中银中小盘成长股票型证券投资基金

2014 年度报告摘要

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：二〇一五年三月二十七日

§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2015年3月25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2014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	中银中小盘成长股票
基金主代码	163818
交易代码	163818
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月23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	67,599,887.49份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对具备良好成长潜力及合理估值水平的中小盘股票的投资，在有效控制组合风险的基础上，力图实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济因素、政策导向因素、市场环境因素等，对证券市场系统性风险程度和中长期预期收益率进行动态监控，在投资范围内确定相应的大类资产配置比例；其次通过股票筛选建立基础股票池，在基础股票池的基础上，结合衡量股票成长性的定性和定量指标，精选具有良好基本面和成长潜力的中小盘股票进行投资。
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准为：中证700指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	程明	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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	26,264,799.23	36,678,218.52	10,216,204.50
本期利润	21,401,213.38	25,519,396.46	25,224,073.36
加权平均基金份额本期利润	0.2145	0.1380	0.0577
本期基金份额净值增长率	20.91%	11.56%	-5.89%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.2716	0.0522	-0.0707
期末基金资产净值	85,959,263.01	131,014,757.72	240,444,977.87
期末基金份额净值	1.272	1.052	0.943

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

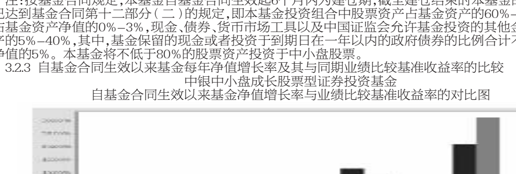
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.75%	1.32%	12.94%	1.12%	-9.19%	0.20%
过去六个月	17.67%	1.08%	32.65%	0.94%	-14.98%	0.14%
过去一年	20.91%	1.19%	31.22%	0.95%	-10.31%	0.24%
过去三年	26.95%	1.20%	45.63%	1.09%	-18.68%	0.11%
自基金合同生效起至今	27.20%	1.18%	26.51%	1.10%	0.69%	0.08%

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

中银中小盘成长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的历史走势对比图

(2011年11月23日至2014年12月31日)

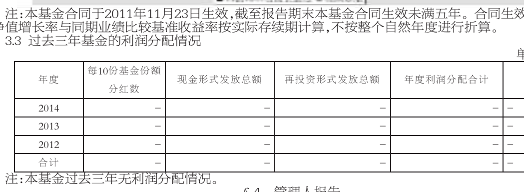


注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期，截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）的规定，即本基金投资组合中股票资产占基金资产的60%-95%，权证投资占基金资产净值的0%-3%，现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%，其中，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金将不低于80%的股票资产投资于中小盘股票。

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

中银中小盘成长股票型证券投资基金

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11月23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
2014	-	-	-	-	-
2013	-	-	-	-	-
2012	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金过去三年无利润分配情况。

§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2014年12月31日，本管理人共管理四十四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、中银持续增长股票型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金、中银动态策略股票型证券投资基金、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、中银中小盘成长股票型证券投资基金、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）、中银主题策略股票型证券投资基金、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、中银消费主题股票型证券投资基金、中银美丽中国股票型证券投资基金、中银盛利纯债一年定期开放债券型证券投资基金（LOF）、中银保本二号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、中银优秀企业股票型证券投资基金、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、中银健康生活股票型证券投资基金、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，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		
张发余	本基金的基金经理、中银价值基金基金经理、中银研究精选基金基金经理、公司研究部总经理	2014-03-07	-	13	中银基金管理有限公司研究部总经理，董事(Director)，经济学博士。曾任长江证券研究员、长江证券研究所投资策略分析师。2006年加入中银基金管理有限公司，2010年8月至今任中银价值基金基金经理，2014年3月至今任中银中小盘基金基金经理，2014年12月至今任中银研究精选基金基金经理。具有13年证券从业年限。具备基金、证券从业资格。
王涛	本基金的基金经理(已离任)	2011-11-23	2014-03-07	7	上海交通大学工科硕士。曾任东吴证券有限责任公司电脑中心工程师，阿尔卡特-朗讯中国公司销售经理。2007年加入中银基金管理有限公司，曾担任研究员。2011年11月至2014年3月任中银中小盘基金基金经理。具有7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遵规守信情况的说明

