

中银美丽中国混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2016年第1号）

基金管理人：中银基金管理有限公司
基金托管人：中国民生银行股份有限公司
二〇一六年一月
重要提示

本基金经2013年4月7日中国证券监督管理委员会证监许可【2013】313号文核准募集，基金合同于2013年6月7日正式生效。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、本基金的特定风险、操作或技术风险、合规性风险和其他风险等。本基金是股票型证券投资基金，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，其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其认可基金合同的承认和接受，并授权《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本更新招募说明书所载内容截止日为2015年12月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日（财务数据未经过审计）。本基金托管人中国民生银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

一、基金合同生效日
2013年6月7日
二、基金管理人
（一）基金管理人概况
公司名称：中银基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼
法定代表人：潭源
设立日期：2004年8月12日
电话：（021）38834999
传真：（021）68872488
联系人：高爽秋
注册资本：1亿元人民币
股权结构：

股 东	出资额	占注册资本比例
中国银行股份有限公司	人民币R350万元	83.5%
贝莱德投资管理（美国）有限公司	相当于人民币1650万元的美元	16.5%

（二）主要人员情况
1、董事会成员
白志中（BAI Zhizhong）先生，董事长。上海交通大学工商管理专业硕士，高级经济师。历任中国银行山西省分行综合计划处处长及办公室主任，中国银行宁夏回族自治区分行行长、党委书记，中国银行广西壮族自区分行行长、党委书记，中国银行四川省分行行长、党委书记，中国银行广东省分行行长、党委书记等职。现任中银基金管理有限公司董事长。
李道滨（LI Daobin）先生，董事。清华大学法学博士。2000年10月至2012年4月任职于嘉实基金管理有限公司，历任基金管理部副总、总监、总经理助理和公司副总经理。现任中银基金管理有限公司执行总裁。

赵春霖（ZHAO Chuntang）先生，董事。南开大学世界经济专业硕士。历任中国银行国际金融研究所干部，中国银行董事会秘书部副处长、主管，中国银行上海市办公室主任，中国银行江西省分行行长助理、副行长、党委委员、中国银行个人金融总部副总经理等职。现任中国银行财富管理与私人银行部副总经理（主持工作）。

宋福宁（SONG Funing）先生，董事。厦门大学经济学硕士、经济师。历任中国银行福建省分行资金计划处外汇交易科科长、资金计划处副科长、资金业务部负责人、资金业务部总经理，中国银行总行金融市场总部助理总经理，中国银行总行投资银行与资产管理部助理总经理等职。现任中国银行投资银行与资产管理部副总经理。

葛伟岱（David Graham）先生，董事。葛伟岱先生于1977年—1994年供职于Deloitte Haskins & Sells（现为普华永道）伦敦和悉尼分公司，之后，在拉扎兹（Lazards）银行伦敦、香港和东京分公司任职。1992年，加入美林投资管理有限公司（MLIM），曾担任欧洲、中东、非洲、太平洋地区客户关系部门的负责人。2006年贝莱德与美林投资管理有限公司合并后，加入贝莱德。现任贝莱德投资管理有限公司董事总经理，主要负责管理贝莱德合资企业关系方面的事务。

荆新，中国籍，1967年生，中共党员，会计学博士，中国人民大学商学院会计系教授、博士生导师，兼任中国会计学会理事、财政部政府会计准则委员会顾问、全国MPAcc教指委副主任委员、中国青少年发展基金会监事。

赵欣阿（ZHAO Xinge）先生，独立董事。美国西北大学经济学博士。曾在美国威廉与玛丽学院商学院任教，并曾为美国投资公司协会（美国共同基金行业协会）等公司和机构提供咨询。现任中欧国际工商学院金融学与会计学教授、副教授兼和金融MBA主任，并在中国的数家上市公司和金融投资公司担任独立董事。

雷晓波（Edward Radcliffe）先生，独立董事。法国INSEAD工商管理硕士。曾任白狐技术有限公司总经理，目前仍担任该公司的咨询顾问。在此之前，曾任英国电信集团零售部助理经理，贝特伯恩顾问公司董事、北京代表处首席代表、总经理，中英商会财务司库、英中贸易协会理事会成员。现任银珠合伙人有限公司合伙人。

