上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金

2012 第二季度 报告

[illegible]年6月[illegible]日

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月十九日

§员 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于[illegible]复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自[illegible]起至[illegible]止。

§圆 基金产品概况

基金简称	上投摩根全球天然资源股票[illegible]
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	[illegible]
报告期末基金份额总额	[illegible]
投资目标	本基金主要投资于全球范围内从事天然资源的勘探、开发、生产及销售,或是向天然资源行业提供服务的公司的股票,通过积极主动的资产配置和组合管理,在风险可控的前提下以获取长期资产增值。
投资策略	全球天然资源的稀缺与人类对其需求的不断增长的矛盾日益突显,这显示了天然资源具有极大的战略价值,该行业的相关上市公司也具有良好的投资机会。本基金将充分分享全球天然资源行业未来的高增长成果,审慎把握全球天然资源的投资机会,争取为投资者带来长期稳健回报。总体上本基金将采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。首先通过考察不同国家的发展趋势及不同行业的景气程度,决定地区与板块的基本布局;其次采取自下而上的选股策略,对股票进行基本面分析的同时,通过深入研究股票的价值与动量特性,选取目标投资对象。在固定收益类投资部分,本基金将综合考虑资产布局的安全性、流动性与收益性,并结合现金管理要求等来制订具体策略。
业绩比较基准	汇丰矿产、黄金及能源指数[illegible]回报
风险收益特征	本基金为股票型投资基金,主要投资于海外市场的天然资源行业的股票,本基金的业绩表现在大多数的情况下与国际大宗商品价格的走势具有较高的相关性。本基金的预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于较高风险和较高预期收益的基金品种。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
境外投资顾问英文名称	[illegible]
境外投资顾问中文名称	摩根资产管理(英国)有限公司
境外资产托管人英文名称	[illegible]
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)有限公司

§猿 主要财务指标和基金净值表现

猿.员 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期([illegible])
员.本期已实现收益	[illegible]
圆.本期利润	[illegible]
猿.加权平均基金份额本期利润	[illegible]
源.期末基金资产净值	[illegible]
缘.期末基金份额净值	[illegible]

注: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。

基金合同在当期生效。上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。

猿.圆 基金净值表现

猿.圆.员 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

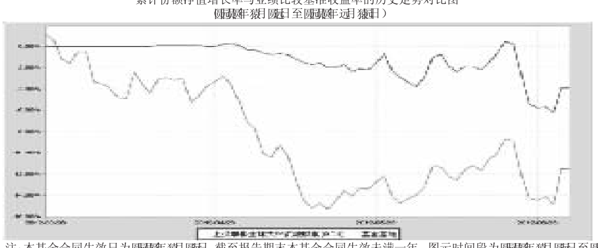
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

猿.圆.圆 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

上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

([illegible]至[illegible])



注:本基金合同生效日为[illegible],截至报告期末本基金合同生效未满一年。图示时间段为[illegible]至[illegible]。

本基金建仓期自[illegible]至[illegible],目前本基金还处于建仓期。

§源 管理人报告

源.员 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张军	本基金基金经理	[illegible]	原	[illegible]	毕业于上海复旦大学,曾担任上海国际信托有限公司国际业务部经理、交易部经理。[illegible]加入上投摩根基金管理有限公司,历任交易总监、投资经理,[illegible]起担任上投摩根亚太优势股票型证券投资基金基金经理,[illegible]起同时担任上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金经理。

注:员.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

圆.张军先生担任本基金首任基金经理的任职日期为本基金基金合同生效之日;

猿.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

源.圆 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
[illegible]	全球天然资源团队专家	[illegible]	男,获澳大利亚墨尔本大学地质学学位

源.猿 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

源.源 公平交易专项说明

源.源.员 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求,严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动,通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析,以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相关的环节均得到公平对待。

对于二级市场投资活动,本公司执行集中交易制度,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;对于一级市场申购活动,本公司遵循价格优先、比例分配的原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内,通过对不同投资组合之间的交易价差和分配结果监控分析,监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

源.源.圆 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易时间、交易价格、分配结果监控分析,监察稽核部未发现存在异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的缘%的情形:不适用。

