

中银美丽中国混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十六日

重要提示

基金管理人董事会及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、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

基金管理人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

2 基金产品概况

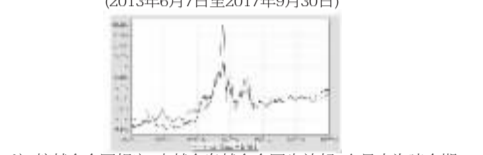
Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 基金管理人, 基金托管人

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 报告期, 本报告期, 上年同期, 本报告期末, 上年度末

3.2 自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:按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,

截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分(二)的规定,即本基金投资组合中股票资产占基金资产的80%-95%,其中A股资产占基金资产的比例不低于基金资产净值的5%。

4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理小组简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1. 曾任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日,非曾任基金经理的“任职日期”为根据公司决定的聘任日期,基金经理的“离任日期”均为根据公司决定的解聘日期。

2. 证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 管理人对外报告内本基金运作遵守中国证监会的相关规定

4. 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》、中国证监会的有关规定和其他有关法律法规的规定,严格执行本基金基金合同,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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。

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《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系,通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待,严格执行不同投资组合之间进行利益输送。

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。

4.3.3 投资效率及投资分析

2017年第三季度,全球经济增长继续稳定复苏,美国仍是表现相对较好的经济体,欧元区经济整体向好。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66.0水平,创出2004年以来新高,经济加速扩张;就业市场整体稳健,失业率降至2001年以来最低4.2%。

4.3.4 投资组合及行业配置情况

截至2017年9月30日止,本基金的资产净值为1,306.21亿元,本基金的累计净值1,341.1元。本季度内本基金净值增长率14.0%,同期业绩比较基准收益率为3.67%。

4.3.5 投资组合报告

4.3.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 类别, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

4.3.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.3 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 with columns: 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(%)

4.3.5.4 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 with columns: 序号, 债券品种, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.7 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 with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

4.3.5.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货交易。

4.3.5.10 报告期末本基金投资的期权交易情况

本基金本报告期末未持有期权。

4.3.5.11 报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况

本基金本报告期末未持有国债逆回购。

4.3.5.12 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

4.3.5.13 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资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.15 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的情况。

4.3.5.16 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名权证中不存在流通受限的情况。

4.3.5.17 报告期末前十名资产支持证券中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名资产支持证券中不存在流通受限的情况。

4.3.5.18 报告期末前十名贵金属中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名贵金属中不存在流通受限的情况。

4.3.5.19 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名权证中不存在流通受限的情况。

4.3.5.20 报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况

本基金本报告期末未持有国债逆回购。

4.3.5.21 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

4.3.5.22 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资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.23 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.24 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的情况。

4.3.5.25 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名权证中不存在流通受限的情况。

4.3.5.26 报告期末前十名资产支持证券中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名资产支持证券中不存在流通受限的情况。

4.3.5.27 报告期末前十名贵金属中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名贵金属中不存在流通受限的情况。

4.3.5.28 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名权证中不存在流通受限的情况。

4.3.5.29 报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况

本基金本报告期末未持有国债逆回购。

4.3.5.30 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

4.3.5.31 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资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.32 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.33 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的情况。

中银稳健双利债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十六日

基金管理人董事会及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、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

基金管理人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

2 基金产品概况

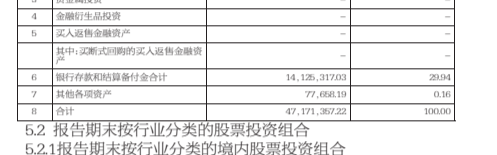
Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 基金管理人, 基金托管人

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 报告期, 本报告期, 上年同期, 本报告期末, 上年度末

3.2 自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:按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,

截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分(二)的规定,即本基金投资组合中债券资产占基金资产的80%-95%,其中A股资产占基金资产的比例不低于基金资产净值的5%。

