

# 中银证券保本 1 号混合型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：中银国际证券有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 30 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 4 月 29 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中银证券保本 1 号混合
场内简称	中银证券保本 1 号混合
基金主代码	002601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 29 日
基金管理人	中银国际证券有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,599,271,897.68 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保障保本期到期时本金安全的前提下, 力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势, 在注重风险控制的基础上, 将严谨的定性分析和规范的定量模型相结合, 动态调整稳健资产和风险资产的配置比例; 在此基础上精选债券和股票, 以实现基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金为保本混合型基金, 属于证券投资基金中的低风险品种。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构, 保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

### 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	中银国际证券有限责任公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵向雷
	联系电话	010-67595096
	电子邮箱	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话	021-61195566, 400-620-8888	95533
传真	021-50372474	010-66275830

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年 4 月 29 日 (基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	2015 年	2014 年
本期已实现收益	42,851,773.13	-	-
本期利润	18,037,323.99	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0037	-	-
本期基金份额净值增长率	0.35%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0035	-	-
期末基金资产净值	4,615,255,778.94	-	-
期末基金份额净值	1.0035	-	-

注：本基金合同生效日为 2016 年 4 月 29 日。

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。

期末可供分配利润是指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。

上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 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

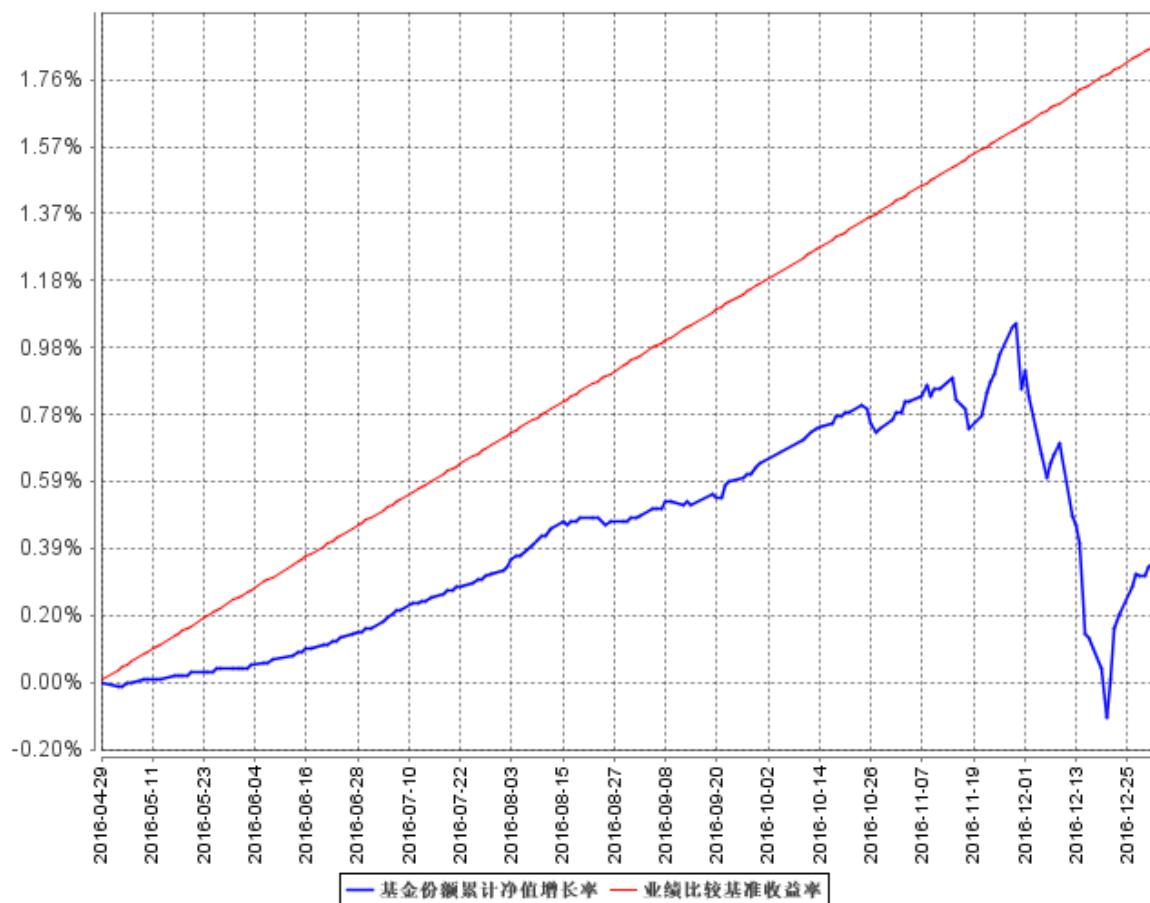
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.29%	0.07%	0.69%	0.01%	-0.98%	0.06%