2、监事
赵经纬（ZHAO Huiping）先生，监事。国籍：中国。中央党校经济管理专业本科、人力资源管理师、经济师。曾任中国银行人力资源部信息团队主管、中国银行人力资源部综合处副处长、处长、人事部部长干部处干部、副处长。
乐妮（YUE Ni）女士，职工监事。国籍：中国。上海交通大学工商管理硕士。曾分别就职于上海浦东发展银行、山西证券有限责任公司、友邦华泰基金管理公司。2006年7月加入中银基金管理有限公司，现任基金运营部总经理。具有14年证券从业年限，11年基金行业从业经验。

3、管理层成员
李道滨（LI Daobin）先生，董事、执行总裁。简历见董事会成员介绍。

欧阳向军（Jason X. OUYANG）先生，督察长。国籍：加拿大。中国证券业协会—沃顿商学院高级管理培训班（Wharton-SAC Executive Program）毕业证书，加拿大西部大学毅伟商学院（Vey School of Business，Western University）工商管理硕士（MBA）和经济学硕士。曾在加拿大太平洋银行集团、加拿大中银商业银行和加拿大伦敦人寿保险公司等海外机构从事金融工作多年，也曾任加拿大证券有限责任公司（现英大证券）研究发展中心总经理、融通基金管理公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦大学国际金融系国际金融教研室主任、讲师。

张家文（ZHANG Jiawen）先生，副执行总裁。国籍：中国。西安交通大学工商管理硕士，历任中国银行苏州分行太仓支行副行长、苏州分行风险管理处处长、苏州分行工业园区支行行长、苏州分行副行长、党委委员。

陈军（CHEN Jun）先生，副执行总裁。国籍：中国。上海交通大学工商管理硕士、美国伊利诺伊大学金融学硕士。2004年加入中银基金管理有限公司，历任基金经理、权益投资部总经理、助理执行总裁。

4、基金经理
陈军（CHEN Jun）先生，中银基金管理有限公司副执行总裁，金融学硕士。曾任中信证券股份有限公司资产管理部项目经理。2004年加入中银基金管理有限公司，2006年10月至今任中银收益基金基金经理，2009年9月至2013年10月任中银中证100指数基金基金经理，2013年6月至今任中银美丽中

国基金基金经理，2013年8月至今任中银中国基金基金经理。特许金融分析师（CFA），香港财经分析师协会会员。具有17年证券从业年限。具备基金从业资格。

王伟（WANG Wei）先生，中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），工学硕士。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2月至今任中银美丽中国基金基金经理，2015年3月至今任中银中小盘基金基金经理，2015年5月至今任中银优选基金基金经理，2015年6月至今任中银智能制造基金基金经理。具有5年证券从业年限。具备基金从业资格。

5、投资决策委员会成员的姓名及职务
主席：李道滨（执行总裁）
成员：陈军（副执行总裁）、杨军（资深投资经理）、奚鹏洲（固定收益投资部总经理）、李建（固定收益投资部副总经理）列席成员：欧阳向军（督察长）
6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人
（一）基金托管人概况
名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）
住所：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
成立时间：1996年2月7日
基金托管业务批准文号：证监基金字〔2004〕101号
组织形式：股份有限公司（上市）
注册资本：28,365,585,227元人民币
存续期间：持续经营
电话：010—58560666
联系人：赵天圣
（二）主要人员情况
杨春萍：女，北京大学本科、硕士。资产托管部副总经理。曾就职于中国建设银行总行，意大利联合信贷银行北京代表处，中国民生银行金融市场部和资产托管部，历任中国建设银行总行业务经理，意大利联合信贷银行北京代表处代表，中国民生银行金融市场部处长、资产托管部总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）等职务。具有近三十年的金融从业经历，丰富的外资银行工作经验，具有广阔的视野和前瞻性的战略眼光。

（三）基金托管业务经营情况
中国民生银行银行股份有限公司于2004年7月9日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工60人，平均年龄36岁，100%员工拥有大学本科以上学历，80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员100%都具有基金从业资格。

