中金现金管家货币市场基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人:中金基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金现金管家	
基金主代码	000882	
交易代码	000882	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年11月28日	
报告期末基金份额总额	232,698,756.37份	
投资目标	在保障基金资产的安全性和流动性的前提下,通过积极主动管理,力争实现超越业绩比较基准的稳定收益。	
投资策略	根据对宏观经济指标、货币政策、市场结构变化等因素的研究与分析,对未来一段时期短期市场利率进行判断,对短期利率走势形成合理预期,并根此调整基金资产的配置策略。通过对市场资金供求、基金申赎情况进行动态分析,确定本基金流动性目标,相应调整基金资产在高流动性资产和相对流动性较低资产之间的配比,并根据对短期利率走势的判断确定并调整组合的平均剩余期限。在充分论证银行间市场和交易所市场套利的合可行性基础上,寻找个人时机,进行跨市场操作,获得安全的超额收益。在遵循流动性优先的原则下,建立流动性预警指标,并通过现金库存、资产变现、剩余期限管理等措施确保基金资产的整体变现能力。	
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中金现金管家A类	中金现金管家B类
下属分级基金的交易代码	000882	000883
报告期末下属分级基金的份额总额	28,293,912.01份	204,404,844.36份

§3 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

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)	
	中金现金管家A类	中金现金管家B类
1.本期已实现收益	337,931.51	4,935,956.66
2.本期利润	337,931.51	4,935,956.66
3.期末基金资产净值	28,293,912.01	204,404,844.36

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金现金管家A类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.0840%	0.0092%	0.3329%	0.0000%	0.7511%	0.0092%

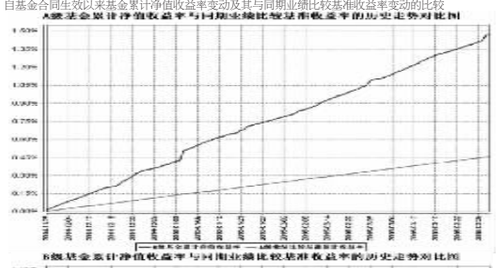
注:本基金收益分配按日结转份额。

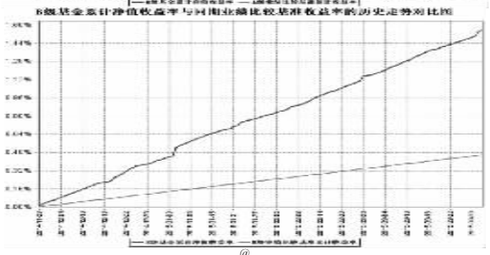
中金现金管家B类

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	1.1434%	0.0092%	0.3329%	0.0000%	0.8105%	0.0092%

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:本基金的基金合同生效日为2014年11月28日。按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石云峰	本基金的基金经理	2014年11月28日	-	8	石云峰先生,经济学硕士。历任中国邮政储蓄银行总行资金管运部交易员,太平养老保险股份有限公司固定收益投资经理,嘉实基金管理有限公司投资管理部基金经理,2014年11月4日起任中金现金管家货币市场基金基金经理。

注:1、上述任职日期为基金合同生效日;
2、证券从业的含义遵从行业协会《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》等有关法律法规的规定和《中金现金管家货币市场基金本基金合同》的约定规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在保障基金资产的安全性和流动性的前提下,通过积极主动管理,力争实现超越业绩比较基准的稳定收益作为本基金投资组合的目标。报告期内,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。

本报告期内,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本基金管理人与本公司管理的其他型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生的同日反向交易,未发生过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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年一季度,国内经济增长压力仍较大,且通胀持续处于低位,央行在一季度分别下调了一次存款准备金率和进行了一次降息。

资金面方面,在下调存准的同时,央行利用公开市场操作、短期流动性调整工具(SLO)及中期借贷便利(MLF)等对市场流动性予以支持。但受到国际资本流动、节假日和新股发行等因素的影响,除1月初和3月下旬外,一季度资金面都处于较为紧张的局面,回购和存款利率基本都维持在较高水平。

