中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2012年第2号）

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

二〇一二年九月

重要提示

本基金经中国证监会2009年12月22日证监许可【2009】1425号文核准进行募集，基金合同于2010年2月11日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。

投资有风险，投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日2012年8月11日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年6月30日（财务数据未经审计）。本基金托管人招商银行已复核了本次更新的招募说明书。

一、基金合同生效日

2010年2月11日。

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：中银基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼

法定代表人：谭炳

设立日期：2004年8月12日

电话：（021）38834999

传真：（021）68872488

联系人：高爽秋

注册资本：1亿元人民币

股权结构：

股 东	出资额	占注册资本的比例
中国银行股份有限公司	人民币8350万元	83.5%
贝莱德投资管理有限公司	相当于人民币1650万元的美元	16.5%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

谭炳（TAN Jiong）先生，董事长。国籍：中国。武汉大学硕士研究生，高级经济师、云南省人民政府特殊津贴专家。历任中国银行武汉市青山支行行长、党总支书记、中国银行西藏自治区分行行长、党委书记、中国银行云南省分行行长、党委书记等职。

李道滨（LI Daobin）先生，董事。国籍：中国。清华大学法学博士。中银基金管理有限公司执行总裁。2000年10月至2012年4月任职于嘉实基金管理有限公司，历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。具有12年基金行业从业经验。

梅非奇（MEI Feiqi）先生，董事。国籍：中国。现任中国银行总行个人金融总部总经理。哈尔滨工业大学硕士研究生，高级工程师、高级经济师。曾先后在地质矿产部、国务院办公厅工作，加入中国银行后，历任中国银行总行办公室副主任、中国银行北京市分行副行长等职。

葛岱炜（David Graham）先生，董事。国籍：美国。现任贝莱德投资管理有限公司董事总经理，主要负责管理贝莱德台资企业关系方面事务。葛岱炜先生于1977年—1984年供职于Deloitte Haskins & Sells（现为普华永道）伦敦和悉尼分公司，之后，在拉扎兹（Lazards）银行伦敦、香港和东京分公司任职。1992年，加入美林投资管理有限公司（MLIM），曾担任欧洲、中东、非洲、太平洋地区客户关系部门的负责人。2006年贝莱德与美林投资管理有限公司合并后，加入贝莱德。

朱善利（ZHU Shanli）先生，独立董事。国籍：中国。现北京大学光华管理学院教授、博士生导师，北京大学中国中小企业促进中心主任，21世纪创业投资中心主任，管理科学中心副主任，兼任中国投资协会理事、中国财政学会理事、中国企业投资协会常务理事等职。曾任北京大学光华管理学院经济管理系讲师、副教授、主任、北京大学光华管理学院应用经济学系主任、北京大学光华管理学院副院长等职。

荆新（JING Xin）先生，独立董事。国籍：中国。现任中国人民大学商学院党委书记兼副院长、会计学教授、博士生导师、博士后合作导师，兼任财政部中国会计准则委员会咨询专家、中国会计学会理事、全国会计学会学位教指委副主任委员。曾任中国人民大学会计系副主任、中国人民大学财计处处长等职。

葛礼（Gary Rieschel）先生，独立董事。国籍：美国。启明维创投资咨询有限公司的创办者、现任董事总经理，同时供职于里德学院董事会、亚洲协会、中美合资企业清洁能源、清洁技术论坛的顾问委员会，并担任纳斯达克上市公司THQ的独立董事。曾在美国知名技术公司思科、英特尔等任高级营运职位，并被多家杂志如福布斯、红鲱鱼、网络标准评为全球最主要的风险资本家之一。曾在美国英特尔公司担任品质保证经理，在美国NCube公司、思科公司以及日本Sequent公司担任管理职位，后为SOFTBANKMobius风险资本的创办者、董事总经理。哈佛商学院工商管理硕士，里德学院生物学学士。