截止到2015年9月30日，本行共托管基金62只，分别为天治品质优选混合型证券投资基金、融通易支付货币市场证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、天治天得利货币市场基金、东方金鼎货币市场基金、长信增长动态策略证券投资基金、华商领先企业混合型证券投资基金、银华深证100指数分级证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、光大德信信用添益债券型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、建信深证基本面60开放式指数分级证券投资基金、建信深证基本面60交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、工银瑞信睿晋深证100指数分级证券投资基金、农银汇理行业轮动股票型证券投资基金、建信月盈安安心理财货币型证券投资基金、中银美丽中国股票型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增值18个月定期开放债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、德邦德利货币市场基金、中银互利分级债券型证券投资基金、工银瑞信添福货币型证券投资基金、中银中高等级债券型证券投资基金、汇添富全额宝货币市场证券投资基金、国金通用金腾货币市场证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、摩根士丹利华鑫德利稳健添利18个月定期开放债券型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、兴业多策略灵活配置混合型固定收益型证券投资基金、德邦新动力灵活配置混合型证券投资基金、兴业年年利定期开放债券型证券投资基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金、德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金、兴业聚利灵活配置证券投资基金基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发安鑫回报混合型证券投资基金、广发安盛回报混合型证券投资基金、兴业聚兴灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫利稳健灵活配置混合型证券投资基金、国金通用上证50指数分级证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值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、交银施罗德荣和保本混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、东方赢家保本混合型证券投资基金、中欧添钱宝发起式货币市场基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信财富快线货币市场基金、泰康新意宝货币市场基金、摩根士丹利华鑫新利通灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、东方新思略灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫裕回报灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、托管基金资产净值为1429.29亿元。

四、相关服务机构
（一）基金份额发售机构
1、直销机构
名称：中银基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、45楼
法定代表人：潭源
电话：（021）38834999
传真：（021）68872488
联系人：徐琳
2、其他销售机构
（1）中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客户服务电话：95566
联系人：宋亚平
网址：www.boc.cn
（2）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
客户服务电话：95568
联系人：姚建英
公司网站：www.cmbc.com.cn
（3）交通银行股份有限公司
注册地址：上海银城中路189号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客户服务电话：95559
联系人：曹榕
网址：www.bankcomm.com
（4）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号中山大厦邮政编码：350003
法定代表人：高建平
联系人：李博
联系电话：95561
公司网站：www.cib.com.cn/
（5）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼20

楼、45楼
法定代表人：潭源
电话：（021）38834999
传真：（021）68872488
联系人：徐琳
2、其他销售机构
（1）中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客户服务电话：95566
联系人：宋亚平
网址：www.boc.cn
（2）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
客户服务电话：95568
联系人：姚建英
公司网站：www.cmbc.com.cn
（3）交通银行股份有限公司
注册地址：上海银城中路189号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客户服务电话：95559
联系人：曹榕
网址：www.bankcomm.com
（4）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号中山大厦邮政编码：350003
法定代表人：高建平
联系人：李博
联系电话：95561
公司网站：www.cib.com.cn/
（5）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼20

楼、45楼
法定代表人：潭源
电话：（021）38834999
传真：（021）68872488
联系人：徐琳
2、其他销售机构
（1）中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客户服务电话：95566
联系人：宋亚平
网址：www.boc.cn
（2）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
客户服务电话：95568
联系人：姚建英
公司网站：www.cmbc.com.cn
（3）交通银行股份有限公司
注册地址：上海银城中路189号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客户服务电话：95559
联系人：曹榕
网址：www.bankcomm.com
（4）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号中山大厦邮政编码：350003
法定代表人：高建平
联系人：李博
联系电话：95561
公司网站：www.cib.com.cn/
（5）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼20

楼、45楼
法定代表人：潭源
电话：（021）38834999
传真：（021）68872488
联系人：徐琳
2、其他销售机构
（1）中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客户服务电话：95566
联系人：宋亚平
网址：www.boc.cn
（2）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
客户服务电话：95568
联系人：姚建英
公司网站：www.cmbc.com.cn
（3）交通银行股份有限公司
注册地址：上海银城中路189号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客户服务电话：95559
联系人：曹榕
网址：www.bankcomm.com
（4）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号中山大厦邮政编码：350003
法定代表人：高建平
联系人：李博
联系电话：95561
公司网站：www.cib.com.cn/
（5）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼20

