

中银战略新兴产业股票型证券投资基金
2016 年半年度报告
2016 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十四日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 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.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.8 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.....	36
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	36
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.11 投资组合报告附注.....	37
8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	38
9 开放式基金份额变动	38
10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4 基金投资策略的改变	39
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	39
10.8 其他重大事件	40
11 备查文件目录	41
11.1 备查文件目录	41
11.2 存放地点	41
11.3 查阅方式	41

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银战略新兴产业股票型证券投资基金
基金简称	中银战略新兴产业股票
基金主代码	001677
交易代码	001677
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 26 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	202,357,668.98 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于战略新兴产业相关股票，通过自上而下的研究分析和精选个股，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将专注于战略新兴产业主题投资，对其相关的行业发展进行密切跟踪，充分把握战略新兴产业企业的投资机会，发掘与战略新兴主题相关的上市公司中商业模式独特、竞争优势明显，具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司，分享企业成长及变革带来的资本增值。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×80% +中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于高预期风险和高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛文成	张志永
	联系电话	021-38834999	021-62677777-212004
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95561
传真		021-68873488	021-62159217
注册地址		上海市银城中路200号中银大厦45层	福州市湖东路154号
办公地址		上海市银城中路200号中银大厦26层、45层	上海江宁路168号兴业大厦20楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		白志中	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 200 号 26 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中银基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 200 号 45 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-9,978,800.96
本期利润	-1,998,694.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0089
本期加权平均净值利润率	-0.92%
本期基金份额净值增长率	-0.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-8,710,549.54
期末可供分配基金份额利润	-0.0430
期末基金资产净值	202,124,471.56
期末基金份额净值	0.999
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-0.10%

注：1、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。

2、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。期末可供分配收益，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

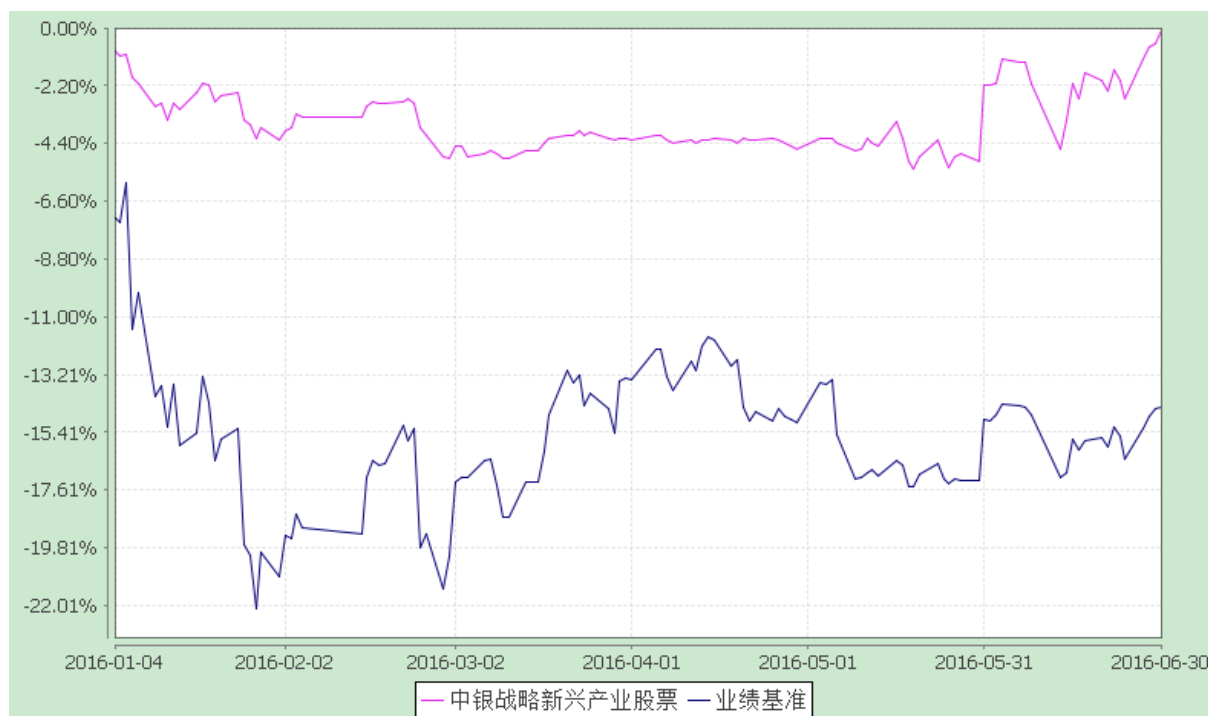
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.15%	0.95%	0.51%	0.91%	1.64%	0.04%
过去三个月	4.28%	0.72%	-1.28%	0.94%	5.56%	-0.22%
过去六个月	-0.10%	0.59%	-13.30%	1.62%	13.20%	-1.03%
自基金合同生效起至今	-0.10%	0.53%	-14.47%	1.58%	14.37%	-1.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

