

上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金
2015 年年度报告摘要
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：二〇一六年三月二十五日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国企 ETF
场内简称	国企 ETF
基金主代码	510270
交易代码	510270
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 16 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
报告期末基金份额总额	26,832,064.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011 年 8 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为交易型开放式指数基金（ETF），紧密跟踪标的指数（上证国有企业 100 指数），追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照上证国有企业 100 指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合进行适当变通和调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。本基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%，但因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	上证国有企业 100 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表

现，是股票基金中风险中等、收益与市场平均水平大致相近的产品。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛文成	张燕
	联系电话	021-38834999	0755-83199084
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	Yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95555
传真		021-68873488	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金年度报告备置地点	上海市银城中路 200 号中银大厦 26 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	14,421,184.45	5,258,650.01	-4,159,385.05
本期利润	-2,596,930.73	28,283,028.75	-9,941,215.09
加权平均基金份额本期利润	-0.0624	0.3659	-0.0981
本期基金份额净值增长率	-3.59%	67.87%	-13.33%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0993	-0.1503	-0.2530
期末基金资产净值	28,781,447.73	66,612,460.78	57,535,835.23
期末基金份额净值	1.073	1.113	0.663

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
过去三个月	10.50%	1.61%	11.44%	1.64%	-0.94%	-0.03%
过去六个月	-18.40%	2.62%	-18.62%	2.72%	0.22%	-0.10%
过去一年	-3.59%	2.49%	-4.69%	2.56%	1.10%	-0.07%
过去三年	40.26%	1.82%	34.38%	1.86%	5.88%	-0.04%
自基金合同生效起至今	25.21%	1.64%	19.40%	1.68%	5.81%	-0.04%

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

上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2011 年 6 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日)

