

中银主题策略混合型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31日

基金管理人:中银基金管理有限公司 基金托管人:广发银行股份有限公司 报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

Table with 2 columns: Item (基金简称, 基金代码, etc.) and Value (中银主题策略混合, 163822, etc.)

83 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标 (1.本期已实现收益, 2.本期利润, etc.) and 报告期 (2017年1月1日至2017年3月31日)

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率标准差③, ①-③, ②-④

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起6个月内为建仓期,截至建仓结束时本基金的资产配置符合基金合同第十二部分(二)的规定...

84 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限, 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”为根据基金合同确定的聘任日期...

2.基金经理的计算标准及含义遵从《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等相关规定。

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》...

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 1. 宏观经济分析

国内外经济方面,世界经济继续处于缓慢复苏中。主要经济体经济走势分化,美国经济复苏加快,欧元区复苏不断巩固...

2. 市场回顾 整体来看,上证指数震荡上行,创业板指震荡下行。一月份周期性行业在周期复苏的预期下,表现较好...

3. 运行分析 中银主题策略混合型证券投资基金基金经理:王仲伟

本基金年初对经济复苏的预期较强,同时国内供给侧改革也在不断推进,行业配置主要集中在金属和油气等相关受益于经济复苏的行业...

4.2 报告期内基金的投资表现 截至2017年3月31日,本基金的单位净值为1.8430元。本基金的累计单位净值为1.943元...

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 展望2017年,我们认为全球主要经济体将维持复苏势头,美国新任总统特朗普的“减税+基建”财政政策有望提振美国经济增长...

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形。

85 投资组合报告

85.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

85.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

85.3 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 5 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(%)

85.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末持有债券 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

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 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

85.5 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股指期货投资明细

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权证投资明细 5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 5.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 5.13 其他各项资产

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 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。

86 投资组合报告 86.1 基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

86.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

86.3 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 5 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(%)

中银智能制造股票型证券投资基金 2017年第1季度报告

2017年3月31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 报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

81 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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

4.2 报告期内基金的投资表现 截至2017年3月31日,本基金的单位净值为0.747元。本基金的累计单位净值为0.747元...

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 展望2017年,我们认为全球主要经济体将维持复苏势头,美国新任总统特朗普的“减税+基建”财政政策有望提振美国经济增长...

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形。

85 投资组合报告

85.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

85.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

85.3 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 5 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(%)

85.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末持有债券 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

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 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

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 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 5.13 其他各项资产

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 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。

86 投资组合报告 86.1 基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

86.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

86.3 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 5 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(%)

86.4 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股指期货投资明细

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权证投资明细 5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 5.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 5.13 其他各项资产

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 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。

87 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

87.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况 87.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

88 备查文件目录 1. 中银智能制造股票型证券投资基金募集说明书; 2. 中银智能制造股票型证券投资基金合同;

3. 中银智能制造股票型证券投资基金托管协议; 4. 中银智能制造股票型证券投资基金招募说明书; 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. 中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点 基金管理人及基金托管人的办公场所,部分文件同时存放于基金管理人互联网站。

8.3 查阅方式 投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

中银基金管理有限公司 二〇一七年四月二十一日

5.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合 本基金本报告期末持有沪港通股票投资

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 5 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 with 5 columns: 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(%)

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

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 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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.13 其他各项资产 5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 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。

86 投资组合报告 86.1 基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

86.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

86.3 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 5 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(%)

86.4 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股指期货投资明细

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权证投资明细 5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 5.9 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.12 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 5.13 其他各项资产

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 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。