源.缘 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

源.缘.员 报告期内基金投资策略和运作分析

受投资者规避风险情绪的影响,二季度全球资源品价格下跌,尤其是当希腊大选后政府组阁失败,不得不在六月重新二次选举,一度引起市场高度波动,加上中国公布的经济数据显示经济增长放慢,未来对资源的需求减弱。使得在报告期内,资源类股价基本回吐了年初的涨幅。然而因为本基金正在建仓过程中,平均仓位较低,当市场出现下跌时,基金的跌幅仍然小于指数。

展望后市,尽管欧洲局势风险尤在,但不容忽视的是各国政府和国际组织都有所作为,保增长已是全球政府的一致态度,经济短暂下滑后企稳反弹是大概率事件。从研究的基本面考虑,资源股经过前期的下跌对已述的宏观风险已有较充分的反映,中长期投资价值明显。在下一季度中,基金将均衡地布局于矿业、黄金和能源这三个主要板块,重点选择未来[illegible]年内有明确成长且估值较低的公司投资,如铁矿石公司、大型金矿企业和龙头能源公司。

源.缘.圆 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为[illegible],同期业绩比较基准收益率为[illegible]。

§缘 投资组合报告

缘.员 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
员	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中:普通股	[illegible]	[illegible]
	存托凭证	原	原
圆	基金投资	[illegible]	[illegible]
猿	固定收益投资	原	原
	其中:债券	原	原
	资产支持证券	原	原
源	金融衍生品投资	原	原
	其中:远期	原	原
	期货	原	原
	期权	原	原
	权证	原	原
缘	买入返售金融资产	原	原
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	原	原
远	货币市场工具	原	原
苑	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
愿	其他各项资产	[illegible]	[illegible]
怨	合计	[illegible]	[illegible]

注:截至[illegible],本基金资产净值为[illegible]元,基金份额净值为[illegible]元,累计基金份额净值为[illegible]元。

缘.圆 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
加拿大	[illegible]	[illegible]
英国	[illegible]	[illegible]
澳大利亚	[illegible]	[illegible]
美国	[illegible]	[illegible]
中国香港	[illegible]	[illegible]
挪威	[illegible]	[illegible]
合计	[illegible]	[illegible]

注:国家(地区)类别根据其所在的证券交易所确定,[illegible]按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

缘.猿 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
金属与采矿	[illegible]	[illegible]
石油、天然气及消耗燃料业	[illegible]	[illegible]
合计	[illegible]	[illegible]

注:行业分类标准:[illegible]

缘.源 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及存托凭证投资明细

序号	证券代码	公司名称(英文)	公司名称(中文)	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
员	[illegible]	[illegible]	必和必拓有限公司	伦敦证券交易所	英国	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	[illegible]	原	多伦多证券交易所	加拿大	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	[illegible]	力拓有限公司	伦敦证券交易所	英国	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	[illegible]	原	多伦多证券交易所	加拿大	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	[illegible]	原	多伦多证券交易所	加拿大	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	[illegible]	原	伦敦证券交易所	英国	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	[illegible]	原	纽约证券交易所	美国	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	[illegible]	原	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	[illegible]	[illegible]	原	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	[illegible]	[illegible]	[illegible]
员园	[illegible]	[illegible]	原	纽约证券交易所	美国	[illegible]	[illegible]	[illegible]

注:员.所用证券代码采用[illegible]代码。

圆.所属国家(地区)列示证券挂牌的证券交易所所在国家(地区)。

缘.缘 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

缘.远 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

本基金本报告期末未持有债券。

缘.苑 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

缘.愿 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

缘.怨 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
员	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

缘.员园 投资组合报告附注

缘.员园.员 报告期内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,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

缘.员园.圆 报告期内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。

缘.员园.猿 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
员	存出保证金	原
圆	应收证券清算款	原
猿	应收股利	[illegible]
源	应收利息	[illegible]
缘	应收申购款	[illegible]
远	其他应收款	[illegible]
苑	待摊费用	原
愿	其他	原
怨	合计	[illegible]

