中银中国精选混合型开放式证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12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：二〇一六年一月二十二日

§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2016年1月20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，投资者在做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2015年10月1日起至12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	990,968,004.27份
投资目标	基金管理人致力于研究全球经济和行业发展的趋势，紧随中国经济独特的发展节奏，挖掘中国主题，努力为投资者实现基金资产中、长期资本增值的目标，追求稳定的、优于业绩基准的回报。
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	本基金股票投资部分的业绩比较基准为：沪深300指数；债券投资部分的业绩比较基准为：中证国债指数。本基金的整体业绩基准=沪深300指数×70%+中证国债指数×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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2015年10月1日-2015年12月31日）
1.本期已实现收益	35,454,512.74
2.本期利润	268,275,993.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.2654
4.期末基金资产净值	1,676,866,588.49
5.期末基金份额净值	1.6922

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。

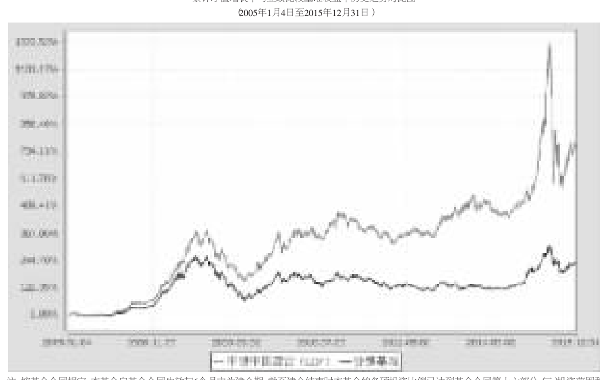
3.2 基金净值表现

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	18.35%	1.69%	12.14%	1.17%	6.21%	0.52%

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2015年12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、中银收益基金基金经理、中银美丽中国股票基金基金经理、副执行总裁	2013-08-23	-	17	中银基金管理有限公司副执行总裁，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17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办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》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，全球经济步入较为稳定但缓慢的复苏通道，美国仍是表现相对较好的经济体，美联储2015年末重启加息之后，美元指数处于95-100左右的区间窄幅波动。

国内经济方面，在前期政策刺激及国际大宗商品价格下行的内外因素影响下，经济领先指标有所震荡企稳，但下行压力并未消除。从经济增长动力来看，拉动经济的三驾马车以下滑为主：消费增速小幅回升至10.67%，但出口增速继续下滑至-7.1%左右，而固定资产投资增速全面下行至10.2%的低位水平。通胀方面，CPI通缩预期有所修正，小幅上行于1.5%左右的水平，PPI环比跌幅有所加大，同比跌幅继续扩大至-5.9%左右。

2.行情回顾

在汇率逐步稳定及央行降准降息的提振下，四季度国内股市出现了反弹。上证指数上涨15.93%，创业板指数更是大幅上涨30.3%。整体来看，中小市值和新兴产业股票涨幅更大。

3.运行分析

报告期内，基于对市场的回暖预期，基金在四季度整体采取较高的仓位和积极配置成长股的投资策略，使基金净值取得了一定的反弹。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日为止，本基金的单位净值为1.6922元，本基金的累计单位净值为4.2322元。季度内本基金净值增长率为18.35%，绩基准增长率为12.14%。

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，全球经济有望在美国经济的拉动下维持缓慢复苏的态势，但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，新兴市场金融体系稳定性面临考验。中央经济工作会议强调，2016年及今后一个时期，要在适度扩大总需求的同时，着力加强供给侧结构性改革。预计2016年一季度财政政策力度将有所增大，货币政策继续稳健操作，宏观调控更加注重引导经济增速平稳放缓，产业结构进一步提质、增效、升级。

经历过2015年的大幅波动以后，我们认为A股市场仍然是面临机遇与挑战的环境。经济上要经历供给侧改革和去产能的阵痛，美联储进入加息通道也给汇率上带来一定压力。流动性预计仍将宽松，但相比2015年改善可能有限。股市在资产荒的时代仍占据重要地位，但同时也需看到注册制加速推进下的供给"容压力。因此全年来看，我们认为市场指数可能空间有限，局部存在机会，需要有一个相对理性的收益率预期。

