中银腾利灵活配置混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十六日

1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金的过往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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	中银腾利混合	
基金主代码	002502	
交易代码	002502	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年6月21日	
基金管理人	中银基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	499,709,454.40份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银腾利混合A	中银腾利混合C
下属分级基金的交易代码	002502	002503
报告期末下属分级基金的份额总额	498,612,068.49份	1,097,385.91份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格风险控制的前提下,通过科学严谨、具有前瞻性的宏观策略分析以及个券精选策略,结合大类资产配置策略,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用"自上而下"与"自下而上"相结合的主动投资管理策略,将定性分析与定量分析贯穿于大类资产配置、行业配置和个股筛选中,精选经济新变化和发展趋势中的大类资产和个股个券,构建投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%。如果今后证券市场中有其他代表性更强,或者指数编制单位停止编制该指数,或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况在按照监管部门要求履行适当的程序并经基金托管人同意后对业绩比较基准进行相应调整。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	薛文成	李修滨
	联系电话	021-38834999	4006800000
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95558
传真		021-68873488	010-85230024

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路200号26楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)	
	中银腾利混合A	中银腾利混合C
本期已实现收益	10,602,588.80	25,602.15
本期利润	36,548,742.79	91,937.68
加权平均基金份额本期利润	0.0719	0.0720
本期基金份额净值增长率	7.55%	7.47%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	中银腾利混合A	中银腾利混合C
期末可供分配基金份额利润	0.0086	0.0079
期末基金资产净值	508,418,682.78	1,118,201.35
期末基金份额净值	1.020	1.019

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.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。期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额),即如果期末未分配利润(报表数,下同)的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

中银腾利混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.40%	0.23%	3.35%	0.69%	-0.95%	-0.46%
过去三个月	2.19%	0.22%	-0.65%	0.91%	2.84%	-0.69%
过去六个月	7.55%	0.26%	15.98%	0.92%	-8.43%	-0.66%
过去一年	5.81%	0.27%	7.21%	0.91%	-1.40%	-0.64%
过去三年	13.31%	0.22%	13.55%	0.66%	-0.24%	-0.44%
自基金合同生效日起	13.42%	0.22%	14.57%	0.66%	-1.15%	-0.44%

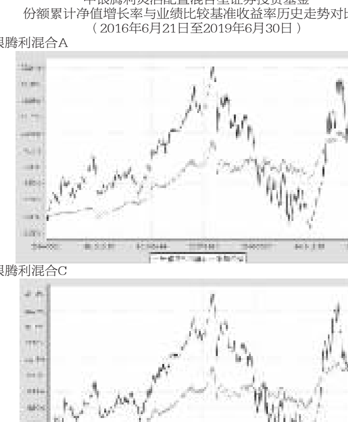
中银腾利混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.40%	0.24%	3.35%	0.69%	-0.95%	-0.45%
过去三个月	2.19%	0.23%	-0.65%	0.91%	2.84%	-0.68%
过去六个月	7.47%	0.27%	15.98%	0.92%	-8.51%	-0.65%
过去一年	5.19%	0.28%	7.21%	0.91%	-2.02%	-0.63%
过去三年	12.54%	0.23%	13.55%	0.66%	-1.01%	-0.43%
自基金合同生效日起	12.65%	0.23%	14.57%	0.66%	-1.92%	-0.43%

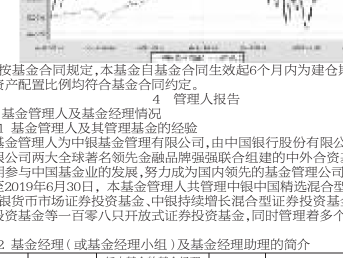
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银腾利灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年6月21日至2019年6月30日)

中银腾利混合A



中银腾利混合C



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起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约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中银基金管理有限公司,由中国银行股份有限公司和贝莱德投资管理有限公司两大全球著名领先金融品牌强强联合组建的中外合资基金管理公司,致力于长期参与中国基金业的发展,努力成为国内领先的基金管理公司。

