

中银保本二号混合型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30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：二〇一四年七月二十一日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中银基金管理有限公司依照《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及基金合同的规定，于2014年7月18日编制了本基金的财务报表、净值表现和投资组合报告等内容，并经会计师事务所审计，会计师事务所出具的审计报告与本报告中财务指标、净值表现和投资组合报告等内容存在差异，基金管理人不承担由此产生的任何责任，投资者应当以基金合同、基金招募说明书及基金定期报告等书面文件为准。
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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。
本报告期内基金管理人于2014年7月18日起每日披露基金份额净值。

1.2 基金产品概况

基金名称	中银保本二号混合型
基金代码	000190
交易代码	000190
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月10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
基金销售人	中银基金管理有限公司

1.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期 (2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期利润总额	7,402,246.60
2.本期利润	19,500,563.31
3.归属于母基金持有人本期利润	10,023.23
4.归属于母基金持有人本期基金份额持有人的本期利润	838,573.79
5.本期基金份额持有人本期基金份额持有人的本期利润	1,054.16

注：1.本期利润总额扣除基金管理人报酬、托管费、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。本期利润为本期利润总额扣除公允价值变动收益。
2.本报告期基金份额持有人本期利润为从关联交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平主要取决于列示项。
3.2.归属于母基金持有人本期利润及基金份额持有人本期利润的合计。
4.归属于母基金持有人本期利润为从关联交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平主要取决于列示项。
5.2.归属于母基金持有人本期利润及基金份额持有人本期利润的合计。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期利润总额	7,402,246.60
2.本期利润	19,500,563.31
3.归属于母基金持有人本期利润	10,023.23
4.归属于母基金持有人本期基金份额持有人的本期利润	838,573.79
5.本期基金份额持有人本期基金份额持有人的本期利润	1,054.16

注：1.本期利润总额扣除基金管理人报酬、托管费、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。本期利润为本期利润总额扣除公允价值变动收益。
2.本报告期基金份额持有人本期利润为从关联交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平主要取决于列示项。
3.2.归属于母基金持有人本期利润及基金份额持有人本期利润的合计。
4.归属于母基金持有人本期利润为从关联交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平主要取决于列示项。
5.2.归属于母基金持有人本期利润及基金份额持有人本期利润的合计。



注：截至报告期末，本基金成立以来，本基金在报告期内每个自然月内基金份额净值增长率超过业绩比较基准的月份数占报告期内总月份数的比例(即“达标率”)为60%。本基金在报告期内每个自然月内基金份额净值增长率超过业绩比较基准的月份数占报告期内总月份数的比例(即“达标率”)为60%。本基金在报告期内每个自然月内基金份额净值增长率超过业绩比较基准的月份数占报告期内总月份数的比例(即“达标率”)为60%。

4.1 基金投资组合报告

4.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	30,000,000.00	3.58
2	债券投资	133,776,000.00	15.96
3	基金投资	133,776,000.00	15.96
4	其他资产	581,922,329.23	69.37
5	其他负债	30,297,000.00	3.61
6	中债国债	120,788,000.00	14.41
7	可转债	41,454,701.70	4.94
8	其他	-	-
9	合计	937,500,000.00	111.87

4.1.2 报告期末按行业分类的基金资产组合情况

行业	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1 农林牧渔	289.37	0.00
2 采矿业	10,273.18	0.00
3 制造业	146,640.00	0.17
4 建筑业	120.70	0.00
5 金融业	2,473,660.00	0.29
6 房地产业	149,640.00	0.18
7 公用事业	423,900.00	0.27
8 交通运输	109,200.00	0.13
9 信息技术	59,608.00	0.01
10 其他	142,113.00	0.17

4.2 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	122266	13F国债	809,900	90,079,999.10	10.74
2	122273	13F国债	807,000	87,457,500.00	10.40
3	142020	14F国债	800,000	83,600,000.00	9.88
4	124258	13F国债	300,000	30,500,000.00	3.63
5	124258	14F国债	300,000	49,963,801.01	5.96

4.3 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债券投资明细

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中债国债	120,788,000.00	14.41
2	可转债	41,454,701.70	4.94

4.4 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权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	180022	18F国债	1,500.00	0.00
2	180013	18F国债	70,000.00	0.01
3	180227	18F国债	600,000.00	0.01
4	122800	13F国债	50,000.00	0.00
5	130018	13F国债	50,000.00	0.00

4.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	180022	18F国债	1,500.00	0.00
2	180013	18F国债	70,000.00	0.01
3	180227	18F国债	600,000.00	0.01
4	122800	13F国债	50,000.00	0.00
5	130018	13F国债	50,000.00	0.00