我们维持对中国股市短期谨慎，中长期相对乐观的看法，在未来一个季度我们仍将控制总体仓位，继续看好医疗、教育、军工等刚需强劲的行业，密切关注周期行业产能缩减带来的投资机会，同时加大研究力度，精选个股，分享优秀上市公司的成长和股东回报。

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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	1,231,280,826.48	73.12
	其中：股票	1,231,280,826.48	73.12
2	固定收益投资	140,871,150.00	8.37
	其中：债券	140,871,150.00	8.37
	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	200,000,000.00	11.88
	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	97,433,391.12	5.79
7	其他各项资产	14,447,458.60	0.86
8	合计	1,684,032,826.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	528,651,866.77	31.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,099,194.40	0.54
E	建筑业	179,061,810.56	10.68
F	批发和零售业	18,931,660.56	1.13
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	273,207,164.48	16.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	35,004,576.00	2.09
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	39,239,280.10	2.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,409,256.00	0.62
Q	卫生和社会工作	69,771,011.88	4.16
R	文化、体育和娱乐业	55,314,944.73	3.30
S	综合	12,590,061.00	0.75
	合计	1,231,280,826.48	73.43

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	002421	达实智能	6,485,202	142,025,923.80	8.47
2	300003	乐普医疗	2,979,424	115,005,766.40	6.86
3	002325	洪涛股份	5,871,171	91,766,402.73	5.47
4	300244	迪安诊断	1,003,322	69,771,011.88	4.16
5	002659	中泰桥梁	2,848,962	66,523,262.70	3.97
6	600271	航天信息	761,200	54,395,352.00	3.24
7	300170	汉得信息	2,559,332	50,802,740.20	3.03
8	300182	捷成股份	2,054,033	49,296,792.00	2.94
9	002539	新都化工	3,024,705	48,395,280.00	2.89
10	600055	华润万东	924,078	39,106,980.96	2.33

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	140,226,000.00	8.36
	其中：政策性金融债	140,226,000.00	8.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	645,150.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	140,871,150.00	8.40

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	150403	15农发03	800,000	80,160,000.00	4.78
2	150413	15农发13	600,000	60,066,000.00	3.58
3	132002	15天集EB	5,610	645,150.00	0.04

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	473,755.44
2	应收证券清算款	10,042,008.39
3	应收股利	-
4	应收利息	3,521,486.05
5	应收申购款	410,208.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,447,458.60

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债。

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	600271	航天信息	54,395,352.00	3.24	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	1,022,219,957.77
本报告期基金总申购份额	46,722,194.99
减：本报告期基金总赎回份额	77,974,148.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	990,968,004.27

§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 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，经与托管行协商一致，本基金管理人决定变更本基金的业绩比较基准，相关事项已向中国证监会备案，具体可详见本基金管理人于2015年10月8日发布的《关于变更中银中国精选混合型开放式证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 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

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
二〇一六年一月二十二日

中银中小盘成长混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12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：二〇一六年一月二十二日

§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2016年1月20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，投资者在做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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中银中小盘成长混合
基金主代码	163818
交易代码	163818
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月23日
报告期末基金份额总额	31,314,010.14份
投资目标	通过对具备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，力图实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济因素、政策导向因素、市场环境因素等，对证券市场系统性风险程度和中长期预期收益率进行动态监控，在投资范围内确定相应的大类资产配置比例；其次通过股票筛选建立基础股票池，在基础股票池的基础上，结合衡量股票成长性的定性和定量指标，精选具有良好基本面和成长潜力的中小盘股票进行投资。
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准为：中证700指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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（2015年10月1日-2015年12月31日）
1.本期已实现收益	8,373,230.86
2.本期利润	14,459,356.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.4635
4.期末基金资产净值	57,444,735.26
5.期末基金份额净值	1.834

