中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:二〇一四年四月十九日

§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。

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2014年4月18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。

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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	922,686,392.94份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	18,527,776.97
2.本期利润	-17,855,388.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0161
4.期末基金资产净值	932,038,136.82
5.期末基金份额净值	1.010

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。

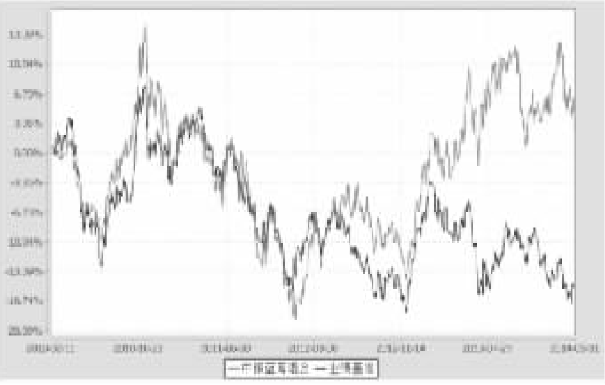
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-2.23%	1.02%	-4.44%	0.72%	2.21%	0.30%

3.2.2自基金合同生效以来基金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
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2014年3月31日)



注: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。

§4 管理人报告

4.1 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		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、中银消费主题股票基金基金经理、中银优秀企业股票基金基金经理、公司权益投资部副总经理	2010-02-11	-	20	中银基金管理有限公司权益投资部副总经理,董事(Director),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2014年1月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2014年1月任中银主题策略基金基金经理,2013年4月至今任中银消费主题股票基金基金经理,2014年1月至今任中银优秀企业股票基金基金经理。具有20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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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

国外经济方面,美联储引导加息预期提前,国际资本流出新兴经济体的压力有所上升。国内经济方面,一季度经济加速下滑。从经济增长动力来看,拉动经济的三驾马车增速均有所放缓。通胀在2.0%-2.5%的低位水平震荡,PPI通缩幅度重新扩大。

展望未来,欧元区经济维持改善趋势,美联储货币政策从紧的节奏稳步加速。预计国内经济在"在促改革、调结构、惠民生协同并进中稳增长"财政政策的托底保障下,短期内有望企稳,但需求疲弱、产能过剩、融资受限等根本性问题尚未解决。货币政策预计仍将维持中性操作,社会融资总量增速继续放缓是大概率事件。

2.行情回顾

一季度上证综指低位盘整,下跌3.91%,创业板指数在大幅上涨之后又快速回落,最终小幅上涨1.79%。从行业来看,代表经济转型的新兴产业表现较好,涨幅最大行业是计算机。而受经济结构调整影响,跌幅最大的行业是煤炭。

3.运行分析

一季度市场先扬后抑,振幅加大。从风格上看,价值股逐步走强。本基金从去年四季度末起,就逐步降低了仓位,并增持了低估值板块公司。同时在行业选择上,偏重于大众消费品、医药等符合长期发展逻辑的行业。目前对2014年二季度的市场仍保持比较谨慎的判断。短期关注政策对经济托底行为带来的投资机会。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年03月31日为止,本基金的单位净值为1.010元,本基金的累计单位净值为1.030元。季度内本基金份额净值增长率为-2.23%,同期业绩比较基准收益率为-4.44%。

4.5 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,随着一季度经济快速下滑,政策保增长力度逐步加强。同时海外中概股调整,新股发行继续开闸,创业板年报和季报公布部分低于预期,导致创业板和中小板调整,以及大盘价值股相对走强。

预计二季度政策对经济的短期托底会带来大股票的估值修复行情,但幅度有限。价值股修复行情主要受制于产能过剩、融资受限等。市场更多的机会来自深化改革、转型发展下带来的机遇。判断后阶段市场机会仍然会集中在服务消费、节能环保、新能源相关行业和移动互联网等方向上。

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。

§5 投资组合报告

5.1 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(%)
1	权益投资	615,894,833.85	65.80
	其中:股票	615,894,833.85	65.80
2	固定收益投资	160,630,000.00	17.16
	其中:债券	160,630,000.00	17.16
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	115,590,457.80	12.35
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	38,780,050.73	4.14
7	其他各项资产	5,110,066.23	0.55
8	合计	936,005,408.61	100.00