中银战略新兴产业股票型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015 年 11 月 26 日至 2016 年 6 月 30 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，即本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80-95%，本基金投资于战略新兴产业相关主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中银基金管理有限公司前身为中银国际基金管理有限公司，于 2004 年 8 月 12 日正式成立，由中银国际和美林投资管理合资组建（2006 年 9 月 29 日美林投资管理有限公司与贝莱德投资管理有限公司合并，合并后新公司名称为“贝莱德投资管理有限公司”）。2007 年 12 月 25 日，经中国证券监督管理委员会批复，同意中国银行股份有限公司直接控股中银基金。公司注册地为中国上海市，注册资本为人民币一亿元，其中中国银行拥有 83.5% 的股权，贝莱德投资管理拥有 16.5% 的股权。截

至 2016 年 6 月 30 日，本管理人共管理六十六只开放式证券投资基金：中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金、中银动态策略混合型证券投资基金、中银稳健增利债券型证券投资基金、中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金、中银中证 100 指数增强型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、中银全球策略证券投资基金 (FOF)、上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、中银中小盘成长混合型证券投资基金、中银信用增利债券型证券投资基金、中银沪深 300 等权重指数证券投资基金(LOF)、中银主题策略混合型证券投资基金、中银保本混合型证券投资基金、中银理财 14 天债券型证券投资基金、中银理财 60 天债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、中银理财 7 天债券型证券投资基金、中银理财 30 天债券型证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金、中银消费主题混合型证券投资基金、中银美丽中国混合型证券投资基金、中银盛利纯债一年定期开放债券型证券投资基金 (LOF)、中银新回报灵活配置混合型证券投资基金、中银互利分级债券型证券投资基金、中银惠利纯债半年定期开放债券型证券投资基金、中银中高等级债券型证券投资基金、中银理财 21 天债券型证券投资基金、中银优秀企业混合型证券投资基金、中银活期宝货币市场基金、中银多策略灵活配置混合型证券投资基金、中银健康生活混合型证券投资基金、中银聚利分级债券型证券投资基金、中银薪钱包货币市场基金、中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金、中银新经济灵活配置混合型证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、中银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、中银恒利半年定期开放债券型证券投资基金、中银新动力股票型证券投资基金、中银宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、中银新趋势灵活配置混合型证券投资基金、中银智能制造股票型证券投资基金、中银互联网+股票型证券投资基金、中银国有企业债债券型证券投资基金、中银新财富灵活配置混合型证券投资基金、中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中银战略新兴产业股票型证券投资基金、中银机构现金管理货币市场基金、中银美元债债券型证券投资基金(QDII)、中银稳进保本混合型证券投资基金、中银宝利灵活配置混合型证券投资基金、中银瑞利灵活配置混合型证券投资基金、中银珍利灵活配置混合型证券投资基金、中银鑫利灵活配置混合型证券投资基金、中银益利灵活配置混合型证券投资基金、中银裕利灵活配置混合型证券投资基金、中银合利债券型证券投资基金、中银腾利灵活配置混合型证券投资基金、中银永利半年定期开放债券型证券投资基金，同时管理着多个特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱亚风云	本基金的基金经理、中银消费主题基金基金经理、中银新财富基金基金经理、中银宝利基金基金经理	2015-11-26	-	6	金融学硕士。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 7 月至今任中银消费主题基金基金经理，2015 年 11 月至今任中银新财富基金基金经理，2015 年 11 月至今任中银战略新兴产业基金基金经理，2016 年 2 月至今任中银宝利基金基金经理。具有 6 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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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。上半年欧元区经济延续弱势复苏态势，不过，受英国公投脱欧的负面冲击，欧盟统计局数据显示 6 月份的服务业、零售业和建筑业信心明显恶化，消费者也变得更为悲观。综合来看，美国仍是全球复苏前景最好的经济体，受美联储加息预期反复影响，美元指数在 94-96 左右的区间窄幅波动。