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。

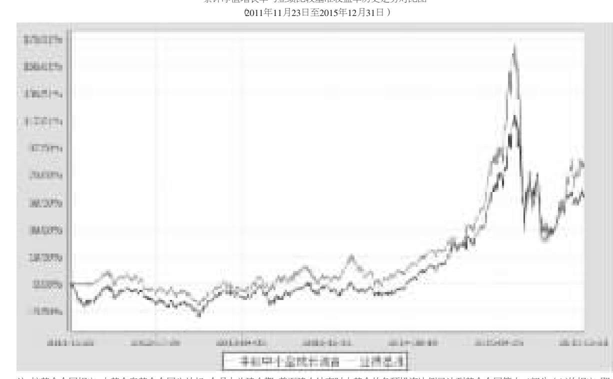
3.2 基金净值表现

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	33.77%	2.33%	18.26%	1.61%	15.51%	0.72%

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

中银中小盘成长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
（2011年11月23日至2015年12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60%-95%，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本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%。本基金将不低于80%的股票资产投资于中小盘股票。

§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		
王伟	本基金的基金经理、中银美丽中国基金基金经理、中银优选基金基金经理、中银智能制造基金基金经理	2015-03-23	-	5	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），工学硕士。2010年加入中银基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理。2015年2月至今任中银美丽中国股票基金基金经理，2015年3月至今任中银中小盘基金基金经理，2015年5月至今任中银优选基金基金经理，2015年6月至今任中银智能制造基金基金经理。具有5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办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》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，全球经济步入较为稳定但缓慢的复苏通道，美国仍是表现相对较好的经济体，美联储2015年末重启加息之后，美元指数处于95-100左右的区间窄幅波动。

国内经济方面，在前期政策刺激及国际大宗商品价格下行的内外因素影响下，经济领先指标有所震荡企稳，但下行压力并未消除。从经济增长动力来看，拉动经济的三驾马车以下滑为主：消费增速小幅回升至10.67%，但出口增速继续下滑至-7.1%左右，而固定资产投资增速全面下行至10.2%的低位水平。通胀方面，CPI通缩预期有所修正，小幅上行于1.5%左右的水平，PPI环比跌幅有所加大，同比跌幅继续扩大至-5.9%左右。

2.行情回顾

在汇率逐步稳定及央行降准降息的提振下，四季度国内股市出现了反弹。上证指数上涨15.93%，创业板指数更是大幅上涨30.3%。整体来看，中小市值和新兴产业股票涨幅更大。

3.运行分析

报告期内，基于对市场的回暖预期，基金在四季度整体采取较高的仓位和积极配置成长股的投资策略，使基金净值取得了一定的反弹。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日为止，本基金的单位净值为1.834元，本基金的累计单位净值为1.834元。季度内本基金份额净值增长率为33.77%，同期业绩比较基准收益率为18.26%。

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，全球经济有望在美国经济的拉动下维持缓慢复苏的态势，但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，新兴市场金融体系稳定性面临考验。中央经济工作会议强调，2016年及今后一个时期，要在适度扩大总需求的同时，着力加强供给侧结构性改革。预计2016年一季度财政政策力度将有所增大，货币政策继续稳健操作，宏观调控更加注重引导经济增速平稳放缓，产业结构进一步提质、增效、升级。

经历过2015年的大幅波动以后，我们认为A股市场仍然是面临机遇与挑战的环境。经济上要经历供给侧改革和去产能的阵痛，美联储进入加息通道也给汇率上带来一定压力。流动性预计仍将宽松，但相比2015年改善可能有限。股市在资产荒的时代仍占据重要地位，但同时也需看到注册制加速推进下的供给"容压力。因此全年来看，我们认为市场指数可能空间有限，局部存在机会，但需要有一个相对理性的收益率预期。

我们维持对中长期中国股市相对乐观的看法，在未来一个季度我们将以相对积极但审慎的思路去寻找机会，继续加大对中小市值股票的研究力度，精选个股，分享有潜力的上市公司的成长和股东回报。

