.48 |
| 债券利息收入 | 7,540,003.53 | 12,113,835.61 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 5,509,224.06 | 1,360,623.20 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 276,136,380.97 | -72,673,379.72 |
| 其中：股票投资收益 | 230,005,451.92 | -112,557,745.33 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 3,390,720.62 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 42,740,208.43 | 39,884,365.61 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -1,116,883,730.10 | -1,964,572,838.15 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 212,441.23 | 625,361.29 |
| 减：二、费用 | 98,182,256.23 | 108,552,558.21 |
| 1.管理人报酬 | 67,714,497.59 | 77,969,255.10 |
| 2.托管费 | 11,285,749.61 | 12,994,875.82 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 18,149,036.37 | 17,270,843.82 |
| 5.利息支出 | 714,216.48 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 714,216.48 | - |
| 6.其他费用 | 318,756.18 | 317,583.47 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | -924,161,702.55 | -2,128,140,137.50 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | -924,161,702.55 | -2,128,140,137.50 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中银持续增长股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至2011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) | 4,672,550,189.90 | 5,701,135,839.60 | 10,373,686,029.50 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -924,161,702.55 | -924,161,702.55 |
| 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) | -54,553,381.19 | -53,578,489.01 | -108,131,870.20 |
| 其中：1.基金申购款 | 322,945,450.85 | 304,107,269.47 | 627,052,720.32 |
| 2.基金赎回款 | -377,498,832.04 | -357,685,758.48 | -735,184,590.52 |
| 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) | - | -948,516,565.81 | -948,516,565.81 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 4,617,996,808.71 | 3,774,879,082.23 | 8,392,875,890.94 |
| **项目** | **上年度可比期间 2010年1月1日至2010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) | 5,481,858,831.09 | 6,396,737,809.86 | 11,878,596,640.95 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -2,128,140,137.50 | -2,128,140,137.50 |
| 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) | -311,686,372.71 | -327,998,776.77 | -639,685,149.48 |
| 其中：1.基金申购款 | 106,673,203.77 | 107,726,084.74 | 214,399,288.51 |
| 2.基金赎回款 | -418,359,576.48 | -435,724,861.51 | -854,084,437.99 |
| 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) | 5,170,172,458.38 | 3,940,598,895.59 | 9,110,771,353.97 |

报告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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银持续增长股票型证券投资基金(原名为中银国际持续增长股票型证券投资基金，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")证监基金字[2005]第197号《关于同意中银国际持续增长股票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(原名为中银国际基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银国际持续增长股票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2,457,954,759.56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(2006)第17号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银国际持续增长股票型证券投资基金基金合同》于2006年3月17日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,458,895,662.35份基金份额，其中认购资金利息折合940,902.79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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中银国际持续增长股票型证券投资基金招募说明书》和《中银国际持续增长股票型证券投资基金开展基金份额拆分及持续销售活动的公告》的有关规定，本基金于2007年7月27日进行了基金份额拆分，拆分比例为1：2.545214074，并于2007年7月27日进行了变更登记。

根据本基金的基金管理人于2008年2月27日发布的《中银基金管理有限公司关于变更旗下基金名称的公告》的有关规定，本基金正式更名为中银持续增长股票型证券投资基金，其基金合同相应更名为《中银持续增长股票型证券投资基金基金合同》，本次变更不影响本基金已签署的全部法律文件的效力及其履行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银持续增长股票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，包括国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。主要投资对象为有增长前景且具备可持续性潜力的股票。投资组合中股票资产投资比例不低于基金净资产的60%；现金类资产、债券资产及回购比例符合法律法规的有关规定。本基金的业绩比较基准为：MSCI中国A股指数×85%+上证国债指数×15%。

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8月26日批准报出。

6.4.2 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》、《中银持续增长股票型证券投资基金基金合同》和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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011年半年度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2011年6月30日的财务状况以及2011年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

无。

6.4.6 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。

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

本基金本报告期不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。

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 |
| 中国工商银行股份有限公司("中国工商银行") | 基金托管人、基金代销机构 |
| 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 |

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

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 | | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 中银证券 | 1,138,802,609.13 | 10.06% | 636,208,063.86 | 5.76% |

