

**中银国有企业债债券型证券投资基金**

**2021 年第 2 季度报告**

**2021 年 6 月 30 日**

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十日

## §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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 19 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 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|             |  |           |
|-------------|--|-----------|
| 基金简称        | 中银国有企业债  |           |
| 基金主代码       | 001235   |           |
| 基金运作方式      | 契约型开放式   |           |
| 基金合同生效日     | 2015 年 9 月 29 日  |           |
| 报告期末基金份额总额  | 996,470,362.28 份   |           |
| 投资目标        | 本基金主要投资于国有企业债券，在严格控制信用风险和追求本金安全的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。   |           |
| 投资策略        | 本基金根据对宏观经济趋势、国家政策方向、行业和企业盈利、信用状况及其变化趋势、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等因素的动态分析，在限定投资范围内，决定债券类资产的配置比例，并跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化，定期或不定期对大类资产配置比例进行调整。在充分论证债券市场宏观环境和仔细分析利率走势基础上，依次通过久期配置策略、期限结构配置策略、类属配置策略、信用类债券策略等自上而下完成组合构建。本基金在整个投资决策过程中将认真遵守投资纪律并有效管理投资风险。 |           |
| 业绩比较基准      | 中债综合全价（总值）指数   |           |
| 风险收益特征      | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  |           |
| 基金管理人       | 中银基金管理有限公司   |           |
| 基金托管人       | 交通银行股份有限公司   |           |
| 下属两级基金的基金简称 | 中银国有企业债 A  | 中银国有企业债 C |

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 下属两级基金的交易代码     | 001235           | 006331          |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 985,942,722.27 份 | 10,527,640.01 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<br>(2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) |               |
|----------------|---|---------------|
|                | 中银国有企业债 A                               | 中银国有企业债 C     |
| 1.本期已实现收益      | 12,721,671.91                           | 115,274.19    |
| 2.本期利润         | 18,206,364.71                           | 135,039.53    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0180                                  | 0.0149        |
| 4.期末基金资产净值     | 1,031,743,494.52                        | 10,785,155.68 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.046                                   | 1.024         |

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

###### 1、中银国有企业债 A：

| 阶段            | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|---------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月         | 1.75%      | 0.06%         | 0.45%          | 0.03%                 | 1.30%  | 0.03% |
| 过去六个月         | 1.95%      | 0.07%         | 0.65%          | 0.04%                 | 1.30%  | 0.03% |
| 过去一年          | 4.97%      | 0.12%         | -0.20%         | 0.06%                 | 5.17%  | 0.06% |
| 过去三年          | 18.21%     | 0.11%         | 4.53%          | 0.07%                 | 13.68% | 0.04% |
| 过去五年          | 23.43%     | 0.10%         | 1.70%          | 0.07%                 | 21.73% | 0.03% |
| 自基金合同<br>生效日起 | 27.25%     | 0.10%         | 3.45%          | 0.07%                 | 23.80% | 0.03% |