截至2019年6月30日,本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等一百零八只开放式证券投资基金,同时管理着多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苗婷	基金经理	2016-08-16	-	12	经济学硕士。曾任万家基金管理有限公司交易员。2010年加入中银基金管理有限公司,曾任债券交易员。2016年8月至今任中银新机遇基金基金经理,2016年8月至今任中银瑞利基金基金经理,2016年8月至今任中银珍利基金基金经理,2016年8月至今任中银新财富基金基金经理,2016年8月至今任中银裕利基金基金经理,2016年8月至今任中银腾利基金基金经理,2016年12月至今中银广利基金基金经理。具有12年证券从业年限。具备基金从业资格。

注:1、首任基金经理的"任职日期"为基金合同生效日,非首任基金经理的"任职日期"为根据公司决定确定的聘任日期,基金经理的"离任日期"均为根据公司决定确定的解聘日期;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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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则和其他有关法律法规的规定,严格遵循本基金基金合同,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。

本报告期内,本基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易,本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

本报告期内,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较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

1. 宏观经济分析

国外经济方面,上半年全球经济普遍下行,美国经济的韧性也有所松动。从领先指标来看,美国经济景气度显著下降,上半年美国ISM制造业PMI指数从54.3下滑至51.7,个人消费支出增速下行,核心PCE依旧不达2%的目标,但劳动力市场整体稳健,薪资增速温和放缓至3.1%,美元指数由于美强欧弱格局的维持震荡走高至97上方。欧元区经济下行风险加大,上半年制造业PMI指数从51.4显著下行至47.6,不过内部经济存在分化,德国PMI大幅下滑至荣枯线50以下,法国、意大利PMI在下行后有所回升;欧元区通胀表现疲软,欧央行立场向鸽派调整,下一步大概率进行降息及重启QE。日本经济延续放缓,上半年制造业PMI指数从52.6回落至荣枯线50以下,通胀逐渐回暖但工业产出仍在延续下行,日本央行预计维持宽松基调。综合来看,美国经济增速预计继续放缓,贸易不确定性依然给经济前景蒙上阴影,美联储2019年下半年预计降息1-2次;欧洲经济景气度继续低迷,德国经济增长前景仍受外需拖累;日本经济在通胀低迷、外需下行的影响下复苏前景不佳。

国内经济方面,在外需持续偏弱和贸易摩擦升级背景下,经济下行压力再度体现。具体来看,上半年领先指标中采制造业PMI指数短暂回升后又重新回落至49.4,同步指标工业增加值1-6月累计同比增长6.0%,较2018年末回落0.2个百分点。从经济增长动力来看,出口继续受贸易摩擦和外需走弱冲击,消费企稳回升,投资小幅回落:1-6月美元计价累计出口增速较2018年末回落9.8个百分点至0.1%左右,6月社会消费品零售总额增速较2018年末回升1.6个百分点至9.8%,制造业投资大幅下滑,房地产投资高位回落,基建投资低位震荡,1-6月固定资产投资增速较2018年末小幅回落0.1个百分点至5.8%的水平。通胀方面,CPI小幅攀升但阶段性见顶,6月同比增速从2018年末的1.9%上升0.8个百分点至2.7%,PPI震荡回落,6月同比增速从2018年末的0.9%下行0.9个百分点至0%。

2. 市场回顾

整体来看,上半年债市利率债品种出现了不同程度的下跌,但信用债出现上涨。其中,一季度,中债总全价指数上涨0.15%,中债银行间国债全价指数上涨0.55%,中债企业债总全价指数上涨0.57%;二季度中债总全价指数下跌0.53%,中债银行间国债全价指数下跌1.06%,中债企业债总全价指数下跌0.10%。反映在收益率曲线上,上半年收益率曲线略有平坦化。其中,一季度,10年期国债收益率从3.23%的水平下行16个bp至3.07%,10年期金融债(国开)收益率从3.64%下行6个bp至3.58%;二季度,10年期国债收益率从3.07%的水平上行16个bp至3.23%,10年期金融债(国开)收益率从3.58%上行3个bp至3.61%。货币市场方面,上半年货币政策中性偏宽松,资金面呈现总体宽松、时点性紧张的格局。其中,一季度,银行间1天回购加权平均利率均值在2.22%左右,较上季度均值下行17bp,银行间7天回购利率均值在2.66%左右,较上季度均值下行18bp;二季度,银行间1天回购加权平均利率均值在2.09%左右,较上季度均值下行13bp,银行间7天回购利率均值在2.64%左右,较上季度均值下行2bp。