2、监事

赵俭坪（ZHAO Huiping）先生，监事。国籍：中国。中央党校经济管理专业本科、人力资源管理师、经济师。曾任中国银行人力资源部信息团队主管、中国银行人力资源部综合处副处长、处长、人事部技术干部处干部、副处长。

陈宇（CHEN Yu）先生，职工监事，国籍：中国。复旦大学软件工程硕士研究生。现任中银基金管理有限公司副总裁、信息资讯部门主管，参与中银国际基金管理有限公司筹建工作。曾在中银万国证券股份公司从事信息技术管理工作，12年证券基金行业工作经历。

3、管理层成员

李道滨（LI Daobin）先生，董事，执行总裁。简历见董事会成员介绍。

欧阳向军（Jason X. OUYANG）先生，督察长。国籍：加拿大。中国证券业协会-沃顿商学院高级管理培训班（Wharton-SAC Executive Program）毕业证书，加拿大西安大略大学毅伟商学院（Ivey School of Business，The University of Western Ontario）工商管理硕士（MBA）和经济学硕士。曾在加拿大太平洋集团公司、加拿大帝国商业银行和加拿大伦敦人寿保险公司等海外机构从事金融工作多年，也曾任蔚深证券有限责任公司（现英大证券）研究发展中心总经理、融通基金管理公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦大学国际金融系国际金融教研室主任、讲师。

宁敏（NING Min）女士，副执行总裁。国籍：中国。中国社会科学院法学博士，中国政法大学法学硕士，曾在中国人民银行研究局博士后流动站从事金融专业博士后研究工作。宁敏女士曾先后在中国银行总行法律与合规部、总行投信执行部及总行托管及投资者服务部工作，先后担任副处长、主管（处长）等职。

4、基金经理

甘霖（GAN lin）先生：中银基金管理有限公司投资管理部权益投资助理总监、副总裁（VP）、工商管理硕士。曾任武汉证券公司交易部经理。2004年加入中银基金管理有限公司，2007年8月至今任中银收益基金基金经理，2010年2月至今任中银蓝筹基金基金经理，2012年7月至今任中银主题策略基金基金经理。具有18年证券从业年限。具备基金从业资格。

孙庆瑞（SUN Qingrui）女士，中银基金管理有限公司投资管理部权益投资总监、副总裁（VP）。管理硕士。曾任长盛基金管理有限公司全国社保组合债券基金经理、基金经理助理、债券研究员，联合证券股份有限公司债券研究员。2006年加入中银基金管理有限公司，2006年7月至2010年5月任中银货币基金基金经理，2006年10月至2008年4月任中银收益基金基金经理，2007年8月至今任中银中国基金基金经理， 2010年2月至今任中银蓝筹基金基金经理，2011年9月至今任中银增长基金基金经理。具有11年证券从业年限。具备基金从业资格。

（三）投资决策委员会成员的姓名及职务

主席：陈军（副总裁）

成员：孙庆瑞（副总裁）、奚鹏洲（副总裁）、张发余（副总裁）、甘霖（副总裁）

列席成员：欧阳向军（督察长）、寻明辉（副总裁）、李建（副总裁）

（四）上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

基金托管人概况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称"招商银行"）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：215.77亿元

法定代表人：傅育宁

行长：马蔚华

资产托管业务批准文号：证监基金字【2002】83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

名称：中银基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼

法定代表人：谭炳

电话：（021）38834999

传真：（021）68872488

联系人：徐琳

2、场外代销机构

1）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1 号

法定代表人：肖钢

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

2）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

3）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

4）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

5）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

客户服务中心电话：95588

银行网站：www.icbc.com.cn

6）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

客户服务中心电话：95568

银行网站：www.cmbc.com.cn

7）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

客服电话：95558

银行网站：bank.ecitic.com

8）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

公司网站：http://www.hxb.com.cn

9）中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200 号中银大厦39F

法定代表人：许刚

联系电话：（021）68604866

客服电话：61195566

网址：www.boci.com.cn

10）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618 号

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

客服电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

11）中国国际金融有限公司

注册地址：北京建国门外大街1 号国贸大厦2 座27 层及28 层

法定代表人：李剑阁

联系人：罗春蓉

联系电话：010-65051166 或直接联系各营业部

网址：www.cicc.com.cn

12）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98 号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