###### 2、中银国有企业债 C：

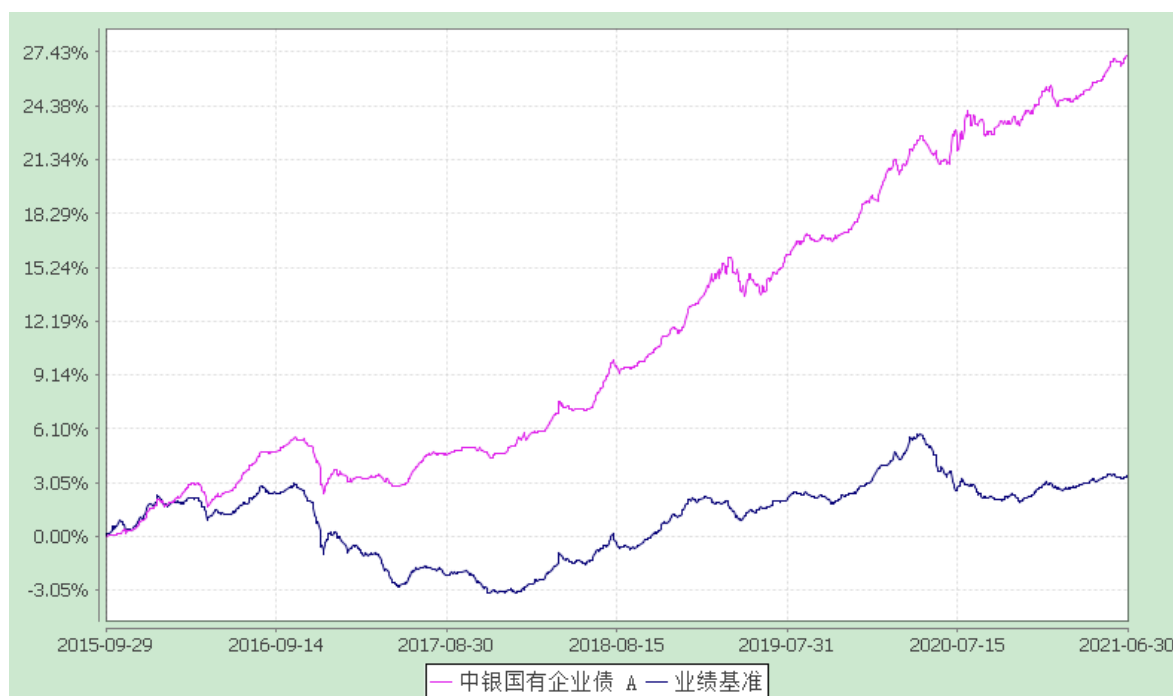
| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 1.69%      | 0.06%         | 0.45%          | 0.03%                 | 1.24% | 0.03% |
| 过去六个月 | 1.79%      | 0.08%         | 0.65%          | 0.04%                 | 1.14% | 0.04% |
| 过去一年  | 2.80%      | 0.16%         | -0.20%         | 0.06%                 | 3.00% | 0.10% |

|           |        |       |       |       |       |       |
|-----------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 自基金合同生效日起 | 13.46% | 0.13% | 4.06% | 0.07% | 9.40% | 0.06% |
|-----------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|

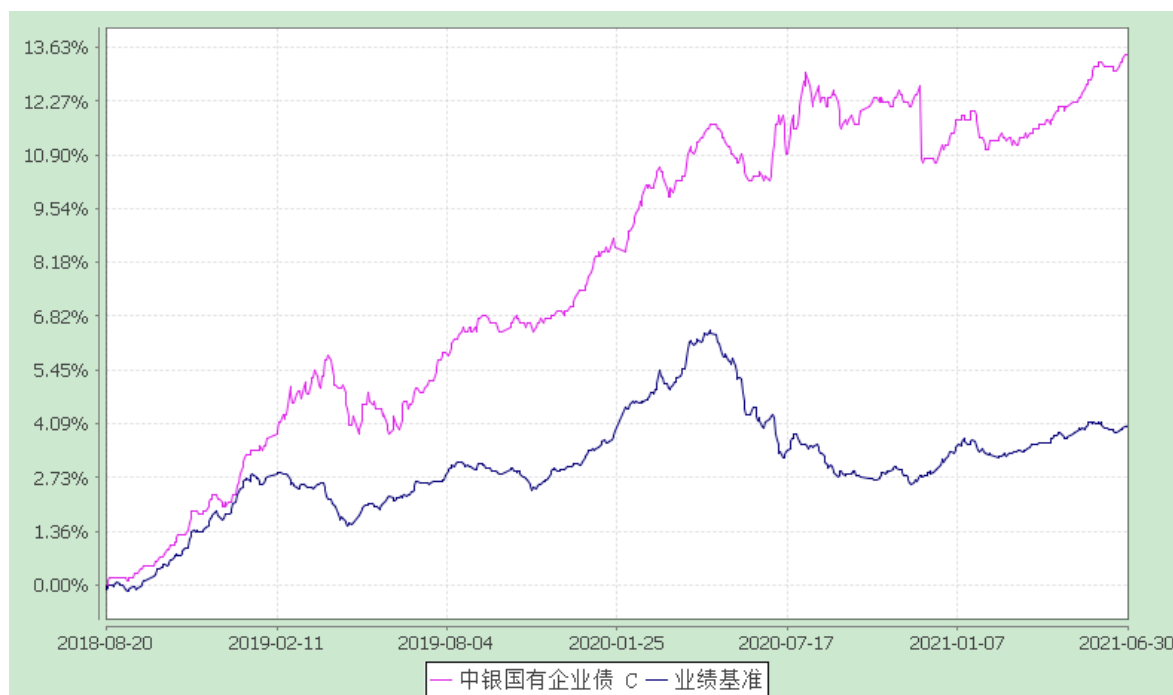
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银国有企业债券型证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2015 年 9 月 29 日至 2021 年 6 月 30 日)