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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	51,573,049.68	88.88
	其中：股票	51,573,049.68	88.88
2	固定收益投资	205,147.20	0.35
	其中：债券	205,147.20	0.35
	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	6,172,351.99	10.64
7	其他各项资产	75,009.57	0.13
8	合计	58,025,558.44	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	20,075,190.27	34.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	823,674.15	1.43
F	批发和零售业	3,416,998.00	5.95
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	562,210.00	0.98
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,551,244.92	14.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,274,605.86	3.96
L	租赁和商务服务业	2,264,470.48	3.94
M	科学研究和技术服务业	1,513,726.20	2.64
N	水利、环境和公共设施管理业	1,865,457.00	3.25
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	10,225,472.80	17.80
S	综合	-	-
	合计	51,573,049.68	89.78

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	002292	奥飞动漫	43,500	2,249,385.00	3.92
2	300364	中文在线	12,200	2,171,600.00	3.78
3	600682	南京新百	64,200	2,117,316.00	3.69
4	002329	皇氏集团	74,600	2,081,340.00	3.62
5	300310	宜通世纪	31,600	1,969,628.00	3.43
6	600593	大连圣亚	36,300	1,865,457.00	3.25
7	601599	鹿港科技	65,776	1,628,613.76	2.84
8	603268	松发股份	23,600	1,620,848.00	2.82
9	300008	上海佳豪	56,907	1,513,726.20	2.64
10	300113	顺网科技	14,700	1,490,139.00	2.59

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	205,147.20	0.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	205,147.20	0.36

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	110031	航信转债	1,580	205,147.20	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	58,848.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,839.93
5	应收申购款	14,320.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,009.57

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	110031	航信转债	205,147.20	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

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	600682	南京新百	2,117,316.00	3.69	重大事项

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	32,283,675.11
本报告期基金总申购份额	3,019,630.84
减：本报告期基金总赎回份额	3,989,295.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	31,314,010.14

§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、《中银中小盘成长混合型证券投资基金基金合同》
2、《中银中小盘成长混合型证券投资基金招募说明书》
3、《中银中小盘成长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
二〇一六年一月二十二日

中银中证100指数增强型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12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：二〇一六年一月二十二日

§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2016年1月20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，投资者在做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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中银中证100指数增强
场内简称	中银100
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	305,058,642.93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控制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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2015年10月1日-2015年12月31日）
1.本期已实现收益	5,549,832.32
2.本期利润	40,238,490.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.1277
4.期末基金资产净值	316,832,915.19
5.期末基金份额净值	1.039

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。

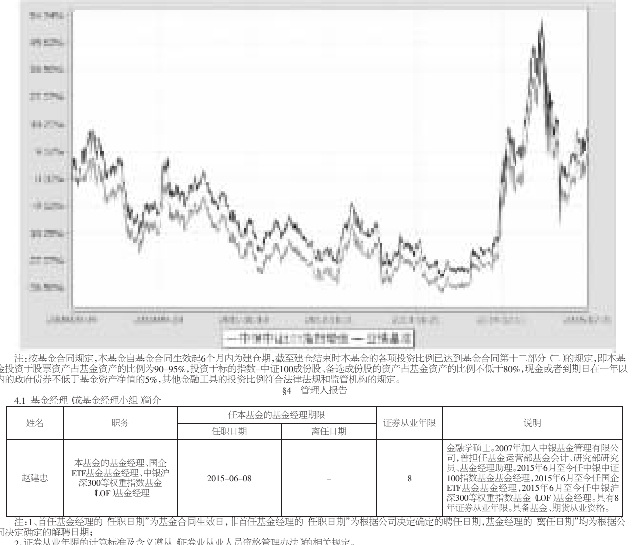
3.2 基金净值表现

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	13.68%	1.51%	12.86%	1.43%	0.82%	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

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2015年12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		
赵建忠	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	2015-06-08	-	8	金融学硕士。2007年加入中银基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金会计、研究部研究员、基金经理助理。2015年6月至今任中银中证100指数基金基金经理，2015年6月至今任国企ETF基金基金经理，2015年6月至今任中银沪深300等权重指数基金（LOF）基金经理。具有8年证券从业年限。具备基金、期货从业资格。