4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理小组简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1. 曾任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日,非曾任基金经理的“任职日期”为根据公司决定的聘任日期,基金经理的“离任日期”均为根据公司决定的解聘日期。

2. 证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 管理人对外报告内本基金运作遵守中国证监会的相关规定

4. 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》、中国证监会的有关规定和其他有关法律法规的规定,严格执行本基金基金合同,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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。

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《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系,通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待,严格执行不同投资组合之间进行利益输送。

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。

4.3.3 投资效率及投资分析

2017年第三季度,全球经济增长继续稳定复苏,美国仍是表现相对较好的经济体,欧元区经济整体向好。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66.0水平,创出2004年以来新高,经济加速扩张;就业市场整体稳健,失业率降至2001年以来最低4.2%。

4.3.4 投资组合及行业配置情况

截至2017年9月30日止,本基金的资产净值为1,025.21亿元,本基金的累计净值1,070.21元。本季度内本基金净值增长率10.2%,同期业绩比较基准收益率为3.67%。

4.3.5 投资组合报告

4.3.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 类别, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

4.3.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.3 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 with columns: 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(%)

4.3.5.4 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 with columns: 序号, 债券品种, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.7 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 with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

4.3.5.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货交易。

4.3.5.10 报告期末本基金投资的期权交易情况

本基金本报告期末未持有期权。

4.3.5.11 报告期末本基金投资的国债逆回购交易情况

本基金本报告期末未持有国债逆回购。

4.3.5.12 报告期末本基金持有的所有资产支持证券

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

4.3.5.13 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资产支持证券投资明细

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.15 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的情况。

4.3.5.16 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名权证中不存在流通受限的情况。

4.3.5.17 报告期末前十名资产支持证券中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名资产支持证券中不存在流通受限的情况。

4.3.5.18 报告期末前十名贵金属中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名贵金属中不存在流通受限的情况。

4.3.5.19 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名权证中不存在流通受限的情况。

中银稳健双利债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:二〇一七年十月二十六日

基金管理人董事会及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、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

基金管理人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

2 基金产品概况

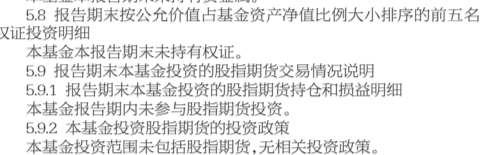
Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日期, 基金管理人, 基金托管人

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 报告期, 本报告期, 上年同期, 本报告期末, 上年度末

3.2 自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:按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,

截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分(二)的规定,即本基金投资组合中债券资产占基金资产的80%-95%,其中A股资产占基金资产的比例不低于基金资产净值的5%。

4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理小组简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明

注:1. 曾任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日,非曾任基金经理的“任职日期”为根据公司决定的聘任日期,基金经理的“离任日期”均为根据公司决定的解聘日期。

2. 证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 管理人对外报告内本基金运作遵守中国证监会的相关规定

4. 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》、中国证监会的有关规定和其他有关法律法规的规定,严格执行本基金基金合同,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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。

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《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系,通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待,严格执行不同投资组合之间进行利益输送。

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。

4.3.3 投资效率及投资分析

2017年第三季度,全球经济增长继续稳定复苏,美国仍是表现相对较好的经济体,欧元区经济整体向好。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66.0水平,创出2004年以来新高,经济加速扩张;就业市场整体稳健,失业率降至2001年以来最低4.2%。

4.3.4 投资组合及行业配置情况

截至2017年9月30日止,本基金的资产净值为1,025.21亿元,本基金的累计净值1,070.21元。本季度内本基金净值增长率10.2%,同期业绩比较基准收益率为3.67%。

4.3.5 投资组合报告

4.3.5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 类别, 金额(元), 占基金总资产比例(%)

4.3.5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.3 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 with columns: 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(%)

4.3.5.4 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 with columns: 序号, 债券品种, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.7 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 with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3.5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

4.3.5.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货交易。