国内经济方面，在前期“稳增长”政策刺激及国际大宗商品价格阶段性上行的内外因素影响下，经济领先指标整体仍是震荡走弱，下行压力并未消除。通胀方面，CPI 通缩预期有所修正，6 月小幅下行于 1.9% 的水平，PPI 环比跌幅有所收窄，6 月同比跌幅缩小至 -2.6% 左右。

2. 市场回顾

股票市场方面，上半年整体震荡下行。其中，一季度上证综指下跌 15.12%，代表大盘股表现的沪深 300 指数下跌 13.75%，中小盘综合指数下跌 17.35%，创业板综合指数下跌 19.31%；二季度，上证综指下跌 2.47%，代表大盘股表现的沪深 300 指数下跌 1.99%，中小盘综合指数上行 3.79%，创业板综合指数上行 6.72%。

3. 运行分析

报告期内，基金行业配置主要是食品饮料、新能源和家电。随着科技行业调整逐渐到位，产品会逐渐加大科技行业配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日为止，本基金的单位净值为 0.999 元，本基金的累计单位净值为 0.999 元。报告期内本基金净值增长率为 -0.10%，绩基准增长率为 -13.30%。

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，国内经济增速下滑压力仍未消退，但财政政策放松有望继续，加之货币政策转向稳健偏松，或将对下半年经济形成一定程度

的托底效应。总体而言，我们认为下半年宏观环境上流动性相对仍保持宽松，但管理层“严监管、控风险”的趋势值得重视。

综合上述分析，我们认为 2016 年下半年股票市场仍大概率维持宽幅震荡走势。具体操作上，一方面寻找景气度较好或者业绩表现良好的优质公司，另一方面继续在新兴产业布局中长期看好的潜力公司。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由投资管理部、风险管理部、基金运营部、法律合规部和信息披露相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金运营部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值模型并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由运营部做出提示，风险管理部相关人员对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。其他特殊情形，可由基金经理做出提示，并由研究员提供估值研究报告，交估值委员会审议，同时按流程对外公布。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.6.4 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同第十六部分基金的收益与分配相关约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不

满 3 个月可不进行收益分配。本报告期期末可供分配利润为-8710549.54 元，本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银战略新兴产业股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	38,655,379.57	223,476,548.15
结算备付金		1,512,296.22	-
存出保证金		97,342.17	-
交易性金融资产	6.4.7.2	162,686,609.37	22,420,260.00
其中：股票投资		162,686,609.37	22,420,260.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	16,002.39	114,890.64
应收股利		-	-
应收申购款		163,585.63	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		203,131,215.35	246,011,698.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,430,959.09
应付赎回款		346,960.34	-
应付管理人报酬		246,468.02	310,041.78
应付托管费		41,078.01	51,673.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	187,435.31	22,728.73
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	184,802.11	-
负债合计		1,006,743.79	2,815,403.25
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	202,357,668.98	243,213,369.97
未分配利润	6.4.7.10	-233,197.42	-17,074.43
所有者权益合计		202,124,471.56	243,196,295.54
负债和所有者权益总计		203,131,215.35	246,011,698.79

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.999 元，基金份额总额 202,357,668.98 份。

6.2 利润表

会计主体：中银战略新兴产业股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
----	-----	----

		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		395,007.96
1.利息收入		1,331,932.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,331,932.15
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,019,745.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-9,969,136.01
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	949,390.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	7,980,106.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	102,714.62
减：二、费用		2,393,702.04
1. 管理人报酬		1,617,880.70
2. 托管费		269,646.78
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	316,849.42
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	189,325.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,998,694.08
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,998,694.08

注：本基金合同于 2015 年 11 月 26 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银战略新兴产业股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基	243,213,369.97	-17,074.43	243,196,295.54

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,998,694.08	-1,998,694.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-40,855,700.99	1,782,571.09	-39,073,129.90
其中: 1.基金申购款	3,133,638.75	-103,512.05	3,030,126.70
2.基金赎回款	-43,989,339.74	1,886,083.14	-42,103,256.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	202,357,668.98	-233,197.42	202,124,471.56

注: 本基金合同于 2015 年 11 月 26 日生效, 无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 李道滨, 主管会计工作负责人: 欧阳向军, 会计机构负责人: 乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银战略新兴产业股票型证券投资基金(以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1552 号《关于核准中银战略新兴产业股票型证券投资基金注册的批复》的核准, 由基金管理人中银基金管理有限公司于 2015 年 11 月 09 日至 2015 年 11 月 26 日向社会公开募集, 募集期结束经安永华明会计师事务所有限公司验证并出具安永华明(2015)验字第 61062100_B15 号验资报告后, 向中国证监会报送基金备案材料。