过去六个月	0.19%	0.05%	1.38%	0.01%	-1.19%	0.04%
自基金合同生效起至今	0.35%	0.04%	1.86%	0.01%	-1.51%	0.03%

注：本基金成立于 2016 年 4 月 29 日，本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款收益率（税后）。

### 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

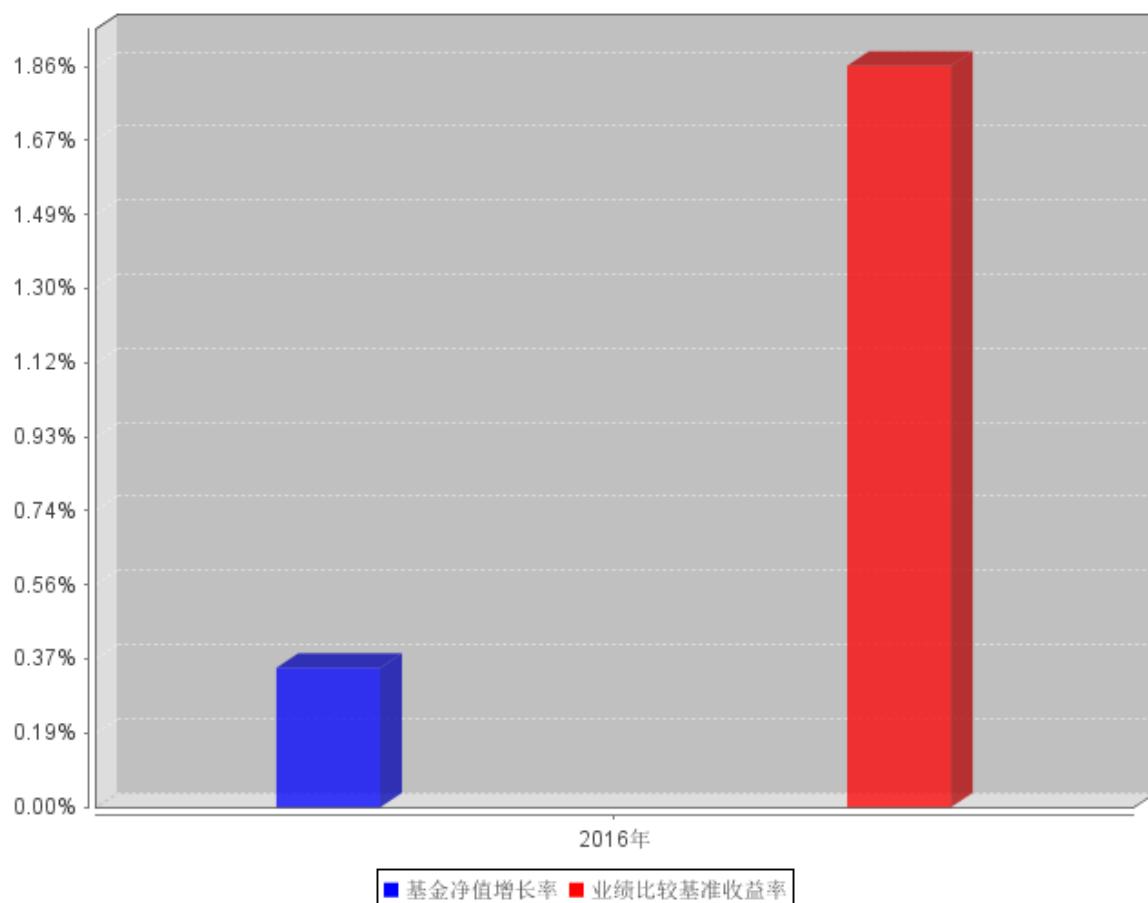
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1. 本基金基金合同于 2016 年 4 月 29 日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。  
2. 按基金合同规定，本基金建仓期为六个月。建仓期满后，本基金的各项投资比例应符合基金合同投资范围、投资限制中规定的各项比例：本基金投资的股票等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；法律法规及本基金合同规定的其他比例限制。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施利润分配。