楼、45楼
法定代表人：潭源
电话：（021）38834999
传真：（021）68872488
联系人：徐琳
2、其他销售机构
（1）中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客户服务电话：95566
联系人：宋亚平
网址：www.boc.cn
（2）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
客户服务电话：95568
联系人：姚建英
公司网站：www.cmbc.com.cn
（3）交通银行股份有限公司
注册地址：上海银城中路189号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客户服务电话：95559
联系人：曹榕
网址：www.bankcomm.com
（4）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号中山大厦邮政编码：350003
法定代表人：高建平
联系人：李博
联系电话：95561
公司网站：www.cib.com.cn/
（5）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼20

楼、45楼
法定代表人：潭源
电话：（021）38834999
传真：（021）68872488
联系人：徐琳
2、其他销售机构
（1）中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客户服务电话：95566
联系人：宋亚平
网址：www.boc.cn
（2）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
客户服务电话：95568
联系人：姚建英
公司网站：www.cmbc.com.cn
（3）交通银行股份有限公司
注册地址：上海银城中路189号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客户服务电话：95559
联系人：曹榕
网址：www.bankcomm.com
（4）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号中山大厦邮政编码：350003
法定代表人：高建平
联系人：李博
联系电话：95561
公司网站：www.cib.com.cn/
（5）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼20

楼、45楼
法定代表人：潭源
电话：（021）38834999
传真：（021）68872488
联系人：徐琳
2、其他销售机构
（1）中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客户服务电话：95566
联系人：宋亚平
网址：www.boc.cn
（2）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
客户服务电话：95568
联系人：姚建英
公司网站：www.cmbc.com.cn
（3）交通银行股份有限公司
注册地址：上海银城中路189号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客户服务电话：95559
联系人：曹榕
网址：www.bankcomm.com
（4）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号中山大厦邮政编码：350003
法定代表人：高建平
联系人：李博
联系电话：95561
公司网站：www.cib.com.cn/
（5）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼20

楼、45楼
法定代表人：潭源
电话：（021）38834999
传真：（021）68872488
联系人：徐琳
2、其他销售机构
（1）中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客户服务电话：95566
联系人：宋亚平
网址：www.boc.cn
（2）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
客户服务电话：95568
联系人：姚建英
公司网站：www.cmbc.com.cn
（3）交通银行股份有限公司
注册地址：上海银城中路189号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客户服务电话：95559
联系人：曹榕
网址：www.bankcomm.com
（4）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号中山大厦邮政编码：350003
法定代表人：高建平
联系人：李博
联系电话：95561
公司网站：www.cib.com.cn/
（5）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼20

楼、45楼
法定代表人：潭源
电话：（021）38834999
传真：（021）68872488
联系人：徐琳
2、其他销售机构
（1）中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客户服务电话：95566
联系人：宋亚平
网址：www.boc.cn
（2）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
客户服务电话：95568
联系人：姚建英
公司网站：www.cmbc.com.cn
（3）交通银行股份有限公司
注册地址：上海银城中路189号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客户服务电话：95559
联系人：曹榕
网址：www.bankcomm.com
（4）兴业银行股份有限公司
注册地址：福州市湖东路154号中山大厦邮政编码：350003
法定代表人：高建平
联系人：李博
联系电话：95561
公司网站：www.cib.com.cn/
（5）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市民生路1199弄证大五道口广场1号楼20

客服电话：95523
公司网站：www.swhysc.com
（7）中国国际证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F
法定代表人：许刚
联系人：马瑾
联系电话：61195566
公司网站：www.bocichina.com
（8）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
联系人：芮敏祺
客服电话：95521
公司网站：www.gtja.com
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
电话：（010）59378835
传真：（010）59378907
联系人：任瑞新
（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：上海通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
经办律师：吕江、孙睿
联系人：孙睿
（四）审计基金财产的会计师事务所
名称：安永华明会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
执行事务合伙人：吴港平
电话：010—58153000
传真：010—58188298
联系人：汤竣
经办会计师：汤竣、许培菁
五、基金名称
中银美丽中国混合型证券投资基金
六、基金的类型
契约型开放式
七、基金的投资目标
本基金主要投资于美丽中国主题相关的上市公司股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的中长期稳定增值。

