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:二〇一三年三月三十日

中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

2012年度报告摘要

2012年12月31日

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中银蓝筹混合
基金主代码	163809
交易代码	163809
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月11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
报告期末基金份额总额	1,783,168,248.79份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。
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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
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。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	程明	张燕
	联系电话	021-38834999	0755-83199084
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	Yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95555
传真		021-68873488	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金年度报告备置地点	上海市银城中路200号中银大厦45层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2012年	2011年	2010年2月11日至2010年12月31日
本期已实现收益	-109,793,985.36	-55,476,183.17	100,894,411.95
本期利润	180,948,392.58	-394,710,774.97	257,735,752.99
加权平均基金份额本期利润	0.0978	-0.1901	0.0537
本期基金份额净值增长率	12.06%	-19.28%	4.53%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0713	-0.1713	0.0271
期末基金资产净值	1,656,008,181.87	1,547,249,456.16	2,476,903,268.46
期末基金份额净值	0.929	0.829	1.027

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未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
过去三个月	4.15%	0.67%	6.33%	0.77%	-2.18%	-0.10%
过去六个月	0.76%	0.74%	2.35%	0.74%	-1.59%	0.00%
过去一年	12.06%	0.85%	6.36%	0.77%	5.70%	0.08%
自基金合同生效起至今	-5.44%	0.92%	-8.70%	0.83%	3.26%	0.09%

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

中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

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

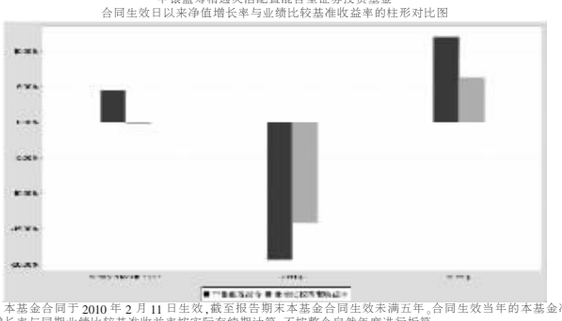
(2010年2月11日至2012年12月31日)

按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6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部分(二)的规定,即本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为30-80%,持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,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%,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%,其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



本基金合同于2010年2月11日生效,截至报告期末本基金合同生效未满五年,合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

金额单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	-	-	-	-	-
2011	-	-	-	-	-
2010	0.200	48,286,859.55	3,977,357.17	52,264,216.72	-
合计	0.200	48,286,859.55	3,977,357.17	52,264,216.72	-

注:本基金合同于2010年2月11日生效,截至报告期末本基金合同生效未满三年。

§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8月12日正式成立,由中银国际和美林投资管理合资组建(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2012年12月31日,本管理人共管理二十三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、中银转债增强债券型证券投资基金、中银中小盘成长股票型证券投资基金、中银信用增利债券型证券投资基金、中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF)、中银主题策略股票型证券投资基金、中银保本混合型证券投资基金、中银理财14天债券型证券投资基金、中银理财60天债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金及中银理财7天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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
甘霖	本基金的基金经理、中银收益基金基金经理、中银主题策略基金基金经理、公司权益投资部副总经理	2010-02-11	-	18	中银基金管理有限公司权益投资部副总经理,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	本基金的基金经理、中银中国基金基金经理、中银增长基金基金经理、公司权益投资部总经理	2010-02-11	-	11	中银基金管理有限公司权益投资部总经理,副总裁(VP),管理学硕士,曾任长城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。

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;

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 公平交易制度和控制方法

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》,公司制定了《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、《新股询价申购和参与公开增发管理制度》、《债券询价申购管理制度》、《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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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,本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

本报告期内,本公司通过对公司管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,并对连续四个季度的不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,对其进行了95%置信区间,假设溢价率为0的T分布检验,结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明,本报告期内公司对各投资组合公平对待,不存在利益输送的行为。

4.3.3 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5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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

刚刚过去的2012年,是国内外经济从危机中艰难突围的一年。随着欧债危机系统性风险和美国"财政悬崖"逐步缓解,各主要货币当局持续放松货币政策以支撑经济摆脱困局。国内货币政策在三季度开始通过数量型工具的操作,维持相对宽松的货币环境,国内经济增速在上半年持续下滑后,第三季度末筑底弱势回升。