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，未发现有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

全球经济复苏不均衡是2014年的主要特征。在经历了多年的调整之后，美国的消费、就业、房地产市场出现了较为明显的改善，在全球经济复苏中一枝独秀。美联储选择了逐步退出量化宽松的货币收紧策略，美元在全球货币对比中显得格外强势。这些特征对全球经济带来较为明显的影响。一方面全球资本从新兴经济体回流美国，给新兴经济体带来了较大的冲击；另一方面，由于美元走强也带来了原油、铁矿石和其他大宗商品价格的大幅下跌，并进而使欧洲和日本的通缩加剧，尤其是欧洲和日本被迫采取了进一步量化宽松政策，以应对经济的紧缩。

中国作为新兴经济体的代表，也受到了来自全球货币政策变化的压力。人民币2014年的绝大部分时候维持相对强势，是仅次于美元的货币，强势人民币也使去向日本和欧洲的出口增速减缓。而大宗商品价格的走低，也直接和间接地导致了生产价格指数（PPI）持续走低，这进一步引致国内制造业投资增速放缓。因监管当局加强了对信托和银行资产运用的监管，也使银行和信托风险偏好发生改变，房地产产业链的资金来源出现了明显下滑，房地产投资增速出现了下滑。尽管中央政府基建投资增速保持在高位，但仅仅起到了托住经济的作用，并未使经济出现明显的扩张。消费作为滞后经济的指标，在投资和出口均未大幅扩张的情况下，也只能保持相对稳定。总之，2014年的经济是平着走的。经济本身并没有特别多的亮点。亮点在于中央政府出台了许多开创性的改革措施，给出了明确而坚定的改革信号。而预算法的通过和房地产政策的调整基本上消除了金融领域爆发系统性风险的可能性，这是2015年资本市场最大的背景。

2.行情回顾

以申万行业分类来看，全年涨幅相对居前的行业包括证券、保险、钢铁、银行、交通运输、计算机、国防军工、房地产、电力和建筑等。归纳全年上涨的行业，可以发现几个较为明显的特征。一类是体现出国家意志的行业，如国防、安全和对外经济政策的变化。从国家战略上表现为对国产软件、硬件的重视，对一路一带的重视和对军工发展的重视；二是体现出行业基本面改善，如证券、保险和电力行业，由于证券市场复苏和煤炭价格下跌带来了行业盈利的改善；三是国家政策的变化，如政策从限制走向放松，房地产领域和国企改革相关的领域。从上下半年来看，上半年主要是体现为新兴产业更受市场关注，而下半年蓝筹股票更受资本市场青睐。

3.运行分析

在报告期内，上半年年，在新兴产业上涨过程中本基金是相对受益的，但到了下半年，受制于基金合同的约束，本基金无法大规模参与到本轮蓝筹股反弹行情，没能给投资人带来理想的回报。但本基金通过组合的结构调整，逐步减持了一些基本面较弱的主题类个股，减小了组合的向下波动性。由于中小市值股票的回调，给了本基金更好的机会去挑选中长期看好的行业和个股。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日为止，本基金的单位净值为1.272元，本基金的累计单位净值为1.272元。报告期内本基金份额净值增长率为20.91%，同期业绩比较基准收益率为31.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体看来，2015年美国经济有望继续复苏，欧元区和日本经济复苏的态势有待观察，而国内经济2015年上半年仍然有维稳的压力，但下行幅度有限。根据中央经济工作会议精神，预估财政政策会适度加力，货币政策将维持相对稳健。经济有望企稳和利率逐步下行的组合仍然有利于股市表现。