#### 1. 中银国有企业债 A:



#### 2. 中银国有企业债 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 |        |  |
| 王晓彦 | 基金经理 | 2021-05-11  | -    | 10     | 金融学经济学双硕士。曾任申银万国证券研究所分析师，上海浦东发展银行资产管理部投资组合经理。2015年加入中银基金管理有限公司，曾任研究员、专户投资经理助理、专户投资经理。2021年5月至今任中银国有企业债基金基金经理，2021年5月至今任中银泰享基金基金经理，2021年5月至今任中银恒裕9个月基金基金经理，2021年5月至今任中银同享基金基金经理。具备基 |

|    |      |            |            |    |  |
|----|------|------------|------------|----|--|
|    |      |            |            |    | 金、银行间本币市场交易员、银行间外汇市场交易员从业资格。   |
| 方抗 | 基金经理 | 2015-09-29 | 2021-05-11 | 14 | 中银基金管理有限公司助理副总裁 (AVP), 金融学硕士。曾任交通银行总行金融市场部授信管理员, 南京银行总行金融市场部上海分部销售交易团队主管。2013 年加入中银基金管理有限公司, 曾任固定收益基金经理助理。2014 年 8 月至 2021 年 4 月任中银增利基金经理, 2014 年 8 月至 2021 年 4 月任中银货币基金基金经理, 2015 年 9 月至 2021 年 5 月任中银国有企业债基金基金经理, 2015 年 12 月至 2021 年 4 月任中银机构货币基金基金经理, 2017 年 3 月至 2020 年 4 月任中银理财 90 天债券基金基金经理, 2018 年 3 月至 2021 年 5 月任中银泰享基金基金经理, 2019 年 8 月至 2021 年 4 月任中银康享基金经理, 2019 年 12 月至 2021 年 5 月任中银恒裕 9 个月基金基金经理, 2020 年 3 月至 2021 年 5 月任中银同享基金基金经理。具有 14 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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 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，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

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，本报告期内未发生异常交易行为。

### 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 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，二季度全球发达国家疫情总体好转，印度疫情爆发带动东南亚和英国疫情反复，美国消费继续复苏，通胀走高，就业伴随疫苗接种总体恢复，失业率 5 月值较 3 月值下降 0.2 个百分点至 5.8%，制造业 PMI 6 月值较 3 月值上行 3.5 个百分点至 62.6，服务业 PMI 6 月值较 3 月值上升 4.4 个百分点至 64.8。美联储维持利率水平和资产购买规模，上调 IOER 和 ONRRP 利率，

三季度关注美国就业恢复后美联储可能明确 QE taper 信号。欧元区继续复苏，制造业 PMI 6 月值较 3 月值上升 0.6 个百分点至 63.1，服务业 PMI 6 月值较 3 月值上升 8.4 个百分点至 58，欧央行 6 月议息会议上提出加快 PEPP 购买步伐。日本央行维持基准利率不变，经济恢复放缓，通缩问题有所好转，CPI 5 月值较 3 月值回升 0.1 个百分点至 -0.1%，制造业 PMI 6 月值较 3 月值回落 0.3 个百分点至 52.4。

国内经济方面，生产数据较为稳定，需求端地产、汽车保持稳定，食品价格略降，但大宗价格仍高位反复拉锯，通胀预期仍在。具体来看，领先指标中采制造业 PMI 于二季度持续位于荣枯线上方窄幅震荡，但 6 月值较 3 月走低 1 个百分点至 50.9，同步指标工业增加值 1-5 月同比增长 17.8%，较 2021 年一季度末回落 6.7 个百分点。从经济增长动力来看，出口总体偏强，消费投资继续改善：1-5 月美元计价出口累计增速较 2021 年一季度末回落 8.7 个百分点至 40.2% 左右，5 月消费同比增速较 2021 年 3 月回落 21.8 个百分点至 12.4%，制造业、房地产、基建投资均缓慢改善，1-5 月固定资产投资增速较 2021 年一季度末回落 10.2 个百分点至 15.4% 的水平。通胀方面，CPI 快速升，5 月同比增速较 2021 年一季度末上升 0.9 个百分点至 1.3%；PPI 大幅回升至年内较高点，5 月同比增速较 2021 年一季度末上升 4.6 个百分点至 9%。

