

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

1 重要提示

基金管理人及董事承诺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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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。

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预示其未来表现,投资者有风险,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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告日期为2018年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	中银转债债券
基金代码	002303
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月29日
报告期末基金份额总额	2,603,569,729.69份
投资目标	本基金主要投资于具有良好流动性的资产,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的长期稳定回报。
投资策略	本基金在严格控制风险的前提下,根据宏观经济、证券市场及行业状况,将债券市场作为资产配置的主要方向,并积极参与股票、可转债等资产的投资,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*60%+中证转债指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,本基金的风险收益特征高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
下属同类型基金简称	中银转债债券A 中银转债债券C
下属同类型基金代码	002303A 002303C
报告期末下属同类型基金资产净值	2,563,589,688.43 2,686,029.21

3 主要财务指标和基金净值表现

注:1.本基金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。

2.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,计入费用导致实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要财务指标

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)
1.本期已实现收益	30,307,613.17
2.本期利润	68,001,000.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0261
4.本期基金份额净值	2,610,568,489.26
5.本期基金份额净值增长率	1.807%

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1. 中银转债债券 A:

期间	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	2.81%	0.01%	0.07%	0.07%	1.82%	0.01%

2. 中银转债债券 C:

期间	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	0.67%	0.05%	0.11%	0.04%	0.53%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银转债债券债券型证券投资基金
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
(2016年9月29日至2018年9月30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
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

1 重要提示

基金管理人及董事承诺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。

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2018年10月23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。

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预示其未来表现,投资者有风险,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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告日期为2018年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	中银转债债券
基金代码	002303
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月29日
报告期末基金份额总额	2,603,569,729.69份
投资目标	本基金主要投资于具有良好流动性的资产,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的长期稳定回报。
投资策略	本基金在严格控制风险的前提下,根据宏观经济、证券市场及行业状况,将债券市场作为资产配置的主要方向,并积极参与股票、可转债等资产的投资,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*60%+中证转债指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,本基金的风险收益特征高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
下属同类型基金简称	中银转债债券A 中银转债债券C
下属同类型基金代码	002303A 002303C
报告期末下属同类型基金资产净值	2,563,589,688.43 2,686,029.21

3 主要财务指标和基金净值表现

注:1.本基金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。

2.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,计入费用导致实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要财务指标

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-109,364.20
2.本期利润	36,007.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0000
4.本期基金份额净值	2,608,432.60
5.本期基金份额净值增长率	0.98%

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1. 中银转债债券 A:

期间	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	0.84%	0.16%	0.07%	0.07%	-0.17%	0.09%

2. 中银转债债券 C:

期间	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.71%	1.06%	-0.07%	0.11%	-1.48%	0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银转债债券债券型证券投资基金
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
(2016年9月29日至2018年9月30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
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

1 重要提示

基金管理人及董事承诺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。

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2018年10月23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。

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预示其未来表现,投资者有风险,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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告日期为2018年7月1日起至9月30日止。

2 基金产品概况

基金名称	中银转债债券
基金代码	002303
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月29日
报告期末基金份额总额	2,603,569,729.69份
投资目标	本基金主要投资于具有良好流动性的资产,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的长期稳定回报。
投资策略	本基金在严格控制风险的前提下,根据宏观经济、证券市场及行业状况,将债券市场作为资产配置的主要方向,并积极参与股票、可转债等资产的投资,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*60%+中证转债指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,本基金的风险收益特征高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
下属同类型基金简称	中银转债债券A 中银转债债券C
下属同类型基金代码	002303A 002303C
报告期末下属同类型基金资产净值	2,563,589,688.43 2,686,029.21

3 主要财务指标和基金净值表现

注:1.本基金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。

2.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,计入费用导致实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要财务指标

单位:人民币元	
主要财务指标	报告期(2018年7月1日至2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-2,407,603.10
2.本期利润	30,307,613.17
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0006
4.本期基金份额净值	2,610,568,489.26
5.本期基金份额净值增长率	0.982%

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1. 中银转债债券 A:

期间	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.71%	1.06%	-0.07%	0.11%	-1.48%	0.07%