6.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中银证券 | 948,071.49 | 9.96% | 144,713.12 | 3.67% |
| **关联方名称** | **上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日** | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中银证券 | 523,775.23 | 5.63% | - | - |

注：1、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的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。

2、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。

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 2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 67,714,497.59 | 77,969,255.10 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 11,026,620.51 | 12,553,278.07 |

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 11,285,749.61 | 12,994,875.82 |

注：支付基金托管人中国工商银行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。

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

无。

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

无。

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

无。

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 2011年1月1日至2011年6月30日 | | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010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 |
| 中国工商银行 | 778,302,847.93 | 1,413,766.18 | 1,218,896,098.48 | 3,475,584.47 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2011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 |
| 601113 | 华鼎锦纶 | 2011-04-28 | 2011-08-12 | 新股网下申购 | 14.00 | 14.26 | 485,584 | 6,798,176.00 | 6,924,427.84 | - |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.9.2 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 600315 | 上海家化 | 2010-12-06 | 重大事项停牌 | 35.60 | - | - | 13,000,000 | 268,839,382.14 | 462,800,000.00 | - |
| 002296 | 辉煌科技 | 2011-06-28 | 重大事项停牌 | 26.00 | - | - | 3,133,991 | 76,283,940.20 | 81,483,766.00 | - |

注：本基金截至2011年06月30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。

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

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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 | 7,112,898,466.58 | 83.75 |
| | 其中：股票 | 7,112,898,466.58 | 83.75 |
| 2 | 固定收益投资 | 568,653,380.70 | 6.70 |
| | 其中：债券 | 568,653,380.70 | 6.70 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 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 | 801,033,150.85 | 9.43 |
| 6 | 其他各项资产 | 10,656,795.07 | 0.13 |
| 7 | 合计 | 8,493,241,793.20 | 100.00 |

7.2 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 | 43,195,074.85 | 0.51 |
| B | 采掘业 | 963,666,849.05 | 11.48 |
| C | 制造业 | 2,790,451,229.90 | 33.25 |
| C0 | 食品、饮料 | 535,252,031.47 | 6.38 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 77,625,535.54 | 0.92 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 530,614,169.00 | 6.32 |
| C5 | 电子 | 64,887,776.90 | 0.77 |
| C6 | 金属、非金属 | 263,905,455.16 | 3.14 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 940,734,166.35 | 11.21 |
| C8 | 医药、生物制品 | 377,432,095.48 | 4.50 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 176,183,399.12 | 2.10 |
| E | 建筑业 | 302,639,849.37 | 3.61 |
| F | 交通运输、仓储业 | 93,649,449.38 | 1.12 |
| G | 信息技术业 | 890,642,974.78 | 10.61 |
| H | 批发和零售贸易 | 811,088,845.82 | 9.66 |
| I | 金融、保险业 | 670,236,777.87 | 7.99 |
| J | 房地产业 | 68,789,270.70 | 0.82 |
| K | 社会服务业 | 254,618,745.74 | 3.03 |
| L | 传播与文化产业 | 47,736,000.00 | 0.57 |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 7,112,898,466.58 | 84.75 |

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 | 600690 | 青岛海尔 | 18,542,955 | 518,275,592.25 | 6.18 |
| 2 | 600315 | 上海家化 | 13,000,000 | 462,800,000.00 | 5.51 |
| 3 | 600739 | 辽宁成大 | 12,514,281 | 347,897,011.80 | 4.15 |
| 4 | 002065 | 东华软件 | 14,557,261 | 345,007,085.70 | 4.11 |
| 5 | 000869 | 张裕A | 3,349,024 | 330,883,571.20 | 3.94 |
| 6 | 600050 | 中国联通 | 49,999,623 | 262,498,020.75 | 3.13 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 15,399,691 | 201,427,958.28 | 2.40 |
| 8 | 601088 | 中国神华 | 5,999,694 | 180,830,777.16 | 2.15 |
| 9 | 600795 | 国电电力 | 55,399,797 | 163,983,399.12 | 1.95 |
| 10 | 601857 | 中国石油 | 14,999,501 | 163,344,565.89 | 1.95 |