可转债方面,上半年主要跟随权益市场,整体先扬后抑,同时转债估值较2018年末低位小幅提升。其中,一季度,中证转债指数上涨17.48%,个券方面,特发转债、广电转债、天马转债等中小品种整体表现相对较好,分别上涨72.51%、64.27%、49.78%;二季度,中证转债指数下跌3.55%,个券方面,凯龙转债、泰晶转债、特发转债、联泰转债、安井转债等品种表现相对较好,分别上涨47.65%、40.06%、27.32%、26.20%、23.56%。从市场波动情况看,转债估值总体较为平稳,权益市场几乎完全主导了转债市场的波动。股票市场方面,一季度上证综指上涨23.93%,代表大盘股表现的沪深300指数上涨28.62%,中小板综合指数上涨33.79%,创业板综合指数上涨33.43%。二季度,上证综指下跌3.62%,代表大盘股表现的沪深300指数下跌1.21%,中小板综合指数下跌10.31%,创业板综合指数下跌9.36%。

3. 运行分析

上半年股票市场先扬后抑,总体出现一定程度上涨,债券市场各品种表现分化。策略上,本基金延续绝对收益投资思路,即以配置高等级信用债券为主,合理控制组合久期和杠杆比例;同时保持适量权益仓位,积极把握波段机会,适时调整行业配置结构;积极参与一级市场新股申购,借此提升基金的业绩表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金A类份额净值增长率为7.55%,同期业绩比较基准收益率为15.98%。

报告期内本基金C类份额净值增长率为7.47%,同期业绩比较基准收益率为15.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,全球经济继续走弱,中美贸易谈判重回正轨,但是第二批2000亿美元商品关税已经上调至25%,国内经济基本面仍面临一定下行压力。国内宏观政策保持定力,货币政策主要根据国内经济增长、价格形势的变化到进行预调微调,保持流动性合理充裕和市场利率水平合理稳定。财政政策继续托底,地方政府专项债券新规助力提升基建投资增速。

我们对2019年下半年债券市场的走势保持谨慎乐观。经济基本面下行压力延续,制造业景气度较低,后续PMI可能呈现低位震荡或弱反弹走势,固定资产投资增速预计保持低位震荡,出口持续承压,消费略有起色。货币政策稳健偏松的同时保持定力,保留了"总闸门"的说法,推动供给体系、需求体系和金融体系形成相互支持的三角框架,并稳妥推进金融风险防控工作。通货膨胀方面,下半年存在一定压力,CPI同比增速预计三季度见顶回落,PPI同比增速预计三季度延续回落,但两者均预计在四季度明显抬升。全球需求下滑背景下,美国经济边际下行风险逐渐加大,美债收益率维持低位,中美利差仍处于较高水平,对于国内长端利率不构成限制。综合上述分析,预计下半年债券收益率可能呈震荡走势。可转债方面,整体估值仍处在较低区间,随着品种的持续丰富,市场结构性机会带来的择券空间将继续增加。信用债方面,经济下行叠加结构性去杠杆背景下需对违约风险继续保持高度关注。在做好组合流动性管理的基础上,我们将保持适度杠杆和久期,合理分配各类资产,审慎精选信用债和可转债品种,积极把握投资交易机会。我们将坚持从自上而下的角度预判市场走势,并从自下而上的角度严防信用风险。权益方面,虽然企业盈利在贸易摩擦和PPI趋势回落的背景下承压,但在国内逆周期政策对冲下不至于失速,同时国内外偏松的货币环境将引导无风险利率下行从而支撑估值,预计下半年市场大概率呈现震荡格局,中美贸易战仍是影响风险偏好的重要变量,但具有较大的不确定性,在坚守核心资产的同时我们关注成长板块、受益于科创板和流动性宽松的券商行业及受益于逆周期政策发力的基建板块等。作为基金管理者,我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧,为投资人创造应有的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定,本公司为建立健全有效的估值政策和程序,经公司执行委员会批准,公司成立估值委员会,明确参与估值流程各方的人员分工和职责,由研究部、风险管理部、基金运营部及投资相关部门的相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性,分工明确,在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场环境相适应的估值方法,基金运营部应征询会计师事务所、托管行的相关意见。公司按特殊流程改变估值技术时,导致基金资产净值的变化在0.25%以上的,应就基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见,会计师事务所应对公司所采用的相关估值模型、假设、参数及输入的适当性发表审核意见,同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外,对于特定品种或者投资品种相同,但具有不同特征的,若协会有特定调整估值方法的通知的,比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的,应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见,并经估值委员会审议,采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.6.2本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.6.3定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