4.6 投资组合报告附注

4.6.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。
4.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。
4.6.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

4.7 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合

4.7.1 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合。
4.7.2 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合。
4.7.3 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合。

4.8 基金资产组合情况

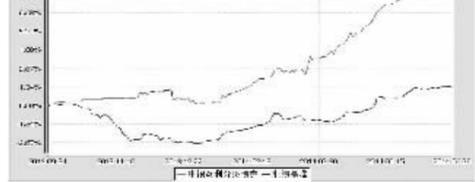
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	30,000,000.00	3.58
2	债券投资	133,776,000.00	15.96
3	基金投资	133,776,000.00	15.96
4	其他资产	581,922,329.23	69.37
5	其他负债	30,297,000.00	3.61
6	中债国债	120,788,000.00	14.41
7	可转债	41,454,701.70	4.94
8	其他	-	-
9	合计	937,500,000.00	111.87

4.9 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合

4.9.1 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合。
4.9.2 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合。
4.9.3 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合。

4.10 基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	30,000,000.00	3.58
2	债券投资	133,776,000.00	15.96
3	基金投资	133,776,000.00	15.96
4	其他资产	581,922,329.23	69.37
5	其他负债	30,297,000.00	3.61
6	中债国债	120,788,000.00	14.41
7	可转债	41,454,701.70	4.94
8	其他	-	-
9	合计	937,500,000.00	111.87



注：截至报告期末，本基金成立以来，本基金在报告期内每个自然月内基金份额净值增长率超过业绩比较基准的月份数占报告期内总月份数的比例(即“达标率”)为60%。本基金在报告期内每个自然月内基金份额净值增长率超过业绩比较基准的月份数占报告期内总月份数的比例(即“达标率”)为60%。本基金在报告期内每个自然月内基金份额净值增长率超过业绩比较基准的月份数占报告期内总月份数的比例(即“达标率”)为60%。

中银收益混合型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30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：二〇一四年七月二十一日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中银基金管理有限公司依照《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及基金合同的规定，于2014年7月18日编制了本基金的财务报表、净值表现和投资组合报告等内容，并经会计师事务所审计，会计师事务所出具的审计报告与本报告中财务指标、净值表现和投资组合报告等内容存在差异，基金管理人不承担由此产生的任何责任，投资者应当以基金合同、基金招募说明书及基金定期报告等书面文件为准。
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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。
本报告期内基金管理人于2014年7月18日起每日披露基金份额净值。

1.2 基金产品概况

基金名称	中银收益混合
基金代码	163804
交易代码	163804
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月11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
基金销售人	中银基金管理有限公司

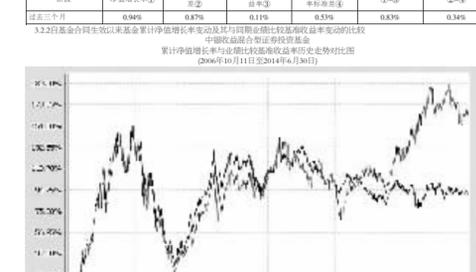
1.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期 (2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期利润总额	-26,706,972.85
2.本期利润	36,724,384.90
3.归属于母基金持有人本期利润	4,078,347.99
4.归属于母基金持有人本期基金份额持有人的本期利润	1,119.93

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期利润总额	-26,706,972.85
2.本期利润	36,724,384.90
3.归属于母基金持有人本期利润	4,078,347.99
4.归属于母基金持有人本期基金份额持有人的本期利润	1,119.93

注：1.本期利润总额扣除基金管理人报酬、托管费、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。本期利润为本期利润总额扣除公允价值变动收益。
2.本报告期基金份额持有人本期利润为从关联交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平主要取决于列示项。
3.2.归属于母基金持有人本期利润及基金份额持有人本期利润的合计。
4.归属于母基金持有人本期利润为从关联交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平主要取决于列示项。
5.2.归属于母基金持有人本期利润及基金份额持有人本期利润的合计。



注：截至报告期末，本基金成立以来，本基金在报告期内每个自然月内基金份额净值增长率超过业绩比较基准的月份数占报告期内总月份数的比例(即“达标率”)为60%。本基金在报告期内每个自然月内基金份额净值增长率超过业绩比较基准的月份数占报告期内总月份数的比例(即“达标率”)为60%。本基金在报告期内每个自然月内基金份额净值增长率超过业绩比较基准的月份数占报告期内总月份数的比例(即“达标率”)为60%。

