中银消费主题股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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：二〇一四年十月二十五日

§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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中银消费主题股票
基金主代码	000057
交易代码	000057
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月25日
报告期末基金份额总额	56,114,911.64份
投资目标	本基金重点投资于大消费行业中的优质上市公司，在合理控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，并进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。本基金是以大消费行业为主要投资标的的主题基金，将分别从政策影响和行业特征两个方面对大消费行业的各个子行业进行分析，在行业配置的基础上，通过定性和定量分析相结合的办法，挑选出受惠于经济转型和消费升级的优质上市公司进行投资。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。
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较高预期风险和较高预期收益品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2014年7月1日-2014年9月30日）
1.本期已实现收益	1,931,119.92
2.本期利润	6,010,554.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0943
4.期末基金资产净值	66,880,154.20
5.期末基金份额净值	1.192

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	8.66%	0.78%	8.18%	0.70%	0.48%	0.08%

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

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（三）的规定，即本基金投资组合中股票资产占基金资产的60%-95%，其中投资于本基金定义的大消费行业的股票不低于股票资产的80%，权证投资占基金资产净值的0%-3%，现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%，其中，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

§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、中银监尊基金基金经理、中银优秀企业基金基金经理、公司权益投资部副总经理	2013-04-25	-	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。曾任武汉证券公司乌鲁经理。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月至今任中银监尊基金基金经理，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，美国与其它主要经济体的增速进一步分化。三季度欧元区经济复苏态势进一步放缓，美国仍是全球复苏前景最好的经济体，美联储稳步退出超宽松货币政策，国际资本流出新兴经济体的压力继续。

国内经济方面，在前期政策微刺激与房地产市场下滑的双重力量作用下，三季度经济反弹后下滑。具体来看，领先指标制造业PMI指数先升后降，同步指标工业增加值同比增速自6-7月份9.0%之上的水平迅速滑落至8月份6.9%。从经济增长动力来看，拉动经济的三驾马车滚跌不一：出口增速在较低水平继续缓慢回升，消费增速基本保持平稳，而固定资产投资增速全面下行。通胀方面，CPI同比增速仍在低位水平震荡，PPI保持通缩水平。

2.行情回顾

尽管三季度经济表现不佳，但国内股市却展开了一轮显著上涨的行情。从7月下旬开始，上证指数走出单边上涨行情，三季度累计上涨15.4%，是近几年来表现最好的一个季度。同时创业板指数同期也上涨9.6%，主题投资活跃。行业方面，国防军工、农业、交通运输等行业涨幅靠前，银行和石油石化表现较弱。政府稳增长、地产放松、资金面和市场对改革的乐观预期等因素共同推动了本轮行情的产生。

3.运行分析

本基金在三季度增加了政策稳增长投资机会的配置，在此基础上，四季度继续根据市场变化，积极提高仓位和调整结构，投资符合未来政策鼓励和经济转型方向的公司。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年09月30日为止，本基金的单位净值为1.192元，本基金的累计单位净值为1.192元。季度内本基金份额净值增长率为8.66%，同期业绩比较基准收益率为8.18%。

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，美国经济有望继续复苏，欧元区复苏愈发艰难，而国内经济四季度加速回落的压力不大。国务院提出保持宏观政策的连续性稳定性，着力稳增长、促发展，保持经济中高速增长。央行继续实施稳健的货币政策，保持适度流动性。经济有望企稳和利率逐步下行的组合有利于股市的行情表现。

四季度国内股市即将迎来“沪港通”的开通，四中全会也将召开。中长期角度看，经济转型和改革的实施为中国股市带来新的希望。短期市场可能有所震荡，但我们仍将以积极的心态寻找未来的投资机会。

基金将继续布局服务消费、节能环保、新能源和移动互联网方向的投资机会，并结合基本面选择业绩良好、估值合理的优质股票，同时关注改革推进带来的投资机会。

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	54,412,294.37	80.89
	其中：股票	54,412,294.37	80.89
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	12,667,597.37	18.83
7	其他各项资产	190,045.31	0.28
8	合计	67,269,937.05	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	1,243,690.00	1.86
B	采矿业	1,875,944.18	2.80
C	制造业	31,344,916.31	46.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	659,293.00	0.99
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,685,054.50	5.51
G	交通运输、仓储和邮政业	686,565.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,453,403.47	8.15
J	金融业	2,097,264.00	3.14
K	房地产业	851,697.00	1.27
L	租赁和商务服务业	3,598,291.24	5.38
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	2,916,175.67	4.36
S	综合	-	-
	合计	54,412,294.37	81.36

