

中银转债增强债券型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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：二〇一五年七月二十日

§ 1 基金概况

基金基本情况：本基金名称为中银转债增强债券型证券投资基金，基金简称：中银转债增强债券，基金代码：168816。

基金运作方式：契约型开放式。

基金合同生效日：2011年7月9日。

报告期末基金资产总额：182,017,317.40元。

投资目标：本基金主要投资于中银转债品种以及其他债券和股票的组合，通过“自上而下”和“自下而上”两个角度综合考虑后选择符合未来大类资产配置思路的债券和股票品种，以期在控制风险和保持资产流动性的前提下，超越业绩基准。

投资策略：本基金将通过“自上而下”的方法进行资产配置，配置组合，结合“自上而下”和“自下而上”两个角度综合考虑后选择符合未来大类资产配置思路的债券和股票品种，以期在控制风险和保持资产流动性的前提下，超越业绩基准。

投资目标：本基金的业绩基准为：沪深300指数收益率×8%+中债综合全价指数收益率×20%。

风险收益特征：本基金属于债券型基金，其预期风险收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

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。

报告期天数：2015年4月1日至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：中银转债增强债券

基金代码：168816

基金运作方式：契约型开放式。

基金合同生效日：2011年7月9日。

报告期末基金资产总额：182,017,317.40元。

投资目标：本基金主要投资于中银转债品种以及其他债券和股票的组合，通过“自上而下”和“自下而上”两个角度综合考虑后选择符合未来大类资产配置思路的债券和股票品种，以期在控制风险和保持资产流动性的前提下，超越业绩基准。

投资策略：本基金将通过“自上而下”的方法进行资产配置，配置组合，结合“自上而下”和“自下而上”两个角度综合考虑后选择符合未来大类资产配置思路的债券和股票品种，以期在控制风险和保持资产流动性的前提下，超越业绩基准。

投资目标：本基金的业绩基准为：沪深300指数收益率×8%+中债综合全价指数收益率×20%。

风险收益特征：本基金属于债券型基金，其预期风险收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

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。

报告期天数：2015年4月1日至6月30日止。

§ 3 主要财务指标

(单位：人民币元)

		报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
	中银转债增强债券	中银转债增强债券
1.本期已实现收益	148,412,312.81	97,024,878.19
2.本期利润	87,292,733.64	78,472,507.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.4982	0.6324
4.期末基金份额净值	307,931,817.90	170,299,847.81
5.期末总资产净值	2,642	2,601

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，本期利润指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，即为本期利润。

注2.由于本基金的估值方法与所持证券的估值方法不同，所持证券的公允价值可能不同于基金资产净值，因此，上述基金本期利润和期末基金资产净值并不代表基金份额的真实价值，仅供投资者参考。

注3.基金净值表现不同时期的申购赎回价格及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.中银转债增强债券A:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 15.07% 3.92% -7.10% 3.01% 22.17% 0.91%

2.中银转债增强债券B:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 14.99% 3.91% -7.10% 3.01% 22.09% 0.90%

3.2.2 基金合同生效以来基金总回报率与同期业绩比较基准的走势图

注1.基金合同生效以来基金总回报率=基金成立以来每万份基金份额的累计净值增长率，同期业绩比较基准的走势图=同期业绩比较基准收益率。

注2.本基金的业绩基准为：沪深300指数收益率×8%+中债综合全价指数收益率×20%。

注3.基金净值表现不同时期的申购赎回价格及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.中银转债增强债券A:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 15.07% 3.92% -7.10% 3.01% 22.17% 0.91%

2.中银转债增强债券B:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 14.99% 3.91% -7.10% 3.01% 22.09% 0.90%

3.2.3 基金合同生效以来基金总回报率与同期业绩比较基准的走势图

注1.基金合同生效以来基金总回报率=基金成立以来每万份基金份额的累计净值增长率，同期业绩比较基准的走势图=同期业绩比较基准收益率。

注2.本基金的业绩基准为：沪深300指数收益率×8%+中债综合全价指数收益率×20%。

注3.基金净值表现不同时期的申购赎回价格及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.中银转债增强债券A:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 15.07% 3.92% -7.10% 3.01% 22.17% 0.91%