基金合同于 2015 年 11 月 26 日生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 243,145,498.45 元, 在募集期间产生的活期存款利息为人民币 67,871.52 元, 以上实收基金(本息)合计为人民币 243,213,369.97 元, 折合 243,213,369.97 份基金份额。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司, 注册登记机构为中银基金管理有限公司, 基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、股票期权等权益类品种, 债券等固定收益类品种(包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融

资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具), 国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 但须符合中国证监会的相关规定。

基金管理人投资股票期权及其他新增投资品种前, 应与基金托管人就清算交收、核算估值、系统支持等方面确认一致, 确保双方均准备就绪方可投资。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80-95%。本基金投资于战略新兴产业相关主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制, 基金管理人在履行适当程序后, 可以调整上述投资品种的投资比例。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制, 同时, 在具体会计核算和信息披露方面, 也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金于 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度, 即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的编制期间

系 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票和债券投资；

本基金目前持有的其他金融资产分类为贷款和应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债；

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可

行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

- (5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认, 并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;
- (6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认, 并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;
- (7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认, 并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;
- (8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认, 并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;
- (9) 股利收益于除息日确认, 并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;
- (10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;
- (11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方, 经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提;
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提;
- (3) 卖出回购金融资产支出, 按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时, 也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;
- (4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定, 按实际支出金额, 列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的, 则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权;
- (2) 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额, 不足以支付银行转账或其他手续费用时, 基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额;
- (3) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配;
- (4) 本基金收益分配方式分为两种: 现金分红与红利再投资, 投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资; 场内投资人只能选择现金分红; 若投资人不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红;
- (5) 基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过 15 个工作日;
- (6) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值, 即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收

流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	38,655,379.57
定期存款	-
其他存款	-
合计	38,655,379.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	154,690,831.35	162,686,609.37	7,995,778.02
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	154,690,831.35	162,686,609.37	7,995,778.02

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	15,277.77
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	680.50
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.32
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	43.80
合计	16,002.39

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	187,435.31
银行间市场应付交易费用	-
合计	187,435.31

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,288.73
预提费用	183,513.38
其他	-
合计	184,802.11

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	243,213,369.97	243,213,369.97
本期申购	3,133,638.75	3,133,638.75
本期赎回（以“-”号填列）	-43,989,339.74	-43,989,339.74

本期末	202,357,668.98	202,357,668.98
-----	----------------	----------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-32,745.57	15,671.14	-17,074.43
本期利润	-9,978,800.96	7,980,106.88	-1,998,694.08
本期基金份额交易产生的变动数	1,300,996.99	481,574.10	1,782,571.09
其中：基金申购款	-135,333.01	31,820.96	-103,512.05
基金赎回款	1,436,330.00	449,753.14	1,886,083.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,710,549.54	8,477,352.12	-233,197.42

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	1,329,031.28
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,628.45
其他	272.42
合计	1,331,932.15

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	57,482,052.32
减：卖出股票成本总额	67,451,188.33
买卖股票差价收入	-9,969,136.01

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	949,390.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	949,390.32

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	7,980,106.88
——股票投资	7,980,106.88
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	7,980,106.88

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	87,066.45
转换费收入	15,648.17
合计	102,714.62

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	316,849.42
银行间市场交易费用	-
合计	316,849.42

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,178.12
银行间账户维护费	9,000.00

银行汇划费	1,311.76
合计	189,325.14

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中银国际证券有限责任公司(“中银证券”)	受中国银行重大影响、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,617,880.70
其中：支付销售机构的客户维护费	626,660.53

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	269,646.78

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行管理有限公司	38,655,379.57	1,329,031.28
合计	38,655,379.57	1,329,031.28

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	网下中签	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	网下中签	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	网下中签	12.98	12.98	1,424	18,483.52	18,483.52	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	网下中签	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项停牌	20.92	2016-07-01	23.01	5,193	18,019.71	108,637.56	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止, 本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止, 本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要为股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内, 使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 建立了包括风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部、法律合规部、稽核部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 审议通过风