## 2. 市场回顾

债券市场方面，二季度债市各品种出现不同程度上涨。其中，二季度中债总全价指数上涨 0.46%，中债银行间国债全价指数上涨 0.39%，中债企业债总全价指数上涨 0.42%。在收益率曲线上，二季度收益率曲线走势略有平坦化。其中，二季度 10 年期国债收益率从 3.19% 下行 11bp 至 3.08%，10 年期金融债（国开）收益率从 3.57% 下行 8 个 bp 至 3.49%。货币市场方面，二季度央行公开市场投放量保持低位，银行间资金面总体平衡但 5 月下旬以后边际收紧，其中，二季度银行间 1 天回购加权平均利率均值在 2.03% 左右，较上季度均值下行 2bp，银行间 7 天回购利率均值在 2.25% 左右，较上季度均值下行 16bp。

可转债方面，二季度中证转债指数上涨 4.45%。权益市场上涨，转债估值略有压缩。个券方面，小康转债、维格转债、蓝晓转债、鼎胜转债、恩捷转债、中矿转债等表现较好，分别上涨 212%、198%、115%、112%、110%、95%，上涨较多的标的主要涉及新能源板块。

## 3. 运行分析

二季度债券市场各品种出现不同程度上涨，本基金业绩表现好于比较基准。策略上，我们保持合适的久期和杠杆比例，优化配置结构，重点配置高等级信用债，适度参与可转债的二级市场交易，合理分配类属资产比例。



#### 4.5 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 1.75%，同期业绩比较基准收益率为 0.45%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 1.69%，同期业绩比较基准收益率为 0.45%。

#### 4.6 报告期内基金持有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。

### §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            | 1,073,314,966.26 | 93.12        |
|    | 其中：债券             | 1,073,314,966.26 | 93.12        |
|    | 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          | 21,997,126.00    | 1.91         |
|    | 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      | 5,531,730.04     | 0.48         |
| 7  | 其他各项资产            | 51,733,575.25    | 4.49         |
| 8  | 合计                | 1,152,577,397.55 | 100.00       |

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

##### 5.2.2 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投资股票。

#### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

##### 5.3.1 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

本基金本报告期末未持有股票。

##### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统

**挂牌股票投资明细**

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

**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      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 352,644,000.00   | 33.83        |
|    | 其中：政策性金融债 | 261,783,000.00   | 25.11        |
| 4  | 企业债券      | 548,216,000.00   | 52.59        |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 10,162,000.00    | 0.97         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 84,571,966.26    | 8.11         |
| 8  | 同业存单      | 77,721,000.00    | 7.46         |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,073,314,966.26 | 102.95       |

**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  | 190202    | 19 国开 02      | 600,000 | 60,222,000.00 | 5.78         |
| 2  | 190208    | 19 国开 08      | 500,000 | 50,565,000.00 | 4.85         |
| 3  | 190203    | 19 国开 03      | 500,000 | 50,390,000.00 | 4.83         |
| 4  | 200204    | 20 国开 04      | 500,000 | 50,190,000.00 | 4.81         |
| 5  | 112110166 | 21 兴业银行 CD166 | 500,000 | 48,570,000.00 | 4.66         |

**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**

本基金本报告期末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**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**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**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.9.1 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。

## 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2021 年二季度，本基金投资的前十大债券的发行主体中，兴业银行、华夏银行受到中国银行保险监督管理委员会或地方银保监局的行政处罚。基金管理人通过对上述发行人进一步了解分析后，认为以上处分不会对所持有的 21 兴业银行 CD166(112110166.IB)、20 华夏银行(2028054.IB)的投资价值构成实质性影响，因此未披露处罚事宜。

报告期内，本基金投资的前十名债券的其余债券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 21,814.28     |
| 2  | 应收证券清算款 | 37,287,414.79 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 14,321,534.46 |
| 5  | 应收申购款   | 102,811.72    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 51,733,575.25 |

