

中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF)

2018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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

基金管理人的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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
本基金托管人及招行银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月23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。

基金投资风险提示：投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》及相关公告，了解基金的具体情况，选择与自己风险识别能力和承受能力相适应的基金产品，谨慎投资。

本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF)

场内简称:中银300E

基金代码:163821

交易方式:场外

上市交易场所:上海市证券交易所

基金合同生效日:2012年6月17日

报告期末基金份额总额:24,610,231.00份

报告期基金份额净值:1.00元

基金份额净值增长率:66.2224%

报告期基金份额净值增长率标准差:1.377792%

过去三个月份额净值利润率:-0.08%

4期基金份额净值:30,361,897.90

5期基金份额净值:1,294 cfdt-pU_Gm3GzJyqZp6n2 g2uL-1mengpe

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;2.所述基金业绩指标包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.1 本报告期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 净值增长 率 业绩比较基 准收益率 业绩比较基 准收益率 标准差

过去三个月 -0.08% 1.17% -0.01% 0.64% -0.08%

注:2.2自基金成立以来本基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的对比图

中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF) 累计净值增长率历史走势图(2012年5月1日至2018年9月30日)

注:按基金合同规定,本基金基金合同期生效起6个月内为建仓期,截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同的规定。

4.1 管理人报告

4.1.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证书从业年限 说明

赵建斌 中银沪深300等权重指数证券投资基金(LOF) 2016-06-08 - 11 1. 前任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日,非现任基金经理的“任职日期”、证书从业年限、说明均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. 证券从业人员对报告期内本基金运作的合规性意见、风险提示和其他说明。

本基金在报告期内,本基金管理人遵守了有关法律法规的规定,严格履行了基金合同约定的职责,没有损害基金份额持有人的利益。

本基金在报告期内,本基金管理人没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

本基金在报告期内,本基金管理人没有发生损害基金份额持有人利益的事件。

本基金在报告期内,本基金管理人没有发生损害基金份额持有人