截止收益分配基准日2019年3月5日,A类份额可供分配利润为10,579,759.35元,C类份额可供分配利润为23,080.04元,本基金于2019年3月15日进行了收益分配,每10份A类基金份额分红0.20元,分红总金额为10,171,606.54元;每10份C类基金份额分红0.15元,分红总金额为22,231.34元。

截止收益分配基准日2019年6月12日,A类份额可供分配利润为5,074,148.28元,C类份额可供分配利润为10,324.07元,本基金于2019年6月25日进行了收益分配,每10份A类基金份额分红0.09元,分红总金额为4,487,399.32元;每10份C类基金份额分红0.09元,分红总金额为9,813.41元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对中银腾利灵活配置混合型证券投资基金2019年半年度基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,中银基金管理有限公司在中银腾利灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,中银基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的中银腾利灵活配置混合型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:中银腾利灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:	-	-
银行存款	3,788,658.47	2,797,518.30
结算备付金	3,836,280.90	8,547,927.83
存出保证金	52,913.70	101,479.75
交易性金融资产	611,331,468.51	636,796,432.53
其中:股票投资	102,336,354.52	122,765,706.62
基金投资	-	-
债券投资	508,995,113.99	514,030,725.91
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	787,927.67
应收利息	8,029,598.17	5,323,875.52
应收股利	-	-
应收申购款	1,793.24	2,000.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	627,040,712.99	654,357,161.60
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	117,000,000.00	156,000,000.00
应付证券清算款	21,632.88	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	252,232.14	254,363.94
应付托管费	42,038.70	55,417.48
应付销售服务费	93.01	104.64
应付交易费用	8,845.88	44,763.27
应交税费	40,783.35	28,000.97
应付利息	18,882.19	-42,313.98
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	119,320.71	79,000.00
负债合计	117,503,828.86	156,419,336.32
所有者权益:	-	-
实收基金	499,709,454.40	509,936,145.85
未分配利润	9,827,429.73	-11,998,320.57
所有者权益合计	509,536,884.13	497,937,825.28
负债和所有者权益总计	627,040,712.99	654,357,161.60

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.020元,基金份额总额499,709,454.40份。其中A类基金份额净值1.020元,A类基金份额498,612,068.49份;C类基金份额净值1.019元,C类基金份额1,097,385.91份。

6.2 利润表

会计主体:中银腾利灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	40,545,742.51	14,402,692.85
1.利息收入	8,642,730.80	11,248,489.38
其中:存款利息收入	74,650.69	513,250.41
债券利息收入	8,562,255.36	10,127,246.66
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,824.75	607,992.31
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	5,889,913.60	-131,907.61
其中:股票投资收益	3,220,844.35	1,662,054.59
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,769,801.75	-3,258,016.82
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	899,267.50	1,464,054.62
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	26,012,489.52	3,285,378.50
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	608.59	732.58
减:二、费用	3,905,062.04	3,808,561.22
1. 管理人报酬	1,523,597.53	2,208,311.20
2. 托管费	253,932.88	552,077.83
3. 销售服务费	636.16	10,888.27
4. 交易费用	182,594.15	738,630.40
5. 利息支出	1,790,605.94	69,496.43
其中:卖出回购金融资产支出	1,790,605.94	69,496.43
6.税金及附加	19,905.10	5,887.39
7. 其他费用	133,790.28	223,269.70
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	36,640,680.47	10,594,131.63
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	36,640,680.47	10,594,131.63