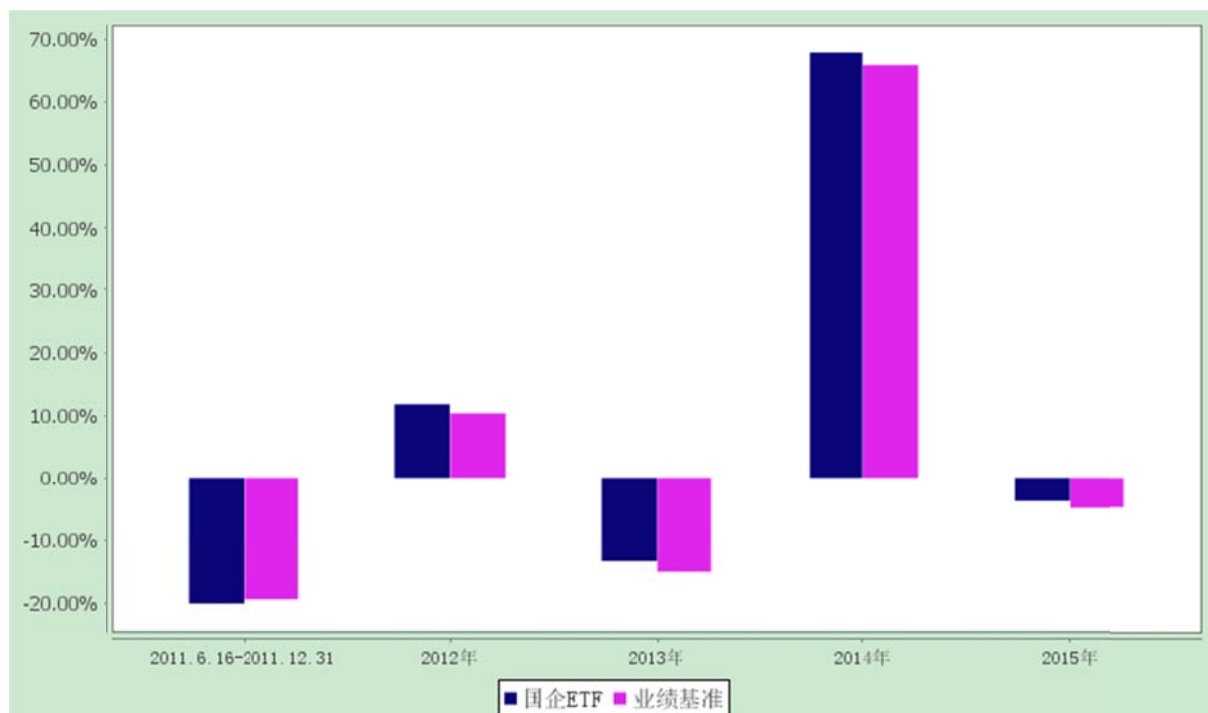


注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 3 个月内为建仓期，截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十六部分（三）的规定，即本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在建仓期完成后，本基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%，但因法律法规的规定而受限制的情形除外。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他投资工具，基金管理人在履行适当程序后，可将其纳入投资范围。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2011 年 6 月 16 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满五年。合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-
2013	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§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，注册资本为一亿元人民币，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 2015 年 12 月 31 日，本管理人共管理五十六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），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		
赵建忠	本基金的基金经理、中银中证 100 指数增强基金基金经理、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。
周小丹	本基金的基金经理、中银中证 100 指数增强基金基金经理、中银沪深 300 等权重指数基金 (LOF) 基金经理	2011-06-16	2015-06-08	8	中银基金管理有限公司副总裁 (VP)，经济学硕士。2005 年加入中银基金管理有限公司，先后担任研究员、基金经理助理等职。2010 年 7 月至 2014 年 1 月任中银增长基金基金经理，2011 年 9 月至 2015 年 5 月任中银优选基金基金经理，2013 年 5 月至 2015 年 5 月任中银策略基金基金经理，2014 年 5 月至 2015 年 5 月任中银健康生活基金基金经理。具有 8 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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

本报告期内，本公司通过对公司管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，并对连续四个季度的不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.3 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

刚刚过去的 2015 年，主要经济体经济态势出现明显分化，各国货币政策也分化明显。从国外具体情况看，欧洲经济通缩风险略有缓解，欧元区通胀由年初-0.6%回升至年底 0.2%，物价依然低迷；

制造业 PMI 由年初 51 逐步回升至年底的 53.2 左右；失业率持续维持在 10% 以上。在此背景下，欧央行多措并举，加大了宽松力度。美国经济整体维持复苏态势，制造业 PMI 全年都处于较强的扩张区域，消费者信心指数依然保持较高水平，就业市场持续改善，新增非农就业多数月份维持在 20 万以上，失业率由年初 5.7% 降至 5.0%，物价小幅走高，总体温和，GDP 年化增速 2.4% 左右，实现了低通胀，较高增长的宏观局面。美联储逐步退出量化宽松，货币政策在正常化通道中。新兴市场经济体货币政策出现分化，外部环境复杂性增加导致政策制定难度进一步加大。一方面，多个经济体为提振经济、缓解外部冲击先后放宽了货币政策。2015 年俄罗斯 5 次下调基准利率共 600 个基点至 11%；印度储备银行 4 次下调回购利率共 125 个基点至 6.75%。另一方面，部分经济体收紧货币政策以应对国内通胀压力，减少美联储加息带来的冲击。巴西央行 5 次上调基准利率共 250 个基点至 14.25%；秘鲁央行、南非央行分别 2 次上调基准利率共 50 个基点至 3.75% 和 6.25%。