缘.员园.源 报告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。

缘.员园.缘 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

缘.员园.远 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因,投资组合报告中分项之和与合计数可能存在尾差。

§远 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	[illegible]
本报告期基金总申购份额	[illegible]
减:本报告期基金总赎回份额	[illegible]
本报告期基金拆分变动份额	原
本报告期期末基金份额总额	[illegible]

§苑 备查文件目录

苑.员 备查文件目录

员中国证监会批准上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金设立的文件;

圆《上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金合同》;

猿《上投摩根全球天然资源股票型证券投资基金基金托管协议》;

源《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

缘基金管理人业务资格批件、营业执照;

远基金托管人业务资格批件和营业执照。

苑.圆 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

苑.猿 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一二年七月十九日

上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金

2012 第二季度 报告

[illegible]年6月[illegible]日

基金管理人:上投摩根基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月十九日

§员 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于[illegible]复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自[illegible]起至[illegible]止。

§圆 基金产品概况

基金简称	上投摩根健康品质生活股票
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	[illegible]
报告期末基金份额总额	[illegible]
投资目标	本基金主要投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的行业及公司,力争把握经济结构调整和消费升级所带来的投资机会,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	员.资产配置策略 本基金对大类资产的配置是从宏观层面出发,采用定量分析和定性分析相结合的手段,综合宏观经济环境、宏观经济政策、产业政策、行业景气度、证券市场走势和流动性的综合分析,积极进行大类资产配置。影响资产收益的关键驱动因素主要包括基本面和流动性。基本面驱动主要指在经济周期和通胀周期影响下,业绩增长、利率环境、通胀预期等因素的变动;流动性驱动主要体现为货币市场环境变动的影响,具体包括汇率变动、流动性结构变动等。随着各类资产风险收益特征的相对变化,本基金将适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例。 圆.股票投资策略 人类的需求主要来自于两方面:一是延长生命长度,提升健康水平;二是拓展生命宽度,提高生活品质。随着居民收入水平的提升、城镇化进程的推进以及社会保障体制的完善,居民的各方面需求将逐步释放,尤其是对于身体健康和生活品质的要求会逐步提高,由此带来对相关产品和服务的需求的增加,将推动提供此类产品和服务的上市公司的快速成长。本基金将围绕健康生活与品质生活这两大主题,重点关注有利于提升民众健康水平以及物质生活和精神生活质量的行业和个股。
业绩比较基准	沪深[illegible]指数收益率×[illegible]+上证国债指数收益率×[illegible]
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,主要投资于有利于提升居民健康水平和生活品质的行业和公司,属于主题类股票型基金,其预期风险和预期收益可能高于全市场股票型基金,也高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于较高风险、较高预期收益的基金产品。
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§猿 主要财务指标和基金净值表现

猿.员 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期([illegible])
员.本期已实现收益	[illegible]
圆.本期利润	[illegible]
猿.加权平均基金份额本期利润	[illegible]
源.期末基金资产净值	[illegible]
缘.期末基金份额净值	[illegible]

注: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。

上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(例如,开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

猿.圆 基金净值表现

猿.圆.员 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

阶段	净值增长率①	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	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

猿.圆.圆 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

上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

([illegible]至[illegible])

注:本基金合同生效日为[illegible],截至报告期末本基金合同生效未满一年。

根据基金合同的规定,本基金建仓期自基金合同生效之日起六个月。

本基金在本报告期末尚处在建仓期内。

§源 管理人报告

源.员 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
董红波	本基金基金经理	[illegible]	原	[illegible]	管理学硕士,曾任职于中华全国供销合作总社监察局及办公厅、中国平安人寿上海分公司战略发展部,[illegible]进入泰信基金管理公司,先后担任研究部副经理、泰信先行策略基金经理助理,[illegible]至[illegible]担任泰信先行策略基金经理,[illegible]加入上投摩根基金管理有限公司,[illegible]起担任上投摩根中小盘股票型证券投资基金基金经理,自[illegible]起同时担任上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金基金经理。

注:员.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

圆.董红波先生为本基金首任基金经理,其任职日期指本基金基金合同生效之日。

猿.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

源.圆 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制,基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