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	180,720	3,502,353.60	5.24
2	300003	乐普医疗	143,688	3,376,668.00	5.05
3	600998	九州通	172,910	2,930,824.50	4.38
4	000513	丽珠集团	55,200	2,913,456.00	4.36
5	600332	白云山	104,070	2,899,390.20	4.34
6	002241	歌尔声学	75,715	2,085,948.25	3.12
7	002400	省广股份	80,616	2,026,686.24	3.03
8	600518	康美药业	123,100	1,972,062.00	2.95
9	300157	恒泰艾普	104,626	1,875,944.18	2.80
10	601888	中国国旅	41,500	1,571,605.00	2.35

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本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

本基金本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	23,895.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,230.89
5	应收申购款	163,919.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	190,045.31

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	300315	掌趣科技	3,502,353.60	5.24	重大事项停牌
2	000513	丽珠集团	2,913,456.00	4.36	重大事项停牌
3	300157	恒泰艾普	1,875,944.18	2.80	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

单位：份

本报告期期初基金份额总额	72,094,361.43
本报告期基金总申购份额	28,287,839.62
减：本报告期基金总赎回份额	44,267,289.41
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	56,114,911.64

§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，本公司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、《中银消费主题股票型证券投资基金基金合同》

2、《中银消费主题股票型证券投资基金招募说明书》

3、《中银消费主题股票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

二〇一四年十月二十五日

中银美丽中国股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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：中国民生银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年十月二十五日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中银美丽中国股票
基金主代码	000120
交易代码	000120
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月7日
报告期末基金份额总额	272,398,033.13份
投资目标	本基金主要投资于美丽中国主题相关的上市公司股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行大类资产配置。其次，基于自上而下的投资主题框架，综合运用定量和定性的分析方法，针对经济转型过程中直接从事生态文明建设的行业，以及投资或受益于美丽中国发展的行业进行跟踪分析，不断发掘投资机会，精选出受惠于美丽中国发展的优质上市公司进行投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。
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较高预期风险和较高预期收益品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、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	中国民生银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2014年7月1日-2014年9月30日）
1.本期已实现收益	7,976,672.67
2.本期利润	31,453,678.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0971
4.期末基金资产净值	297,853,222.16
5.期末基金份额净值	1.093

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	10.07%	0.77%	10.63%	0.72%	-0.56%	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

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60%-95%，其中投资于本基金定义的美丽中国主题相关的股票不低于基金非现金资产的80%，权证投资占基金资产净值的0%-3%，债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%，其中，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

§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、中银收益基金基金经理、中银中国基金基金经理、助理执行总裁	2013-06-07	-	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，美国与其它主要经济体的增速进一步分化。三季度欧元区经济复苏态势进一步放缓，美国仍是全球复苏前景最好的经济体，美联储稳步退出超宽松货币政策，国际资本流出新兴经济体的压力继续。

国内经济方面，在前期政策微刺激与房地产市场下滑的双重力量作用下，三季度经济反弹后下滑。具体来看，领先指标制造业PMI指数先升后降，同步指标工业增加值同比增速自6-7月份9.0%之上的水平迅速滑落至8月份6.9%。从经济增长动力来看，拉动经济的三驾马车滚跌不一：出口增速在较低水平继续缓慢回升，消费增速基本保持平稳，而固定资产投资增速全面下行。通胀方面，CPI同比增速仍在低位水平震荡，PPI保持通缩水平。

2.行情回顾

尽管三季度经济表现不佳，但国内股市却展开了一轮显著上涨的行情。从7月下旬开始，上证指数走出单边上涨行情，三季度累计上涨15.4%，是近几年来表现最好的一个季度。同时创业板指数同期也上涨9.6%，主题投资活跃。行业方面，国防军工、农业、交通运输等行业涨幅靠前，银行和石油石化表现较弱。政府稳增长、地产放松、资金面和市场对改革的乐观预期等因素共同推动了本轮行情的产生。