市场表现方面,1月份在货币宽松预期带动下,债券市场修复12月份的大调整,2月初披露的CPI及PMI数据低于预期,货币宽松预期继续升温,推动市场收益率水平突破去年11月份低点;3月份在降息兑现,获利了结压力及实质宽松效果不及预期的影响下,债券市场进入调整阶段,加上3月下旬财政部公布地方债务置换计划叠加地产330新政,市场收益率快速回升。整体来看债券市场先扬后逆,收益率回到年初水平。

本报告期内,本着稳健投资原则,本基金在风险和收益之间进行平衡。在获取绝对回报为主的前提下,重点配置了中高等级信用债,选择了确定性强的品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,中金纯债A类份额净值增长率为0.89%,中金纯债C份额净值增长率为0.79%,同期业绩比较基准收益率为0.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一季度,货币政策进行了一定的放松,加上房地产刺激政策的出台,政策对经济的正面效果将逐步显现,但经济转型的大方向不变,未来经济仍维持疲弱格局。展望二季度,我们在经济仍处维持疲软格局的基本判断下,二季度央行仍有放松的动作出台,降准的概率大于降息,债券收益率震荡下行,由于对信用风险的担忧,我们更看好中高等级信用债。今年债券市场操作难度增加,长周期来看,我们可能处于利率逐步走低的过程中,但中间可能会有一些阶段性的利率抬升。我们在获取绝对回报为主的前提下,重点配置确定性高的中高等级信用债。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	60,095,197.26	25.78
	其中:债券	60,095,197.26	25.78
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	85,900,568.85	36.85
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	79,278,380.46	34.01
4	其他资产	7,820,125.18	3.35
5	合计	233,094,271.75	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.32
	其中:买断式回购融资	0.00
序号	项目	金额 / 占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	- / -
	其中:买断式回购融资	- / -

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内,本货币市场基金未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	25
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	66
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	7

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内本理财基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	81.91	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	4.30	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	12.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.13	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,999,141.97	4.30
	其中:政策性金融债	9,999,141.97	4.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,096,055.29	21.53
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	60,095,197.26	25.83
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041465007	14灵山CP002	100,000	10,039,928.06	4.31
2	041459060	14桑德CP002	100,000	10,030,305.00	4.31
3	041460030	14统众CP001	100,000	10,014,431.07	4.30
4	041460077	14润华CP001	100,000	10,010,237.87	4.30
5	041459044	14青松CP001	100,000	10,001,153.29	4.30
6	120215	12国开15	100,000	9,999,141.97	4.30

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1603%
报告期内偏离度的最低值	0.0263%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0939%

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十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

5.8.2

本报告期内本基金没有出现持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3

本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	5,400,487.50
3	应收利息	2,399,637.68
4	应收申购款	20,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	7,820,125.18

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中金现金管家A类	中金现金管家B类
报告期期初基金份额总额	13,076,608.55	262,853,555.41
报告期期间基金总申购份额	74,681,247.02	1,261,033,706.74
减:报告期期间基金总赎回份额	59,463,943.56	1,319,482,417.79
报告期期末基金份额总额	28,293,912.01	204,404,844.36

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;基金总赎回份额含转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投资	2015年1月31日	59,212.75	59,212.75	0.0000%
2	红利再投资	2015年2月28日	35,480.15	35,480.15	0.0000%
3	红利再投资	2015年3月31日	39,577.20	39,577.20	0.0000%
合计			134,270.10	134,270.10	

注:基金管理人按照《中金现金管家货币市场基金基金合同》、《中金现金管家货币市场基金招募说明书》的约定费率于2014年11月24日通过中金基金管理有限公司直销中心认购本基金,认购份额共计10,000,450份。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予中金现金管家货币市场基金募集注册的文件