险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能

力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	38,655,379.57	-	-	-	38,655,379.57
结算备付金	1,512,296.22	-	-	-	1,512,296.22
存出保证金	97,342.17	-	-	-	97,342.17
交易性金融资产	-	-	-	162,686,609.37	162,686,609.37
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	16,002.39	16,002.39
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	163,585.63	163,585.63
资产总计	40,265,017.96	-	-	162,866,197.39	203,131,215.35
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	346,960.34	346,960.34
应付管理人报酬	-	-	-	246,468.02	246,468.02
应付托管费	-	-	-	41,078.01	41,078.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	187,435.31	187,435.31
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	184,802.11	184,802.11
负债总计	-	-	-	1,006,743.79	1,006,743.79
利率敏感度缺口	40,265,017.96	-	-	161,859,453.60	202,124,471.56

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经

济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80-95%，本基金投资于战略新兴产业相关主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括特定指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	162,686,609.37	80.49	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	162,686,609.37	80.49	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 208	-
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 208	-	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	162,686,609.37	80.09
	其中：股票	162,686,609.37	80.09
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	40,167,675.79	19.77
7	其他各项资产	276,930.19	0.14
8	合计	203,131,215.35	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	6,052,830.00	2.99
B	采矿业	2,990,917.68	1.48
C	制造业	69,162,227.26	34.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	108,637.56	0.05
F	批发和零售业	9,468,799.00	4.68
G	交通运输、仓储和邮政业	3,796,848.00	1.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,291,287.57	3.61
J	金融业	63,794,936.20	31.56
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	20,126.10	0.01
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	162,686,609.37	80.49

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	223,800	7,280,214.00	3.60
2	600519	贵州茅台	23,600	6,889,312.00	3.41
3	002035	华帝股份	275,400	6,741,792.00	3.34
4	000596	古井贡酒	134,300	6,439,685.00	3.19
5	002594	比亚迪	102,600	6,259,626.00	3.10
6	600155	宝硕股份	454,200	6,240,708.00	3.09
7	000860	顺鑫农业	261,700	6,223,226.00	3.08
8	002299	圣农发展	233,700	6,052,830.00	2.99
9	601939	建设银行	1,268,900	6,027,275.00	2.98
10	002007	华兰生物	191,200	6,003,680.00	2.97
11	601688	华泰证券	309,700	5,859,524.00	2.90
12	600713	南京医药	658,200	5,542,044.00	2.74
13	601328	交通银行	958,200	5,394,666.00	2.67
14	601818	光大银行	1,421,500	5,344,840.00	2.64
15	601998	中信银行	913,000	5,176,710.00	2.56
16	601398	工商银行	1,158,400	5,143,296.00	2.54
17	601288	农业银行	1,603,300	5,130,560.00	2.54
18	601628	中国人寿	240,600	5,009,292.00	2.48
19	601318	中国平安	155,000	4,966,200.00	2.46
20	601336	新华保险	122,100	4,932,840.00	2.44
21	600016	民生银行	547,200	4,886,496.00	2.42
22	000895	双汇发展	231,000	4,823,280.00	2.39
23	300302	同有科技	147,000	4,773,090.00	2.36
24	000078	海王生物	528,500	3,926,755.00	1.94
25	601021	春秋航空	79,200	3,796,848.00	1.88
26	000700	模塑科技	369,000	3,737,970.00	1.85
27	601169	北京银行	341,852	3,545,005.24	1.75
28	300078	思创医惠	89,600	2,996,224.00	1.48
29	600028	中国石化	633,669	2,990,917.68	1.48
30	603589	口子窖	77,234	2,796,643.14	1.38
31	300031	宝通科技	96,866	2,472,020.32	1.22
32	002273	水晶光电	85,600	2,395,944.00	1.19
33	601198	东兴证券	97,309	2,378,231.96	1.18

34	601611	中国核建	5,193	108,637.56	0.05
35	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.04
36	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.03
37	601127	小康股份	2,605	62,181.35	0.03
38	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
39	300518	盛讯达	787	36,870.95	0.02
40	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
41	603958	哈森股份	1,528	22,156.00	0.01
42	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
43	601966	玲珑轮胎	1,424	18,483.52	0.01
44	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.01
45	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
46	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002027	分众传媒	7,062,522.00	2.90
2	000700	模塑科技	7,029,152.00	2.89
3	000858	五粮液	6,658,169.62	2.74
4	002311	海大集团	6,417,120.12	2.64
5	600519	贵州茅台	6,079,922.50	2.50
6	601939	建设银行	6,078,031.00	2.50
7	002007	华兰生物	6,034,443.26	2.48
8	000860	顺鑫农业	6,031,399.91	2.48
9	002594	比亚迪	6,029,664.84	2.48
10	002299	圣农发展	5,951,272.00	2.45
11	600028	中国石化	5,860,372.00	2.41
12	300031	宝通科技	5,852,436.17	2.41
13	000596	古井贡酒	5,771,736.69	2.37
14	002035	华帝股份	5,755,065.76	2.37
15	600713	南京医药	5,663,926.00	2.33
16	000895	双汇发展	5,049,416.19	2.08
17	601988	中国银行	5,035,550.00	2.07
18	601818	光大银行	5,032,110.00	2.07
19	601998	中信银行	5,030,630.00	2.07
20	601328	交通银行	5,030,550.00	2.07
21	601688	华泰证券	4,957,688.00	2.04
22	601628	中国人寿	4,953,980.00	2.04
23	601318	中国平安	4,947,060.00	2.03