源.猿 公平交易专项说明

源.猿.员 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求,严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动,通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析,以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相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动,本公司执行集中交易制度,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;对于银行间市场投资活动,本公司通过对手库控制和交易室询价机制,严格防范对手风险并抽检价格公允性;对于申购投资行为,本公司遵循价格优先、比例分配的原则,根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内,通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析,监察稽核部未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

源.猿.圆 异常交易行为的专项说明

报告期内,通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析,监察稽核部未发现存在异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的缘%的情形:无。

源.源 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

源.源.员 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在报告期内仍属于建仓期,在此期间,我们遵照契约要求,重点对医药、食品饮料、服装、地产等行业重点公司进行了深入研究及配置,同时考虑到行业发展的趋势,对原先持有的零售等行业进行了减持,整体来看,报告期内本基金实现了较好收益。

就未来市场而言,我们仍然持谨慎乐观的态度,我们认为,目前经济下滑的趋势将在三季度得到改善,而流动性的宽松、通胀的下降、政策对于证券市场的支持以及目前市场整体较低的估值水平将对未来市场形成较强支持。我们将继续强化研究,以挖掘持续成长公司为重点,同时保持相对灵活的操作风格,努力实现基金业绩的稳定增长。

源.源.圆 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为[illegible],同期业绩比较基准收益率为[illegible]。

§缘 投资组合报告

缘.员 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
员	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中:股票	[illegible]	[illegible]
圆	固定收益投资	原	原
	其中:债券	原	原
	资产支持证券	原	原
猿	金融衍生品投资	原	原
源	买入返售金融资产	原	原
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	原	原
缘	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
远	其他各项资产	[illegible]	[illegible]
苑	合计	[illegible]	[illegible]

注:截至[illegible],本基金资产净值为[illegible]元,基金份额净值为[illegible]元,累计基金份额净值为[illegible]元。

缘.圆 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
粤	农、林、牧、渔业	原	原
月	采掘业	原	原
悦	制造业	[illegible]	[illegible]
悦园	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
悦员	纺织、服装、皮毛	[illegible]	[illegible]
悦圆	木材、家具	原	原
悦猿	造纸、印刷	原	原
悦源	石油、化学、塑胶、塑料	原	原
悦缘	电子	[illegible]	[illegible]
悦远	金属、非金属	原	原
悦苑	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
悦愿	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
悦怨	其他制造业	原	原
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	原	原
耘	建筑业	[illegible]	[illegible]
云	交通运输、仓储业	原	原
郧	信息技术业	[illegible]	[illegible]
匀	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
陨	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
允	房地产业	[illegible]	[illegible]
运	社会服务业	[illegible]	[illegible]
蕴	传播与文化产业	[illegible]	[illegible]
酝	综合类	原	原
	合计	[illegible]	[illegible]

缘.猿 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
员	[illegible]	康美药业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	双鹭药业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	山西汾酒	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	朗姿股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	北京城建	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	长信科技	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	广田股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	金地集团	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	[illegible]	榕基软件	[illegible]	[illegible]	[illegible]
员园	[illegible]	长盈精密	[illegible]	[illegible]	[illegible]

缘.源 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

缘.缘 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

本基金本报告期末未持有债券。

缘.远 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

缘.苑 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

本基金本报告期末未持有权证。

缘.愿 投资组合报告附注

缘.愿.员 报告期内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。

缘.愿.圆 报告期内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。

缘.愿.猿 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
员	存出保证金	[illegible]
圆	应收证券清算款	原
猿	应收股利	原
源	应收利息	[illegible]
缘	应收申购款	[illegible]
远	其他应收款	原
苑	待摊费用	原
愿	其他	原
怨	合计	[illegible]

缘.愿.源 报告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。

缘.愿.缘 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

缘.愿.远 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§远 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	[illegible]
本报告期基金总申购份额	[illegible]
减:本报告期基金总赎回份额	[illegible]
本报告期基金拆分变动份额	原
本报告期期末基金份额总额	[illegible]

§苑 备查文件目录

苑.员 备查文件目录

苑.员.员 中国证监会批准上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金设立的文件;

