

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
报告送出日期:二〇一九年七月十九日

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法律责任。

基金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2019年7月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

2. 基金产品概况

基金简称	中银互利半年定期开放债券
基金代码	163825
交易代码	163825
基金运作方式	契约式、定期开放式
基金合同生效日	2017年11月19日
报告期末基金份额总额	151,336,229.68份
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的恒定收益。
投资策略	本基金采用中长期利率趋势分析、债券经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,进行债券配置时的选择;买入并持有策略,采用积极的债券投资组合管理,力争获取超越业绩比较基准的稳定收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
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,本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争获取超越业绩比较基准的稳定收益。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期已实现收益	2,671,541.17
2.本期利润	-7,233,541.86
3.本期利润扣除计提的资产减值准备的金额	-69,488.5
4.期末基金资产净值	158,619,982.97
5.期末基金份额净值	1.0501

注:1.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。

2.本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指标收益。

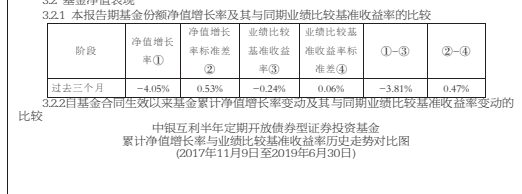
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 ②	业绩比较基准 ③	业绩比较基准 ④	①-③	②-④
过去三个月	-1.05%	0.53%	-0.24%	0.06%	-3.81%	0.47%

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变动的比较

中银互利半年定期开放债券证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年11月19日至2019年6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:二〇一九年七月十九日

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法律责任。

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2019年7月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

2. 基金产品概况

基金简称	中银沪深300等权指数基金(LOF)
基金代码	163801
交易代码	163801
基金运作方式	契约式、定期开放式
基金合同生效日	2015年12月11日
报告期末基金份额总额	44,446,982.97份
投资目标	本基金主要投资于沪深两市符合中证300指数编制方案的股票,通过分散化投资,力争实现基金资产长期稳健增值,并力争超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在严格控制风险的前提下,通过分散化投资,力争实现基金资产长期稳健增值,并力争超越业绩比较基准。
业绩比较基准	中证300指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,属于证券投资基金中的较高风险品种,本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争获取超越业绩比较基准的稳定收益。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期已实现收益	620,837.87
2.本期利润	-2,122,297.86
3.本期利润扣除计提的资产减值准备的金额	-10,644
4.期末基金资产净值	44,446,982.97
5.期末基金份额净值	1.234

注:1.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。

2.本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指标收益。

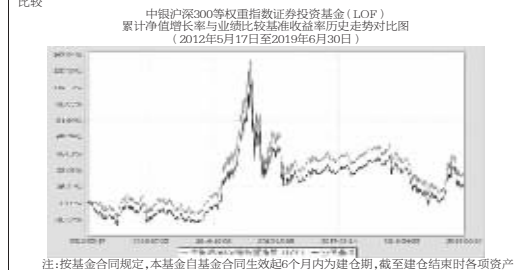
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 ②	业绩比较基准 ③	业绩比较基准 ④	①-③	②-④
过去三个月	-4.92%	1.56%	-6.28%	1.53%	1.36%	-0.03%

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变动的比较

中银沪深300等权指数证券投资基金(L-OF)
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年12月11日至2019年6月30日)



注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

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变动的比较

中银沪深300等权指数证券投资基金(L-OF)
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年12月11日至2019年6月30日)

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

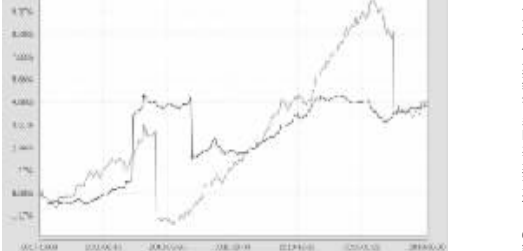
注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

信息披露

中银互利半年定期开放债券型证券投资基金

2019年第二季度报告



注:本基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4.1 基金管理人(或基金小组)简介

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

报告送出日期:二〇一九年七月十九日

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法律责任。

基金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2019年7月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期已实现收益	2,671,541.17
2.本期利润	-7,233,541.86
3.本期利润扣除计提的资产减值准备的金额	-69,488.5
4.期末基金资产净值	158,619,982.97
5.期末基金份额净值	1.0501

注:1.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。

2.本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指标收益。

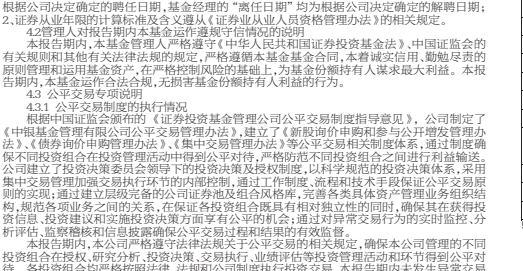
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 ②	业绩比较基准 ③	业绩比较基准 ④	①-③	②-④
过去三个月	-1.05%	0.53%	-0.24%	0.06%	-3.81%	0.47%

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变动的比较

中银互利半年定期开放债券证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年11月19日至2019年6月30日)



注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

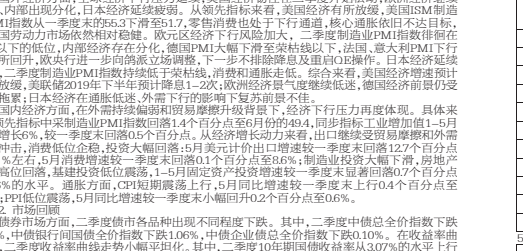
注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

信息披露

中银沪深300等权指数证券投资基金

2019年第二季度报告



注:本基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4.1 基金管理人(或基金小组)简介

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

报告送出日期:二〇一九年七月十九日

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法律责任。

基金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2019年7月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期已实现收益	620,837.87
2.本期利润	-2,122,297.86
3.本期利润扣除计提的资产减值准备的金额	-10,644
4.期末基金资产净值	44,446,982.97
5.期末基金份额净值	1.234

注:1.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。

2.本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指标收益。

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

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 ②	业绩比较基准 ③	业绩比较基准 ④	①-③	②-④
过去三个月	-4.92%	1.56%	-6.28%	1.53%	1.36%	-0.03%

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变动的比较

中银沪深300等权指数证券投资基金(L-OF)
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年12月11日至2019年6月30日)



注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

注:本基金收益分配方式为按月现金分红。

信息披露

中银沪深300等权指数证券投资基金

2019年第二季度报告



注:本基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4.1 基金管理人(或基金小组)简介

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

报告送出日期:二〇一九年七月十九日

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法律责任。

基金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2019年7月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期已实现收益	620,837.87
2.本期利润	-2,122,297.86
3.本期利润扣除计提的资产减值准备的金额	-10,644
4.期末基金资产净值	44,446,982.97
5.期末基金份额净值	1.234