从国外的经济情况来看,2012年美国经济经历了较大的起伏,继续艰难复苏。随着第三季度推出新一轮量化宽松政策,经济复苏势头恢复,GDP环比增长达到了5.9%,失业率也明显回落至7.8%。但从领先指标来看,美国ISM发布的制造业PMI在2012年11-12月份勉强在50%荣枯线附近波动,预计2013年一季度美国经济复苏步伐仍将较为艰难。欧元区方面,债务危机担忧在2012年上半年持续升温,随后ESM机制的生效与银行统一监管协议的达成缓解了欧元区崩溃的系统性风险,但欧债危机根本性问题尚未解决。在此情况下,欧元区经济仍处于衰退泥潭之中,但衰退势头有趋缓迹象。展望2013年,3-5月份美国仍将面临关于削减支出、预算方案及债务上限的谈判,总体仍将维持"宽货币、紧财政"的环境;欧元区将在寻求进一步债务危机解决方案的同时,维持宽松的货币政策以防止经济进一步滑向衰退深渊。

从国内的经济情况来看,在"稳中求进"的经济工作重点下,积极的财政政策与稳健的货币政策贯穿全年,经济增速与通胀水平在下半年缓慢筑底。具体来看第一季度,GDP与工业增加值同比增速分别维持于在高位,二季度经济出现超预期下滑。三季度随着"稳增长"政策和货币政策的宽松以及财政政策增速见底,经济逐步见底,在四季度经济小幅回升。当前来看,稳定的政策环境有望延续,地产及汽车等下游需求继续恢复,经济短期内有望延续弱势回暖态势。

展望2013年,全球经济在寻求复苏的道路上仍将面临不少阻碍。相比之下,美国经济内生动力恢复的现状较好。欧元区债务危机问题导致欧元区经济难以明显回暖。国内经济方面,积极的财政政策与稳健的货币政策有望为稳定经济增长营造较为有利的环境。但考虑到工业企业产能依然过剩以及房地产市场的泡沫化程度,加之管理层严控财政金融系统性风险的态度可能限制社会融资总量的增长,故经济回暖的持续性有待观察。

2.行情回顾

股票指数2012年呈现先抑后扬走势,并且后期的涨幅大于之前的跌幅,上证综指最终上涨3.17%。从风格来看,大盘股大幅跑赢中小盘股。代表大盘股的上证50指数上涨14.84%,而代表中小盘的中证500指数仅上涨0.28%,沪深300指数上涨7.55%。从行业来看,涨跌互现,涨幅最大的是券商和地产,分别上涨36.33%和31.85%。跌幅最大的是电信服务和电气设备,分别下跌30.68%和20.06%。

3.运行分析

2012年年初基于对全年经济较乐观的预期下,市场在一季度经历了较明显的估值回升行情。本基金在年初加大了对业绩确定性股票的配置,在年初取得了较好的收益。而二季度随着经济超预期的下滑,周期性行业股票出现了大幅的下滑,对本基金的影响相对较小,取得了相对的优势。三季度至四季度前两个月,市场的机会较少。本基金通过仓位控制和行业选择,有效的规避了市场普跌的风险。但在四季度最后一个月,市场在经历了七个月的调整后,12月份出现了大逆转。在权重股的带领下,上证指数和深证成指分别上涨了15.9%和18.6%。银行、金融、煤炭、地产等行业指数大幅上涨。本基金在12月的市场逆转中,虽然加大了仓位,但对市场的结构性机会把握不够,对银行、金融、地产等行业配置不够,导致最后一个月表现低于预期。后阶段,会进行结构调整,把握好新年的结构机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日为止,本基金的单位净值为0.929元,本基金的累计单位净值为0.949元。年内本基金净值增长率为12.06%,同期业绩基准增长率为6.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年的市场对基金管理者来说,是挑战比较大的一年,市场的机会持续时间比较短,同时结构性机会特征明显。前三个月,市场经历了一波估值修正的结构性行情。之后因为经济超预期下滑和流动性因素,市场逐步下跌并创出一年新低。11月底,在新股停发、地产销售旺盛、市场流动性改善、管理层加大QFII审批、经济持续复苏等利好因素下,以金融银行、地产为代表的板块在经历了近一年的不景气后,大幅反弹,带动近期指数不断走高。在经历了市场大幅度的估值修复后,未来市场运行趋势更多取决于宏观基本面的变化。目前看,影响后阶段的因素有美国经济回升的持续性、一季度国内政府换届后对地产调控的政策变化和新政府开局后的财政货币政策。基于城镇化的预期,未来投资增速如果能保持稳定,经济向好的持续性会更确定。基于此,未来在密切跟踪政策变化的情况下,做好前瞻性政策预期和基金结构布局是下一步主要的操作思路。

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

4.7.1 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,由交易部做出提示,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确认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。