客服电话：95553

网址：www.htsec.com

13）信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街9 号院1 号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

客服电话：400-800-8899

网址：www.cinda sec.com

14）平安证券有限责任公司

注册地址：广东深圳福田区金田路大中华国际交易广场8 楼

法定代表人：杨宇翔

客户服务电话：4008866338

联系人：郑舒丽

公司网址：www.pa18.com

15）中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66 号4 号楼

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

客服电话：4008888108

网站：www.csc108.com

16）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨

客服电话：4008-888-788 、10108998

网址：www.ebscn.com

17）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171 号

法定代表人：储晓明

客服电话：0086-21-962505

联系人：高夫

网址：www.sw2000.com.cn

18）华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

法定代表人：李工

客服电话：0551-96518

联系人：甘霖

公司网址：www.hazq.com.cn

19）东信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018 号安联大厦35 层、28 层A02 单元

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

客服电话：4008001001

网址：www.essences.com.cn

20）广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路183 号大都会广场43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄凤

客服电话：95575 或致电各地营业网点

网址：www.gf.com.cn

21）天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19 号富凯大厦B 座701

法定代表人：林义相

联系人：潘鸿

客服电话：010-66045678

网址：www.txsec.com

22）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

客服电话：4008888888

网址：www.chinastock.com.cn

23）中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路29 号澳柯玛大厦15 层（1507-1510 室）

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

客服电话：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

24）东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路23 号投资广场18-19 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：李涛

客服电话：4008888588

网址：www.longone.com.cn

25）宏源证券股份有限公司

地址：北京市西城区太平桥大街19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

26）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

27）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157 号新天地大厦7、8 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

客服电话：96326（福建省外加拨0591）

网址：www.hfzq.com.cn

28）天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2 号高科大厦四楼

法定代表人：余磊

联系人：陈璐

客服电话：028-86711410

网址：www.tfzq.com

29）渤海证券股份有限公司

地址：天津市南开区宾水西道8 号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

客服电话：4006515988

网址：http://www.bhzq.com

30）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90 号

法定代表人：吴万善

联系人：万鸣

客服电话：（025）95597

网址：www.htsc.com.cn

31）国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3 号国华投资大厦9 层10 层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

客服电话：400 818 8118

网址：www.guodu.com

32）中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088 号招商银行大厦第A 层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

客服电话：010-84588888 或拨打各城市营业网点咨询电话

网站：www.cs.ecitic.com

33）中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：杭州市中河南路11 号万凯商务大楼A 座

法定代表人：刘军

联系人：俞会亮

客户服务咨询电话：（0571）96598

网址：www.bigsun.com.cn

3、场内代销机构

场内代销机构是指具有中国证监会认定的开放式基金代销资格、符合深圳证券交易所（以下简称"深交所"）有关规定并经本基金管理人认可的，可通过深交所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的深交所会员单位（具体名单请参见发售公告）。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

电话：（010）59378839

传真：（010）59378907

（三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68 号时代金融中心19 楼

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318 号星展银行大厦6 楼

法定代表人：杨绍信

电话：（021）61238888

传真：（021）61238800

联系人：汪建

经办注册会计师： 汪建、徐振晨

五、基金名称

中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

在优化资产配置的基础上，精选价值相对低估的优质蓝筹上市公司股票，力求获得基金资产的长期稳健增值。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合中，股票资产占基金资产的30-80%，其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金投资于优质蓝筹上市公司股票的资产不低于股票资产的80%。

九、投资策略

本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将科学、规范的选股方法与积极、灵活的资产配置相结合，通过精选业绩优良、经营稳定、具备增长潜力、具有行业领先优势的蓝筹上市公司股票，并结合基于"自上而下"的宏观经济研究和宏观经济政策导向分析而确定的积极灵活的类别资产配置策略，以谋求基金资产的长期稳健增值。