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中银腾利灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	509,936,145.85	-11,998,320.57	497,937,825.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	36,640,680.47	36,640,680.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-10,226,691.45	-123,879.56	-10,350,571.01
其中:1.基金申购款	703,908.41	3,202.16	707,110.57
2.基金赎回款	-10,930,599.86	-127,081.72	-11,057,681.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-14,691,050.61	-14,691,050.61
五、期末所有者权益(基金净值)	499,709,454.40	9,827,429.73	509,536,884.13
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,964,348,889.15	6,148,915.48	1,970,497,804.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,594,131.63	10,594,131.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,302,846,219.49	-15,921,577.12	-1,318,767,796.61
其中:1.基金申购款	352,167.87	4,120.02	356,287.89
2.基金赎回款	-1,303,198,387.36	-15,925,697.14	-1,319,124,084.50
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-5,958,836.44	-5,958,836.44
五、期末所有者权益(基金净值)	661,502,669.66	-5,137,366.45	656,365,303.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:李道滨,主管会计工作负责人:王圣明,会计机构负责人:乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银腾利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2016]293号文《关于准予中银腾利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由基金管理人中银基金管理有限公司于自2016年5月31日至2016年6月17日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第61062100_B10号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年6月21日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币656,548,754.56元,在募集期间产生的利息为人民币68,614.56元,以上实收基金(本息)合计为人民币656,617,369.12元,折合656,617,369.12份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中银基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股票期权、权证、股指期货等权益类品种,债券等固定收益类品种(包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款等)、货币市场工具、国债期货,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2019年6月30日的财务状况以及2019年半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定(2011年修订)》及相关地方教育附加的征收规定,凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人,都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司("中信银行")	基金托管人、基金销售机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.1.1 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,523,597.53	2,208,311.20
其中:支付销售机构的客户维护费	5,665.80	7,894.17

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.6%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	253,932.88	552,077.83

注:基金托管费每日计提,按月支付。原基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%年费率计提,基金份额持有人大会于2018年12月19日表决通过了《关于中银腾利灵活配置混合型证券投资基金调整基金费率的议案》,将基金年托管费率从0.15%降低至0.1%,自2018年12月20日起,正式实施调整后的基金托管费率。计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银腾利混合A	中银腾利混合C	合计
中信银行	-	363.43	363.43
中国银行	-	238.95	238.95
中银基金管理有限公司	-	27.18	27.18
合计	-	629.56	629.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银腾利混合A	中银腾利混合C	合计
中信银行	-	707.32	707.32
中国银行	-	184.51	184.51
中银基金管理有限公司	-	9,993.57	9,993.57
合计	-	10,885.40	10,885.40

注:基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别,适用不同的销售服务费率。其中,A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。本基金C类基金份额销售服务费计提的计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日 债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	-	98,304,197.79	-	-	-	-

注:本基金本报告期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	3,788,658.47	15,930.12	4,097,743.71	171,343.11
合计	3,788,658.47	15,930.12	4,097,743.71	171,343.11

注:本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管,按银行同业利率计息。

除上表列示的金额外,本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司,获得的利息收入为人民币58,102.69元,2019年6月30日结算备付金余额为人民币3,836,280.90元。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300014	亿纬锂能	2019-05-20	2020-05-20	非公开发行限售	21.74	26.93	344,986	7,499,995.64	9,290,472.98	-
300014	亿纬锂能	2019-05-20	2021-05-20	非公开发行限售	21.74	25.89	344,986	7,499,995.64	8,931,687.54	-
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	网下新股待上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	网下新股待上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.9.1.2受限证券类别:债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113028	环境转债	2019-06-20	2019-07-08	网下新债待上市	100.00	100.00	1,530	153,000.00	153,000.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为117,000,000.00元。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	102,336,354.52	16.32
	其中:股票	102,336,354.52	16.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	508,995,113.99	81.17
	其中:债券	508,995,113.99	81.17
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,624,939.37	1.22
8	其他各项资产	8,084,305.11	1.29
9	合计	627,040,712.99	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	2,627,548.80	0.52
C	制造业	40,061,426.58	7.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,070,500.00	1.39
E	建筑业	5,004,334.00	0.98
F	批发和零售业	2,316,549.20	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	5,700,092.12	1.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.01
J	金融业	37,731,132.46	7.40
K	房地产业	1,762,061.00	0.35
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	102,336,354.52	20.08