5.2 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(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	21,123,530.31	2.27
C	制造业	434,040,781.56	46.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	30,213,284.28	3.24
F	批发和零售业	21,421,796.93	2.30
G	交通运输、仓储和邮政业	11,873,044.36	1.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,708,114.95	3.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	60,561,254.26	6.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	6,953,027.20	0.75
S	综合	-	-
	合计	615,894,833.85	66.08

5.3 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(%)
1	002004	华邦颖泰	3,312,658	56,083,299.94	6.02
2	603288	海天味业	568,424	37,589,879.12	4.03
3	600887	伊利股份	973,426	34,877,853.58	3.74
4	300058	蓝色光标	664,839	33,241,950.00	3.57
5	002038	双鹭药业	648,441	25,224,354.90	2.71
6	600518	康美药业	1,492,734	24,182,290.80	2.59
7	600594	益佰制药	589,506	24,140,270.70	2.59
8	300315	掌趣科技	751,761	23,444,795.04	2.52
9	600557	康缘药业	705,414	21,508,072.86	2.31
10	300071	华谊嘉信	765,399	21,232,168.26	2.28

5.4 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(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,910,000.00	6.43
	其中:政策性金融债	59,910,000.00	6.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,720,000.00	10.81
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	160,630,000.00	17.23

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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(%)
1	041361016	13中电投CP002	1,000,000	100,720,000.00	10.81
2	130227	13国开27	600,000	59,910,000.00	6.43

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货,无相关投资政策。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货,无相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资,无相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	286,116.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,765,228.85
5	应收申购款	58,721.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,110,066.23

5.11.4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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300071	华谊嘉信	21,232,168.26	2.28	重大资产重组

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

本报告期期初基金份额总额	1,217,113,424.31
本报告期基金总申购份额	3,213,795.29
减:本报告期基金总赎回份额	297,640,826.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	922,686,392.94

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
2、《中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
3、《中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4、中国证监会要求的其他文件

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人网站www.bocim.com。

8.3 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办公场所免费查阅,也可登录基金管理人网站www.bocim.com查阅。

中银基金管理有限公司
二〇一四年四月十九日

中银中国精选混合型开放式证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:二〇一四年四月十九日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月18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。

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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中银中国混合(LOF)(场内简称:中银中国)
基金主代码	163801
交易代码	163801
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2005年1月4日
报告期末基金份额总额	1,978,936,198.71份
投资目标	研究全球经济和行业发展趋势,紧随中国经济独特的发展节奏,挖掘中国主题,致力于通过专业投资获得长期资本增值。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的主动投资管理策略,将定性与定量分析贯穿于主题精选、公司价值评估、投资组合构建以及组合风险管理的全过程之中。本基金的投资管理主要分为三个层次:第一个层次是自上而下的资产类别的配置,第二个层次是精选主题,第三个层次是自下而上的个股选择。
业绩比较基准	中信标普300指数×70% +中信国债指数×20% + 1年期银行存款利率×10%
风险收益特征	中等偏上风险品种
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	58,461,367.23
2.本期利润	-157,331,534.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0746
4.期末基金资产净值	2,440,263,479.58
5.期末基金份额净值	1.2331

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。

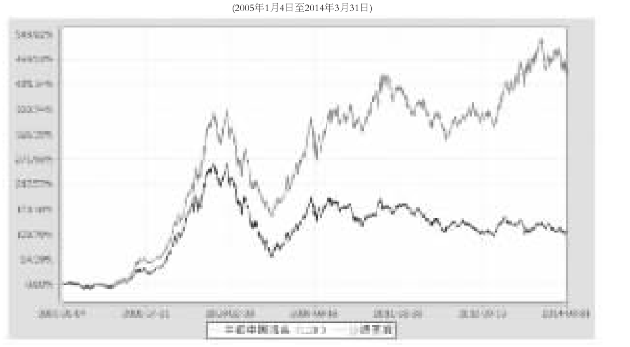
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-5.81%	1.07%	-4.55%	0.82%	-1.26%	0.25%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

中银中国精选混合型开放式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005年1月4日至2014年3月31日)



注: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十六部分(三)投资范围和投资对象、(五)投资管理程序的规定,即本基金投资组合中股票资产投资比例为基金净资产的40%-95%,债券资产及回购比例为0-45%,现金类资产比例为5-15%。

