

中银中小盘成长股票型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及监察稽核部声明本基金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。

基金托管人声明本基金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。

基金的过往业绩并不代表未来的业绩表现。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。

本报告期截至2012年9月30日止。

§2 基本产品概况

基金名称	中银中小盘成长股票
基金代码	168818
交易代码	168818
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月12日
报告期末基金份额总额	259,845,779.00

投资目标	
通过其具良好成长潜力及合理估值水平的中小盘股票的投资，在有效控制组合风险的基础上，力争实现超越业绩基准的收益。	
本基金主要投资于具有良好成长性、估值合理的中小盘股票，对上市企业基本面的评价和长期成长性进行深入挖掘，在投资风格上倾向于选择具有较高成长性的行业，如医药、电子、机械设备、计算机、通信、公用事业等。	
本基金将保持较低的仓位，以降低组合的波动率，同时通过定期调整行业配置比例，把握不同行业间的轮动机会，从而达到资产配置的动态平衡。	
本基金将通过严格的风险控制，力争在有效控制风险的前提下，为投资者创造良好的回报。	

投资策略	
本基金将综合运用多种分析方法，对上市企业的基本面进行深入研究，结合宏观经济环境和政策因素，对上市企业的行业地位、盈利能力、成长性、估值水平等方面进行综合评估，精选出具有较好投资价值的上市公司股票，构建投资组合。	
本基金将根据宏观经济形势的变化，适时调整行业配置比例，把握不同行业间的轮动机会，从而达到资产配置的动态平衡。	
本基金将通过严格的风险控制，力争在有效控制风险的前提下，为投资者创造良好的回报。	
本基金将通过严格的风险控制，力争在有效控制风险的前提下，为投资者创造良好的回报。	

业绩比较基准	
本基金的业绩比较基准为“沪深300指数*90%+上证国债收益率*10%”	

风险收益特征	
本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险类别，预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和货币市场基金。	

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	

单位：人民币元	
主要财务指标	

报告期 2012年7月1日至2012年9月30日	
1.本期已实现收益	-22,210,626.22
2.本期利润	-9,315,844.58
3.期末可供分配利润本年末利润	-0.0351
4.期末基金净值价值	242,892,988.88
5.期末基金份额净值	0.935

注：本期已实现收益为本期利润减去本期公允价值变动收益，其中包含对收入类投资收益的贡献，但不包括利息收入、股息红利收入、其他收入；期末可供分配利润不等于基金净值，因为未考虑分红时的费用影响。

3.2 本期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银中小盘成长股票型证券投资基金

累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2011年11月12日至2012年9月30日

注：本基金的净值增长率=（报告期每份收益-同期银行活期存款利率）/同期银行活期存款利率。

3.3 本期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银中小盘成长股票型证券投资基金

累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2011年11月12日至2012年9月30日

注：本基金的净值增长率=（报告期每份收益-同期银行活期存款利率）/同期银行活期存款利率。

3.4 管理人报告

3.4.1 基金管理人报告期内的运作情况说明

报告期内，本基金未发生任何对基金份额持有人利益造成重大影响的事件。

3.4.2 基金管理人对旗下基金运作的评价说明

本报告期内，基金管理人严格按照《基金法》及相关法律法规的规定，勤勉尽责地履行了法定职责，严格遵循了基金合同约定的基金管理人应尽的义务，没有损害基金份额持有人利益的情况。

3.4.3 公司年度报告的说明

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.4 公司年度报告的披露情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.5 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.6 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.7 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.8 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.9 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.10 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.11 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.12 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.13 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.14 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.15 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.16 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.17 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.18 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.19 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.20 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.21 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.22 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.23 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.24 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.25 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.26 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.27 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.28 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.29 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.30 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.31 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.32 公司年度报告的披露地点

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度报告》。

3.4.33 公司年度报告的披露时间

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公开募集证券投资基金年度报告编制及披露规则》，基金管理人编制了《中银基金管理有限公司2012年度