2、《中金现金管家货币市场基金基金合同》

3、《中金现金管家货币市场基金托管协议》

4、基金管理人业务资格批复、营业执照

5、报告期内中金现金管家货币市场基金在指定媒介上披露的各项公告

6、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

中金基金管理有限公司,地址:北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(www.ccfund.com)查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中金基金管理有限公司。

咨询电话:(86)010-63211122 400-868-1166

传真:(86)010-66159121

中金基金管理有限公司
2015年4月22日

中金纯债债券型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人:中金基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金纯债	
基金主代码	000801	
交易代码	000801	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年11月4日	
报告期末基金份额总额	322,986,747.94份	
投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产长期稳健的增值。	
投资策略	本基金的资产配置策略主要是基于对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策分析等宏观基本面研究,结合对各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等因素的评估,在约定的投资比例范围内确定各大类资产的中长期基本配置比例并进行调整,包括普通债券投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略。其中,普通债券投资策略具体包括债券类属配置策略、期限结构配置策略、利率策略、信用债券投资策略、骑乘策略、息差策略。	
业绩比较基准	中证全债指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中金纯债A	中金纯债C
下属分级基金的交易代码	000801	000802
报告期末下属分级基金的份额总额	272,890,584.79份	50,096,163.15份

§3 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

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)	
	中金纯债A	中金纯债C
1.本期已实现收益	6,390,219.85	1,466,496.97
2.本期利润	5,373,719.51	1,371,281.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0126	0.0133
4.期末基金资产净值	278,328,017.25	50,992,582.01
5.期末基金份额净值	1.020	1.018

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.本报告所列示的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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

中金纯债A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.89%	0.13%	0.94%	0.10%	-0.05%	0.03%

中金纯债C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.79%	0.13%	0.94%	0.10%	-0.15%	0.03%

3.2.2 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:本基金的基金合同生效日为2014年11月4日。按照本基金的基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

§4 管理人报告

4.1 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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石云峰	本基金的基金经理	2014年11月4日	-	8	石云峰先生,经济学硕士。历任中国邮政储蓄银行总行资金管运部交易员,太平养老保险股份有限公司固定收益投资经理,嘉实基金管理有限公司机构投资部投资经理。现任中金基金管理有限公司投资管理部基金经理,2014年11月2日起任中金现金管家货币市场基金基金经理。

注:1、上述任职日期为基金合同生效日;
2、证券从业的含义遵从行业协会《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》等有关法律法规的规定和《中金纯债债券型证券投资基金基金合同》的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险和保持流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产长期稳健的增值,无损害基金份额持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。

本报告期内,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生的同日反向交易,未发生过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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年一季度,国内经济增长压力仍较大,且通胀持续处于低位,央行在一季度分别下调了一次存款准备金率和进行了一次降息。

资金面方面,在下调存准的同时,央行利用公开市场操作、短期流动性调整工具(SLO)及中期借贷便利(MLF)等对市场流动性予以支持。但受到国际资本流动、节假日和新股发行等因素的影响,除1月初和3月下旬外,一季度资金面都处于较为紧张的局面,回购和存款利率基本都维持在较高水平。

市场表现方面,1月份在货币宽松预期带动下,债券市场修复12月份的大调整,2月初披露的CPI及PMI数据低于预期,货币宽松预期继续升温,推动市场收益率水平突破去年11月份低点;3月份在降息兑现,获利了结压力及实质宽松效果不及预期的影响下,债券市场进入调整阶段,加上3月下旬财政部公布地方债务置换计划叠加地产330新政,市场收益率快速回升。整体来看债券市场先扬后逆,收益率回到年初水平。