按照以前年度政策发布和两会讨论热点，我们预计很多关于转型和改革的政策将会在一季度继续讨论，而关于稳定和刺激的诸多经济政策也会陆续出台。从中长期角度看，我们对新一届管理层和经济改革转型的成功有较强信心。我们行业选择和选股的方向会沿着转型和改革进行。

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

根据相关法律法规和基金合同的要求，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配6次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的20%；本基金本报告期期末可供分配利润为18,359,375.52元，未进行收益分配。

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出现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

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 徐 艳 许培菁签字出具了安永华明（2015）审字第61062100_B16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：中银中小盘成长股票型证券投资基金

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	1,684,967.27	14,321,424.58
结算备付金		288,509.11	1,060,920.97
存出保证金		55,134.71	107,029.60
交易性金融资产	7.4.7.2	83,890,480.23	117,173,439.93
其中：股票投资		73,736,591.35	107,255,439.93
基金投资		-	-
债券投资		10,153,888.88	9,918,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	261,395.27
应收利息	7.4.7.5	202,511.50	183,789.64
应收股利		-	-
应收申购款		315,983.16	373,640.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		86,437,585.98	133,481,640.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,560,241.52
应付赎回款		127,371.81	67,685.94
应付管理人报酬	7.4.10.2	116,529.57	167,595.87
应付托管费	7.4.10.2	19,421.60	27,932.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	160,472.88	488,909.56
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	54,527.11	154,516.92
负债合计		478,322.97	2,466,882.49
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	67,599,887.49	124,510,016.62
未分配利润	7.4.7.10	18,359,375.52	6,504,741.10
所有者权益合计		85,959,263.01	131,014,757.72
负债和所有者权益总计		86,437,585.98	133,481,640.21

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.272元，基金份额总额67,599,887.49份。

7.2 利润表

会计主体：中银中小盘成长股票型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		24,620,228.72	31,935,745.33
1.利息收入		519,379.38	605,013.94
其中：存款利息收入	7.4.7.11	89,687.13	218,473.59
债券利息收入		401,291.78	386,540.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		28,400.47	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		28,934,928.71	42,313,087.66
其中：股票投资收益	7.4.7.12	27,864,320.39	40,942,791.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	24,150.00	-1,343.10
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,046,458.32	1,371,639.09
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-4,863,585.85	-11,158,822.06
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	29,506.48	176,465.79
减：二、费用		3,219,015.34	6,416,348.87
1.管理人报酬	7.4.10.2	1,686,517.51	2,812,461.66
2.托管费	7.4.10.2	281,086.22	468,743.68
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	1,043,891.31	2,781,448.58
5.利息支出		1,713.41	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,713.41	-
6.其他费用	7.4.7.19	205,806.89	353,694.95
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		21,401,213.38	25,519,396.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		21,401,213.38	25,519,396.46

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银中小盘成长股票型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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）	124,510,016.62	6,504,741.10	131,014,757.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	21,401,213.38	21,401,213.38
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）	-56,910,129.13	-9,546,578.96	-66,456,708.09
其中：1.基金申购款	24,199,533.62	4,129,206.98	28,328,740.60
2.基金赎回款	-81,109,662.75	-13,675,785.94	-94,785,448.69
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）	67,599,887.49	18,359,375.52	85,959,263.01

项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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）	255,001,370.57	-14,556,392.70	240,444,977.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,519,396.46	25,519,396.46
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）	-130,491,353.95	-4,458,262.66	-134,949,616.61
其中：1.基金申购款	12,555,660.76	185,039.00	12,740,699.76
2.基金赎回款	-143,047,014.71	-4,643,301.66	-147,690,316.37
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）	124,510,016.62	6,504,741.10	131,014,757.72

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：乔炳亚，会计机构负责人：乐妮

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中银中小盘成长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[2011]820号文《关于核准中银中小盘成长股票型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募集，基金合同于2011年11月23日正式生效，首次设立募集规模为3,045,725,983.68 份基金份额。本基金为契约型开放式，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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的A股股票（包含中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金的业绩比较基准为：中证700 指数×80%＋上证国债指数×20%。

