

中银持续增长股票型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9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:二〇一一年十月二十五日
§1 重要提示
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责任。

§2 基金产品概况
基金简称:中银增长股票
基金代码:163800
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
报告期末基金份额总额:11,541,753,190.38份

§3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益: -258,738,777.71
2.本期利润: -969,330,567.28
3.加权平均基金份额本期利润: -0.0835
4.期末基金份额净值: 7,272,452,197.58
5.期末基金资产净值: 6,630.01

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
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。

§4 基金经理人简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明
俞皓 中银增长基金经理,中银优势基金基金经理,中银权益基金基金经理(兼职) 2008-4-3 2011-9-27 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副总经理兼基金管理部副经理,新华基金管理有限公司基金管理部基金经理兼行业分析师,2007年4月加入中银基金管理有限公司,2008年4月担任2011年9月担任中银增长基金经理,2009年4月至2011年9月担任中银优势基金基金经理,具有13年证券从业年限,具备基金从业资格。

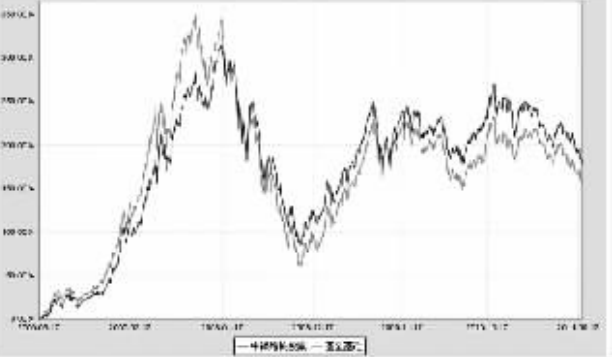


Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%) for the fund's portfolio. Includes categories like 权益投资, 固定收益投资, 金融资产投资, etc.

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.3 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股票投资明细

§6 开放式基金份额变动
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:二〇一一年十月二十五日

基金运行正宏观调的预期方向发展,但依然面临世界经济动荡的风险因素及尚存的通胀压力。会议依然将实施稳健的货币政策以及稳定物价总水平作为首要目标,但同时也有着强调增强调控的针对性,有效性和前瞻性,注意把握好政策的节奏和力度。因此,随着通胀压力的明显缓解,调控力度或将依据经济增长速度而动态、定向地放松,考虑到当前通胀压力有所缓解但仍处在高位,短期内使用降低利率或准备金率的手段放松调控的可能性不大。货币政策仍将保持以平滑的公开市场操作为主,加以有效的财政政策以实现进一步优化信贷结构,继续发挥直接融资作用等目标,有效地管理流动性,保持合理的社会融资规模和货币总量。

中银基金管理有限公司
二〇一一年十月二十五日

中银中证100指数增强型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年十月二十五日
§1 重要提示
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责任。

§2 基金产品概况
基金简称:中银中证100指数增强
基金代码:163808
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2009年9月4日
报告期末基金份额总额:2,437,141,735.71份

§3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益: -44,924,527.13
2.本期利润: -301,699,396.65
3.加权平均基金份额本期利润: -0.1179
4.期末基金份额净值: 1,780,427,970.36
5.期末基金资产净值: 0.731

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
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。

§4 基金经理人简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明
陈军 中银中证100指数增强基金基金经理 2009-9-4 13 中银基金管理有限公司投资管理部权益投资总监,副總裁,AP,金融硕士,曾任中信证券股份有限公司资产管理部副经理,2004年加入中银基金管理有限公司,2006年10月至今任中银中证100指数增强基金基金经理,2010年11月至今任中银中证100指数增强基金基金经理,具有13年证券从业年限,具备基金从业资格。

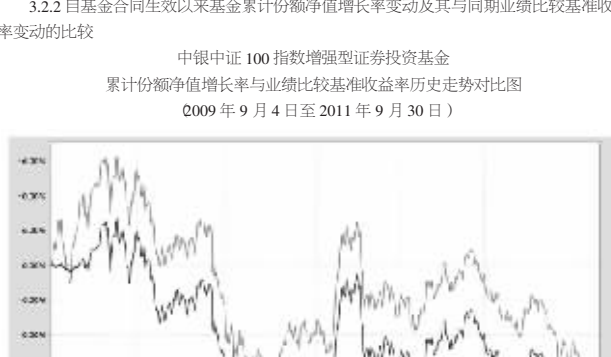


Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%) for the fund's portfolio. Includes categories like 权益投资, 固定收益投资, 金融资产投资, etc.

