

基金管理人：中银基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一六年三月二十五日

1.1 基金提示  
基金管理人的声明：本公司及所委托的代销机构保证本招募说明书（以下简称“本基金”）的真实性、准确性、完整性并承担相应的法律责任。本公司承诺以忠实诚信的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。  
基金托管人的声明：本公司承诺以忠实诚信的原则保管基金，但不保证基金一定盈利。  
基金管理人和基金托管人对本基金的风险评级和适用费用，以报告书中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财产状况报告、投资运作报告等为准。投资者在购买本基金前应仔细阅读本招募说明书及其更新。  
本报告期为2015年1月1日起至1月31日止。

§ 2 基金简介

# 中银理财14天债券型证券投资基金

## 2015 年 度 报 告 摘 要

本基金报告表已于2016年3月24日经本基金的基金管理人批准。  
§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金份额组合情况

	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1 固定收益投资		979,032,076.15	43.48
其中：债券		979,032,076.15	43.48
货币市场工具		-	-
2 股权投资		-	-
其中：股票		-	-
3 衍生金融工具		-	-
4 其他各类资产		1,269,941,916.80	56.01
5 合计		2,251,976,689.95	100.00

8.2 报告期利润分配情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期利润	1761

其中：实现的净利润

报告期利润总额

报告期利润总额占基金资产净值的比例(%)

报告期利润总额占基金资产净值的比例的简单平均值

报告期利润总额占基金资产净值的比例如下表所示

本基金已在全国银行间同业市场进行债券回购的金额不得超过基金资产净值的40%，本报告期，本基金未发生此种情形。

8.3 报告期投资组合平均余额情况

序号	项目	天数
1	报告期投资组合平均余额	83
2	报告期内投资组合平均余额最高值	102
3	报告期内投资组合平均余额最低值	39

报告期投资组合平均余额超期超过180天情况说明

本基金合计持有：本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过134天”，本报告期，本基金未发生超标情况。

8.3.1 报告期投资组合平均余额分析

序号	平均剩余期限	各期限占基金资产净值的比例(%)	各期限占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	3051	16.62
	其中：剩余存续期间超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-90天	414	-
	其中：剩余存续期间超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	40.60	-
	其中：剩余存续期间超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	25.41	-
	其中：剩余存续期间超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	6.21	-
	其中：剩余存续期间超过397天的浮动利率债	-	-
9	合计	979,032,076.15	100.00

8.4 期末未赎回基金品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	99,241,996.49	6.14
2	中央票据	99,104,412.01	5.64
3	金融债券	120,100,737.92	6.22
4	企业债券	120,100,737.92	6.22
5	企业短期融资券	61,004,562.91	3.16
6	中期票据	155,000.00	0.08
7	同业存单	247,926,767.32	12.84
8	其他	60,194,567.11	3.12
9	合计	2,251,976,689.95	100.00

8.5 期末未赎回基金资产净值比例(%)排名前十名债券投资明细

序号	债券名称	金额单位(人民币元)
1	11151229 15年国债C0229	1,000,000.00
2	11161003 15年国债C0063	1,000,000.00
3	01159689 15年农发债C0003	900,000.00
4	150026 15年国开行C0008	70,073,319.31
5	01159600 15年农发行C0002	60,000.00
6	11158007 15年国开行C0007	60,000.00
7	01152007 15年农发行C0006	50,000.00
8	01152006 15年农发行C0005	50,000.00
9	01152005 15年农发行C0004	50,000.00
10	01756000 16东证券C0006	50,000.00

8.6 期末未赎回基金资产净值比例(%)排名前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	11151229	15年国债C0229	1,000,000.00	99,241,996.49
2	11161003	15年国债C0063	1,000,000.00	99,104,412.01
3	01159689	15年农发债C0003	900,000.00	79,992,665.79
4	150026	15年国开行C0008	70,073,319.31	3.03
5	01159600	15年农发行C0002	60,000.00	36.30
6	11158007	15年国开行C0007	60,000.00	60,194,567.11
7	01152007	15年农发行C0006	50,000.00	25.41
8	01152006	15年农发行C0005	50,000.00	14.18
9	01152005	15年农发行C0004	50,000.00	13.76
10	01756000	16东证券C0006	50,000.00	49,992,280.82

8.7 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.8 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.9 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.10 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.11 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.12 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.13 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.14 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.15 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.16 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.17 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.18 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.19 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.20 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.21 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.22 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.23 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.24 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.25 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.26 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.27 报告期内债券品种的公允价值变动情况

本基金本报告期未出现债券品种的公允价值变动。

8.28 报告期内债券品种的公允价值变动情况