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办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》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，全球经济步入较为稳定但缓慢的复苏通道，美国仍是表现相对较好的经济体。从领先指标来看，四季度美国ISM制造业PMI指数缓慢回落至48.6水平，就业市场持续改善，失业率降至5.0%水平。四季度欧元区经济保持弱势复苏态势，制造业PMI指数稳步在53.1，CPI同比增速小幅回升至0.2%左右。美国仍是全球复苏前景最好的经济体，美联储2015年末重启加息之后，美元指数处于95-100左右的区间窄幅波动。

国内经济方面，在前期政策刺激及国际大宗商品价格下行的内外因素影响下，经济领先指标有所震荡企稳，但下行压力并未消除。具体来看，领先指标制造业PMI缓慢下行至49.7的荣枯线以下，同步指标工业增加值同比增速1-11月累计增速6.1%，创下2009年以来新低水平。从经济增长动力来看，拉动经济的三驾马车以下滑为主：消费增速小幅回升至10.67%，但出口增速继续下滑至-7.1%左右，而固定资产投资增速全面下行至10.2%的低位水平。通胀方面，CPI通缩预期有所修正，小幅上行于1.5%左右的水平，PPI环比跌幅有所加大，同比跌幅继续扩大至-5.9%左右。

展望未来，全球经济有望在美国经济的拉动下维持缓慢复苏的态势，但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，新兴市场金融体系稳定性面临考验。鉴于对当前经济和通胀增速的判断，经济增速下滑压力仍未消退，但财政政策、信贷投放、房地产政策放松有望继续，加之货币政策稳健配置，或将对未来一个季度经济企稳形成一定支撑。中央经济工作会议指出，2016年是全面建成小康社会决胜阶段的开局之年，也是推进结构性改革的攻坚之年。会议强调，2016年及今后一个时期，要在适度扩大总需求的同时，着力加强供给侧结构性改革，实施相互配合的政策支柱。宏观政策要稳，就是要为结构性改革营造稳定的宏观经济环境。积极的财政政策要加大力度，实行减税政策，阶段性提高财政赤字率。预计2016年一季度财政政策力度将有所增大，货币政策继续稳健操作，宏观调控更加注重引导经济增速平稳放缓，产业结构进一步提质、增效、升级。公开市场方面，在近期经济下行压力未减的情况下，预计货币政策维持中性偏松基调，公开市场方面也更加注重维护流动性环境平稳。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，商业银行风险偏好及实体企业融资需求匹配度下降，预计表外融资自发扩张的动力依然有限，而表内信贷投放或将在政策鼓励下继续扩张，社会融资总量大概率上仍将维持较为平稳的适度增长。

2、行情回顾

在经历了二季度的大跌后，市场从9月开始有了较高涨幅，不少个股更是创出新高。反弹依次以TMT为代表的成长股到以地产、餐饮等为代表的消费类，且各类概念穿插其间，如并购重组、高送转、锂电池、虚拟现实、险资举牌等，四季度上证指数上涨15.93%，沪深300上涨16.49%，中证100上涨14.27%。分行业来看，蓝筹与小盘股皆取得不错的涨幅，电子、房地产、计算机分别上涨41.01%、39.77%、39.31%，涨幅较小的三个行业是钢铁、交运、军工，分别上涨为5.46%、5.83%、10.62%。

3、运行分析

本报告期本基金为正常运作期，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2015年12月31日为止，本基金的单位净值为1.039元，本基金的累计单位净值为1.049元。季度内本基金份额净值增长率为13.68%，同期业绩比较基准收益率为12.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望一季度，从基本面看，11月和12月份的一些经济指标回升，经济有企稳迹象，但PMI指数还在荣枯线以下，经济的困境并未结束。从资金面来看，资产荒在可预见的时间里仍然会持续，具有目标收益率要求的金融机构将继续加配权益类资产，流动性充足的企业部门也会继续增加股票投资，住户部门的资产在提升直接融资比例的时代背景下也会向权益类资产迁移。政策面看，2016年的重中之重应该在供给侧改革，供需错位已然成为中国经济持续增长的最大障碍，过去侧重总需求管理的宏观调控手段的可用空间已经显著收窄。从长期看，经济增长取决于长期潜在增长率也就是资本、劳动力和技术进步，必须通过改革、经济结构调整和科技进步，来提高潜在增长率，也就是改善供给侧。但地方政府债务风险、信用风险、IPO 或者注册制、地缘政治、汇率风险等等，任何一个风险点的预期放大都可能导致市场的较大波动。当前整体估值相对偏低，股息率较高的蓝筹股在大类资产配置中仍具一定吸引力。

