

# 中银智能制造股票型证券投资基金

## 2015 年度 报告 摘要

分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 审计报告

本报告期内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 源、 张哲青出具了无保留意见(报告编号:0100210),审计报告全文刊登在投资者可通过指定信息披露网站查阅本年度报告全文。

5 7 年度财务报表

71 资产负债表

会计主体:中银智能制造股票型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产

2015年12月31日

资产:

银行存款 131,941,295.28

现金 29,449,185.72

存出保证金 4,589,429.50

交易性金融资产 4,002,288,540.06

其中:股票投资 3,751,983,540.06

基金投资 256,236,000.00

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 8,227,410.52

应收证券清算款 2,816,595.33

应收股利 -

应收申购款 348,668.77

递延所得税资产 -

其他资产 -

资产总计 4,177,539,106.41

负债和所有者权益

2015年12月31日

负债:

短期借款 -

应付账款 -

应付证券清算款 9,254,659.76

应付赎回款 11,027,168.26

应付管理人报酬 5,637,151.54

应付托管费 937,888.58

其他应付款 -

应付交易费用 10,048,390.47

应交税费 -

应付利息 -

递延所得税负债 -

其他负债 140,257.69

负债合计 37,045,526.30

所有者权益:

实收基金 4,120,268,583.43

未分配利润 20,284,956.68

所有者权益合计 4,140,493,579.11

负债和所有者权益总计 4,177,539,106.41

72 利润表

会计主体:中银智能制造股票型证券投资基金

本报告期:2015年6月19日至(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

资产

2015年6月19日至(基金合同生效日)至2015年12月31日

一、收入 20,272,614.64

1.利息收入 33,003,532.17

其中:存款利息收入 27,661,091.30

债券利息收入 1,627,950.82

资产支持证券利息收入 -

买入返售金融资产收入 3,714,490.05

其他收入 -

其中:公允价值变动收益(损失以“-”号填列) 406,266,820.66

4.C.兑换损益(损失以“-”号填列) -

5.其他收入(损失以“-”号填列) -

减:二、费用 3,366,315.75

1.管理人报酬 42,631,017.45

2.托管费 7,105,188.61

3.销售服务费 -

4.交易费用 22,541,338.13

5.利息支出 -

其中:卖出回购金融资产支出 -

6.其他费用 318,069.56

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) -52,322,977.11

减:所得税费用 -

四、净利润(净亏损以“-”号填列) -52,322,977.11

73 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中银智能制造股票型证券投资基金

本报告期:2015年6月19日至(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目

2015年6月19日(基金合同生效日)至2015年12月31日

一、期初所有者权益(基金净值) 6,374,911,023.92

二、本期增减变动金额(基金净值变动) -52,322,977.11

其中:本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

三、期末所有者权益(基金净值) 6,322,588,046.81

四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

九、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

十、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

十一、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

十二、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

十三、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

十四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

十五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

十六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

十七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

十八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

十九、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

二十、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

二十一、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

二十二、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

二十三、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

二十四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

二十五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

二十六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

二十七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

二十八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

二十九、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

三十、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

三十一、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

三十二、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

三十三、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

三十四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

三十五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

三十六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

三十七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

三十八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

三十九、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

四十、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

四十一、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

四十二、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

四十三、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

四十四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

四十五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

四十六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

四十七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

四十八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

四十九、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

五十、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

五十一、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

五十二、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

五十三、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

五十四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

五十五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

五十六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

五十七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

五十八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

五十九、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

六十、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

六十一、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

六十二、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

六十三、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

六十四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

六十五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

六十六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

六十七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

六十八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

六十九、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

七十、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

七十一、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

七十二、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

七十三、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

七十四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

七十五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

七十六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

七十七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

七十八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

七十九、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

八十、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

八十一、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

八十二、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

八十三、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

八十四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

八十五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

八十六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

八十七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

八十八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

八十九、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

九十、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

九十一、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

九十二、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

九十三、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

九十四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

九十五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

九十六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

九十七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

九十八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

九十九、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百零一、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百零二、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百零三、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百零四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百零五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百零六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百零七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百零八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百零九、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百一十、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百一十一、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百一十二、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百一十三、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百一十四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百一十五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百一十六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百一十七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百一十八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百一十九、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百二十、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百二十一、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百二十二、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百二十三、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百二十四、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百二十五、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百二十六、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百二十七、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百二十八、本期基金净值变动(基金净值变动) -52,322,977.11

一百二十九、本期基金净值变动