从国内具体情况看，宏观经济步入微通缩周期，经济增速呈现托底式下滑。2015 年一季度稳增长压力继续增大，房地产投资和新开工大幅下滑，拖累固定资产投资；政策重点开始倾向于稳增长，基建投资力度加大、降低社会融资成本等一系列刺激政策使得经济增速在二季度环比上升，三、四季度经济重新进入下滑趋势。由于内需不足，原油价格回落，工业品出厂价格持续回落，通缩压力加大；居民通胀水平也整体呈现稳步回落态势。在此背景下，稳定经济区间运行，以调结构、促改革释放经济增长动力成为共识，积极的财政政策和稳健的货币政策内涵与以往也有所不同，宏观经济调控方式、宏观经济指标与实体经济相互关系都发生变化，经济环境和政策方式进入新常态。财政政策方面，受制于财政赤字规模约束和财政收入增速放缓、财政部关于地方政府债务新规、融资平台融资困难等共同影响，地方政府以往通过财政举债刺激经济增长的空间受到限制。货币政策方面，面对结构调整过程中出现的经济下行压力，继续实施稳健的货币政策，加强预调微调，进一步增强调控的针对性和有效性。具体政策上，一是综合运用公开市场操作、中期借贷便利、普降金融机构存款准备金率等多种工具合理调节银行体系流动性。二是五次下调人民币存贷款基准利率，九次引导公开市场逆回购操作利率下行，适时下调信贷政策支持再贷款、中期借贷便利和抵押补充贷款利率，探索常备借贷便利利率发挥利率走廊上限作用，引导融资成本下行。三是实施定向降准，扩大信贷资产质押和央行内部评级试点，发挥差别准备金动态调整机制的逆周期调节和结构导向作用。2016 年，预计宏观调控思路仍将延续，经济增长目标或转向 6.5%-7.0% 的目标区间，经济仍有下滑压力。

2. 行情回顾

2015 年市场可以用大起大落、惊心动魄来形容。上半年依靠杠杆资金节节走高，投资者积极入市，市场走出了波澜壮阔的牛市，赚钱效应显现；年中在去杠杆背景下股灾突然降临，管理层的直

接入市控制住了风险向其他金融领域的蔓延，后又因汇改等原因 2 个月左右时间内市场暴跌 45%。9 月之后市场逐渐修复，并在 4 季度震荡向上。全年来看，沪深 300 等权指数涨跌幅度为 20.12%，中证 100 涨跌幅-1.52%；上证国企指数涨跌幅-4.69%。

3.运行分析

本报告期为基金的正常运作期。我们严格遵守基金合同，采用完全复制策略跟踪指数，在因指数权重调整或基金申赎发生变动时，根据市场的流动性情况采用量化模型优化交易以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 1.073 元，本基金的累计单位净值 1.073 元。报告期内本基金份额净值增长率为-3.59%，同期业绩比较基准收益率为-4.69%。

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 2016 年，基本面来看，还会保持稳中趋缓、缓中有进的总体格局，经济增速的换挡使上市公司业绩整体承压，所以分子端难以给 A 股市场提升整体估值，但结构性亮点值得期待。政策面来看，我们对 2016 年宏观经济政策保持相对乐观，积极的财政政策有望强化；在美元升息压力下，人民币继续降息的困难加大，尽管基于对冲资本外流的降准行为仍有必要，但宽松的力度将较 2015 年更受限制。积极的财政政策更多地对应“适度扩大总需求”，而宽松的货币政策利好宏观流动性的相对充裕，无风险收益率仍有下降空间；我们对于 2016 年 A 股市场谨慎乐观，仍具有配置价值，市场的震荡整固积蓄力量将构成未来新一轮牛市的蓄势阶段。

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，保持跟踪误差在较小范围内。

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

4.7.1 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，由研究部、风险管理部、基金运营部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方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金运营部做出提示，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，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值委员会审议，同时按流程对外公布。

4.7.2 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。

4.7.3 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。

4.7.4 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

根据本基金基金合同的规定，当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。截至本报告期末，本基金未满足基金合同中有关收益与分配的约定，无相关收益分配事项。

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

截至本报告期末，本基金的基金资产净值自 2015 年 7 月 17 日起已持续超过 60 个工作日低于 5000 万元。

§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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格

的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 汤骏 许培菁签字出具了安永华明（2016）审字第 61062100_B13 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	724,875.38	831,594.37
结算备付金	2,016.43	6,201.87
存出保证金	4,859.46	484.71
交易性金融资产	28,282,070.52	65,977,194.44
其中：股票投资	28,261,296.12	65,977,194.44
基金投资	-	-
债券投资	20,774.40	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-

衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	2,664.27
应收利息	178.37	178.46
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	29,014,000.16	66,818,318.12
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
负 债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	11,017.21
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	12,623.10	24,605.06
应付托管费	2,524.62	4,921.04
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,404.71	5,314.03
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	210,000.00	160,000.00
负债合计	232,552.43	205,857.34
所有者权益：	-	-