1、资产配置策略

在资产配置中，本基金运用以宏观经济研究及宏观经济政策导向分析为核心的分析方法来确定股票、债券和现金类资产（现金和到期日在一年以内的政府债券）等资产类别的预期收益、风险和各种情景发生的概率，在有效控制投资组合风险的前提下，形成对各类别资产的配置比例。

在上述确定的资产配置比例下，本基金将根据盈利增长、流动性、估值水平、投资主体行为、市场情绪等因素进行综合判断，对各类别资产配置进行灵活调整。

2、股票投资策略

（1）行业配置

本基金将通过对经济周期、产业环境、产业关联关系和行业竞争格局、行业集中度、行业表现相关性的分析和预测，确定宏观及产业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机，并据此对基金股票投资资产的行业分布进行动态调整。一般而言，本基金会重点投资国民经济增长中的支柱行业，受国家产业政策重点扶持的优势行业，以及受国内外宏观经济运行有利因素影响行业景气良好的行业。

（2）个股选择

本基金所重点选择的优质蓝筹股票是指，价值相对低估且业绩优良、经营稳定、具备增长潜力、具有行业领先优势的上市公司股票，本基金管理人将采用定量与定性相结合的研究方法，通过深入细致的基本面分析，自下而上精选符合上述标准的股票构建本基金股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得长期稳健的投资收益。具体而言，本基金管理人将按照以下标准选择优质蓝筹上市公司股票：

1）品质优选，构建本基金基础股票池的主要部分：

a）本基金管理人首先对所有A股上市公司股票进行初次筛选，剔除ST和*ST股票，以及接受监管机构公开谴责或处罚未满半年和涉及重大案件或诉讼的股票；

b）具备较大的市值规模，上一年度末总市值规模在所有A股上市公司中排名前三分之一或在各自行业内（按照GICS行业分类标准进行行业划分）总市值排名前三分之一；

c）具有行业领先优势，上一年度主营业务收入排名位于所属行业的前二分之一。

2）蓝筹精选，构建本基金重点或核心股票池的主要部分：

a）经营业绩优良，过去三年净资产收益率排名位于所属行业的前二分之一；

b）具备增长潜力，历史或预测的主营业务收入、利润增长率大于经济增长率，具有较高的研发投入比例；

c）具备良好的公司治理结构，管理规范，信息透明；

d）具备良好的品牌形象和市场美誉度，能够承担应有的企业社会责任。

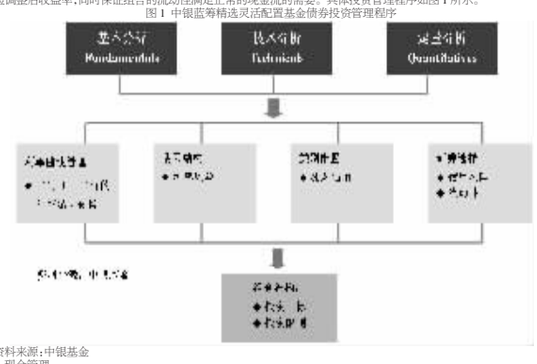
本基金管理人根据上述蓝筹股选择原则和标准，自下而上精选优质的蓝筹上市公司股票，使本基金投资于蓝筹上市公司股票的资产不低于股票资产的80%。并辅以科学、严谨的风险控制方法和流程对投资组合进行维护和优化。

3、债券投资策略

本基金在充分论证债券市场宏观环境和仔细分析利率走势基础上，依次通过平均久期配置策略、期限结构配置策略及类属配置策略自上而下完成投台构建。在投资实践过程中，本基金将灵活运用跨市场套利策略、跨品种套利策略、滚动配置策略、骑乘策略、回购放大策略等积极投资策略，发现、确认并利用资产定价偏离或市场不平衡等来实现投资组合的增值。本基金在整个投资决策过程中将认真遵守投资纪律并有效管理投资风险。