## § 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

中银国际证券有限责任公司(以下简称“中银国际证券”)经中国证监会批准于 2002 年 2 月 28 日在上海成立，注册资本 25 亿元人民币。中银国际证券由中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、上海金融发展投资基金(有限合伙)、云南省投资控股集团有限公司、江西铜业股份有限公司、凯瑞富海实业投资有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、上海祥众投资合伙企业(有限合伙)、江苏洋河酒厂股份有限公司、上海联新投资中心(有限合伙)、江西铜业集团财务有限公司、达濠市政建设有限公司、万兴投资发展有限公司共同投资。中银国

际证券的经营范围包括：证券经纪、证券投资咨询、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券自营、证券资产管理、证券投资基金代销、融资融券、代销金融产品、公开募集证券投资基金管理。截至 2016 年 12 月 31 日，本管理人共管理四只开放式证券投资基金，包括：中银证券保本 1 号混合型证券投资基金、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金和中银证券安进债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
吴亮谷	本基金基金经理	2016 年 4 月 29 日	-	9	吴亮谷，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。历任福建海峡银行债券交易员、平安银行债券交易员、投资经理，天治基金管理有限公司天治天得利货币市场基金基金经理、天治稳定收益证券投资基金基金经理。2014 年加盟中银国际证券有限责任公司，历任中银国际证券中国红债券宝投资主办人，现任中银国际证券中国红货币宝投资主办人、中银证券保本 1 号混合型证券投资基金基金经理、中银证券安进债券型证券投资基金基金经理、中银证券现金管家货币市场基金基金经理、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
白冰洋	本基金基金经理	2016 年 4 月 29 日	-	7	白冰洋，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基金从业资格。历任台湾群益证券研究员。2012 年加盟中银国际证券有限责任公司，现任中银国际证券中

					国红 1 号投资主办人、中国红基金宝投资主办人、中银证券保本 1 号混合型证券投资基金管理基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金管理人已于 2017 年 1 月 12 日分别在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站发布公告，王玉玺自 2017 年 1 月 12 日起增聘为本基金基金经理；于 2017 年 1 月 25 日分别在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站发布公告，罗众球自 2017 年 1 月 25 日起增聘为本基金基金经理。

## 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》、《中华人民共和国证券法》、《中银证券保本 1 号混合型证券投资基金基金合同》以及其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了《中银国际证券有限责任公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法》、《中银国际证券有限责任公司产品与交易部交易室异常交易监控与报告管理办法》等公平交易相关制度体系。

《中银国际证券有限责任公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法》所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时涵盖包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

公平交易的控制方法主要包括：建立科学、制衡的投资决策体系，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，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；严格隔离投资管理职能和交易执行职能，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并进行公平的

交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

### **4.3.2 公平交易制度的执行情况**

报告期内，公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，公司未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的情况。

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。

## **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**

2016 年固定收益市场整体跌宕起伏，黑天鹅频出。货币政策方面，央行继续利用公开市场操作进行稳健调控，并在四季度悄然完成由稳健向中性调整。相对于政策变化，央企信用债违约，英国脱欧、国海罗卜章事件、美联储加息、川普当选、年末通胀预期抬头等中小概率事件接连发生也对当年市场形成相应扰动。货币市场方面，资金利率前平后高，整体资金较去年更紧张，四季度中爆发持续时间近半个月的“钱荒”。债券市场方面，一季度延续债券牛市，4 月份在央企铁物资债券违约催化下，债券市场引发踩踏式大调整，短短一个月信用债收益率曲线整体上抬超过 100BP。三季度市场快速从大调整阴影走出，10 年期国债收益率甚至创出 2003 年以来新低。四季度开始市场氛围略紧，并在 11 月出现“债灾”，一个月内一年期品种收益率上抬超过 160BP，10 年期国债收益率上升超过 50BP，国开债超过 70BP，12 月下旬后“债灾”结束。股票市场方面，1 月份受政策影响连续大幅下跌，后面缓慢回升，上证综指全年下跌 12.31%，申万一级行业分类看，超过 9 成行业指数下跌，其中传媒、计算机、交运、休闲服务等行业跌幅靠前，均超过 20%，食品饮料涨幅居前，建筑材料维持不涨不跌。总的看，2016 年是个重要拐点，在全年深幅震荡中结束了固定收益市场自 2014 年开始的连续两年牛市，股票市场则在之前多次大幅调整后进入相对估值修复阶段。

