

中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日 基金管理人:中国基金管理有限公司 基金托管人:上海银行股份有限公司

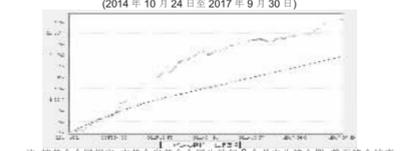
Table with 2 columns: Item, Value. Summary of key financial indicators for the fund.

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: Item, Value. Financial performance metrics for the period.

3.2 本基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:中证综合债指数收益率

3.2.2 本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



注:本基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至建仓结束

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table listing fund managers with columns for Name, Position, Tenure, and Bio.

注:1. 担任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日,非基金经理的“任职日期”为根据基金合同规定确定的聘任日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关法规和其他有关法律法规的规定,严格遵守基金合同、基金招募说明书、基金合同及基金托管协议等法律文件的约定,恪尽职守,勤勉尽责,努力实现基金份额持有人的利益。

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》,建立了《申报的申购和赎回与公开增发管理办法》、《债券申购的申报办法》、《集中交易管理办法》等公平交易管理制度。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,全球经济增长乏力,经济复苏缓慢,美国仍是表现相对较好的经济体。从领先指标来看,三季度美国ISM制造业PMI指数从57.8进一步大幅上升至60.8水平,创出2004年以来新高,经济加速扩张,就业市场整体稳健,通胀影响导致的暂时性扰动并未造成市场恐慌,失业率降至2001年以来最低4.2%。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现异常交易行为。 报告期内,本基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交比例高于该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金投资组合运作分析

报告期内,全球经济增长乏力,经济复苏缓慢,美国仍是表现相对较好的经济体。从领先指标来看,三季度美国ISM制造业PMI指数从57.8进一步大幅上升至60.8水平,创出2004年以来新高,经济加速扩张,就业市场整体稳健,通胀影响导致的暂时性扰动并未造成市场恐慌,失业率降至2001年以来最低4.2%。

4.5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition: 1. 权益投资, 2. 固定收益投资, 3. 金融衍生品投资, 4. 其他资产.

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing industry breakdown of domestic equity investments.

5.3 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股票投资明细

Table listing top 10 equity holdings by fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond portfolio breakdown by type.

5.5 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债券投资明细

Table listing top 5 bond holdings by fair value.

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

Table listing top 10 asset-backed securities.

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权证投资明细

Table listing top 5 warrants.

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.12 其他资产构成

Table showing other assets: 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, 3. 应收股利, 4. 应收利息, 5. 应收申购款, 6. 其他应收款, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

为1.16元,季度内本基金份额净值增长率为0.8%,同期业绩比较基准收益率为0.54%。

4.6 报告期内基金持有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基金资产净值低于五千万元的情况。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition: 1. 权益投资, 2. 固定收益投资, 3. 金融衍生品投资, 4. 其他资产.

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing industry breakdown of domestic equity investments.

5.3 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股票投资明细

Table listing top 10 equity holdings by fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond portfolio breakdown by type.

5.5 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债券投资明细

Table listing top 5 bond holdings by fair value.

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

Table listing top 10 asset-backed securities.

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权证投资明细

Table listing top 5 warrants.

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.12 其他资产构成

Table showing other assets: 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, 3. 应收股利, 4. 应收利息, 5. 应收申购款, 6. 其他应收款, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 投资组合报告附注

5.12 其他资产构成

Table showing other assets: 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, 3. 应收股利, 4. 应收利息, 5. 应收申购款, 6. 其他应收款, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

5.14 报告期内持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末未持有处于转股期的可转换债券

5.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.17 因合同四至五人原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项可能存在尾差。

5.18 其他资产构成

Table showing other assets: 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, 3. 应收股利, 4. 应收利息, 5. 应收申购款, 6. 其他应收款, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

9.1 报告期内第一投资持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table showing top 10 shareholders.

9.2 存放地点

9.3 账户方式

9.4 其他重要事项

9.5 其他重要事项

9.6 其他重要事项

9.7 其他重要事项

9.8 其他重要事项

9.9 其他重要事项

9.10 其他重要事项

9.11 其他重要事项

9.12 其他重要事项

9.13 其他重要事项

9.14 其他重要事项

9.15 其他重要事项

9.16 其他重要事项

9.17 其他重要事项

9.18 其他重要事项

9.19 其他重要事项

9.20 其他重要事项

9.21 其他重要事项

9.22 其他重要事项

9.23 其他重要事项

9.24 其他重要事项

9.25 其他重要事项

9.26 其他重要事项

9.27 其他重要事项

9.28 其他重要事项

9.29 其他重要事项

9.30 其他重要事项

9.31 其他重要事项

9.32 其他重要事项

信诚鼎泰多策略灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日 基金管理人:信诚基金管理有限公司 基金托管人:中国银行股份有限公司

Table with 2 columns: Item, Value. Summary of key financial indicators for the fund.

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: Item, Value. Financial performance metrics for the period.

3.2 本基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:中证综合债指数收益率

3.2.2 本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



注:本基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期,截至建仓结束

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table listing fund managers with columns for Name, Position, Tenure, and Bio.