本基金对债券组合的投资管理程序借鉴了贝莱德投资管理在海外的投资管理经验，采用主动的投资管理，追求获得较高的风险调整后收益率，同时保证组合的流动性满足正常的现金流的需要。具体投资管理程序如图1所示。

图1 中银蓝筹精选灵活配置基金债券投资管理程序



资料来源：中银基金

4、现金管理

在现金管理上，本基金通过对未来现金流的预测进行现金预算管理，及时满足本基金运作的流动性需求。

5、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，依据权证定价模型确定其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产的长期稳定增长。

十、业绩比较基准

本基金的整体业绩基准为：沪深300指数收益率×60% + 上证国债指数收益率×40%。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股跨市场指数，其样本选自沪深两个证券市场，具有较好的市场代表性，其成分股为中国A股市场中代表性强、流动性高、交易活跃的主流投资股票，能够反映A股市场总体发展趋势。

上证国债指数全称为"上海证券交易所国债指数"，是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。其编制方法借鉴了美林债券指数、JP摩根债券指数等国际成熟市场主流债券指数的编制方法和特点，并充分考虑了国内债券市场发展的现状，具备科学性、合理性、简便性和易于复制等优点。上证国债指数可以表征整个中国国债市场的总体表现。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在与本基金托管人协商一致，并履行适当程序后，变更业绩比较基准并及时公告。

十一、风险收益特征

本基金是混合型基金，风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

十二、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

十三、投资组合报告

本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。

本基金的托管人——招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年9月4日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。

本投资组合报告所载数据截至2012年6月30日，本报告所列财务数据未经审计。

（一）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	1,221,592,463.47	69.86
	其中：股票	1,221,592,463.47	69.86
2	固定收益投资	298,885,000.00	17.09
	其中：债券	298,885,000.00	17.09
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	98,000,169.00	5.60
	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	121,991,802.63	6.98
6	其他各项资产	8,181,690.49	0.47
7	合计	1,748,651,125.59	100.00

（二）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	-	-
B	采掘业	100,464,611.30	5.77
C	制造业	620,525,667.14	35.61
C0	食品、饮料	227,827,007.99	13.08
C1	纺织、服装、皮毛	9,861,963.50	0.57
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	108,579,832.20	6.23
C5	电子	45,069,790.81	2.59
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	76,908,986.23	4.41
C8	医药、生物制品	152,278,086.41	8.74
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	17,199,620.80	0.99
E	建筑业	108,257,700.73	6.21
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	15,229,398.55	0.87
H	批发和零售贸易	31,202,927.34	1.79
I	金融、保险业	38,883,373.84	2.23
J	房地产业	227,558,250.93	13.06
K	社会服务业	54,826,078.04	3.15
L	传播与文化产业	7,444,834.80	0.43
M	综合类	-	-
	合计	1,221,592,463.47	70.11

（三）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	000858	五粮液	2,042,174	66,901,620.24	3.84
2	600519	贵州茅台	255,535	61,111,195.25	3.51
3	600208	新湖中宝	13,397,753	55,332,719.89	3.18
4	002310	东方园林	888,785	52,180,567.35	2.99
5	002004	华邦制药	2,269,378	51,061,005.00	2.93
6	000568	泸州老窖	1,157,663	48,980,721.53	2.81
7	600048	保利地产	4,259,722	48,305,247.48	2.77
8	600079	人福医药	2,028,402	47,038,642.38	2.70
9	600518	康美药业	2,932,904	45,225,379.68	2.60
10	000002	万科A	4,920,464	43,841,334.24	2.52

（四）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	-	-
2	央行票据	48,480,000.00	2.78
3	金融债券	250,405,000.00	14.37
	其中：政策性金融债	250,405,000.00	14.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
	其他	-	-
8	合计	298,885,000.00	17.15