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。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	289,441,741.84	91.07
	其中：股票	289,441,741.84	91.07
2	固定收益投资	10,029,000.00	3.16
	其中：债券	10,029,000.00	3.16
	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	-	-
	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	18,033,400.26	5.67
7	其他各项资产	313,228.06	0.10
8	合计	317,817,370.16	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	10,635.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,353,535.00	0.43
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	1,364,170.00	0.43

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	8,835,330.29	2.79
C	制造业	75,191,803.73	23.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,919,053.36	3.13
E	建筑业	13,728,337.10	4.33
F	批发和零售业	2,845,266.80	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	7,338,479.86	2.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,159,916.80	2.89
J	金融业	144,661,916.69	45.66
K	房地产业	14,103,472.81	4.45
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	1,573,994.40	0.50
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	720,000.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	288,077,571.84	90.92

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	601318	中国平安	523,724	18,854,064.00	5.95
2	600016	民生银行	1,562,013	15,057,805.32	4.75
3	601166	兴业银行	705,310	12,039,641.70	3.80
4	000002	万科A	376,107	9,188,294.01	2.90
5	600036	招商银行	499,423	8,984,619.77	2.84
6	600000	浦发银行	452,591	8,268,837.57	2.61
7	600030	中信证券	385,864	7,466,468.40	2.36
8	601328	交通银行	1,129,975	7,277,039.00	2.30
9	601169	北京银行	599,791	6,315,799.23	1.99
10	600837	海通证券	390,542	6,178,374.44	1.95

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	600886	国投电力	162,100.00	1,353,535.00	0.43
2	002782	可立克	500.00	10,635.00	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	10,029,000.00	3.17
	其中：政策性金融债	10,029,000.00	3.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,029,000.00	3.17

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	150211	15国开11	100,000	10,029,000.00	3.17

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

5.11.1 2015年12月12日，中国民生银行股份有限公司（600016）非执行董事郭广昌先生因存在违规协助相关司法机关进行调查。目前，郭广昌先生已结束协查，该公司业务、运行及财务状况一切正常，该事项未对该公司产生影响。基金管理人通过对该发行人进一步了解分析后，认为该处分不会对民生银行（600016）投资价值构成实质性影响。

2015年8月25日，中信证券股份有限公司（600030）几名高级管理人员和员工被公安机关要求协助调查有关问题。另外，公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定。2015年11月30日，中国证券监督管理委员会在调查中信证券股份有限公司（600030）融资融券业务开展过程中发现该公司存在违反《证券公司监督管理条例》第八十四条"未按规定与客户签订业务合同"规定之嫌，决定对该公司进行立案调查。2015年12月4日晚间，有媒体报及中信证券股份有限公司（600030）执行委员会委员陈军先生、闫建霖先生或涉配合调查，目前公司暂时无法与上述人员取得联系。此外，公司前期配合调查的员工中，已有一部分员工先后返回工作岗位。基金管理人通过对该发行人进一步了解分析后，认为该处分不会对中信证券（600030）投资价值构成实质性影响。

2015年11月28日，经多方了解核实，海通证券股份有限公司（600837）因在融资融券业务中涉嫌违反《证券公司监督管理条例》第八十四条"未按规定与客户签订业务合同"的规定被中国证券监督管理委员会立案调查。基金管理人通过对该发行人进一步了解分析后，认为该处分不会对海通证券（600837）投资价值构成实质性影响。

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	100,022.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	206,489.04
5	应收申购款	6,716.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	313,228.06

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

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	000002	万科A	9,188,294.01	2.90	重大事项

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

单位：份

本报告期期初基金份额总额	323,757,147.36
本报告期基金总申购份额	6,582,720.82
减：本报告期基金总赎回份额	25,281,225.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	305,058,642.93

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	16,882,093.22
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	16,882,093.22
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	5.53

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

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
二〇一六年一月二十二日