4.7.2 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,但不介入基金日常估值业务。

4.7.3 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。

4.7.4 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的30%。

本报告期期末可供分配利润为-127,160,066.92元,本基金份额净值低于面值。根据本基金基金合同第十六部分基金的收益与分配相关约定,无相关收益分配事项。

§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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所审计,注册会计师汪棣、刘颖签字出具了普华永道中天审字(2013)第20482号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	198,528,198.43	67,869,442.60
结算备付金		8,144,828.59	881,051.91
存出保证金		2,000,000.00	1,106,224.38
交易性金融资产	7.4.7.2	1,469,897,888.26	1,482,235,421.76
其中:股票投资		1,220,287,888.26	984,033,945.64
基金投资		-	-
债券投资		249,610,000.00	498,201,476.12
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	5,030,910.50	6,974,260.63
应收股利		-	-
应收申购款		21,041.59	30,216.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,683,622,867.37	1,559,096,617.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		21,171,877.59	5,955,047.79
应付赎回款		739,833.97	1,814,248.12
应付管理人报酬		1,999,388.12	2,036,694.02
应付托管费		333,231.36	339,449.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,165,769.44	595,042.75
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,204,585.02	1,106,679.79
负债合计		27,614,685.50	11,847,161.47
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,783,168,248.79	1,867,092,837.65
未分配利润	7.4.7.10	-127,160,066.92	-319,843,381.49
所有者权益合计		1,656,008,181.87	1,547,249,456.16
负债和所有者权益总计		1,683,622,867.37	1,559,096,617.63

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.929元,基金份额总额1,783,168,248.79份。

7.2 利润表

会计主体:中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一.收入		217,664,788.79	-350,906,393.49
1.利息收入		15,653,998.31	17,455,133.40
其中:存款利息收入	7.4.7.11	1,983,154.90	1,427,628.93
债券利息收入		10,711,351.58	13,711,077.18
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,959,491.83	2,316,427.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-88,780,164.10	-29,606,707.00
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-102,689,734.16	-40,996,251.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,669,280.96	1,009,602.59
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	11,240,289.10	10,379,941.52
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	290,742,377.94	-339,234,591.80
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	48,576.64	479,771.91
减:二.费用		36,716,396.21	43,804,381.48
1.管理人报酬		24,664,136.83	29,832,198.46
2.托管费		4,110,689.57	4,972,033.08
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	7,488,025.03	8,400,846.65
5.利息支出		-	106,867.09
其中:卖出回购金融资产支出		-	106,867.09
6.其他费用	7.4.7.19	453,544.78	492,436.20
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		180,948,392.58	-394,710,774.97
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		180,948,392.58	-394,710,774.97

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31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)	1,867,092,837.65	-319,843,381.49	1,547,249,456.16
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	180,948,392.58	180,948,392.58
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)	-83,924,588.86	11,734,921.99	-72,189,666.87
其中:1.基金申购款	154,427,728.02	-12,944,353.29	141,483,374.73
2.基金赎回款	-238,352,316.88	24,679,275.28	-213,673,041.60
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)	1,783,168,248.79	-127,160,066.92	1,656,008,181.87

项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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)	2,411,640,684.21	65,262,584.25	2,476,903,268.46
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-394,710,774.97	-394,710,774.97
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)	-544,547,846.56	9,604,809.23	-534,943,037.33
其中:1.基金申购款	88,512,955.93	-2,602,642.72	85,910,313.21
2.基金赎回款	-633,060,802.49	12,207,451.95	-620,853,350.54
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)	1,867,092,837.65	-319,843,381.49	1,547,249,456.16

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:李道滨,主管会计工作负责人:乔炳亚,会计机构负责人:乐妮

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金(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")证监许可[2009]1425号《关于核准中银蓝筹精选灵活配置混合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依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银蓝筹精选灵活配置混合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证券投资基金,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6,181,247,984.67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(2010)第033号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2010年2月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为6,183,631,055.91份,其中认购资金利息折合2,383,071.24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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银蓝筹精选灵活配置混合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。本基金的投资组合为:本基金投资组合中,股票资产为基金资产的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%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

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2013年3月29日批准报出。

7.4.2 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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012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2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间没有需作说明的会计差错更正。

7.4.6 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[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)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

(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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金管理人的股东、基金销售机构
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、基金销售机构
中银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、基金销售机构
贝莱德投资管理(英国)有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	24,664,136.83	29,832,198.46
其中:支付销售机构的客户维护费	4,409,358.51	5,426,439.78

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×1.50%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,110,689.57	4,972,033.08

注:支付基金托管人招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×0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	198,528,198.43	1,886,744.51	67,869,442.60	1,381,875.54

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2012年1月1日至2012年12月31日					