4.1 基金投资组合报告

4.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	30,000,000.00	3.58
2	债券投资	133,776,000.00	15.96
3	基金投资	133,776,000.00	15.96
4	其他资产	581,922,329.23	69.37
5	其他负债	30,297,000.00	3.61
6	中债国债	120,788,000.00	14.41
7	可转债	41,454,701.70	4.94
8	其他	-	-
9	合计	937,500,000.00	111.87

4.1.2 报告期末按行业分类的基金资产组合情况

行业	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1 农林牧渔	289.37	0.00
2 采矿业	10,273.18	0.00
3 制造业	146,640.00	0.17
4 建筑业	120.70	0.00
5 金融业	2,473,660.00	0.29
6 房地产业	149,640.00	0.18
7 公用事业	423,900.00	0.27
8 交通运输	109,200.00	0.13
9 信息技术	59,608.00	0.01
10 其他	142,113.00	0.17

4.2 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	122266	13F国债	809,900	90,079,999.10	10.74
2	122273	13F国债	807,000	87,457,500.00	10.40
3	142020	14F国债	800,000	83,600,000.00	9.88
4	124258	13F国债	300,000	30,500,000.00	3.63
5	124258	14F国债	300,000	49,963,801.01	5.96

4.3 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债券投资明细

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	中债国债	120,788,000.00	14.41
2	可转债	41,454,701.70	4.94

4.4 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权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	180022	18F国债	1,500.00	0.00
2	180013	18F国债	70,000.00	0.01
3	180227	18F国债	600,000.00	0.01
4	122800	13F国债	50,000.00	0.00
5	130018	13F国债	50,000.00	0.00

4.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	180022	18F国债	1,500.00	0.00
2	180013	18F国债	70,000.00	0.01
3	180227	18F国债	600,000.00	0.01
4	122800	13F国债	50,000.00	0.00
5	130018	13F国债	50,000.00	0.00

4.6 投资组合报告附注

4.6.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。
4.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。
4.6.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

4.7 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合

4.7.1 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合。
4.7.2 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合。
4.7.3 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合。

4.8 基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	30,000,000.00	3.58
2	债券投资	133,776,000.00	15.96
3	基金投资	133,776,000.00	15.96
4	其他资产	581,922,329.23	69.37
5	其他负债	30,297,000.00	3.61
6	中债国债	120,788,000.00	14.41
7	可转债	41,454,701.70	4.94
8	其他	-	-
9	合计	937,500,000.00	111.87

4.9 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合

4.9.1 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合。
4.9.2 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合。
4.9.3 基金管理人运用基金资产进行场外交易的投资组合。

4.10 基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	30,000,000.00	3.58
2	债券投资	133,776,000.00	15.96
3	基金投资	133,776,000.00	15.96
4	其他资产	581,922,329.23	69.37
5	其他负债	30,297,000.00	3.61
6	中债国债	120,788,000.00	14.41
7	可转债	41,454,701.70	4.94
8	其他	-	-
9	合计	937,500,000.00	111.87



注：截至报告期末，本基金成立以来，本基金在报告期内每个自然月内基金份额净值增长率超过业绩比较基准的月份数占报告期内总月份数的比例(即“达标率”)为60%。本基金在报告期内每个自然月内基金份额净值增长率超过业绩比较基准的月份数占报告期内总月份数的比例(即“达标率”)为60%。本基金在报告期内每个自然月内基金份额净值增长率超过业绩比较基准的月份数占报告期内总月份数的比例(即“达标率”)为60%。

4.1 基金投资组合报告

4.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	2,567,297,947.28	66.92
2	债券投资	2,567,297,947.28	66.92
3	基金投资	390,912,640.00	9.45
4	其他资产	390,912,640.00	9.45
5	其他负债	-	-
6	中债国债	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,135,407,231.29	100.00

4.1.2 报告期末按行业分类的基金资产组合情况

行业	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔	-	-
B 采矿业	-	-
C 制造业	1,201,432,834.94	31.91
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	431,279,929.20	10.57
F 批发和零售业	195,421,467.10	4.79
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 金融业	479,874,838.48	11.77
J 房地产业	2,063,359.59	0.05
K 信息传输、软件和信息技术服务业	281,216,926.42	6.50
L 租赁和商务服务业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 科学研究和技术服务业	-	-
O 教育	-	-
P 卫生和社公事业	56,015,598.26	1.37
Q 其他	98,668,682.00	2.41
合计	2,567,297,947.28	67.85

4.2 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