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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月，财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》；上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月，财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》，在2014年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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2014年12月31日的财务状况以及2014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

会计政策变更的说明可参见7.4.2会计报表的编制基础。上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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

会计政策变更的说明可参见7.4.2会计报表的编制基础。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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。

7.4.7 关联方关系

项目	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
招商银行股份有限公司("招商银行")	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
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：报告期内，基金管理人子公司中银资产管理有限公司于2014年9月正式成立，基金管理人持有其100%股份。

以下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

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中银证券	28,607,253.25	4.25%	66,242,006.49	3.69%

7.4.8.1.2 权证交易

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权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

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债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

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回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中银证券	26,044.34	4.33%	26,044.34	16.26%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中银证券	58,899.22	3.65%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,686,517.51	2,812,461.66
其中：支付销售机构的客户维护费	683,516.65	1,138,064.40

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×1.50%÷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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	281,086.22	468,743.68

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×0.25%÷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。

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

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	1,684,967.27	82,136.43	14,321,424.58	204,804.26

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，2014年度获得的利息收入为人民币6,265.13元（2013年度：人民币11,630.00元），2014年末结算备付金余额为人民币288,509.11元（2013年末：人民币1,060,920.97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（2014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	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002152	广电运通	2014-12-17	重大事项	22.15	2015-03-11	24.37	101,900	1,845,268.00	2,257,085.00	-
002168	深圳惠程	2014-11-28	重大事项	10.13	2015-01-28	9.51	54,400	510,685.00	551,072.00	-
002396	星网锐捷	2014-10-20	重大资产重组	27.31	2015-02-09	30.04	35,570	1,016,683.58	971,416.70	-
600754	锦江股份	2014-11-10	重大资产重组	25.11	2015-01-19	27.00	19,823	475,746.00	497,755.53	-
300315	掌趣科技	2014-07-14	重大事项	19.59	2015-02-16	17.41	130,720	2,322,980.00	2,560,804.80	-

注：掌趣科技于2013年8月14日非公开发行限售流通股212,875,622 股，该部分限售流通股应于2014年8月15日上市流通，但由于重大资产重组事项，掌趣科技于2014年7月14日停牌，截至2014年12月31日仍未复牌。掌趣科技于2015年2月16日复牌并于2015年2月17日发布公告，2013年8月14日发行的限售流通股于2015年2月26日可上市流通。

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2014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抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014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

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2014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工具中属于第一层次的余额为人民币67,045,346.20元，属于第二层次的余额为人民币16,845,134.03元，无属于第三层次的余额。

7.4.14.1.2.2公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

2014年度，对于以公允价值计量的金融工具，由第一层次转入第二层次的投资的金额为人民币3,204,432.00元，无由第二层次转入第一层次的投资。

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2015年3月26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	73,736,591.35	85.31
	其中：股票	73,736,591.35	85.31
2	固定收益投资	10,153,888.88	11.75
	其中：债券	10,153,888.88	11.75
	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	1,973,476.38	2.28
7	其他各项资产	573,629.37	0.66
8	合计	86,437,585.98	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,260,295.48	3.79
B	采矿业	-	-
C	制造业	48,775,741.92	56.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,258,390.02	2.63
F	批发和零售业	1,848,594.00	2.15
G	交通运输、仓储和邮政业	2,205,359.00	2.57
H	住宿和餐饮业	497,755.53	0.58
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,560,804.80	2.98
J	金融业	1,858,986.00	2.16
K	房地产业	6,240,514.60	7.26
L	租赁和商务服务业	1,145,520.00	1.33
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	1,095,258.00	1.27
S	综合	1,989,372.00	2.31
	合计	73,736,591.35	85.78