2.中银转债增强债券B:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 14.99% 3.91% -7.10% 3.01% 22.09% 0.90%

3.2.4 基金合同生效以来基金总回报率与同期业绩比较基准的走势图

注1.基金合同生效以来基金总回报率=基金成立以来每万份基金份额的累计净值增长率，同期业绩比较基准的走势图=同期业绩比较基准收益率。

注2.本基金的业绩基准为：沪深300指数收益率×8%+中债综合全价指数收益率×20%。

注3.基金净值表现不同时期的申购赎回价格及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.中银转债增强债券A:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 15.07% 3.92% -7.10% 3.01% 22.17% 0.91%

2.中银转债增强债券B:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 14.99% 3.91% -7.10% 3.01% 22.09% 0.90%

3.2.5 基金合同生效以来基金总回报率与同期业绩比较基准的走势图

注1.基金合同生效以来基金总回报率=基金成立以来每万份基金份额的累计净值增长率，同期业绩比较基准的走势图=同期业绩比较基准收益率。

注2.本基金的业绩基准为：沪深300指数收益率×8%+中债综合全价指数收益率×20%。

注3.基金净值表现不同时期的申购赎回价格及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.中银转债增强债券A:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 15.07% 3.92% -7.10% 3.01% 22.17% 0.91%

2.中银转债增强债券B:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 14.99% 3.91% -7.10% 3.01% 22.09% 0.90%

3.2.6 基金合同生效以来基金总回报率与同期业绩比较基准的走势图

注1.基金合同生效以来基金总回报率=基金成立以来每万份基金份额的累计净值增长率，同期业绩比较基准的走势图=同期业绩比较基准收益率。

注2.本基金的业绩基准为：沪深300指数收益率×8%+中债综合全价指数收益率×20%。

注3.基金净值表现不同时期的申购赎回价格及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.中银转债增强债券A:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 15.07% 3.92% -7.10% 3.01% 22.17% 0.91%

2.中银转债增强债券B:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 14.99% 3.91% -7.10% 3.01% 22.09% 0.90%

3.2.7 基金合同生效以来基金总回报率与同期业绩比较基准的走势图

注1.基金合同生效以来基金总回报率=基金成立以来每万份基金份额的累计净值增长率，同期业绩比较基准的走势图=同期业绩比较基准收益率。

注2.本基金的业绩基准为：沪深300指数收益率×8%+中债综合全价指数收益率×20%。

注3.基金净值表现不同时期的申购赎回价格及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.中银转债增强债券A:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 15.07% 3.92% -7.10% 3.01% 22.17% 0.91%

2.中银转债增强债券B:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 14.99% 3.91% -7.10% 3.01% 22.09% 0.90%

3.2.8 基金合同生效以来基金总回报率与同期业绩比较基准的走势图

注1.基金合同生效以来基金总回报率=基金成立以来每万份基金份额的累计净值增长率，同期业绩比较基准的走势图=同期业绩比较基准收益率。

注2.本基金的业绩基准为：沪深300指数收益率×8%+中债综合全价指数收益率×20%。

注3.基金净值表现不同时期的申购赎回价格及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.中银转债增强债券A:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 15.07% 3.92% -7.10% 3.01% 22.17% 0.91%

2.中银转债增强债券B:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 14.99% 3.91% -7.10% 3.01% 22.09% 0.90%

3.2.9 基金合同生效以来基金总回报率与同期业绩比较基准的走势图

注1.基金合同生效以来基金总回报率=基金成立以来每万份基金份额的累计净值增长率，同期业绩比较基准的走势图=同期业绩比较基准收益率。

注2.本基金的业绩基准为：沪深300指数收益率×8%+中债综合全价指数收益率×20%。

注3.基金净值表现不同时期的申购赎回价格及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.中银转债增强债券A:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 15.07% 3.92% -7.10% 3.01% 22.17% 0.91%

2.中银转债增强债券B:

阶段 净值增长率(1) 业绩比较基准(2) 业绩比较基准收益率差(3)=业绩净值(1)-业绩基准(2)

过去三个月 14.99% 3.91% -7.10% 3.01% 22.09% 0.90%