苑.员.圆 《上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金基金合同》;

苑.员.猿 《上投摩根健康品质生活股票型证券投资基金托管协议》;

苑.员.源 《上投摩根开放式基金业务规则》;

苑.员.缘 基金管理人业务资格批件、营业执照;

苑.员.远 基金托管人业务资格批件和营业执照。

苑.圆 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

苑.猿 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

上投摩根基金管理有限公司
二〇一二年七月十九日

中银转债增强债券型证券投资基金

2012 第二季度 报告

[illegible]年6月[illegible]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:二〇一二年七月十九日

§员 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于[illegible]复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自[illegible]起至[illegible]止。

§圆 基金产品概况

基金简称	中银转债增强债券	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	[illegible]	
报告期末基金份额总额	[illegible]	
投资目标	本基金主要利用可转换公司债券品种兼具债券和股票的特性,通过"自上而下"宏观分析和"自下而上"个券选择的有效结合来实施大类资产配置和精选可转换公司债券,在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求超越业绩比较基准的超额收益。	
投资策略	本基金将通过"自上而下"的方法进行资产配置、类属配置,结合"自下而上"的明细资产配置(个券、个股选择),积极运用多种投资策略充分挖掘各类品种的投资价值,努力实现投资目标。	
业绩比较基准	天相转债指数收益率×[illegible]+中债综合指数收益率×[illegible]	
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	中银转债增强债券粤类	中银转债增强债券月类
下属两级基金的交易代码	[illegible]	[illegible]
报告期末下属两级基金的份额总额	[illegible]	[illegible]

§猿 主要财务指标和基金净值表现

猿.员 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期([illegible]) 中银转债增强债券粤类	中银转债增强债券月类
员.本期已实现收益	[illegible]	[illegible]
圆.本期利润	[illegible]	[illegible]
猿.加权平均基金份额本期利润	[illegible]	[illegible]
源.期末基金资产净值	[illegible]	[illegible]
缘.期末基金份额净值	[illegible]	[illegible]

注:员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。

圆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。

猿.圆 基金净值表现

猿.圆.员 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

员中银转债增强债券粤类:

阶段	净值增长率①	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	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

圆中银转债增强债券月类:

阶段	净值增长率①	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	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

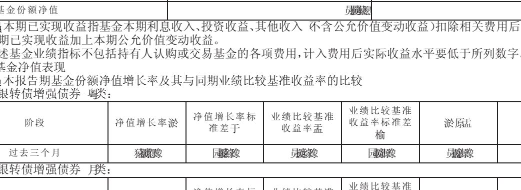
猿.圆.圆 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银转债增强债券型证券投资基金

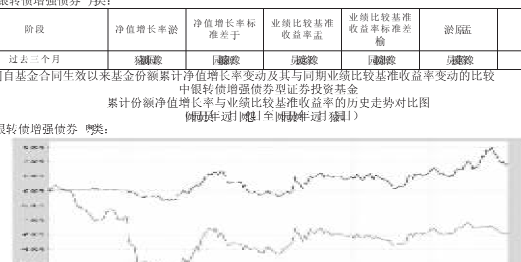
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

([illegible]至[illegible])

员中银转债增强债券粤类:



圆中银转债增强债券月类:



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期,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(二)的规定,即本基金投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的[illegible],其中对可转换公司债券(包含可分离交易可转债)的投资比例不低于基金固定收益类证券资产的[illegible];现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的缘%;投资于股票(含一级市场新股申购和二级市场股票投资)和权证等权益类证券的比例不高于基金资产的[illegible]。

§源 管理人报告

源.员 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李建	本基金的基金经理、中银增利基金经理	[illegible]	原	[illegible]	中银基金管理有限公司副总裁(VP),经济学硕士研究生。曾任联合证券有限责任公司固定收益研究员、恒泰证券有限责任公司固定收益研究员、上海远东证券有限公司投资经理。[illegible]加入中银基金管理有限公司,[illegible]至[illegible]任中银货币基金经理,[illegible]至今任中银增利基金经理,[illegible]至[illegible]任中银双利基金经理,[illegible]至今任中银转债基金经理。具有[illegible]年证券从业年限。具备基金、证券、期货和银行间债券交易员从业资格。