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	3,127,758	18,422,494.62	3.62
2	300014	亿纬锂能	689,972	18,222,160.52	3.58
3	600809	山西汾酒	108,238	7,473,833.90	1.47
4	600900	长江电力	395,000	7,070,500.00	1.39
5	601288	农业银行	1,438,581	5,178,891.60	1.02
6	600104	上汽集团	201,600	5,140,800.00	1.01
7	600009	上海机场	53,700	4,498,986.00	0.88
8	601318	中国平安	47,400	4,200,114.00	0.82
9	600019	宝钢股份	577,500	3,753,750.00	0.74
10	000001	平安银行	254,975	3,513,555.50	0.69

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300014	亿纬锂能	14,999,991.28	3.01
2	002736	国信证券	1,999,635.00	0.40
3	600489	中金黄金	1,999,071.00	0.40
4	002273	水晶光电	1,998,877.40	0.40
5	600837	海通证券	1,998,603.00	0.40
6	600383	XD金地集	1,997,518.00	0.40
7	600029	南方航空	999,640.00	0.20
8	002024	苏宁易购	998,230.00	0.20
9	600570	恒生电子	997,813.00	0.20
10	601333	广深铁路	996,648.00	0.20
11	601288	农业银行	996,343.00	0.20
12	601318	中国平安	993,907.00	0.20
13	000001	平安银行	699,429.00	0.14
14	600989	宝丰能源	270,838.72	0.05
15	600968	海油发展	192,780.00	0.04
16	002948	青岛银行	94,522.24	0.02
17	600928	西安银行	90,684.36	0.02
18	002958	青农商行	70,092.00	0.01
19	603379	三美股份	66,546.36	0.01
20	601615	明阳智能	63,797.25	0.01

注:"买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002142	宁波银行	10,696,431.55	2.15
2	000001	平安银行	9,015,350.28	1.81
3	000651	格力电器	8,270,873.94	1.66
4	002024	苏宁易购	6,539,104.72	1.31
5	000338	潍柴动力	6,533,486.00	1.31
6	000089	深圳机场	5,440,480.87	1.09
7	600570	恒生电子	5,066,712.52	1.02
8	002659	凯文教育	4,825,805.00	0.97
9	000538	云南白药	3,208,413.56	0.64
10	600011	华能国际	2,932,822.00	0.59
11	600837	海通证券	2,470,831.00	0.50
12	000983	西山煤电	2,377,940.00	0.48
13	600489	中金黄金	2,027,741.00	0.41
14	601006	大秦铁路	1,729,680.00	0.35
15	002304	洋河股份	1,443,486.00	0.29
16	000429	粤高速A	1,212,198.06	0.24
17	601333	广深铁路	1,142,813.00	0.23
18	600029	南方航空	1,121,959.00	0.23
19	600315	上海家化	1,096,030.00	0.22
20	601607	上海医药	942,438.00	0.19

注:"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	33,608,872.15
卖出股票的收入(成交)总额	82,008,089.78

注:"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,267,000.00	9.87
	其中:政策性金融债	30,021,000.00	5.89
4	企业债券	281,980,000.00	55.34
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	142,012,000.00	27.87
7	可转债(可交换债)	5,642,113.99	1.11
8	同业存单	29,094,000.00	5.71
9	其他	-	-
10	合计	508,995,113.99	99.89

7.6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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	101801128	18国电MTN002	300,000	30,522,000.00	5.99
2	180410	18农发10	300,000	30,021,000.00	5.89
3	111910209	19兴业银行CD209	300,000	29,094,000.00	5.71
4	101800736	18华能MTN002	200,000	20,512,000.00	4.03
5	101800710	18汇金MTN008	200,000	20,402,000.00	4.00