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http://www.bocim.com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 | 600050 | 中国联通 | 361,589,629.57 | 3.49 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 267,209,911.00 | 2.58 |
| 3 | 000869 | 张裕A | 264,898,051.12 | 2.55 |
| 4 | 600795 | 国电电力 | 184,409,953.26 | 1.78 |
| 5 | 600395 | 盘江股份 | 177,920,317.80 | 1.72 |
| 6 | 601088 | 中国神华 | 174,599,406.72 | 1.68 |
| 7 | 601857 | 中国石油 | 174,084,874.51 | 1.68 |
| 8 | 000783 | 长江证券 | 167,940,583.83 | 1.62 |
| 9 | 600581 | 八一钢铁 | 157,589,624.54 | 1.52 |
| 10 | 600068 | 葛洲坝 | 154,457,843.55 | 1.49 |
| 11 | 600585 | 海螺水泥 | 149,134,072.28 | 1.44 |
| 12 | 600837 | 海通证券 | 146,413,540.79 | 1.41 |
| 13 | 600031 | 三一重工 | 144,101,635.28 | 1.39 |
| 14 | 601668 | 中国建筑 | 132,278,039.49 | 1.28 |
| 15 | 600153 | 建发股份 | 122,088,067.25 | 1.18 |
| 16 | 600125 | 铁龙物流 | 112,327,953.13 | 1.08 |
| 17 | 000895 | 双汇发展 | 97,221,484.07 | 0.94 |
| 18 | 601888 | 中国国旅 | 89,075,191.20 | 0.86 |
| 19 | 600005 | 武钢股份 | 79,209,180.45 | 0.76 |
| 20 | 600644 | 乐山电力 | 77,333,513.38 | 0.75 |

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。

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 | 600068 | 葛洲坝 | 376,663,263.91 | 3.63 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 272,175,960.65 | 2.62 |
| 3 | 600050 | 中国联通 | 247,379,874.41 | 2.38 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 239,280,121.39 | 2.31 |
| 5 | 600309 | 烟台万华 | 203,064,458.26 | 1.96 |
| 6 | 600383 | 金地集团 | 185,149,416.49 | 1.78 |
| 7 | 600690 | 青岛海尔 | 182,227,804.00 | 1.76 |
| 8 | 600581 | 八一钢铁 | 166,603,462.28 | 1.61 |
| 9 | 000983 | 西山煤电 | 152,481,781.24 | 1.47 |
| 10 | 601666 | 平煤股份 | 147,990,565.81 | 1.43 |
| 11 | 601699 | 潞安环能 | 143,134,972.85 | 1.38 |
| 12 | 600348 | 阳泉煤业 | 137,113,194.52 | 1.32 |
| 13 | 000933 | 神火股份 | 134,336,178.12 | 1.29 |
| 14 | 601899 | 紫金矿业 | 133,391,909.97 | 1.29 |
| 15 | 600739 | 辽宁成大 | 131,216,281.56 | 1.26 |
| 16 | 600030 | 中信证券 | 130,739,214.75 | 1.26 |
| 17 | 000968 | 煤气化 | 122,830,473.19 | 1.18 |
| 18 | 600887 | 伊利股份 | 119,971,669.99 | 1.16 |
| 19 | 600837 | 海通证券 | 113,960,631.01 | 1.10 |
| 20 | 601111 | 中国国航 | 111,704,612.16 | 1.08 |

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。

7.4.3 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 | 5,015,799,300.94 |
| 卖出股票的收入(成交)总额 | 6,475,100,406.83 |

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 | 79,632,000.00 | 0.95 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 458,004,000.00 | 5.46 |
| | 其中：政策性金融债 | 458,004,000.00 | 5.46 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 31,017,380.70 | 0.37 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 568,653,380.70 | 6.78 |

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

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 | 110222 | 11国开22 | 2,000,000 | 199,280,000.00 | 2.37 |
| 2 | 080222 | 08国开22 | 2,000,000 | 198,640,000.00 | 2.37 |
| 3 | 110009 | 11附息国债09 | 800,000 | 79,632,000.00 | 0.95 |
| 4 | 080306 | 08进出06 | 600,000 | 60,084,000.00 | 0.72 |
| 5 | 110015 | 石化转债 | 236,620 | 25,519,467.00 | 0.30 |