§4 管理人报告

4.1 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈军	本基金的基金经理、中国收益基金基金经理、中银美丽中国股票基金基金经理、助理执行总裁	2013-08-23	-	16	中银基金管理有限公司助理执行总裁,执行董事(ED),金融学硕士。曾任中信证券股份有限责任公司资产管理部项目经理。2004年加入中银基金管理有限公司,2006年10月至今任中银收益基金基金经理,2009年9月至2013年10月任中银中证100指数基金基金经理,2013年6月至今任中银美丽中国股票基金基金经理,2013年8月至今任中银中国基金基金经理。特许金融分析师(CFA),香港财经分析师学会会员。具有16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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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

国外经济方面,美国经济在年初受到暴风雪天气的小幅冲击,在一季度重回复苏通道。从领先指标来看,一季度美国ISM制造业PMI指数自较低水平回升,同时就业市场改善暂缓。一季度欧元区经济维持复苏态势。美国仍是全球复苏前景最好的经济体,美联储引导加息预期提前,国际资本流出新兴市场经济体的压力可能进一步抬升。

国内经济方面,一季度经济加速下滑。具体来看,领先指标制造业PMI指数降至50荣枯线附近,同步指标工业增加值同比增速降至9.0%之下的低位。从经济增长动力来看,拉动经济的三驾马车增速均有所放缓。通胀方面,CPI同比增速在2.0%-2.5%的低位水平震荡,PPI通缩幅度重新扩大。

2.行情回顾

一季度股市指数表现不一。上证综指低位盘整,下跌3.91%,而创业板指数一季度大幅震荡,大幅上涨之后又快速回落,最终小幅上涨1.79%。从风格来看,与互联网相关的股票表现较好。从行业来看,依然是代表经济转型的新兴产业表现较好,涨幅最大行业是计算机。而受经济结构调整影响,跌幅最大的行业仍然是煤炭。

3.运行分析

报告期内,基金继续控制仓位,并规避强周期行业,超配计算机、传媒和医药等行业。从投资效果看,对成长股的超配继续贡献超额回报。组合将继续通过增持行业景气向上、成长确定性高的股票获得稳健的投资回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年03月31日为止,本基金的单位净值为1.2331元,本基金的累计单位净值3.5731元。季度内本基金份额净值增长率为-5.81%,同期业绩比较基准收益率为-4.55%。

4.5 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,美国经济在摆脱天气影响后有望継续稳步复苏,欧元区经济在较好的外围环境下也有望维持改善趋势。美联储货币政策从紧的节奏稳步加速,国际资本流出新兴市场经济体的压力可能进一步抬升。

鉴于对当前经济和通胀增速的判断,预计国内经济增速短期内有望企稳,但需求疲弱、产能过剩、融资受限等根本性问题尚未解决。国务院常务会议提出"在促改革、调结构、惠民生协同并进中稳增长",要求"今年要更大规模推进棚改,必须抓住资金保障这个'牛鼻子',把政策支持和市场机制有效结合,尤其要发挥好依托国家信用、服务国家战略、资金运用保本微利的开发性金融的'供血'作用,为棚改提速提供依法合规、操作便捷、成本适当、来源稳定的融资渠道,保证棚改任务的资金需要,并努力降低资金成本。"央行货币政策例会表示继续实施稳健的货币政策,保持适度流动性,预计近期货币政策仍将维持中性操作。公开市场方面,二季度到期资金量有所增加,有利于对冲外汇占款下降及财政存款上缴引发的流动性波动,预计公开市场整体仍将延续稳健的操作,以维持较为平稳的货币环境。社会融资方面,防范金融风险及规范表外融资的政策思路延续,预计社会融资总量增速继续放缓是大概率事件。

针对目前和未来的形势判断,本基金会采取结构化的投资策略,精选行业和个股。

投资策略:1)围绕"创新"方向的深入选股,维持计算机、医药和传媒等消费成长行业的配置。2) 持续关注"改革"的进展和相关投资机会,选择转型过程中受益和业绩相对稳定估值合理的个股。3)大消费会是我们基础性配置的板块。选择具有较强护城河、能够穿越周期成长的公司作为长期配置的投资标的。