（五）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	120211	12国开11	1,000,000	100,430,000.00	5.76
2	100223	10国开23	1,000,000	99,750,000.00	5.72
3	120305	12进出05	500,000	50,225,000.00	2.88
4	1101094	11央行票据94	500,000	48,480,000.00	2.78

（六）期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

（七）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。

（八）投资组合报告附注

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。

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。

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	2,000,000.00
2	应收证券清算款	1,198,068.13
3	应收股利	64,455.35
4	应收利息	4,695,749.28
5	应收申购款	223,417.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,181,690.49

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。

5、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。

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。

十四、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2010年2月11日，基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

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
2010年2月11日（基金合同生效日）至2010年12月31日	4.53%	0.99%	-0.09%	0.96%	4.62%	0.03%
2011年1月1日至2011年12月31日	-19.28%	0.91%	-14.09%	0.78%	-5.19%	0.13%
2012年1月1日至2012年6月30日	11.22%	0.96%	3.92%	0.80%	7.30%	0.16%
自基金合同生效起至2012年6月30日	-6.16%	0.95%	-10.80%	0.85%	4.64%	0.10%

十五、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金财产拨划支付的银行费用；

4、基金合同生效后的基金信息披露费用；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

7、基金的证券交易费用；

8、依据相关法律法规和基金合同可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调低基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十六、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金运作的实际情况，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

（一）在"基金管理人"部分，对董事会成员、管理层成员、基金经理等部分信息进行了更新；

（二）在"基金托管人部分"，对基金托管人的发展概况、主要人员情况、基金托管业务经营情况等信息进行了更新；

（三）在"相关服务机构"部分，对场外代销机构、注册登记机构的相关信息进行了更新；

（四）在"投资组合报告"部分，根据《信息披露内容与格式准则第5号》及《基金合同》，补充了本基金最近一期投资组合报告的内容；

（五）在"基金的业绩"部分，说明了基金报告期的投资业绩；

（六）在"其他应披露事项"部分，列明了前次招募说明书公布以来的其他应披露的事项。

中银基金管理有限公司

二〇一二年九月二十五日

股票简称：香溢融通 证券代码：600830 编号：临时2012-037

香溢融通控股集团股份有限公司 七届临时董事会决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

香溢融通控股集团股份有限公司于2012年9月20日发出召开公司第七届董事会临时会议的通知，9月24日以通讯方式召开七届临时董事会。会议应出席董事9名，实际出席董事9名。符合《公司法》和《公司章程》的相关规定。会议在保证公司董事充分发表意见的前提下，以传真方式审议表决。会议审议通过了《关于制订部分内控管理制度的议案》：

审议通过《香溢融通控股集团股份有限公司分级授权管理办法》、《公司控股子公司管理办法》、《公司预算管理制度》、《公司资产减值管理办法》、《公司外部信息使用人管理制度》（详见上海证券交易所网站http://www.sse.com.cn）。

同意9票，反对0票，弃权0票。

特此公告。

香溢融通控股集团股份有限公司

董 事 会

2012年9月24日

证券代码：600830 证券简称：香溢融通 公告编号：临时2012-038

香溢融通控股集团股份有限公司 关于控股子公司委托贷款业务相关事项的公告

2011年3月29日，公司控股子公司浙江香溢金联有限公司（以下简称：香溢金联）委托银行向绍兴水产有限责任公司（以下简称：绍兴水产）发放委托贷款5000万元，借款期限2011年3月29日-2012年3月20日，借款利息12%/年，后展期至2012年9月20日。委托贷款抵押物为绍兴市解放北路128号的宾馆综合用房，土地用途为商服用地，建筑面积共计7649.45平方米。2012年6月22日以来，绍兴水产尚未支付息费，截止本公告披露日，息费已逾期三个月。

目前，香溢金联正同绍兴水产商议该笔贷款利息偿付的具体办法和提高该业务风险保障的具体措施。

根据我司贷款类资产分类标准，本金或息费逾期90天以上，列入可疑类资产，预计将对公司当期业绩带来一定影