本基金成立于 4 月末，处于 4 月债灾刚结束后债券收益率大幅下探并创出历史新低阶段，时间点上不占优势，成立至年末基金净值增长率为 0.35%，整体表现中规中矩。投资上看，成立初期基于稳健操作原则，资产配置全部以短久期固定收益类为主，运行一段时间后积累到少量超额收益，同时基于一级市场新股申购目标适量配置股票资产，主要以大盘蓝筹低估值标的为主。四季度开始股票市场向上动能逐渐加大，组合适当增加了股票比例，同时稳健资产完成建仓，并启动小比例杠杆，主要以银行间中高评级券为主，交易所中短期公司债为辅。11 月中债灾开始，我们及时停止杠杆操作，并进一步压缩组合久期，较好的应对了因巨幅市场变动对组合净值产生的波动影响，也在同类产品中展现出极佳的抗风险能力。不过遗憾难免，前期市场高位中所配部分资产因流动性缺失造成组合被动持仓，对净值有一定机会成本影响，这是后期重点关注点之一。总的看，2016 年市场变动剧烈，组合随波弄潮，时有精彩表现，时又受风雨所侵。未来随着监管对保本产品管理持续细化与调整，我们将继续努力学习，以市场为师，理性判断，谨慎投资，始终秉持投资者利益优先原则，勤勉尽责，争取更好的实现投资目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0035 元，份额累计净值为 1.0035 元，报告期内净值增长率为 0.35%，同期业绩基准涨幅为 1.86%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理层对 2017 年货币政策定调为稳健偏中性，因此理解好中性的概念是把握全年固定收益市场基本面的核心，我们认为这种中性就是在确保不发生钱荒与有效形成金融行业去杠杆约束力间的平衡，但是其平衡的空间有多大解释权在央行，从去年四季度来央行收短放长到春节后提高公开市场回购利率的动作来看，此平衡空间略微偏紧，此基本决定了全年市场在去年拐点已至的情况下继续收益率向上盘整的格局。投资角度而言，我们更关注机会与风险的把握，可预期的风险如下：一、供给侧改革全面推进对产能过剩行业的出清将不可避免加大部分个券的信用风险，因债券违约而对市场形成持续打击的概率始终不小；二、金融去杠杆的持续推进，不排除部分已经长时间执行以时间换空间策略的投资主体越过承受临界点，不可预期的加大市场波动幅度；三、通胀水平不排除走出超越市场预期的态势，或者因生产者价格指数变化等因素影响逐渐成为影响市场短期走势的主要矛盾，使市场承受难以估计的空头力量；四、美联储在 2017 年继续加息，对全球资本流向和幅度带有极大的不确定性。可关注的机会更多体现在因经济增长整体表现不佳，令市场产生去杠杆与稳增长政策取向摇摆的预期。总的看，今年市场预期将以震荡为主，趋势上略偏利率走高，交易性机会大于趋势机会，因此总体风险较之前有所增大。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人始终坚持基金份额持有人利益优先原则，从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实。公司稽核部依据法律法规的规定及公司内部控制的整体要求，独立对旗下基金投资组合、基金宣传推介材料及员工行为等的合规性进行了定期和不定期检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，并定期向监管机构、公司董事会出具监察稽核报告。

在合规管理方面，公司制定了员工行为规范、员工行为准则，修订了员工投资行为管理制度，进一步完善合规制度建设；公司开展多种形式的合规培训，定期进行合规信息收集，不断提升员工的合规守法意识；加强事前事中合规风险管理，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资研究、公平交易、基金销售，投资管理人员通讯管理等关键业务和岗位进行检查监督，促进公募基金业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作有效性，切实保障基金安全、合规运作。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券有限责任公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数

的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金管理法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中银证券保本 1 号混合型证券投资基金

报告截止日： 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	21,649,822.66	—
结算备付金	8,523,414.99	—
存出保证金	81,001.52	—
交易性金融资产	4,687,929,138.25	—
其中：股票投资	221,082,771.65	—
基金投资	—	—
债券投资	4,466,846,366.60	—
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	49,957,817.47	—
应收证券清算款	11,308,338.44	—
应收利息	47,779,359.91	—
应收股利	—	—
应收申购款	1,974.33	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	4,827,230,867.57	—
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
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	200,000,000.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	5,562,739.71	-
应付管理人报酬	4,735,462.49	-
应付托管费	789,243.78	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	498,833.26	-
应交税费	-	-
应付利息	5,475.64	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	383,333.75	-
负债合计	211,975,088.63	-
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	4,599,271,897.68	-
未分配利润	15,983,881.26	-
所有者权益合计	4,615,255,778.94	-
负债和所有者权益总计	4,827,230,867.57	-