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	002358	森源电气	131,300	4,595,500.00	5.35
2	000024	招商地产	160,340	4,231,372.60	4.92
3	300315	掌趣科技	130,720	2,560,804.80	2.98
4	002431	棕榈园林	106,982	2,258,390.02	2.63
5	002152	广电运通	101,900	2,257,085.00	2.63
6	002005	德豪润达	284,400	2,255,292.00	2.62
7	002385	大北农	157,684	2,116,119.28	2.46
8	002146	荣盛发展	126,600	2,009,142.00	2.34
9	600784	鲁银投资	215,300	1,989,372.00	2.31
10	600271	航天信息	64,600	1,970,946.00	2.29

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	000024	招商地产	8,584,898.69	6.55
2	002358	森源电气	8,476,115.79	6.47
3	002375	亚厦股份	5,510,975.63	4.21
4	600261	阳光照明	5,401,140.46	4.12
5	002241	歌尔声学	5,256,494.74	4.01
6	600000	浦发银行	4,361,416.00	3.33
7	002146	荣盛发展	4,117,215.00	3.14
8	002089	新 海 宜	4,030,656.46	3.08
9	002449	国星光电	3,868,089.01	2.95
10	600690	青岛海尔	3,834,353.88	2.93
11	002450	康得新	3,589,459.80	2.74
12	300315	掌趣科技	3,561,807.66	2.72
13	000513	丽珠集团	3,442,496.43	2.63
14	002477	雏鹰农牧	3,439,844.94	2.63
15	002385	大北农	3,324,507.21	2.54
16	600584	长电科技	3,272,657.34	2.50
17	002185	华天科技	3,209,468.84	2.45
18	600880	博瑞传播	3,196,755.56	2.44
19	002392	北京利尔	3,146,860.85	2.40
20	002273	水晶光电	3,113,962.58	2.38
21	000656	金科股份	3,087,903.21	2.36
22	002005	德豪润达	3,014,493.10	2.30
23	000783	长江证券	2,899,257.20	2.21
24	300285	国瓷材料	2,837,635.46	2.17
25	002250	联化科技	2,759,121.08	2.11
26	600839	四川长虹	2,754,582.00	2.10
27	600369	西南证券	2,693,962.00	2.06
28	600383	金地集团	2,626,016.42	2.00

注："买入金额"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。

8.4.2 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	000024	招商地产	6,708,476.86	5.12
2	002375	亚厦股份	6,272,132.80	4.79
3	002185	华天科技	6,092,911.44	4.65
4	000581	威孚高科	5,950,882.55	4.54
5	002396	星网锐捷	5,641,429.30	4.31
6	600261	阳光照明	5,394,681.19	4.12
7	002241	歌尔声学	5,374,857.98	4.10
8	002605	姚记扑克	5,373,365.52	4.10
9	000811	烟台冰轮	5,278,115.86	4.03
10	600000	浦发银行	5,005,791.47	3.82
11	000783	长江证券	4,968,184.16	3.79
12	002527	新时达	4,845,566.34	3.70
13	002139	拓邦股份	4,797,612.84	3.66
14	002358	森源电气	4,786,254.23	3.65
15	000049	德赛电池	4,357,889.18	3.33
16	002450	康得新	4,143,044.64	3.16
17	002104	恒宝股份	4,111,633.71	3.14
18	002449	国星光电	3,957,553.36	3.02
19	002055	得润电子	3,803,733.92	2.90
20	002197	证通电子	3,696,803.93	2.82
21	300034	钢研高纳	3,695,245.71	2.82
22	002392	北京利尔	3,669,082.90	2.80
23	300024	机器人	3,614,804.86	2.76
24	000656	金科股份	3,545,749.78	2.71
25	000997	新 大 陆	3,448,261.99	2.63
26	002437	誉衡药业	3,317,537.09	2.53
27	600839	四川长虹	3,260,950.07	2.49
28	000513	丽珠集团	3,234,636.70	2.47
29	002273	水晶光电	3,217,964.24	2.46
30	600584	长电科技	3,128,021.29	2.39
31	002158	汉钟精机	3,116,468.59	2.38
32	600880	博瑞传播	3,111,775.15	2.38
33	002250	联化科技	3,096,314.82	2.36
34	002465	海格通信	3,048,078.66	2.33
35	002035	华帝股份	3,045,368.39	2.32
36	002642	荣之联	3,045,091.52	2.32
37	002089	新 海 宜	3,026,947.69	2.31
38	002007	华兰生物	2,912,704.07	2.22
39	002315	焦点科技	2,877,603.31	2.20
40	002281	光迅科技	2,875,162.63	2.19
41	300075	数字政通	2,846,114.61	2.17
42	600557	康缘药业	2,820,069.50	2.15
43	600383	金地集团	2,781,101.42	2.12
44	600809	山西汾酒	2,757,025.78	2.10
45	002169	智光电气	2,738,625.66	2.09
46	600570	恒生电子	2,723,565.59	2.08
47	002318	久立特材	2,718,041.00	2.07
48	600048	保利地产	2,697,631.22	2.06
49	600460	士兰微	2,694,733.19	2.06
50	300054	鼎龙股份	2,691,503.23	2.05
51	300285	国瓷材料	2,660,017.42	2.03
52	600690	青岛海尔	2,649,635.14	2.02
53	000915	山大华特	2,648,828.72	2.02
54	002405	四维图新	2,635,658.92	2.01