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。

§5 投资组合报告

5.1 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(%)
1	权益投资	1,605,183,610.94	64.63
	其中:股票	1,605,183,610.94	64.63
2	固定收益投资	307,294,073.40	12.37
	其中:债券	307,294,073.40	12.37
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	400,000,000.00	16.10
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	123,118,209.21	4.96
7	其他各项资产	48,117,723.26	1.94
8	合计	2,483,713,616.81	100.00

5.2 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(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	776,560,181.44	31.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	158,165,095.62	6.48
F	批发和零售业	61,629,299.60	2.53
G	交通运输、仓储和邮政业	7,062,033.30	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	396,519,067.94	16.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	160,259,299.42	6.57
M	科学研究和技术服务业	6,604,147.22	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	38,384,486.40	1.57
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,605,183,610.94	65.78

5.3 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(%)
1	300315	掌趣科技	3,933,590	126,582,926.20	5.19
2	300058	蓝色光标	2,489,975	124,498,750.00	5.10
3	002241	歌尔声学	4,157,412	106,429,747.20	4.36
4	300104	乐视网	2,814,657	105,127,438.95	4.31
5	002325	洪涛股份	10,933,817	98,732,367.51	4.05
6	000538	云南白药	1,078,240	90,572,160.00	3.71
7	600887	伊利股份	2,428,475	87,012,259.25	3.57
8	002236	大华股份	2,686,740	76,813,896.60	3.15
9	600518	康美药业	4,333,332	70,199,978.40	2.88
10	002421	达实智能	3,076,419	68,634,907.89	2.81

5.4 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(%)
1	国家债券	48,460,000.00	1.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	200,000,000.00	8.20
	其中:政策性金融债	200,000,000.00	8.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,130,000.00	2.05
6	中期票据	-	-
7	可转债	8,704,073.40	0.36
8	其他	-	-
9	合计	307,294,073.40	12.59

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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(%)
1	130218	13国开18	2,000,000	200,000,000.00	8.20
2	041361043	13中电投CP003	500,000	50,130,000.00	2.05
3	130018	13附息国债18	500,000	48,460,000.00	1.99
4	110023	民生转债	98,340	8,704,073.40	0.36

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货,无相关投资政策。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货,无相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资,无相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	368,919.88
2	应收证券清算款	37,064,125.35
3	应收股利	-
4	应收利息	7,488,175.49
5	应收申购款	3,196,502.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,117,723.26

5.11.4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(%)
1	110023	民生转债	8,704,073.40	0.36

5.11.5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的情况。

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

本报告期期初基金份额总额	1,997,646,393.07
本报告期基金总申购份额	433,857,886.52
减:本报告期基金总赎回份额	452,568,080.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,978,936,198.71

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内,基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《中银中国精选混合型开放式证券投资基金基金合同》
2、《中银中国精选混合型开放式证券投资基金招募说明书》
3、《中银中国精选混合型开放式证券投资基金托管协议》
4、《中银中国精选混合型开放式证券投资基金上市交易公告书》
5、中国证监会要求的其他文件

8.2 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www.bocim.com。

8.3 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,也可登陆基金管理人网站www.bocim.com查阅。

中银基金管理有限公司
二〇一四年四月十九日

中银中证100指数增强型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:二〇一四年四月十九日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月18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。

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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中银中证100指数增强
基金主代码	163808
交易代码	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	1,224,758,725.71份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,在被动跟踪标的指数的基础上,加入增强型的积极手段,力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%,以实现对中证100指数的有效跟踪并力争实现超越,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数化投资作为主要投资策略,在此基础上进行适度的主动调整,在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在严控偏离风险及力争适度超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离业绩比较基准的风险,本基金力求控制基金份额净值增长率与业绩比较基准间的日跟踪误差不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%。
业绩比较基准	中证100指数收益率×90%+银行同业存款利率×10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-8,574,974.82
2.本期利润	-65,984,557.17
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0520
4.期末基金资产净值	771,462,996.49
5.期末基金份额净值	0.630