## 5.11.4 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  | 110073 | 国投转债    | 5,044,059.30 | 0.48         |
| 2  | 113043 | 财通转债    | 5,011,229.30 | 0.48         |
| 3  | 110051 | 中天转债    | 3,780,203.60 | 0.36         |
| 4  | 110043 | 无锡转债    | 3,301,524.00 | 0.32         |
| 5  | 110061 | 川投转债    | 3,276,059.90 | 0.31         |
| 6  | 113037 | 紫银转债    | 2,867,094.30 | 0.28         |
| 7  | 110047 | 山鹰转债    | 2,053,392.00 | 0.20         |
| 8  | 110048 | 福能转债    | 2,003,700.00 | 0.19         |
| 9  | 110067 | 华安转债    | 1,961,489.20 | 0.19         |
| 10 | 128109 | 楚江转债    | 1,932,113.40 | 0.19         |
| 11 | 128078 | 太极转债    | 1,798,680.00 | 0.17         |
| 12 | 113602 | 景 20 转债 | 1,783,925.40 | 0.17         |
| 13 | 127026 | 超声转债    | 1,657,164.10 | 0.16         |
| 14 | 123049 | 维尔转债    | 1,576,913.20 | 0.15         |
| 15 | 128137 | 洁美转债    | 1,534,757.90 | 0.15         |
| 16 | 128124 | 科华转债    | 1,420,426.50 | 0.14         |
| 17 | 123060 | 苏试转债    | 1,370,688.00 | 0.13         |
| 18 | 128048 | 张行转债    | 1,165,048.00 | 0.11         |
| 19 | 113009 | 广汽转债    | 1,160,268.90 | 0.11         |
| 20 | 113603 | 东缆转债    | 1,140,400.00 | 0.11         |
| 21 | 123025 | 精测转债    | 1,090,116.90 | 0.10         |
| 22 | 123077 | 汉得转债    | 1,009,553.94 | 0.10         |
| 23 | 123010 | 博世转债    | 1,007,300.00 | 0.10         |
| 24 | 128101 | 联创转债    | 979,040.00   | 0.09         |
| 25 | 123078 | 飞凯转债    | 854,770.00   | 0.08         |
| 26 | 123091 | 长海转债    | 816,143.48   | 0.08         |
| 27 | 123035 | 利德转债    | 742,140.00   | 0.07         |
| 28 | 128134 | 鸿路转债    | 675,150.00   | 0.06         |
| 29 | 128035 | 大族转债    | 663,600.00   | 0.06         |
| 30 | 128107 | 交科转债    | 651,360.00   | 0.06         |
| 31 | 123070 | 鹏辉转债    | 540,521.20   | 0.05         |
| 32 | 128046 | 利尔转债    | 519,738.20   | 0.05         |
| 33 | 128119 | 龙大转债    | 480,400.00   | 0.05         |
| 34 | 123068 | 弘信转债    | 325,860.00   | 0.03         |
| 35 | 128125 | 华阳转债    | 305,400.00   | 0.03         |
| 36 | 113550 | 常汽转债    | 174,270.00   | 0.02         |
| 37 | 128129 | 青农转债    | 24,043.50    | 0.00         |
| 38 | 123064 | 万孚转债    | 9,384.00     | 0.00         |

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.11.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目            | 中银国有企业债 A        | 中银国有企业债 C     |
|---------------|------------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 1,041,787,921.53 | 8,001,547.93  |
| 本报告期基金总申购份额   | 8,101,834.45     | 9,799,440.75  |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 63,947,033.71    | 7,273,348.67  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                | -             |
| 本报告期期末基金份额总额  | 985,942,722.27   | 10,527,640.01 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                       | 中银国有企业债 A     | 中银国有企业债 C |
|--------------------------|---------------|-----------|
| 报告期初管理人持有的本基金份额          | 71,248,699.62 | -         |
| 本报告期买入/申购总份额             | -             | -         |
| 本报告期卖出/赎回总份额             | -             | -         |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 71,248,699.62 | -         |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 7.23          | -         |

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本公司未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

### §8 备查文件目录

#### 8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银国有企业债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中银国有企业债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银国有企业债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《中银国有企业债券型证券投资基金托管协议》；
- 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、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

9、中国证监会要求的其他文件。

### **8.2存放地点**

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地，供公众查阅。

### **8.3查阅方式**

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

中银基金管理有限公司

二〇二一年七月二十日