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货,无相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

7.12.12019年06月24日,中国农业发展银行由于存在"贷前调查不到位",被鹤岗银保监局予以50万元的处罚。

2018年11月19日工商银行由于存在电话销售保险过程中欺骗投保人的行为被中国保险监督管理委员会北京监管局处以行政处罚。

基金管理人通过进行进一步了解后,认为该处罚不会对上述证券的投资价值构成实质性的影响。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余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。

7.12.2本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	52,913.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,029,598.17
5	应收申购款	1,793.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,084,305.11

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127005	长证转债	717,916.20	0.14
2	110046	圆通转债	709,424.90	0.14
3	128020	水晶转债	446,345.79	0.09

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300014	亿纬锂能	18,222,160.52	3.58	重大事项

7.12.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
中银腾利混合A	118	4,225,526.00	495,020,316.80	99.2797%	3,591,751.69	0.7203%
中银腾利混合C	128	8,573.33	-	-	1,097,385.91	100.0000%
合计	246	2,031,339.25	495,020,316.80	99.0616%	4,689,137.60	0.9384%

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中银腾利混合A	9,895.26	0.0020%
	中银腾利混合C	1,583.47	0.1443%
	合计	11,478.73	0.0023%

注:分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中银腾利混合A	0
	中银腾利混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中银腾利混合A	0
	中银腾利混合C	0
	合计	0

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中银腾利混合A	中银腾利混合C
基金合同生效日(2016年6月21日)基金份额总额	620,443,415.40	36,173,953.72
本报告期期初基金份额总额	508,669,837.93	1,266,307.92
本报告期基金总申购份额	146,185.17	557,723.24
减:本报告期基金总赎回份额	10,203,954.61	726,645.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	498,612,068.49	1,097,385.91

10 重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

10.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,经基金管理人2019年第一次股东会决议,宋福宁先生不再担任公司董事,荆新先生、雷晓波先生不再担任公司独立董事。王卫东先生新任公司董事,付磊先生新任公司独立董事。

2019年7月19日基金管理人刊登《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更事宜的公告》,经基金管理人董事会决议通过闫黎平女士担任副执行总裁。

本报告期内,经托管人董事会会议审议通过,聘任方合英先生为本行行长,任职资格于2019年3月29日获中国银行保险监督管理委员会批复核准。孙德顺先生因年龄原因不再担任本行执行董事、行长等职务。根据工作需要,任命杨璋琪先生担任本行资产托管部副总经理,主持资产托管部相关工作。

10.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略没有发生改变。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内没有改聘会计师事务所。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
长江证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	63,699,829.69	64.55%	58,447.05	64.54%	-
中金公司	1	15,138,631.26	15.34%	13,795.92	15.23%	-
西南证券	1	9,196,916.66	9.32%	8,565.08	9.46%	-
东吴证券	2	5,133,031.68	5.20%	4,677.80	5.17%	-
西部证券	2	3,024,722.87	3.07%	2,756.47	3.04%	-
东方证券	2	1,494,329.02	1.51%	1,391.63	1.54%	-
广发证券	2	996,343.00	1.01%	927.90	1.02%	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基字〔1998〕29号)及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》有关规定,本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括:券商基本面评价(财务状况、经营状况)、券商研究机构评价(报告质量、及时性和数量)、券商每日信息评价(及时性和有效性)和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序:首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》,然后根据评分高低选择基金专用交易单元并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	50,207,433.97	96.66%	-	-	-	-
华创证券	608,151.59	1.17%	2,674,000,000.00	45.06%	-	-
西南证券	70,796.60	0.14%	2,340,700,000.00	39.44%	-	-
东方证券	1,053,920.00	2.03%	672,000,000.00	11.32%	-	-
广发证券	-	-	248,000,000.00	4.18%	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2019-01-01至2019-06-30	505,020,316.80	-	10,000,000.00	495,020,316.80	99.0616%

产品特有风险

本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况,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资产净值持续低于5000万元的风险。

中银基金管理有限公司
二〇一九年八月二十六日