注:员首任基金经理的"任职日期"为基金合同生效日,非首任基金经理的"任职日期"为根据公司决定确定的聘任日期,基金经理的"离任日期"均为根据公司决定确定的解聘日期;

圆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。

源.圆 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

源.猿 公平交易专项说明

源.猿.员 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制订了《中银基金管理有限公司公平交易管理制度》,建立了《投资研究管理制度》及细则、《新股询价和申购管理制度》、《集中交易管理制度》等公平交易相关制度体系,通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待,严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度,以科学规范的投资决策体系,采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现;通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库,完善各类具体资产管理业务组织结构,规范各项业务之间的关系,在保证各投资组合既具有相对独立性的同时,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

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,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。

源.猿.圆 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

本报告期内,基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的缘%的情况。

源.源 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

源.源.员 报告期内基金投资策略和运作分析

员.宏观经济分析

国外经济方面,二季度美国经济复苏的步伐较为艰难,欧元区经济受债务危机、政局变化等因素影响表现疲弱,美强欧弱的格局继续延续。美国经济方面,领先指标[illegible]制造业[illegible]保持在[illegible]以上,但[illegible]该指数突降至[illegible],自[illegible]以来首次降至[illegible]以下,显示三季度美国经济复苏前景不容乐观。二季度美国就业市场改善的步伐开始放缓,[illegible]新增非农就业人数分别只有[illegible]万和[illegible]万人,较一季度月均[illegible]万人大幅回落;失业率也停止改善趋势,[illegible]失业率分别为[illegible]与[illegible],与[illegible]失业率持平。欧元区经济方面,希腊大选与欧盟峰会的结果暂时平缓了市场对欧债危机的紧张和担忧情绪,但欧元区核心问题并未解决,债务危机仍在发酵,从领先指标来看,欧元区制造业[illegible]持续回落,[illegible]更是创下三年来最低水平[illegible],欧元区经济显现出陷入衰退的迹象。

国内经济方面,二季度经济增长继续回落寻底,但下降速度有所减缓。具体来看,领先指标[illegible]指数结束了此前五个月的连续回升态势,回落至年内低点[illegible];同步指标工业增加值同比增速[illegible]大幅回落至[illegible],[illegible]小幅回升至[illegible],[illegible]略降至[illegible]。从经济增长动力来看,拉动经济的三驾马车增速持续回落,但[illegible]有所反弹:[illegible]固定资产投资累计同比增速下滑至[illegible],[illegible]回升至[illegible];[illegible]社会消费品零售总额同比增长[illegible],[illegible]回升至[illegible];[illegible]出口、进口额累计同比增速分别为[illegible]与[illegible],[illegible]回升至[illegible]和[illegible]。通胀方面,[illegible]回落至[illegible],近期食品价格回落趋势依然较为确定,预计三季度通胀压力将明显减小。

圆.市场回顾

二季度国内货币政策实行数量型和价格型工具相结合的调控方式,央行[illegible]再次下调存款准备金率[illegible]个百分点,[illegible]连续下调存、贷款基准利率,资金面保持宽松。二季度宏观经济出现快速下滑,通胀数据也处于下降通道中,债市收益率曲线在四月份经济数据公布后出现较大幅度的陡峭化下行。整体来看,二季度中债总全价指数上涨[illegible],中债银行间国债全价指数上涨[illegible],中债企业债总全价指数大幅上涨[illegible],反映在收益率曲线上,国债、金融债收益率曲线呈现陡峭化下行态势;信用债收益率下行较多:高等级信用债收益率追随利率债下行,中低等级信用债收益率大幅下行,市场结构化特征明显。具体来看,由于一年期央票一级市场停发,其二级市场收益率从[illegible]下行至[illegible];三年央票继续停发,其二级市场收益率从[illegible]下行至[illegible]。长端收益率整体下行,其中[illegible]期国债收益率从[illegible]下行至[illegible],[illegible]期金融债收益率较四季度末从[illegible]降低至[illegible]。货币市场方面,央行调低存款准备金率和基准利率,市场资金面逐渐宽松。总体来看,银行间[illegible]加权回购利率均值在[illegible],较上季度均值下行[illegible];[illegible]加权回购利率均值在[illegible],较上季度均值下行[illegible]。