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 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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 | 3,132,769.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 420,000.00 |
| 4 | 应收利息 | 6,985,317.60 |
| 5 | 应收申购款 | 118,707.97 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,656,795.07 |

7.9.4 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。

7.9.5 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 | 600315 | 上海家化 | 462,800,000.00 | 5.51 | 重大事项停牌 |

7.9.6 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。

## 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 |
| 439,791 | 26,725.81 | 330,071,304.39 | 2.81% | 11,423,700,681.07 | 97.19% |

8.2 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 | 543,073.98 | 0.0046% |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2006年3月17日)基金份额总额 | 2,458,895,662.35 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 11,892,598,264.25 |
| 本报告期基金总申购份额 | 821,988,423.66 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 960,814,702.45 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 11,753,771,985.46 |

## 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，基金管理人第二届董事会任期届满，经本基金管理人2011年第二次股东会议审议通过，选举谭炯先生、陈儒先生、梅非奇先生、葛岱炜(David Graham)先生担任本基金管理人第三届董事会董事，选举朱善利先生、荆新先生、葛礼(Gary Rieschel)先生担任本基金管理人第三届董事会独立董事。其中，谭炯先生、梅非奇先生为新任董事，朱善利先生、荆新先生为新任独立董事。本基金管理人第二届董事会成员贾建平先生、董杰先生不再担任董事职务，赵纯均先生、于鸿君先生不再担任独立董事职务。上述事项已报监管机构备案，详请参见2011年7月20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》。

此外，本基金管理人第三届董事会第一次会议选举谭炯先生为拟任董事长，相关任职资格正待中国证监会批准。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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监管部门稽查或处罚等情况

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 | |
| 申银万国 | 1 | 1,840,443,439.79 | 16.26% | 1,564,368.92 | 16.44% | - |
| 中信证券 | 1 | 1,235,159,623.68 | 10.91% | 1,003,575.01 | 10.55% | - |
| 国泰君安 | 1 | 1,193,008,120.98 | 10.54% | 1,014,053.44 | 10.66% | - |
| 东方证券 | 1 | 1,179,491,701.08 | 10.42% | 1,002,559.21 | 10.54% | - |
| 中银证券 | 2 | 1,138,802,609.13 | 10.06% | 948,071.49 | 9.96% | - |
| 中金公司 | 1 | 1,002,532,506.59 | 8.85% | 852,147.91 | 8.95% | - |
| 华泰联合 | 1 | 726,447,929.79 | 6.42% | 617,487.22 | 6.49% | - |
| 国元证券 | 1 | 679,464,204.10 | 6.00% | 577,543.37 | 6.07% | - |
| 华宝证券 | 2 | 577,300,526.84 | 5.10% | 469,059.38 | 4.93% | - |
| 东海证券 | 1 | 494,006,991.47 | 4.36% | 419,902.81 | 4.41% | - |
| 海通证券 | 1 | 416,012,140.38 | 3.67% | 338,012.34 | 3.55% | - |
| 安信证券 | 1 | 399,566,503.34 | 3.53% | 339,630.69 | 3.57% | - |
| 国金证券 | 1 | 342,593,453.14 | 3.03% | 291,200.48 | 3.06% | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | 96,873,786.66 | 0.86% | 78,710.25 | 0.83% | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 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》(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。

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 |
| 申银万国 | - | - | 3,450,000,000.00 | 44.98% | - | - |
| 中信证券 | 4,178,482.20 | 68.11% | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | 1,960,000,000.00 | 25.55% | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银证券 | 1,956,869.91 | 31.89% | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | 1,860,000,000.00 | 24.25% | - | - |
| 华泰联合 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | 400,000,000.00 | 5.22% | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

鉴于本公司旗下基金持有证券双汇发展(股票代码：000895)因重大事项临时停牌，为使持有该股票的基金估值更加公平、合理，根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求，经与托管银行中国工商银行股份有限公司协商一致，本公司自2011年3月22日起，对旗下基金持有股票双汇发展按照公允价值进行估值调整；在双汇发展后续停牌期间发生重大事项时，本公司将会及时修订其估值价格。自双汇发展复牌之日起且其交易体现了活跃市场交易特征后，按市场价格进行估值。

上述调整已按要求公告。

**中银基金管理有限公司**
**二〇一一年八月二十六日**