2. 中银转债债券 C:

期间	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率差④	①-③	②-④
过去三个月	0.84%	0.16%	0.07%	0.07%	-0.17%	0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银转债债券债券型证券投资基金
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
(2017年3月1日至2018年9月30日)

中银国有企业债债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1. 宏观经济分析: 三季度经济复苏缓慢,美国通胀粘性仍存,二季度美国通胀超预期。从领先指标来看,美国通胀超预期,三季度美国CPI超预期,二季度美国CPI超预期。在通胀超预期下,三季度美国通胀超预期,一方面对美联储加息预期升温,另一方面美元升值压力加大,将进一步推动美元升值压力,助推美元和美债收益率上行。欧元区经济不及预期,三季度美国通胀超预期,一方面对美联储加息预期升温,一方面美元升值压力加大,将进一步推动美元升值压力,助推美元和美债收益率上行。欧元区经济不及预期,三季度美国通胀超预期,一方面对美联储加息预期升温,一方面美元升值压力加大,将进一步推动美元升值压力,助推美元和美债收益率上行。

4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资组合情况

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	1,400,000.00	53.78
2	央行票据	1,000,000.00	38.42
3	金融债券	36,074,000.00	1.38
4	企业债券	1,009,231,000.00	38.76
5	中期票据	80,162,000.00	3.08
6	可转债	174,914,464.12	6.73
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,969,238,062.02	113.92

4.5 投资组合报告

4.5.1 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	-	-
2	固定收益投资	2,969,238,062.02	97.28
3	金融资产投资	2,969,238,062.02	97.28
4	其他资产	-	-
5	负债	-	-
6	净资产	2,969,238,062.02	100.00

4.5.2 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	171470123	17中债国债逆回购1470123	1,400,000	102,107,000.00	7.42
2	10180009	央行票据10180009	1,000,000	102,100,000.00	3.91
3	10180003	央行票据10180003	1,000,000	100,700,000.00	3.80
4	112280	11国债02	1,000,000	99,800,000.00	3.82
5	170210	17国债10	700,000	60,418,000.00	2.22

4.5.3 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4.5.4 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股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

4.5.5 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

4.5.6 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

4.5.8 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.11 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.12 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.13 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.14 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.15 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.16 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.17 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.18 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.19 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.20 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.21 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.22 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.23 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.24 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.25 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.26 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.27 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.28 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.29 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.30 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.31 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.32 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.33 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.34 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.35 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.36 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.37 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.38 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.39 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.40 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.41 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.42 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

4.5.43 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5 投资组合报告

5.1 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110041	国债期货	30,226,400.00	1.16
2	110111	央行票据	24,987,000.00	0.97
3	133007	16国债18	17,866,000.00	0.69
4	120705	央行票据	14,799,400.00	0.57
5	110043	央行票据	12,411,000.00	0.48
6	120054	央行票据	12,428,072.66	0.48
7	120116	国债期货	8,796,470.66	0.34
8	120006	央行票据	8,103,603.02	0.31
9	120034	国债期货	5,800,147.30	0.23
10	120009	央行票据	4,623,000.00	0.18
11	120008	央行票据	2,487,200.00	0.10
12	110104	国债期货	2,175,272.50	0.08
13	120020	央行票据	1,798,000.00	0.07
14	110111	央行票据	1,427,000.00	0.05
15	110103	国债期货	1,300,363.00	0.05
16	120023	央行票据	974,000.00	0.04
17	120015	央行票据	963,522.52	0.04
18	110102	国债期货	964,513.00	0.04
19	120028	央行票据	697,194.00	0.03
20	110000	央行票据	607,238.00	0.02
21	110008	央行票据	501,100.00	0.02
9	合计	-	-	-

5.1.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.2 报告期末前十名股指期货中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.1.3 报告期末前十名国债期货中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.4 报告期末前十名权证投资中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.5 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.1.7 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.8 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.11 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.12 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.13 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.14 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.15 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.16 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.17 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.18 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.19 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.20 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.21 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.22 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.23 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.24 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明</