实收基金	22,994,617.47	51,275,050.02
未分配利润	5,786,830.26	15,337,410.76
所有者权益合计	28,781,447.73	66,612,460.78
负债和所有者权益总计	29,014,000.16	66,818,318.12

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.073 元，基金份额总额 26,832,064.00 份。

7.2 利润表

会计主体：上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	-1,917,156.64	28,948,606.89
1.利息收入	7,951.35	7,235.86
其中：存款利息收入	7,937.11	7,235.86
债券利息收入	14.24	-
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）	15,125,695.16	5,903,484.16
其中：股票投资收益	14,141,537.14	4,170,754.05
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	984,158.02	1,732,730.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-17,018,115.18	23,024,378.74

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-32,687.97	13,508.13
减：二、费用	679,774.09	665,578.14
1. 管理人报酬	244,774.43	262,225.27
2. 托管费	48,954.90	52,445.13
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	53,788.63	20,060.20
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	332,256.13	330,847.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-2,596,930.73	28,283,028.75
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-2,596,930.73	28,283,028.75

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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（基金净值）	51,275,050.02	15,337,410.76	66,612,460.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,596,930.73	-2,596,930.73
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）	-28,280,432.55	-6,953,649.77	-35,234,082.32

其中：1.基金申购款	107,979,833.43	51,176,743.24	159,156,576.67
2.基金赎回款	-136,260,265.98	-58,130,393.01	-194,390,658.99
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）	22,994,617.47	5,786,830.26	28,781,447.73
项目	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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（基金净值）	74,413,585.69	-16,877,750.46	57,535,835.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	28,283,028.75	28,283,028.75
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）	-23,138,535.67	3,932,132.47	-19,206,403.20
其中：1.基金申购款	31,708,363.77	4,702,480.35	36,410,844.12
2.基金赎回款	-54,846,899.44	-770,347.88	-55,617,247.32
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）	51,275,050.02	15,337,410.76	66,612,460.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金(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[2011]269 号文《关于核准上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行人募集,基金合同于 2011 年 6 月 16 日正式生效,首次设立募集规模为 485,765,331.00 份基金份额。本基金为交易型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的基金管理人中银基金管理有限公司确定 2011 年 7 月 28 日为本基金的基金份额折算日。当日上证国有企业 100 指数收盘值为 840.396 点,基金资产净值为 476,365,833.90 元,折算前基金份额总额为 485,765,331.00 份,折算前基金份额净值为 0.981 元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 1.16689052,折算后基金份额总额为 566,832,064.00 份,折算后基金份额净值为 0.840 元。中银基金管理有限公司已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2011 年 7 月 29 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2011]第 176 号文审核同意,本基金于 2011 年 8 月 18 日在上交所挂牌交易。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在建仓期完成后,本基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%,但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

本基金的业绩比较基准为:上证国有企业 100 指数。

7.4.2 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。

7.4.3 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定，自 2015 年 3 月 30 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金管理人的控股股东
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
中银基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
贝莱德投资管理(英国)有限公司	基金管理人的股东
中银资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	244,774.43	262,225.27
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	48,954.90	52,445.13

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	724,875.38	7,537.58	831,594.37	7,100.79
合计	724,875.38	7,537.58	831,594.37	7,100.79

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015 年度获得的利息收入为人民币 348.46 元(2014 年度：人民币 128.70 元)，2015 年末结算备付金余额为人民币 2,016.43 元(2014 年末：人民币 6,201.87 元)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601377	兴业证券	2015-12-29	重大事项	11.00	2016-01-07	9.40	25,500	295,330.25	280,500.00	-
601018	宁波港	2015-08-04	重大资产重组	8.16	2016-02-22	7.34	31,800	258,644.82	259,488.00	-

600649	城投控股	2015-12-30	重大资产重组	23.16	2016-01-07	20.84	9,200	187,970.53	213,072.00	-
600271	航天信息	2015-10-12	重大资产重组	55.91	-	-	3,700	205,234.08	206,867.00	-
600880	博瑞传播	2015-09-16	重大事项	7.50	2016-01-18	8.25	4,800	58,829.04	36,000.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括 银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金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中属于第一层次的余额为人民币 27,265,369.12 元，属于第二层次的余额为人民币 1,016,701.40 元，无第三层次的余额。（与 2014 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 65,741,337.44 元，第二层次的余额为人民币 235,857.00 元，无划分为第三层次余额）

