

中银国有企业债债券型证券投资基金

2015 年度报告摘要

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:二〇一六年三月二十五日
§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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、准确性负责。本年度报告在百分之二以上之二以上独立董事监督同意，并由董事长签章。

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2016年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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。投资人投资本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新、基金合同。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

报告日期:2015年9月25日起至2015年12月31日

§ 2 基金简介

基金基本情况	中银国有企业债
基金简称	001226
交易代码	001226
基金合同生效日	2015年9月25日
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
报告期天数	2,016,196,44362
基金总资产	不适用

2.1 基金产品说明

投资目标 本基金主要投资于国内企业债券，在严格控制信用风险和追求基金安全的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金根据宏观经济、国家政策环境、行业企业盈利、信用状况及其变化趋势、债券市场和股市的估值水平、以及信用利差等指标，在宏观面进行综合研判，确定投资操作方向，决定投资组合在债券类资产中的配置比例。在具体操作上，本基金将根据宏观经济形势、行业企业盈利、信用状况及其变化趋势、债券市场和股市的估值水平、以及信用利差等指标，在宏观面进行综合研判，确定投资操作方向，决定投资组合在债券类资产中的配置比例。在具体操作上，本基金将根据宏观经济形势、行业企业盈利、信用状况及其变化趋势、债券市场和股市的估值水平、以及信用利差等指标，在宏观面进行综合研判，确定投资操作方向，决定投资组合在债券类资产中的配置比例。

业绩比较基准 中债企业债合债(总值)指数

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。本基金的预期收益和预期风险均高于货币市场基金，低于混合基金和股票型基金。

2.2 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中银基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
姓名	薛成文	汤立彦
联系电话	021-38834699	95569
电子邮箱	clientervice@bcim.com	tangy@bankocom
客户服务电话	021-38834748 400-888-6666	95569
传真	021-68972348	021-62001216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址: www.bcim.com
基金年度报告备置地点: 上海市静安区铜仁路200号中银大厦20层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元
3.1.1 本期数据和指标 2015年9月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日 31日

本期已实现收益 15,121,198.39

本期利润 33,197,890.04

加权平均基金份额本期利润 0.0162

本期基金份额净值增长率 1.60%

3.1.2 期末数据和指标 2015年末

期末可供分配基金份额利润 0.0075

期末基金资产净值 2,040,015,501.13

期末基金份额净值 1.016

注:1.本基金合同于2015年09月29日生效。截至报告期末基金合同生效未满两年。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时产生的费用影响,费用影响后基金资产净值要低于所列数据。

3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、公允价值变动收益、其他收入(不含公允价值变动收益)、扣除相关费用后的本期利润。本期公允价值变动收益,即为本期未实现公允价值变动收益(报告表下同)。下同。本期未实现公允价值变动收益为正数,则本期可供分配的利润为本期未实现公允价值变动收益;若为负数,则本期未实现公允价值变动部分为负数,则本期可供分配利润(即本期实现部分扣除非实现部分)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去一个月	1.60%	0.00%	1.81%	0.00%	-0.21%	-0.03%
自基金份额首次开放以来	1.60%	0.00%	1.93%	0.00%	-0.33%	-0.03%

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

中银国有企业债债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图
(2015年9月29日至2015年12月31日)

注:本基金合同于2015年09月29日生效。按基金合同规定,本基金合同生效6个月内为建仓期,截至报告期末,本基金尚未完成建仓。

3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

中银国有企业债债券型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:本基金合同于2015年09月29日生效。截至报告期末基金合同生效未满三年,无利润分配情况。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

中银基金管理有限公司身为中银国际基金管理有限公司于2000年8月22日正式成立,由中银国际和美林投资管理有限公司(2006年9月29日变更为中银基金管理有限公司)、贝莱德德投资管理有限公司合并,于2007年12月10日,其中银基金管理委员会批准,中银国际和贝莱德德投资管理有限公司合并,中银基金管理有限公司注册资本为人民币1亿元,人民币5000万美金,中银基金管理有限公司于2015年12月1日完成工商变更登记,并取得上海市工商行政管理局核发的《营业执照》。

4.2 管理人对报告期内基金运作情况的说明

本报告期内,基金管理人遵守法律法规及基金合同,谨慎运作,勤勉尽责的履行管理基金的职责,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内内部控制情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司制定了《公平交易制度》,建立了《公平交易制度》和《公平交易操作流程》,并经公司董事会审议通过,并报中国证监会备案。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.28 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.29 公平交易制度的执行情况

公司对旗下基金的交易行为进行监控,对旗下基金的交易行为进行分析,对异常交易行为进行识别、分析和处理,确保旗下基金的交易行为符合公平交易的原则。

4.3.30 公平交易制度的执行情况