本报告期内,本着稳健投资原则,本基金在风险和收益之间进行平衡。在获取绝对回报为主的前提下,重点配置了中高等级信用债,选择了确定性强的品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,中金纯债A类份额净值增长率为0.89%,中金纯债C份额净值增长率为0.79%,同期业绩比较基准收益率为0.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一季度,货币政策进行了一定的放松,加上房地产刺激政策的出台,政策对经济的正面效果将逐步显现,但经济转型的大方向不变,未来经济仍维持疲弱格局。展望二季度,我们在经济仍处维持疲软格局的基本判断下,二季度央行仍有放松的动作出台,降准的概率大于降息,债券收益率震荡下行,由于对信用风险的担忧,我们更看好中高等级信用债。今年债券市场操作难度增加,长周期来看,我们可能处于利率逐步走低的过程中,但中间可能会有一些阶段性的利率抬升。我们在获取绝对回报为主的前提下,重点配置确定性高的中高等级信用债。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	425,853,001.70	88.95
	其中:债券	425,853,001.70	88.95
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,723,847.24	2.45
7	其他资产	41,198,498.57	8.60
8	合计	478,775,347.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本报告期末,本基金未持有股票。

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

注:本报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	17,027,000.00	5.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	248,040,851.70	75.32
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	151,799,000.00	46.09
7	可转债	8,986,150.00	2.73
8	其他	-	-
9	合计	425,853,001.70	129.31

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

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(%)
1	101455022	14祁连山MTN001	300,000	30,909,000.00	9.39
2	122939	09吉安债	290,000	29,957,000.00	9.10
3	1382161	13渝水投MTN1	300,000	29,928,000.00	9.09
4	122883	10楚雄债	280,000	27,994,400.00	8.50
5	112214	14东赛债	265,000	27,345,350.00	8.30

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

注:本报告期末,本基金未持有资产支持证券。

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

注:本报告期末,本基金未持有贵金属。

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

注:本报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本报告期末,本基金未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和揽益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.10.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	45,622.82
2	应收证券清算款	29,999,962.00
3	应收股利	-
4	应收利息	11,072,516.93
5	应收申购款	80,396.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,198,498.57

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	4,804,450.00	1.46

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本报告期末,本基金未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中金纯债A	中金纯债C
报告期期初基金份额总额	562,321,253.05	152,041,608.87
报告期期间基金总申购份额	28,026,937.86	9,120,342.12
减:报告期期间基金总赎回份额	317,457,606.12	111,065,787.84
报告期期间基金份额变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	272,890,584.79	50,096,163.15

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予中金纯债债券型证券投资基金募集注册的文件

2、《中金纯债债券型证券投资基金基金合同》

3、《中金纯债债券型证券投资基金托管协议》

4、基金管理人业务资格批复、营业执照

5、报告期内中金纯债债券型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

6、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

中金基金管理有限公司,地址:北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(www.ccfund.com)查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中金基金管理有限公司。

咨询电话:(86)010-63211122 400-868-1166

传真:(86)010-66159121

中金基金管理有限公司
2015年4月22日

中银转债增强债券型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十二日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中银转债增强债券	
基金主代码	163816	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月29日	
报告期末基金份额总额	393,257,843.07份	
投资目标	本基金主要利用可转换公司债券品种兼具债券和股票的特性,通过"自上而下"宏观分析和"自下而上"个券选择的有效结合来实施大类资产配置和精选可转换公司债券,在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求超越业绩比较基准的超额收益。	
投资策略	本基金将通过"自上而下"的方法进行资产配置、类属配置,结合"自下而上"的详细资产配置、个券、个股选择,积极运用多种投资策略充分挖掘各类品种的投资价值,努力实现投资目标。	
业绩比较基准	天津转债指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期风险收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	中银转债增强债券A	中银转债增强债券B
下属两级基金的交易代码	163816	163817
报告期末下属两级基金的份额总额	223,688,737.18份	169,569,105.89份

§3 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

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)	
	中银转债增强债券A	中银转债增强债券B
1.本期已实现收益	35,819,074.22	38,105,076.91
2.本期利润	58,473,936.29	63,805,679.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.3320	0.3262
4.期末基金资产净值	513,489,056.67	383,592,921.93
5.期末基金份额净值	2.296	2.262

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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①	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
过去三个月	19.77%	1.79%	0.95%	1.55%	18.82%	0.24%

2、中银转债增强债券B:

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	19.62%	1.79%	0.95%	1.55%	18.67%	0.24%