

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：二〇一四年三月二十八日  
§ 1 重要提示

基金管理人和基金托管人根据本基金合同的规定，于2014年3月25日核对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，在报告复核后，确认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。投资人投资在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要。

本年度报告摘要简要披露年度报告全文，投资人欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。  
§ 2 基金简介

基金简称	中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF)
基金代码	162821
交易代码	162821
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2013年1月17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
报告期末基金总资产	119,092,742.61
基金份额净值	不适用
基金资产净值	深圳证券交易所
基金类别	2012年7月13日

22 基金产品说明

本基金为指数型基金，通过严控的纪律构建和精细化的风险管理体系，实现对标的指数的有效跟踪，获得与指数相当的回报。本基金的申购赎回费用率为0.5%，申购费用由申购基金的投资者承担，赎回费用不超过0.5%的申购费用的4%。

本基金为被动式指数基金，采用完全复制法的指数方法跟踪指数，即按照标的指数所包含的股票的构成及权重比例构建基金的股票组合，使基金的收益尽可能地与标的指数的收益相一致。

本基金力争在扣除基金管理费后的净值增长率与标的指数的收益率之间的日均跟踪误差不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

业绩比较基准

沪深300等权重指数×95%+同期银行活期利率×5%

风险收益特征

本基金属于股票型基金，风险与收益高于货币基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于股票，因此具有较高的风险和收益，其收益与风险水平高于股票型基金的平均水平。

23 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

信息披露义务人

姓名 明利 张燕

联系电话 021-38834999 0755-83199084

电子邮箱 clientservice@zscmchina.com Yan\_zhang@zscmchina.com

客户服务电话 021-38834788 400-888-5566 95555

传真 021-68873488 0755-83195201

24 信息披露方式

基金管理人通过合法的方式管理人互联网网址 http://www.zscm.com

基金管理人公告发布地点 上海市银行中路20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

2013年 2012年5月17日(基金合同生效日)至2012年12月31日

本期已实现收益 16,851,077.29 -1,836,518.31

本期利润 11,157,665.75 -710,146.56

加权平均基金份额利润 0.0598 -0.0009

本期基金份额净值增长 1.98% 0.80%

期末基金份额净值 117,691,908.76 110,110.49

基金份额净值 0.988 1.008

注：所述营业收入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.本期三四季度收益扣减基金本身利息收入，即利息收入、手续费、佣金、利息支出、税金等费用后，本公司的净利润与上期相比已实现收益、本期可供分配利润、期末可供分配利润和未分配利润之和与本期末可供分配利润之和的差额部分为正数，则本期可供分配利润的三类实现部分分别为期初未分配利润之和与本期未分配利润之和的差额部分为负数，则本期可供分配利润的金额为本期未分配利润之和（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 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 累计净值增长 (%) (%) (%) (%) (%)

过去三个月 -3.14% 1.12% -2.95% 1.12% -0.19% 0.00%

过去六个月 9.05% 1.24% 8.35% 1.24% 0.52% 0.00%

过去一年 -1.98% 1.29% -2.95% 1.30% 0.97% -0.01%

自基金合同生效 -1.20% 1.21% -10.42% 1.28% 9.22% -0.07%

同期业绩比较基准收益率

中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF)

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

(2012年5月17日至2013年12月31日)

注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起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十三部分（三）的规定，即本基金投资于沪深300等权重指数成份股及备选成份股的资产比例不低于是基金资产净值的90%，除股票以外的其他资产占基金资产的比例为5%-10%，其中现金的比例不超过基金资产净值的5%。

3.2.2 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

中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF)

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

(2012年5月17日至2013年12月31日)

注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起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十三部分（三）的规定，即本基金投资于沪深300等权重指数成份股及备选成份股的资产比例不低于是基金资产净值的90%，除股票以外的其他资产占基金资产的比例为5%-10%，其中现金的比例不超过基金资产净值的5%。

3.2.3 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

中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF)

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

(2012年5月17日至2013年12月31日)

注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起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十三部分（三）的规定，即本基金投资于沪深300等权重指数成份股及备选成份股的资产比例不低于是基金资产净值的90%，除股票以外的其他资产占基金资产的比例为5%-10%，其中现金的比例不超过基金资产净值的5%。

3.3 过往三年基金的利润分配情况

3.3.1 基金利润分配情况

3.3.2 基金利润分配政策

3.3.3 基金利润分配政策

3.3.4 基金利润分配政策

3.3.5 基金利润分配政策

3.3.6 基金利润分配政策

3.3.7 基金利润分配政策

3.3.8 基金利润分配政策

3.3.9 基金利润分配政策

3.3.10 基金利润分配政策

3.3.11 基金利润分配政策

3.3.12 基金利润分配政策

3.3.13 基金利润分配政策

3.3.14 基金利润分配政策

3.3.15 基金利润分配政策

3.3.16 基金利润分配政策

3.3.17 基金利润分配政策

3.3.18 基金利润分配政策

3.3.19 基金利润分配政策

3.3.20 基金利润分配政策

3.3.21 基金利润分配政策

3.3.22 基金利润分配政策

3.3.23 基金利润分配政策

3.3.24 基金利润分配政策

3.3.25 基金利润分配政策

3.3.26 基金利润分配政策

3.3.27 基金利润分配政策

3.3.28 基金利润分配政策

3.3.29 基金利润分配政策

3.3.30 基金利润分配政策

3.3.31 基金利润分配政策

3.3.32 基金利润分配政策

3.3.33 基金利润分配政策

3.3.34 基金利润分配政策

3.3.35 基金利润分配政策

3.3.36 基金利润分配政策

3.3.37 基金利润分配政策

3.3.38 基金利润分配政策

3.3.39 基金利润分配政策

3.3.40 基金利润分配政策

3.3.41 基金利润分配政策

3.3.42 基金利润分配政策

3.3.43 基金利润分配政策

3.3.44 基金利润分配政策

3.3.45 基金利润分配政策

3.3.46 基金利润分配政策

3.3.47 基金利润分配政策

3.3.48 基金利润分配政策

3.3.49 基金利润分配政策

3.3.50 基金利润分配政策

3.3.51 基金利润分配政策

3.3.52 基金利润分配政策

3.3.53 基金利润分配政策

3.3.54 基金利润分配政策

3.3.55 基金利润分配政策

3.3.56 基金利润分配政策

3.3.57 基金利润分配政策

3.3.58 基金利润分配政策

3.3.59 基金利润分配政策

3.3.60 基金利润分配政策

3.3.61 基金利润分配政策

3.3.62 基金利润分配政策

3.3.63 基金利润分配政策

3.3.64 基金利润分配政策

3.3.65 基金利润分配政策

3.3.66 基金利润分配政策

3.3.67 基金利润分配政策

3.3.68 基金利润分配政策

3.3.69 基金利润分配政策

3.3.70 基金利润分配政策

3.3.71 基金利润分配政策

3.3.72 基金利润分配政策