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.3 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股票投资明细

§6 开放式基金份额变动
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
报告送出日期:二〇一一年十月二十五日

基金运行正宏观调的预期方向发展,但依然面临世界经济动荡的风险因素及尚存的通胀压力。会议依然将实施稳健的货币政策以及稳定物价总水平作为首要目标,但同时也有着强调增强调控的针对性,有效性和前瞻性,注意把握好政策的节奏和力度。因此,随着通胀压力的明显缓解,调控力度或将依据经济增长速度而动态、定向地放松,考虑到当前通胀压力有所缓解但仍处在高位,短期内使用降低利率或准备金率的手段放松调控的可能性不大。货币政策仍将保持以平滑的公开市场操作为主,加以有效的财政政策以实现进一步优化信贷结构,继续发挥直接融资作用等目标,有效地管理流动性,保持合理的社会融资规模和货币总量。

中银基金管理有限公司
二〇一一年十月二十五日

截至本报告期末,本基金的单位净值为0.731元,本基金累计单位净值为0.741元;本报告期净值增长率为-14.3%,同期业绩比较基准收益率为-13.74%。报告期内,本基金日跟踪误差为0.11%,年化跟踪误差为1.75%,在合同约定的目标控制范围之内。
4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
鉴于当前通胀和经济增速的判断,宏观经济仍处于着陆过程中。只要外围经济环境不发生超预期的剧烈波动,我国宏观经济在调整经济结构的大目标下,着陆速度处在可预期和可控制的范围之内。随着通胀压力的明显缓解,调控力度或将依据经济增长速度而动态、定向地放松。展望2011年四季度,当前的市场情绪已经过度悲观,投资者对大部分的利空因素有足够的预期,市场的总体估值已经接近历史最低值水平,潜在的利空因素得到释放后,长期来看,持有股票有望取得较好的投资收益。本基金将严格控制契约规定,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,本基金的主动投资部分将严控仓位,采取自上而下策略,力求超额收益。

§2 基金产品概况
基金简称:中银中证100指数增强
基金代码:163808
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2009年9月4日
报告期末基金份额总额:2,437,141,735.71份

§3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益: -44,924,527.13
2.本期利润: -301,699,396.65
3.加权平均基金份额本期利润: -0.1179
4.期末基金份额净值: 1,780,427,970.36
5.期末基金资产净值: 0.731

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
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。

§4 基金经理人简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明
陈军 中银中证100指数增强基金基金经理 2009-9-4 13 中银基金管理有限公司投资管理部权益投资总监,副總裁,AP,金融硕士,曾任中信证券股份有限公司资产管理部副经理,2004年加入中银基金管理有限公司,2006年10月至今任中银中证100指数增强基金基金经理,2010年11月至今任中银中证100指数增强基金基金经理,具有13年证券从业年限,具备基金从业资格。



Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%) for the fund's portfolio. Includes categories like 权益投资, 固定收益投资, 金融资产投资, etc.

§5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.3 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股票投资明细

§6 开放式基金份额变动
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
报告送出日期:二〇一一年十月二十五日

基金运行正宏观调的预期方向发展,但依然面临世界经济动荡的风险因素及尚存的通胀压力。会议依然将实施稳健的货币政策以及稳定物价总水平作为首要目标,但同时也有着强调增强调控的针对性,有效性和前瞻性,注意把握好政策的节奏和力度。因此,随着通胀压力的明显缓解,调控力度或将依据经济增长速度而动态、定向地放松,考虑到当前通胀压力有所缓解但仍处在高位,短期内使用降低利率或准备金率的手段放松调控的可能性不大。货币政策仍将保持以平滑的公开市场操作为主,加以有效的财政政策以实现进一步优化信贷结构,继续发挥直接融资作用等目标,有效地管理流动性,保持合理的社会融资规模和货币总量。

中银基金管理有限公司
二〇一一年十月二十五日