24	601336	新华保险	4,938,703.20	2.03
25	600016	民生银行	4,924,481.00	2.02
26	601398	工商银行	4,923,200.00	2.02
27	601288	农业银行	4,922,131.00	2.02
28	600155	宝硕股份	4,917,160.00	2.02

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002027	分众传媒	6,925,568.80	2.85
2	002311	海大集团	6,548,528.12	2.69
3	002113	天润控股	5,736,844.00	2.36
4	300279	和晶科技	5,350,505.00	2.20
5	601988	中国银行	4,989,068.00	2.05
6	300031	宝通科技	4,775,500.00	1.96
7	600325	华发股份	4,282,346.00	1.76
8	300322	硕贝德	3,395,451.00	1.40
9	002421	达实智能	3,082,585.00	1.27
10	600028	中国石化	3,005,156.18	1.24
11	600173	卧龙地产	2,990,320.00	1.23
12	000700	模塑科技	2,838,945.62	1.17
13	002289	*ST 宇顺	2,147,699.00	0.88
14	002761	多喜爱	1,413,535.60	0.58

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	199,565,750.37
卖出股票的收入（成交）总额	57,482,052.32

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	97,342.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,002.39
5	应收申购款	163,585.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	276,930.19
---	----	------------

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 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情况。

7.11.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,081	97,240.59	992,153.49	0.49%	201,365,515.49	99.51%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	988.50	0.0005%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年11月26日）基金份额总额	243,213,369.97
本报告期期初基金份额总额	243,213,369.97
本报告期基金总申购份额	3,133,638.75
减：本报告期基金总赎回份额	43,989,339.74
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	202,357,668.98
-------------	----------------

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经本基金管理人 2016 年第一次股东会会议审议通过，选举杜惠芬女士担任公司第四届董事会的独立董事。经本基金管理人 2016 年第二次股东会会议审议通过，选举曾仲诚 (Paul Tsang) 先生担任公司董事，葛岱炜 (David Graham) 先生不再担任公司董事。上述事项已报相关机构备案。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略没有发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内没有改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	210,308,641.77	81.82%	193,971.98	82.00%	-
国金证券	1	46,739,160.92	18.18%	42,593.50	18.00%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29 号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择

程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中银基金管理有限公司关于受指数熔断影响暂停旗下部分公开募集证券投资基金申购、赎回、转换、定期定额投资等业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-01-04
2	中银基金管理有限公司关于受指数熔断影响暂停旗下部分公募基金申购、赎回、转换、定期定额投资等业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-01-07
3	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-01-27
4	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-01-28
5	中银战略新兴产业股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-02-24
6	中银战略新兴产业股票型证券投资基金开通电子直销申购、赎回、定期定额投资及转换业务并实施交易费率优惠公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-02-24
7	中银基金管理有限公司关于新增上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-03-04
8	中银战略新兴产业股票型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-04-21
9	中银基金管理有限公司关于调整电子直销平	《上海证券报》、《中国证	2016-04-29

	台中国银行借记卡定期定额申购费率的公告	券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	
10	中银基金管理有限公司关于开通电子直销赎回转认购业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-05-26
11	中银基金管理有限公司关于开通电子直销赎回转申购业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-05-26
12	中银基金管理有限公司关于调整电子直销平台快速赎回业务规则的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-05-26
13	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并实施交易费率优惠的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-06-27
14	关于调整招商银行借记卡基金电子直销申购业务优惠费率的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、 www.bocim.com	2016-06-28

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银战略新兴产业股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中银战略新兴产业股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银战略新兴产业股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集注册中银战略新兴产业股票型证券投资基金之法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人处，供公众查阅。

11.3 查阅方式

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

中银基金管理有限公司
二〇一六年八月二十四日