八、基金的投资范围
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股票（含中小板、创业板及其它中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具以及法律法规和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）。
本基金为股票型基金，基金投资组合中股票资产占基金资产的60%—95%，其中投资于本基金定义的美丽中国主题相关的股票不低于基金非现金资产的80%，权证投资占基金资产净值的0%—3%，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%。

如法律法规或监管机构以后将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。

九、投资策略
1、大类资产配置策略
本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。

在大类资产配置中，本基金主要考虑（1）宏观经济指标，包括国内经济和国内经济的GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等，以判断阶段性的最优资产；（2）微观经济指标，包括市场资金供求状况、不同类资产的盈利变化情况以及盈利预期等；（3）市场方面指标，包括市场成交额、估值水平、股票及债券市场的涨跌及预期收益水平以及反映投资者情绪的技术指标等；（4）政策因素，包括宏观政策、资本市场相关政策和美丽中国主题相关政策等的出台对市场的影响等。

2、股票投资策略
（1）美丽中国主题类股票的界定
本基金对美丽中国主题范畴的投资范围界定为：在十八大报告提出生态文明建设作为社会文明现代化建设中五位一体总体布局的长期政策利好下，从环境保护、环境治理、园林建设、园林装饰、生态建设、生态修复、污染防治等为主营业务，提供相关设备、技术、产品、服务等与美丽中国之美丽国家（地绿、天蓝、水净）相关的环保行业和企业；和地产、建筑、医药、电子、传媒、旅游、食品饮料、水、电力、可选消费、金融、文体、文化等与美丽中国之美好生活相关的基础行业和企业；以及节约能源和资源、新能源、新材料、新技术、新模式等为美丽中国提供持续推动力的新能源和新服务相关行业和企业。

未来随着经济增长方式转变和产业结构升级，从事或受益于上述投资主题的外延将会逐渐扩大，本基金将视实际情况调整上述对美丽中国主题类股票的识别及认定。
（2）美丽中国主题选股策略
本基金将对经济转型过程中直接从事生态文明建设的行业，以及投资或受益于美丽中国发展的行业进行跟踪分析，不断发掘投资机会。

本基金将分别从以下三个方面对美丽中国的各个子行业进行分析：
1）政策影响分析：根据国家产业政策、财政税收政策、货币政策等变化，分析各项政策对美丽中国主题各子行业的影响，超配受益于国家政策较大的子行业。
2）技术优势分析：对公司在新材料开发、原材料消耗、材料回收和再利用、废物管理等方面的核心技术或专利进行分析。技术进步情况影响投资主体的投资周期长短。本基金将密切跟踪各细分市场上市公司技术水平变化及其发展趋势，重点关注整体技术水平提高较快且发展趋势良好的投资标的。
3）市场需求求变化：美丽中国主题各细分市场面对的客户不同，市场需求的特点也有明显差异。不同于行业在竞争格局、定价优势等方面的差异，最终影响到盈利水平。本基金将重点投资市场需求稳定或保持较高增长的细分子行业。

（3）个股投资策略
本基金在行业配置的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的办法，挑选出受惠于美丽中国发展的优质上市公司。
1）定性分析
本基金对上市公司的竞争优势进行定性评估。上市公司在行业中的相对竞争力是决定投资价值的重要依据，主要包括以下几个方面：
A、公司的竞争优势：重点考察公司的市场位置，包括市场地位和市场份额，在细分市场是否占据领先地位，是否具有品牌号召力或较高的行业知名度，在营销渠道及营销网络方面的优势和发展潜力等；资源优势，包括是否拥有独特优势的物资或非物质资源，比如市场资源、专利技术等等；产品优势，包括是否拥有独特的、难以模仿的产品，对产品的定价能力等以及其他优势，例如是否受到中央或地方政府政策的扶持等因素；
B、公司的盈利模式：对企业盈利模式的考察重点关注企业盈利模式的盈利性以及成熟程度，考察核心竞争力的不可复制性、可持续性、稳定性；
C、公司治理方面：考察上市公司是否有清晰、合理、可执行的发展战略；是否具有合理的治理结构，管理团队是否团结高效、经验丰富，是否有进取精神等。