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。

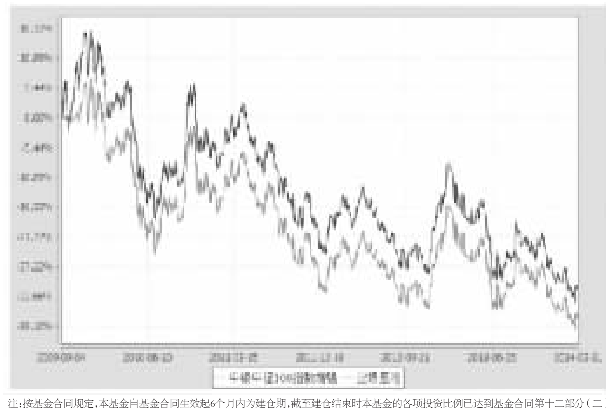
3.2 基金净值表现

3.2.1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	-7.49%	1.11%	-7.39%	1.06%	-0.10%	0.05%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

中银中证100指数增强型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年9月4日至2014年3月31日)



注: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,即本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90-95%,投资于标的指数—中证100成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%,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%,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。

§4 管理人报告

4.1 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周小丹	本基金的基金经理、国企ETF基金基金经理、中银沪深300等权重指数基金(LOF)基金经理	2010-11-05	-	7	中银基金管理有限公司助理副总裁(AVP),香港城市大学金融数学硕士。2007年加入中银基金管理有限公司,先后担任数量研究员、中银中证100指数基金基金经理助理、中银蓝筹基金基金经理助理等职。2010年11月至今任中银中证100指数基金基金经理,2011年6月至今任国企ETF基金基金经理,2012年5月至今任中银沪深300等权重指数基金(LOF)基金经理。具有7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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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

国外经济方面,美国经济在年初受恶劣天气影响小幅调整,在一季度重回复苏通道。从领先指标来看,一季度美国ISM制造业PMI指数自较低水平回升,同时就业市场改善暂缓。一季度欧元区经济维持复苏态势。美国仍是全球复苏前景最好的经济体,美联储引导加息预期提前,国际资本流出新兴经济体的压力有所上升。

国内经济方面,一季度经济加速下滑。具体来看,领先指标制造业PMI指数降至50荣枯线附近,同步指标工业增加值同比增速降至9.0%之下的低位。从经济增长动力来看,拉动经济的三驾马车增速均有所放缓。通胀方面,CPI同比增速在2.0%-2.5%的低位水平震荡,PPI通缩幅度重新扩大。

2.行情回顾

回顾一季度行情,大盘呈现低位震荡走势,春节后流动性改善、资金成本回落未能促使市场出现大幅反弹,市场仍担忧经济增长的持续回落的冲击;另外,一些负面消息事件也不断打击投资者情绪:债券市场开始出现违约事件、房地产市场基本已经确定进入到中期的下行通道、人民币结束了单边持续升值引发热钱流出担忧。在风格板块,前期表现较好成长类股票开始进入业绩兑现与检验期,一些低于预期的行业也开始出现回调,带动整体市场情绪回落。在行业层面,轻工制造、IT、电器服务等行业表现较好,而采掘、券商和农业等行业表现较差。从风格指数来看,中小盘股强于大盘,中证100指数下跌8.23%,沪深300指数下跌7.89%。

3.运行分析

本报告期为本基金正常运作期,在操作中,我们严格遵守基金合同,被动投资为主,主动投资为辅,坚持既定的指数化投资策略,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年03月31日为止,本基金的单位净值为0.630元,本基金的累计单位净值为0.640元。季度内本基金份额净值增长率为-7.49%,同期业绩比较基准收益率为-7.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度,制造业景气度在进入经济活动旺季后微有回升,但幅度远小于历年均值,经济总体旺季不旺态势延续,但企业预期有所改观,3月下旬后工业品量价开始出现企稳迹象,显示经济失速风险在下降,短期稳增长依旧延续预调微调基调,在积极引导市场预期的同时,加快基础设施等已有项目的进度和节奏,但稳增长政策的边际效用在减弱。资金面上4月份 IPO启动基本上是大概率事件,受美国持续退出QE以及加息预期影响美元走强,而人民币汇率则出现明显的弱势震荡格局,凸显出国际资金流出压力。优先股仍有发散机会,并带动蓝筹股出现适度的风格转换,对指数也带来支撑。

本基金将严格按照契约规定,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,采取自下而上策略,力求超额收益。