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关的股票和债

券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次或第三层次。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定，自 2015 年 3 月 30 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本基金期末持有航信转债数量 160.00 张，停牌日期 2015-10-12，成本总额人民币 16,000.00 元，估值总额人民币 20,774.4 元。航信转债因重大资产重组，截至报告日，尚未复牌。

截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币 28,781,447.73 元，已连续超过 113 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元。本基金资产管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定，向中国证监会说明原因和报送解决方案。本基金资产管理人将继续尽职尽责，积极采取措施，力争改变这一状况。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 3 月 24 日 经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	28,261,296.12	97.41
	其中：股票	28,261,296.12	97.41
2	固定收益投资	20,774.40	0.07
	其中：债券	20,774.40	0.07
	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	726,891.81	2.51
7	其他各项资产	5,037.83	0.02
8	合计	29,014,000.16	100.00

注：股票投资包含可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	124,078.84	0.43
B	采矿业	1,273,813.26	4.43
C	制造业	5,815,789.70	20.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,441,145.60	5.01
E	建筑业	2,052,883.00	7.13
F	批发和零售业	564,020.00	1.96

G	交通运输、仓储和邮政业	1,607,216.00	5.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	895,122.45	3.11
J	金融业	13,273,951.07	46.12
K	房地产业	950,525.20	3.30
L	租赁和商务服务业	153,473.00	0.53
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	109,278.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	28,261,296.12	98.19

注：上述股票投资组合不包括可退替代款估值增值。

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.3 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

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	601166	兴业银行	83,514	1,425,583.98	4.95
2	600036	招商银行	63,052	1,134,305.48	3.94
3	600000	浦发银行	57,113	1,043,454.51	3.63
4	601328	交通银行	144,286	929,201.84	3.23
5	600030	中信证券	48,014	929,070.90	3.23
6	601288	农业银行	273,600	883,728.00	3.07
7	600837	海通证券	49,225	778,739.50	2.71
8	601398	工商银行	157,100	719,518.00	2.50
9	601766	中国中车	55,572	714,100.20	2.48
10	600519	贵州茅台	3,046	664,606.74	2.31

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601766	中国中车	1,884,061.40	2.83
2	601398	工商银行	1,099,799.00	1.65
3	601006	大秦铁路	933,063.00	1.40
4	601727	上海电气	722,323.00	1.08
5	601328	交通银行	699,613.00	1.05
6	601169	北京银行	655,354.00	0.98
7	601288	农业银行	592,619.00	0.89
8	600637	东方明珠	547,305.80	0.82
9	601618	中国中冶	539,520.00	0.81
10	601788	光大证券	533,227.00	0.80
11	600839	四川长虹	529,539.00	0.79
12	600000	浦发银行	467,156.00	0.70
13	600958	东方证券	461,501.00	0.69
14	600068	葛洲坝	434,104.00	0.65
15	600028	中国石化	430,105.00	0.65
16	601989	中国重工	385,097.00	0.58
17	601166	兴业银行	380,569.00	0.57
18	601800	中国交建	348,574.03	0.52
19	600030	中信证券	286,051.00	0.43
20	601985	中国核电	284,900.00	0.43

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	600036	招商银行	1,172,005.00	1.76
2	601398	工商银行	573,600.00	0.86
3	600030	中信证券	544,925.00	0.82
4	600000	浦发银行	492,644.00	0.74
5	600837	海通证券	462,701.00	0.69

6	601390	中国中铁	454,573.00	0.68
7	601088	中国神华	453,587.12	0.68
8	600519	贵州茅台	442,615.00	0.66
9	600383	金地集团	436,599.00	0.66
10	601166	兴业银行	416,739.00	0.63
11	601818	光大银行	376,813.00	0.57
12	600597	光明乳业	373,198.66	0.56
13	601888	中国国旅	369,938.87	0.56
14	601899	紫金矿业	338,187.00	0.51
15	600900	长江电力	333,261.00	0.50
16	601668	中国建筑	317,220.00	0.48
17	600015	华夏银行	308,411.00	0.46
18	600887	伊利股份	298,882.00	0.45
19	601766	中国中车	296,575.00	0.45
20	601601	中国太保	272,595.00	0.41

