

中银稳健双利债券型证券投资基金

2017 第一季度报告

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	508,474,436.43	8.12
	其中:股票	508,474,436.43	8.12
2	固定收益投资	4,905,563,749.50	78.34
	其中:债券	4,905,563,749.50	78.34

	资产支持证券	--	--
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	698,300,087.66	11.15

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	61,641,132.48	0.98
7	其他各项资产	87,721,865.37	1.40
8	合计	6,261,701,271.24	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	20,326,940.80	0.39
B	采矿业	28,423,291.76	0.55
C	制造业	333,352,308.58	6.48

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,866,000.00	0.09
E	建筑业	20,813,866.08	0.40
F	批发和零售业	12,726,000.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,354,743.09	0.94

J	金融业	—	—
K	房地产业	13,515,804.00	0.26
L	租赁和商务服务业	10,530,042.12	0.20
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	15,565,440.00	0.30
深圳燃气、能源和其他服务业			

O	房地产业、租赁和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	500,474,436.43	9.88

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600184	江淮汽车	2,470,893	28,958,865.56	0.56

2	002213	永能达	1,228,005	21,875,113.50	0.54
3	002583	海能达	1,642,960	23,970,786.40	0.47
4	600391	成发科技	626,076	22,463,606.88	0.44
5	300115	长盈精密	750,060	21,796,743.60	0.42
6	600060	海信电器	1,200,000	21,708,000.00	0.42

7	002179	中航光电	559,688	21,206,578.32	0.41
8	000547	航天发展	1,413,427	20,989,390.95	0.41
9	002235	瀚天股份	2,990,498	20,813,866.08	0.40
10	002714	牧原股份	747,314	20,326,940.80	0.39

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	621,315,000.00	12.07
	其中：政策性金融债	621,315,000.00	12.07
4	公司债券	7,336,302,054.00	45.40

5	企业短期融资券	349,558,000.00	6.79
6	中期票据	465,547,000.00	9.05
7	可转换(可交换)债	11,202,695.50	2.18
8	同业存单	1,020,721,000.00	19.83
9	其他	-	-

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	111619152	16恒丰银行CD152	3,000,000	289,020,000.00	5.62
2	111617243	16光大CD243	2,600,000	250,666,000.00	4.87

3	111794974	17郑州银行CT8052	2,000,000	191,160,000.00	3.71
4	160310	16进出口	1,900,000	175,788,000.00	3.42
5	111719079	17恒丰银行CT8679	1,500,000	146,685,000.00	2.85

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资范围未包括股指期货,无相关投资政策。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金投资范围未包括国债期货,无相关投资政策。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和期损益明细

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	123,109.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	85,822,880.41
5	应收申购款	905,475.77
6	其他应收款	870,400.00
7	待摊费用	—
8	其他	—

5.1.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细					87,22,003.37
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	110032	三一转债	26,791,003.80	0.52	
2	110033	国贸转债	20,656,221.60	0.40	

3	13008	电气焊费	19,453,100.00	0.38
4	12703	海印铸费	18,196,623.00	0.35
6	128012	铸丰铸费	4,816,756.80	0.09
7	128013	洪涛铸费	3,278,929.10	0.06
8	123001	蓝标铸费	3,258,537.60	0.06

9	13204	15国鑫EB	2,905,800.00	0.06
10	11000	格力转债	2,149,600.00	0.04

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资受限报告期末的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中银互利债券A	中银互利债券B
本报告期初基金份额总额	2,350,086,521.59	186,305,655.92
本报告期基金总申购份额	1,016,164,801.79	29,057,404.46

减:本报告期基金总赎回份额	80,515,982.63	68,572,822.51
本报告期基金份额变动份额	--	--
本报告期末基金份额总额	3,285,935,430.75	147,690,237.87

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

<p>本报告期内基金管理人未持有本基金份额。</p> <p>7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细</p> <p>本报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。</p> <p>§ 8 影响投资者决策的其他重要信息</p>		
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况	<p>报告期内持有基金份额变化情况</p>	<p>报告期末持有基金情况</p>

[illegible]

本基金由于存在以上单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形，存在以下特有风险：(1)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；(2)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；(3)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险；(4)持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值持续低于5000万的风险。

- 2.《中银稳健双利债券型证券投资基金基金合同》;
- 3.《中银稳健双利债券型证券投资基金招募说明书》;
- 4.《中银稳健双利债券型证券投资基金托管协议》;
- 5.法律意见书;
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照;

8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
9、中国证监会要求的其他文件。
9.2 存放地点
基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站 www.bocim.com。
9.3 查阅方式
投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登录基金管理人网站www.bocim.com 查阅。

中旅基金管理有限公司
二〇一七年四月二十一日

本基金本报告期末未有资产支持证券。
5.7 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未有贵金属。
5.8 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有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 本基金股指期货投资情况

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资策略。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

5.9.3 本报告期参与股指期货投资评价

本基金报告期内未参与股指期货投资，无相关投资评价。

5.10 股指期货投资情况说明

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	175,243.77
2	应收证券清算款	371,146.62

3	应收股利	—
4	应收利息	22,163,196.02
5	应收申购款	700,010,354.53
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	722,719,939.34
10	10.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细	
	本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。	
10.5	10.5.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明	
	本基金本报告期末前十名股票中无流通受限股票。	
10.6	10.6.1 投资组合报告附注的其他文字描述部分	
	由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。	

本报告期初基金份额总额	768,933,352.78
本报告期基金总申购份额	499,760,494.92
减：本报告期基金总赎回份额	42,732,903.86

本报告期基金份额变动份额	—
本报告期末基金份额总额	1,225,960,945.84

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期末持有本基金份额	10,000,950.00
-------------	---------------

单位:份

本报告期末元/申购总份额	—
本报告期末元/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,003,956.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.82

72. 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期间，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

73. 报告期末发起式基金总户数及全部持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,003,950.00	0.82%	10,003,950.00	0.82%	3年
基金管理人高级管理人员	--	--	--	--	--
基金经理等人员	--	--	--	--	--

基金管理人股东	--	--	--	--	--
其他	72,576.80	0.01%	--	--	--
合计	10,076,526.80	0.82%	10,003,950.00	0.82%	--

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金份额	
	序号	持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间	期初份额	增/减份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-03-31至2017-03-31	495,048,090.53	-	495,048,090.53	40.380%
	2	2017-03-22至2017-03-30	146,412,152.27	146,412,152.27	146,412,152.27	11.940%

产品特有风险

本基金由于存在上述一投资者持有基金份额比例达到或超过10%的情况，存在以下风险：（1）持有基金份额比例达到或超过10%的投资者可能影响基金的投资策略；（2）持有份额达到20%的投资者、持有基金份额比例达到或超过20%的投资者与一般基金份额持有人利益不一致的风险；（3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者与一般基金份额持有人利益不一致的风险；（4）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者与一般基金份额持有人利益不一致的风险。

10.1 备查文件目录

1、中国证监会核准中银银联添利债券型发起式证券投资基金募集的文件；

- 2.《中银国际稳利债优型发起式证券投资基金基金合同》;
- 3.《中银国际稳利债优型发起式证券投资基金招募说明书》;
- 4.《中银国际稳利债优型发起式证券投资基金托管协议》;
- 5.法律法规;
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照;
- 8.报告期内在指定报刊上披露的各项公告;

9. 中国证监会要求的其他文件。
102. 存放地点
基金管理人及基金托管人的住所,并登载于基金管理人网站www.bocim.com。
103. 查阅方式
投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅,也可登陆基金管理人网站www.bocim.com查阅。
中银基金管理有限公司
二〇一七年四月二十一日