可转债方面,受到上交所转债可做质押式回购的影响可转债市场逆股市上涨,二季度天相可转债指数涨幅[illegible],表现大幅好于上证综指,转债的平均转股溢价率出现一定幅度上行。二级市场表现较好的为电力转债和可质押的转债,大盘转债表现较为平淡。一级市场上发行一只中盘转债,无转债发行预案公告,市场规模增加[illegible]亿元。股票市场方面,二季度上证综指下跌[illegible],代表大盘股表现的沪深[illegible]指数上涨[illegible],中小盘综合指数上涨[illegible],创业板综合指数上涨[illegible]。

猿.运行分析

二季度,股票市场出现下跌,可转债市场总体表现强于股市,本基金规模基本保持稳定。二季度,出于对经济较为谨慎的看法,本基金采取了整体均衡配置,择机逢低介入上交所可质押转债的策略。事实证明该策略是成功的,本基金较好的抓住了可转债市场上涨的机会。

源.源.圆 报告期内基金的业绩表现

中银转债粤截至[illegible]为止,本基金的单位净值为[illegible]元,本基金的累计单位净值为[illegible]元。季度内本基金净值增长率为[illegible],同期业绩基准增长率为[illegible]。

中银转债月截至[illegible]为止,本基金的单位净值为[illegible]元,本基金的累计单位净值为[illegible]元。季度内本基金净值增长率为[illegible],同期业绩基准增长率为[illegible]。

源.缘 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,[illegible]数据为三季度美国经济的复苏前景蒙上了阴影,欧元区方面,希腊大选以平和的结果收场,欧盟峰会取得超预期的成果,主要债务危机国的燃眉之急得以缓解,但有关欧元区劳动力市场、社会保障制度、财政紧缩等欧债危机根本性问题仍无彻底解决方案,因此,欧债危机的风险依然存在。

鉴于当前实体经济的表现,国内宏观经济增速还处于回落寻底过程中,因此,在宏观经济调控政策方面,基准利率的小幅下调、信贷政策的小幅松绑、基建项目的加快审批、内需消费等方面的鼓励政策仍然值得期待。三季度国内货币政策调整将进一步深化,我们预计央行将继续下调存款准备金率,并可能再次下调存贷款利率。公开市场方面,考虑到三季度公开市场到期资金量较上半年明显减少,预计央行公开市场操作提供市场流动性的作用将减弱,央行将通过更为灵活的操作方式,综合运用正回购与逆回购操作,平滑资金面的短期波动。整体来看,下半年宏观经济调控政策将继续往有助于宏观经济增速企稳的方向迈进。。

股市方面,自上而下看,由于二季度经济增速仍然处于放缓过程中,央行降息、降准后经济增速还无明显改善,市场对管理层加大政策放松力度的预期可能会增强,因此,股指可能在三季度有所反弹,但因宏观经济基本面是否能改善仍是影响走势的最主要因素,经济增速是否企稳回升还需观察,因此,预计股指向上反弹空间也较有限。可转债市场方面,目前影响可转债市场的因素主要还是股市走势,一级市场供给的不确定性也还可能会对转债市场造成负面影响,因此,转债市场大幅上涨的可能性不大,但行业的结构性机会依然存在。债券市场方面,三季度债券市场可能表现为收益率小幅震荡向下,中、低评级信用债可能还有一定的收益率下降空间。

策略上,我们对可转债资产不追涨,积极抓住转债回调的机会,布局有较强安全垫且弹性强的品种,精选新发转债进行投资。权益类资产方面,我们考虑适度增加新股资产的配置,以把握绝对收益为主。纯债券资产方面,三季度将重点配置信用债,把握票息收入和资本利得的机会。

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。

§缘 投资组合报告

缘.员 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
员	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中:股票	[illegible]	[illegible]
圆	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中:债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	原	原
猿	金融衍生品投资	原	原
源	买入返售金融资产	原	原
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	原	原
缘	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
远	其他各项资产	[illegible]	[illegible]
苑	合计	[illegible]	[illegible]