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	19,232,213.77
卖出股票的收入（成交）总额	16,883,613.65

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	20,774.40	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,774.40	0.07

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	160	20,774.40	0.07

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与股指期货投资。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2015 年 1 月 16 日，证监会通报了去年四季度对 45 家券商进行的融资类业务现场检查的结果，宣布中信证券存在违规为到期融资融券合约展期问题，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多，对其采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施，中信证券表示将认真整改，全面梳理现有业务流程和规章制度，严格按照现有业务规则开展业务；

2015 年 1 月 16 日，证监会通报了去年四季度对 45 家券商进行的融资类业务现场检查的结果，宣布海通证券存在违规为到期融资融券合约展期问题，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多，对其采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施；

本基金在报告期内持有中信证券股票、海通证券股票，基金管理人通过对该发行人进一步了解分析后，认为公司所涉及的处分不会对上市公司投资价值构成实质性影响，因此未披露处罚事宜。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余八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、处罚的情况。

8.12.2 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。

8.12.3 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	4,859.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	178.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,037.83

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	20,774.40	0.07

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
1,428	18,789.96	1,900,932.00	7.08%	24,931,132.00	92.92%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	统一证券投资信托股份有限公司—客户资产	400,000.00	1.49%
2	统一证券投资信托股份有限公司—统一大龙腾	400,000.00	1.49%

	中国基金		
3	何锦霞	350,067.00	1.30%
4	统一证券投资信托股份有限公司—客户资产	341,937.00	1.27%
5	金俊杰	340,200.00	1.27%
6	中信建投证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	303,200.00	1.13%
7	刘顺安	301,100.00	1.12%
8	吴荣柯	300,000.00	1.12%
9	曾敏如	287,600.00	1.07%
10	钱彬	259,500.00	0.97%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年6月16日)基金份额总额	485,765,331.00
本报告期期初基金份额总额	59,832,064.00
本报告期基金总申购份额	126,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	159,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	26,832,064.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会。

11.2 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，经本基金管理人股东会审议通过，选举白志中先生、李道滨先生、赵春堂先生、宋福宁先生、葛岱炜（David Graham）先生担任公司第四届董事会董事，选举朱善利先生、荆新先生、赵欣舸先生、雷晓波（Edward Radcliffe）先生担任公司第四届董事会独立董事。其中，白志中先生、赵春堂先生、宋福宁先生为公司新任董事，赵欣舸先生、雷晓波（Edward Radcliffe）先生为公司新任独立董事。经本基金管理人第四届董事会第一次会议审议通过，选举白志中先生担任本基金管理人第四届董事会董事长，本基金管理人第三届董事会成员谭炯先生、梅非奇先生不再担任本基金管理人董事职务，葛礼（Gary Rieschel）先生不再担任本基金管理人独立董事职务，相关事项已按规定向监管机构报告。详情参见 2015 年 3 月 19 日刊登的《中银基金管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告》。

本报告期内，经工商行政管理部门核准，本基金管理人法定代表人变更为白志中先生，详情参见 2015 年 7 月 29 日刊登的《中银基金管理有限公司关于公司法定代表人变更公告》。

本报告期内，本基金管理人原独立董事朱善利先生不幸因病逝世，不再担任我司的独立董事，相关事项已按规定向监管机构报告。

本报告期内，经本基金管理人董事会审议通过，聘任陈军先生担任本基金管理人副执行总裁。陈军先生的基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会核准，详情参见 2015 年 12 月 8 日刊登的《中银基金管理有限公司关于副总经理变更事宜的公告》。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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，没有发生涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，没有发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 50,000.00 元，目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 3 年。

11.6 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任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	36,115,827.42	100.00%	33,050.17	100.00%	-

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》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。

中银基金管理有限公司

二〇一六年三月二十五日