

中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF)

2013第四季度报告

2013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:二〇一四年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人和基金份额持有人保证本报告不存在虚假记载、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。

基金托管人招行银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月16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內容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人认购、申购本基金，须仔细阅读本基金的招募说明书。

本公司目前无业务未统计。

报告期前10名股东名称及其持股比例

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	111,428,724.43	94.37
		111,428,724.43	94.37
2	固定收益投资	-	-
3	货币市场工具	-	-
4	权证及衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,056,167.20	5.13
7	其他资产	586,254.88	0.50
8	合计	118,066,143.11	100.00

本基金所持有的股票主要通过严格的估值纪律和审慎化的风险管理手段，实现对所持股票的有效的风险控制，使本基金的净值相比较基准有所提升。本基金的风控目标是追求日均回报率的绝对值不超过0.35%，日均回报率的相对值不超过0.35%。本基金的投资风格为价值型投资。

本基金所持有的债券主要通过审慎的债券投资策略，锁定跟踪指数，保持跟踪误差在较小范围内。

本基金将严格按照契约规定，采用完全复制投资策略，被动跟踪指数，保持跟踪误差在历史区域范围内，对于中长期资金仍有较强吸引力，在改革预期下继续保持好蓝筹股的长期投资价值。

本基金将严格遵守法律法规，勤勉尽责的管理运用基金资产，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。投资人认购、申购本基金，须仔细阅读本基金的招募说明书。

本公司目前无业务未统计。

报告期前10名股东名称及其持股比例

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	-	1,956,578.22	1.66
B 平等贸易行业	-	10,322,772.43	8.77
C 制造业	-	50,590,327.03	42.67
D 电力、热力、燃气、水生产和供应业	-	4,667,092.82	3.93
E 交通运输、仓储和邮政业	-	5,573,715.00	4.71
F 信息传输、软件和信息技术服务业	-	3,924,477.96	3.33
G 商业零售	-	14,058,198.59	11.94
H 食品、饮料和烟草制造业	-	4,993,663.23	4.24
I 制造业服务业	-	1,663,243.48	1.41
J 科学研究、技术服务业	-	1,242,912.44	1.06
K 居民服务、修理和其他服务业	-	31,579	0.27
L 教育	-	552,080.10	0.47
M 其他行业	-	40,277	0.34
N 五金、家具及电子设备制造业	-	526,528.00	0.45
O 仪器仪表业	-	77,422	0.65
P 电气机械、器材制造业	-	526,469.60	0.45
Q 电子元件	-	61,891	0.52
R 东方明珠	-	52,672	0.44
S 网络通信	-	80,311	0.68
T 大农	-	30,874	0.26
U 其他	-	504,780.90	0.43

注:1.本报告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,本期费用包括本期发生的管理费、托管费、申购费、赎回费、交易费、利息支出、手续费、佣金、税金、借款利息、汇兑损益、溢折价摊销等。

2.基金净值增长率=报告期期间净值增长率/(1+报告期期间费用率)

3.报告期平均基金份额利润=报告期期间利润/报告期期间天数。

4.期末基金资产净值=报告期期间末基金资产净值/报告期期间末基金资产净值。

5.期末可供分配基金份额利润=报告期期间可供分配利润/报告期期间天数。

6.报告期期间费用率=报告期期间费用/报告期期间天数。

7.报告期期间利润=报告期期间利息收入、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。

8.报告期期间可供分配利润=报告期期间利润-报告期期间费用。

9.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

10.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

11.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

12.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

13.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

14.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

15.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

16.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

17.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

18.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

19.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

20.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

21.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

22.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

23.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

24.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

25.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

26.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

27.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

28.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

29.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

30.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

31.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

32.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

33.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

34.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

35.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

36.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

37.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

38.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

39.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

40.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

41.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

42.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

43.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

44.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

45.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

46.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

47.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

48.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

49.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

50.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

51.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

52.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

53.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

54.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

55.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

56.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

57.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

58.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

59.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

60.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

61.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

62.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

63.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

64.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

65.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

66.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

67.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

68.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

69.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

70.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

71.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

72.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

73.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

74.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

75.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

76.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

77.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

78.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

79.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

80.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

81.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

82.报告期期间可供分配利润除以报告期期间天数即为报告期期间每日报酬。

<p