缘.圆 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
粤	农、林、牧、渔业	[illegible]	[illegible]
月	采掘业	原	原
悦	制造业	[illegible]	[illegible]
悦园	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
悦员	纺织、服装、皮毛	原	原
悦圆	木材、家具	原	原
悦猿	造纸、印刷	原	原
悦源	石油、化学、塑胶、塑料	原	原
悦缘	电子	[illegible]	[illegible]
悦远	金属、非金属	原	原
悦苑	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
悦愿	医药、生物制品	原	原
悦怨	其他制造业	原	原
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	原	原
耘	建筑业	原	原
云	交通运输、仓储业	原	原
郧	信息技术业	原	原
匀	批发和零售贸易	原	原
陨	金融、保险业	原	原
允	房地产业	[illegible]	[illegible]
运	社会服务业	[illegible]	[illegible]
蕴	传播与文化产业	原	原
酝	综合类	原	原
	合计	[illegible]	[illegible]

缘.猿 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
员	[illegible]	保利地产	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	长安汽车	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	隆平高科	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	五粮液	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	华侨城粤	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	金龙汽车	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	北京城建	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	三安光电	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	原	原	原	原	原
员园	原	原	原	原	原

缘.源 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
员	国家债券	原	原
圆	央行票据	原	原
猿	金融债券	[illegible]	[illegible]
	其中:政策性金融债	[illegible]	[illegible]
源	企业债券	[illegible]	[illegible]
缘	企业短期融资券	原	原
远	中期票据	原	原
苑	可转债	[illegible]	[illegible]
愿	其他	原	原
怨	合计	[illegible]	[illegible]

缘.缘 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
员	[illegible]	石化转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	工行转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	国投转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	国电转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	[illegible]鸣债	[illegible]	[illegible]	[illegible]

缘.远 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

缘.苑 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

本基金本报告期末未持有权证。

缘.愿 投资组合报告附注

缘.愿.员 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。

缘.愿.圆 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。

缘.愿.猿 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
员	存出保证金	[illegible]
圆	应收证券清算款	[illegible]
猿	应收股利	原
源	应收利息	[illegible]
缘	应收申购款	[illegible]
远	其他应收款	原
苑	待摊费用	原
愿	其他	原
怨	合计	[illegible]

缘.愿.源 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
员	[illegible]	石化转债	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	工行转债	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	国投转债	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	国电转债	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	唐钢转债	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	川投转债	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	新钢转债	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	中海转债	[illegible]	[illegible]

缘.愿.缘 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

缘.愿.远 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。

§远 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中银转债增强债券粤类	中银转债增强债券月类
本报告期期初基金份额总额	[illegible]	[illegible]
本报告期基金总申购份额	[illegible]	[illegible]
减:本报告期基金总赎回份额	[illegible]	[illegible]
本报告期基金拆分变动份额	原	原
本报告期期末基金份额总额	[illegible]	[illegible]

§苑 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》([illegible]号文)以及中国证券业协会《关于发布中证协(SAC)基金行业股票估值指数的通知》(中证协发[illegible]号)的有关规定,自[illegible]起,基金管理人已对本基金持有的长期停牌股票隆平高科(证券代码:[illegible])按照"指数收益法"进行估值,并对基金资产净值进行了调整。[illegible],根据本基金所持有的隆平高科(证券代码:[illegible])复牌后的市场交易情况,经基金管理人与基金托管人协商一致,自[illegible]起对本基金所持有的隆平高科采用交易当天收盘价进行估值。

以上情况已按规定公告。

§愿 备查文件目录

愿.员 备查文件目录

员《中银转债增强债券型证券投资基金基金合同》

圆《中银转债增强债券型证券投资基金招募说明书》

猿《中银转债增强债券型证券投资基金托管协议》

源中国证监会要求的其他文件

愿.圆 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站[illegible]。

愿.猿 查阅方式

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[illegible]查阅。

中银基金管理有限公司
二〇一二年七月十九日