

## 中银保本二号混合型证券投资基金

## [2013]第四季度报告

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:二〇一四年二月二十一日

基金管理人的董事会及董事保证本基金所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏,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。

基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏,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。

基金代销机构保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏,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。

基金销售机构承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则和最佳的善意为投资人服务,投资人购买基金时应认真阅读本基金的招募说明书。

基金代销机构未尽到适当性义务,投资人购买基金时应认真阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

基金合同生效未满一年,投资人购买基金时应认真阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

6.2 基金产品概况

基金简称 中银保本二号混合

基金主代码 000190

交易代码 000190

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年9月10日

报告期末基金份额总额 955,853,290.91份

投资目标 本基金在适用本基金保本条款的基金份额提供保本保证的基础上,严控投资风险,力争基金资产在保本周期内的稳定性。

投资策略 本基金充分发挥基金管理人的研究优势,采用CPPI投资组合保险策略和资产配置研究结果,动态调整稳健资产与风险资产的投资比例,以确保保本周期到期时,实现基金资产在保本基础上的保值增值的目的。

业绩比较基准 三年定期存款利率+0.8%。

风险收益特征 本基金为保本混合型基金,属证券投资基金中的低风险品种。投资者投资于本基金并不等于将资金作为存款放在银行存款类金融机构,保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

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

基金保证人 中海保险控股有限公司

6.3 主要财务指标

报告期 (单位:人民币元)

1.本期已实现收益 8,426,283.14

2.本期利润 2,302,207.74

3.加权平均基金份额本期利润 0.0023

4.期末基金资产净值 959,552,885.55

5.期末基金份额净值 1.004

6.期末基金份额净值 0.955,853,290.91

7.期末基金份额净值 0.955,853,290.91

8.本期基金份额净值增长率 0.0023%

9.本期基金份额净值增长率标准差 0.0023%

10.过去三个月 0.20% 0.05% 1.08% 0.01% 0.08% -0.08% 0.04%

32.2基金份额因生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.1 主要财务指标

报告期 (单位:人民币元)

1.本期已实现收益 8,426,283.14

2.本期利润 2,302,207.74

3.加权平均基金份额本期利润 0.0023

4.期末基金资产净值 959,552,885.55

5.期末基金份额净值 1.004

6.期末基金份额净值 0.955,853,290.91

7.期末基金份额净值 0.955,853,290.91

8.本期基金份额净值增长率 0.0023%

9.本期基金份额净值增长率标准差 0.0023%

10.过去三个月 0.20% 0.05% 1.08% 0.01% 0.08% -0.08% 0.04%

32.2基金份额因生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.2 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.3 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.4 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.5 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.6 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.7 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.8 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.9 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.10 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.11 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.12 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.13 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.14 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.15 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.16 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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.上述基金业绩标准不包括持有人认购或交易基金的各类费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数据。

3.本基金在任何情况下不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

4.期末基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.本基金份额净值=基金资产净值/基金份额总额。

6.3.17 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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。