注："卖出金额"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。

8.4.3 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

序号	308,253,440.70
卖出股票的收入(成交)总额	364,666,354.94

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	10,007,000.00	11.64
	其中：政策性金融债	10,007,000.00	11.64
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	146,888.88	0.17
8	其他	-	-
9	合计	10,153,888.88	11.81

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	140218	14国开18	100,000	10,007,000.00	11.64
2	128009	歌尔转债	1,187	146,888.88	0.17

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

本基金本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报告期内，本基金投资的前十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	55,134.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	202,511.50
5	应收申购款	315,983.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	573,629.37

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300315	掌趣科技	2,560,804.80	2.98	重大事项停牌
2	002152	广电运通	2,257,085.00	2.63	重大事项停牌

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
2,924	23,118.98	9,364,908.31	13.85%	58,234,979.18	86.15%

9.2 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	103,995.27	0.1538%

9.3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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	3,045,725,983.68
本报告期期初基金份额总额	124,510,016.62
本报告期基金总申购份额	24,199,533.62
减：本报告期基金总赎回份额	81,109,662.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	67,599,887.49

§11 重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

本报告期内没有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，基金管理人无重大人事变动。

2014年11月14日，本基金托管人发布《关于招商银行股份有限公司姜然基金托管人高级管理人员任职资格及吴晓辉离任的公告》，吴晓辉同志不再担任招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理职务；聘任姜然同志为招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理。

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管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略没有发生改变。

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2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监管部门稽查或处罚。

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	
国联证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	215,237,940.37	31.99%	190,464.33	31.67%	-
国信证券	1	193,042,673.23	28.69%	170,823.92	28.41%	-
国泰君安	2	92,222,030.79	13.70%	83,958.17	13.96%	-
中信建投证券	1	46,611,827.11	6.93%	42,435.14	7.06%	-
长江证券	1	35,383,787.02	5.26%	32,213.38	5.36%	-
中银证券	2	28,607,253.25	4.25%	26,044.34	4.33%	-
华泰证券	2	18,891,004.81	2.81%	16,716.64	2.78%	-
东兴证券	1	18,373,414.34	2.73%	16,727.13	2.78%	-
宏源证券	1	15,827,060.21	2.35%	14,005.38	2.33%	-
财富里昂证券	1	7,773,032.55	1.16%	7,076.49	1.18%	-
齐鲁证券	1	949,771.96	0.14%	864.68	0.14%	-

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。

11.7.2 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
国泰君安	-	-	10,000,000.00	5.05%	-	-
中信建投证券	-	-	7,000,000.00	3.53%	-	-
长江证券	-	-	181,100,000.00	91.42%	-	-

中银基金管理有限公司

二〇一五年三月二十七日