注:1. 担任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日,非基金经理的“任职日期”为根据基金合同规定确定的聘任日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关法规和其他有关法律法规的规定,严格遵守基金合同、基金招募说明书、基金合同及基金托管协议等法律文件的约定,恪尽职守,勤勉尽责,努力实现基金份额持有人的利益。

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《信诚基金管理有限公司公平交易管理办法》,建立了《申报的申购和赎回与公开增发管理办法》、《债券申购的申报办法》、《集中交易管理办法》等公平交易管理制度。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,全球经济增长乏力,经济复苏缓慢,美国仍是表现相对较好的经济体。从领先指标来看,三季度美国ISM制造业PMI指数从57.8进一步大幅上升至60.8水平,创出2004年以来新高,经济加速扩张,就业市场整体稳健,通胀影响导致的暂时性扰动并未造成市场恐慌,失业率降至2001年以来最低4.2%。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现异常交易行为。 报告期内,本基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交比例高于该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金投资组合运作分析

报告期内,全球经济增长乏力,经济复苏缓慢,美国仍是表现相对较好的经济体。从领先指标来看,三季度美国ISM制造业PMI指数从57.8进一步大幅上升至60.8水平,创出2004年以来新高,经济加速扩张,就业市场整体稳健,通胀影响导致的暂时性扰动并未造成市场恐慌,失业率降至2001年以来最低4.2%。

4.5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition: 1. 权益投资, 2. 固定收益投资, 3. 金融衍生品投资, 4. 其他资产.

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing industry breakdown of domestic equity investments.

5.3 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股票投资明细

Table listing top 10 equity holdings by fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond portfolio breakdown by type.

5.5 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债券投资明细

Table listing top 5 bond holdings by fair value.

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

Table listing top 10 asset-backed securities.

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权证投资明细

Table listing top 5 warrants.

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

为1.16元,季度内本基金份额净值增长率为0.8%,同期业绩比较基准收益率为0.54%。

4.6 报告期内基金持有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基金资产净值低于五千万元的情况。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition: 1. 权益投资, 2. 固定收益投资, 3. 金融衍生品投资, 4. 其他资产.

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing industry breakdown of domestic equity investments.

5.3 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股票投资明细

Table listing top 10 equity holdings by fair value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond portfolio breakdown by type.

5.5 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债券投资明细

Table listing top 5 bond holdings by fair value.

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

Table listing top 10 asset-backed securities.

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权证投资明细

Table listing top 5 warrants.

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.10 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.11 投资组合报告附注

5.12 其他资产构成

Table showing other assets: 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, 3. 应收股利, 4. 应收利息, 5. 应收申购款, 6. 其他应收款, 7. 待摊费用, 8. 其他, 9. 合计.

9.1 报告期内第一投资持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table showing top 10 shareholders.

9.2 存放地点

9.3 账户方式

9.4 其他重要事项

9.5 其他重要事项

9.6 其他重要事项

9.7 其他重要事项

9.8 其他重要事项

9.9 其他重要事项

9.10 其他重要事项

9.11 其他重要事项

9.12 其他重要事项

9.13 其他重要事项

9.14 其他重要事项

9.15 其他重要事项

9.16 其他重要事项

9.17 其他重要事项

9.18 其他重要事项

9.19 其他重要事项

9.20 其他重要事项

9.21 其他重要事项

9.22 其他重要事项

上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日 基金管理人:中国基金管理有限公司 基金托管人:招商银行股份有限公司

Table with 2 columns: Item, Value. Summary of key financial indicators for the fund.

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: Item, Value. Financial performance metrics for the period.

3.2 本基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:中证综合债指数收益率

3.2.2 本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



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table listing fund managers with columns for Name, Position, Tenure, and Bio.

注:1. 担任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日,非基金经理的“任职日期”为根据基金合同规定确定的聘任日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关法规和其他有关法律法规的规定,严格遵守基金合同、基金招募说明书、基金合同及基金托管协议等法律文件的约定,恪尽职守,勤勉尽责,努力实现基金份额持有人的利益。

4.3 公平交易专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金公平交易管理办法》,建立了《申报的申购和赎回与公开增发管理办法》、《债券申购的申报办法》、《集中交易管理办法》等公平交易管理制度。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,全球经济增长乏力,经济复苏缓慢,美国仍是表现相对较好的经济体。从领先指标来看,三季度美国ISM制造业PMI指数从57.8进一步大幅上升至60.8水平,创出2004年以来新高,经济加速扩张,就业市场整体稳健,通胀影响导致的暂时性扰动并未造成市场恐慌,失业率降至2001年以来最低4.2%。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现异常交易行为。 报告期内,本基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交比例高于该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金投资组合运作分析

报告期内,全球经济增长乏力,经济复苏缓慢,美国仍是表现相对较好的经济体。从领先指标来看,三季度美国ISM制造业PMI指数从57.8进一步大幅上升至60.8水平,创出2004年以来新高,经济加速扩张,就业市场整体稳健,通胀影响导致的暂时性扰动并未造成市场恐慌,失业率降至2001年以来最低4.2%。

4.5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition: 1. 权益投资, 2. 固定收益投资, 3. 金融衍生品投资, 4. 其他资产.

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing industry breakdown of domestic equity investments.