2）定量分析
本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、财务指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具有成长优势、财务优势和估值优势个股。
A、成长性指标：收入增长率、营业利润增长率和净利润增长率等；
B、财务指标：毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率、经营活动净收益/利润总额等；
C、估值指标：市盈率（PE）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）和总市值。

3、债券投资策略
依据资产配置结果，本基金将在部分阶段以改善组合风险构成作为出发点配置债券资产。首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期和期限结构配置；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等综合因素确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。

（1）久期管理
债券久期是债券组合管理的核心环节，是提高收益、控制风险的有效手段。衡量利率变化对债券组合资产价值影响的一个重要指标即为债券组合的久期。本基金将在对国内宏观经济要素变化趋势进行分析和判断的基础上，通过有效控制风险，基于对利率水平的预测和股票基金中债券投资相对被动的特点，进行以“目标久期”为中心的资产配置，以收益性和安全性为导向配置债券组合。

（2）期限结构配置
在组合久期既定的情况下，债券投资组合的期限配置是债券资产配置的一个重要环节。由于期限不同，债券对市场利率的敏感程度也不同，本基金将结合对收益率曲线变化的预测，采取下面的几种策略进行期限结构配置：首先采取主动型策略，直接进行期限结构配置，通过分析和情景测试，确定长、中、短期三种债券的投资比例。然后与数量化方法相结合，结合对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断，适时采用不同投资组合中债券的期限结构配置。

（3）确定类属配置
收益率利差策略是债券资产在类属间的主要配置策略。按照市场的划分，可以将债券分为银行间债券与交易所债券，按照发行主体划分，又可以将债券分为国债、金融债、企业债、可转债、资产支持证券等。本基金考察债券品种的相对价值是以其收益为基础，以其历史价格关系的数量分析为依据，同时兼顾相关类属的基本面分析。本基金在充分考虑不同类型债券流动性、税收、以及信用风险等因素基础上，进行类属的配置，优化组合收益。

（4）个债选择
本基金在综合考虑上述配置原则基础上，通过对个体券种的价值分析，重点考察各券种的收益率、流动性、信用等级、选择相应的最优投资对象。本基金还将采取积极主动的策略，针对市场定价失误和回购套利机会等，在确定存在超额收益的情况下，积极把握市场机会。本基金在已有组合基础上，根据对未来市场预期的变化，持续运用上述策略对债券组合进行动态调整。

4、现金管理
在现金管理上，本基金通过对未来现金流的预测进行现金预算管理，及时满足本基金运作中的流动性需求。

5、权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具。在进行权证投资时，基金管理人将通过对权证正价证券的基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性，通过限额投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。基金管理人将充分考量权证资产收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求稳定的当期收益。
十、业绩比较基准
本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%＋中债综合指数收益率×20%。

沪深300指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数；该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，不易被操纵，并且有较高的知名度和市场影响力。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

如果今后证券市场中有其他代表性更强，或者指数编制单位停止编制该指数，或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况在履行适当的程序并经基金托管人同意后对业绩比较基准进行相应调整，而无需召开基金份额持有人大会。

十一、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。

十二、投资组合报告
本基金管理人的董事会及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责任。

本基金的托管人——中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年12月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2015年9月30日，本报告所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况				
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	
1	权益投资	32,860,236.79	63.69	
	其中：股票	32,860,236.79	63.69	
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	18,663,140.70	36.12	
7	其他各项资产	150,727.11	0.29	
8	合计	51,474,104.60	100.00	

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合			
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	--	--
B	采矿业	--	--
C	制造业	7,578,202.35	14.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	481,200.00	0.94
F	批发和零售业	4,847,388.60	9.47
G	交通运输、仓储和邮政业	2,087,713.18	4.06
H	住宿和餐饮业	300,000.00	0.59
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,338,283.00	4.57
J	金融业	1,830,230.94	3.58
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	8,320,857.72	16.26
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	1,521,540.00	2.97
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	3,564,821.00	6.96
S	综合	--	--
	合计	32,860,236.79	64.22