3.运行分析

报告期内，基金根据市场变化适时提高了仓位和采取了更积极的投资策略。在对成长股的超配基础上，一方面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，同时积极增加了符合未来政策鼓励和经济转型方向的配置。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年09月30日为止，本基金的单位净值为1.093元，本基金的累计单位净值为1.128元。季度内本基金份额净值增长率为10.07%，同期业绩比较基准收益率为10.63%。

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，美国经济有望继续复苏，欧元区复苏愈发艰难，而国内经济四季度加速回落的压力不大。国务院提出保持宏观政策的连续性稳定性，着力稳增长、促发展，保持经济中高速增长。央行继续实施稳健的货币政策，保持适度流动性。经济有望企稳和利率逐步下行的组合有利于股市的行情表现。

四季度国内股市即将迎来“沪港通”的开通，四中全会也将召开。中长期角度看，我们认为中国正走在正确的道路上，这也必将为中国股市带来新的希望。三中全会布局的各方面改革正在积极推进，未来会给经济基本面带来积极的影响。尽管向上的道路不会一帆风顺，我们仍将以积极的心态寻找未来的投资机会。

针对目前和未来的形势判断，本基金会采取相对积极的投资策略，注重结构配置和行业个股选择。具体重点关注以下几个领域的投资机会：1）大消费行业中的医药、食品饮料；2）信息消费领域的消费电子、计算机软件、传媒等；3）移动互联网带来的投资机会；4）改革利空带来的机会。

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	252,444,250.44	84.23
	其中：股票	252,444,250.44	84.23
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	43,041,084.93	14.36
7	其他各项资产	4,213,780.56	1.41
8	合计	299,699,115.93	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	8,240,195.00	2.77
B	采矿业	-	-
C	制造业	120,048,028.02	40.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,118,017.17	4.74
F	批发和零售业	13,756,170.11	4.62
G	交通运输、仓储和邮政业	7,846,253.04	2.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,533,519.86	13.94
J	金融业	23,638,677.00	7.94
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,167,209.24	6.77
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	3,096,181.00	1.04
S	综合	-	-
	合计	252,444,250.44	84.75

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	572,371	11,092,549.98	3.72
2	002400	省广股份	425,206	10,689,678.84	3.59
3	300170	汉得信息	684,141	10,207,383.72	3.43
4	300339	润和软件	340,326	8,698,732.56	2.92
5	300224	正海磁材	296,580	8,609,717.40	2.89
6	300003	乐普医疗	342,800	8,055,800.00	2.70
7	002089	新海宜	610,322	7,848,740.92	2.64
8	002245	澳洋顺昌	715,899	7,846,253.04	2.63
9	600305	恒顺醋业	457,556	7,696,091.92	2.58
10	603288	海天味业	203,036	7,621,971.44	2.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本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

本基金本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	194,343.25
2	应收证券清算款	3,589,389.20
3	应收股利	-
4	应收利息	8,275.18
5	应收申购款	341,114.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	80,658.24
8	其他	-
9	合计	4,213,780.56

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	300315	掌趣科技	11,092,549.98	3.72	重大事项停牌
2	300224	正海磁材	8,609,717.40	2.89	重大事项停牌

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

单位：份

本报告期期初基金份额总额	298,482,858.31
本报告期基金总申购份额	73,343,469.85
减：本报告期基金总赎回份额	99,428,295.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	272,398,033.13

§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、《中银美丽中国股票型证券投资基金基金合同》

2、《中银美丽中国股票型证券投资基金招募说明书》

3、《中银美丽中国股票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

二〇一四年十月二十五日

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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：二〇一四年十月二十五日

§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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中银标普全球资源等权重指数（QDII）
基金主代码	000049
交易代码	000049
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月19日
报告期末基金份额总额	22,086,331.53份
投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以低成本、低换手率实现对标普全球精选自然资源等权重指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。本基金控制目标为基金净值收益率与标的指数收益率之间的年化跟踪误差不超过5%