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。

§5 投资组合报告

5.1 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(%)
1	权益投资	722,520,943.53	93.20
	其中:股票	722,520,943.53	93.20
2	固定收益投资	29,967,000.00	3.87
	其中:债券	29,967,000.00	3.87
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	18,822,973.19	2.43
7	其他各项资产	3,944,943.99	0.51
8	合计	775,255,860.71	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1积极投资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(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,635.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,635.00	0.00

5.2.2指数投资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(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	49,983,533.70	6.48
C	制造业	200,755,000.50	26.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,150,421.81	2.61
E	建筑业	25,551,085.97	3.31
F	批发和零售业	8,236,172.88	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	17,485,490.16	2.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,184,280.84	1.71
J	金融业	347,358,094.81	45.03
K	房地产业	29,352,372.81	3.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,054,408.61	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	5,392,446.44	0.70
	合计	722,503,308.53	93.65

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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(%)
1	600016	民生银行	5,590,684	42,824,639.44	5.55
2	600036	招商银行	3,885,551	38,156,110.82	4.95
3	601318	中国平安	983,877	36,954,420.12	4.79
4	600000	浦发银行	2,882,408	28,017,005.76	3.63
5	601166	兴业银行	2,819,910	26,845,543.20	3.48
6	000002	万 科A	2,301,927	18,622,589.43	2.41
7	600837	海通证券	1,882,610	17,395,316.40	2.25
8	000001	平安银行	1,498,682	16,140,805.14	2.09
9	000651	格力电器	573,834	16,067,352.00	2.08
10	600030	中信证券	1,522,568	16,032,641.04	2.08

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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(%)
1	002711	欧浦钢网	500.00	17,635.00	0.00

5.4 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(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,967,000.00	3.88
	其中:政策性金融债	29,967,000.00	3.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	29,967,000.00	3.88

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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(%)
1	130308	13进出08	300,000	29,967,000.00	3.88

5.6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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货,无相关投资政策。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货,无相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资,无相关投资评价。

5.11投资组合报告附注

2013年10月15日中国平安(601318)控股子公司平安证券有限责任公司收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》。该处罚决定书责令平安证券改正及给予警告,并没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐业务许可3个月。本基金管理人通过对该上市公司进行了进一步了解分析,认为该处罚并不直接针对上市公司主体(中国平安集团),其主营业务以保险为主,因此不会对其投资价值构成实质性影响,因此未披露处罚事宜;

2013年10月22日,民生银行(600016)受到银行间市场交易商协会诫勉谈话处分,该处分认为作为主承销商,民生银行在江苏汇鸿国际集团有限公司债务融资存续期间的尽职调查中未将中融信佳对外担保情况作为或有事项进行专项了解,亦未辅导企业在募集说明书中披露上述情况。因此根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予民生银行诫勉谈话处分,并处责令改正。本基金管理人通过对该上市公司进行了进一步了解分析,认为该处分不会对其投资价值构成实质性影响,因此未披露处罚事宜;

2013年11月13日,招商银行(600036)受到银行间市场交易商协会诫勉谈话处分,该处分认为作为主承销商,招商银行在林州重机集团股份有限公司债务融资存续期间,对后续管理工作中未充分尽职履责。根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予招商银行诫勉谈话处分,并处责令改正。本基金管理人通过对该上市公司进行了进一步了解分析,认为该处分不会对其投资价值构成实质性影响,因此未披露处罚事宜。

5.11.1本基金为指数投资基金,将继续执行完全复制投资策略持有该公司股票。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余七名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	193,598.50
2	应收证券清算款	2,833,245.60
3	应收股利	-
4	应收利息	850,857.29
5	应收申购款	67,242.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,944,943.99

5.11.4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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

5.11.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

本报告期期初基金份额总额	1,300,535,884.63
本报告期基金总申购份额	14,233,612.76
减:本报告期基金总赎回份额	90,010,771.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,224,758,725.71

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

§9备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《中银中证100 指数增强型证券投资基金基金合同》
2、《中银中证100 指数增强型证券投资基金招募说明书》
3、《中银中证100 指数增强型证券投资基金托管协议》
4、中国证监会要求的其他文件

9.2 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www.bocim.com。

9.3 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www.bocim.com 查阅。

中银基金管理有限公司
二〇一四年四月十九日