注: 1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.0035 元, 基金份额总额 4,599,271,897.68 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2016 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体: 中银证券保本 1 号混合型证券投资基金

本报告期: 2016 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 29 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	66,294,021.61	-
1. 利息收入	88,406,677.07	-
其中: 存款利息收入	1,072,498.86	-
债券利息收入	53,151,566.15	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	34,182,612.06	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)	582,652.06	-
其中: 股票投资收益	6,216,302.45	-
基金投资收益	-	-

债券投资收益	-5,970,688.56	-
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	337,038.17	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-24,814,449.14	-
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	2,119,141.62	-
<b>减：二、费用</b>	48,256,697.62	-
1. 管理人报酬	39,236,325.55	-
2. 托管费	6,539,387.59	-
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	696,743.38	-
5. 利息支出	1,419,104.78	-
其中：卖出回购金融资产支出	1,419,104.78	-
6. 其他费用	365,136.32	-
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	18,037,323.99	-
<b>减：所得税费用</b>	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	18,037,323.99	-

注：本基金合同于 2016 年 4 月 29 日生效，本报告期自 2016 年 4 月 29 日至 2016 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银证券保本 1 号混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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)	4,953,885,173.50	-	4,953,885,173.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	18,037,323.99	18,037,323.99
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)	-354,613,275.82	-2,053,442.73	-356,666,718.55

其中：1. 基金申购款	2, 583, 376. 29	14, 826. 79	2, 598, 203. 08
2. 基金赎回款	-357, 196, 652. 11	-2, 068, 269. 52	-359, 264, 921. 63
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4, 599, 271, 897. 68	15, 983, 881. 26	4, 615, 255, 778. 94
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日			
项目	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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：本基金合同于 2016 年 4 月 29 日生效，本报告期自 2016 年 4 月 29 日至 2016 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 14 页 至 29 页 财务报表由下列负责人签署：

宁敏

基金管理人负责人

赵向雷

主管会计工作负责人

戴景义

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中银证券保本 1 号混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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]623 号《关于准予中银证券保本 1 号混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中银国际证券有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》

和《中银证券保本 1 号混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,952,975,233.25 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2016)第 532 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银证券保本 1 号混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,953,885,173.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 909,940.25 份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，第一个保本期期担保人为中国投融资担保股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券保本 1 号混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资的股票等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%；每个交易日日终现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的投资目标为在保障保本期到期时本金安全的前提下，力争实现基金资产的稳健增值。根据《中银证券保本 1 号混合型证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金的保本期一般每三年为一个周期。在第一个保本期到期日，如本基金的基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上该部分基金份额累计分红金额之和低于认购保本金额，则基金管理人应补足该差额，担保人对此提供不可撤销的连带责任保证。本基金的业绩比较基准为三年期银行定期存款收益率(税后)。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金的保本期安排列示如下：

	截止 2016 年 12 月 31 日		截止 2016 年 12 月
第一个保本期到期日	基金保本份额数	最大保本线	31 日基金份额净值
2019 年 4 月 29 日	4,595,693,256.13	1.0000	1.0035

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券有限责任公司于 2017 年 3 月 31 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银证券保本 1 号混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2016 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金管理政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，

金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中银国际证券有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中银国际控股有限公司	基金管理人的股东
中国石油集团资本有限责任公司	基金管理人的股东
中国石油天然气集团公司	基金管理人的原股东
上海金融发展投资基金(有限合伙)	基金管理人的股东
云南省投资控股集团有限公司	基金管理人的股东
江西铜业股份有限公司	基金管理人的股东
中国银行股份有限公司	基金管理人股东的控股股东、基金销售机构

注：

1、2016 年 6 月 2 日，中银证券 2016 年第六次股东会(临时)会议审议并同意中国石油天然气集团公司将其持有的中银证券 15.92% 的股权转让至中国石油集团资本有限责任公司。该项划转于 2016 年 8 月 22 日获上海证监局核准，并于 2016 年 9 月 22 日完成工商登记变更手续。2016 年 6 月公司独立董事潘飞兼任上海巨人网络科技有限公司独立董事。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年4月29日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
中银国际	575,874,802.33	100.00%	-	-

#### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年4月29日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
中银国际	420,187,992.42	100.00%	-	-

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年4月29日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
中银国际	32,273,900,000.00	100.00%	-	-

#### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年4月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中银国际	421,138.05	100.00%	421,138.05	100.00%

关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。  
 2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月29日(基金合同生 效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	39,236,325.55	-
其中：支付销售机构的客 户维护费	14,308,094.30	-

注：支付基金管理人中银国际证券有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

基金管理人报酬计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.2% / 当年天数。

客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月29日(基金合同生 效日)至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付 的托管费	6,539,387.59	-

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

基金托管费计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期无销售服务费。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）的交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

#### 7.4.8.4.2 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

注：本基金本报告期末无除基金管理人之于的其他关联方投资本基金的情况。

### 7.4.8.5 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 2016 年 4 月 29 日(基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	21,649,822.66	858,940.10	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行同业利率计息。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

### 7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 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

7.4.10.1.1 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
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29	2017 年 1 月 9	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-

		日	日								
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-	
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-	
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-	
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-	
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-	
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-	
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-	
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-	
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-	
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-	
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 200,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 220,698,117.74，属于第二层次的余额为 4,467,231,020.51 元，无属于第三层次的余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	221,082,771.65	4.58
	其中：股票	221,082,771.65	4.58
2	固定收益投资	4,466,846,366.60	92.53
	其中：债券	4,466,846,366.60	92.53
	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	49,957,817.47	1.03
	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	30,173,237.65	0.63
7	其他各项资产	59,170,674.20	1.23
8	合计	4,827,230,867.57	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	33,391,028.54	0.72
C	制造业	134,141,772.23	2.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	118,924.74	0.00
F	批发和零售业	7,531,315.00	0.16

G	交通运输、仓储和邮政业	11,751,638.68	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	290,139.31	0.01
J	金融业	33,820,035.49	0.73
K	房地产业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	221,082,771.65	4.79

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期无沪港通股票投资。

## 8.3 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	600028	中国石化	6,172,094	33,391,028.54	0.72
2	000422	湖北宜化	2,596,688	20,643,669.60	0.45
3	000800	一汽轿车	1,670,000	18,152,900.00	0.39
4	000786	北新建材	1,423,400	14,646,786.00	0.32
5	000651	格力电器	556,230	13,694,382.60	0.30
6	601006	大秦铁路	1,658,500	11,742,180.00	0.25
7	000001	平安银行	1,223,700	11,135,670.00	0.24
8	000338	潍柴动力	1,050,000	10,458,000.00	0.23
9	600060	海信电器	560,000	9,587,200.00	0.21
10	000581	威孚高科	390,000	8,751,600.00	0.19

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600028	中国石化	51,626,302.60	1.12
2	000651	格力电器	24,389,006.00	0.53
3	000422	湖北宜化	23,040,763.00	0.50
4	000800	一汽轿车	19,424,334.46	0.42
5	000157	中联重科	18,600,933.10	0.40
6	600031	三一重工	17,775,769.00	0.39
7	601668	中国建筑	16,793,366.00	0.36
8	000786	北新建材	15,827,517.16	0.34
9	601688	华泰证券	15,767,275.00	0.34
10	601555	东吴证券	14,086,213.29	0.31
11	601006	大秦铁路	13,625,915.52	0.30
12	000001	平安银行	13,150,061.00	0.28
13	601169	北京银行	12,724,966.60	0.28
14	000528	柳工	11,308,345.88	0.25
15	000338	潍柴动力	10,897,200.00	0.24
16	002142	宁波银行	10,011,659.80	0.22
17	600060	海信电器	9,908,141.22	0.21
18	000333	美的集团	9,423,837.00	0.20
19	000581	威孚高科	9,312,625.81	0.20
20	601009	南京银行	8,636,287.00	0.19

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601668	中国建筑	21,590,163.00	0.47
2	600028	中国石化	19,910,723.67	0.43
3	600031	三一重工	17,619,445.50	0.38

4	000157	中联重科	17, 544, 656. 13	0. 38
5	601169	北京银行	12, 632, 909. 15	0. 27
6	000651	格力电器	12, 196, 731. 20	0. 26
7	000528	柳工	10, 581, 642. 00	0. 23
8	002142	宁波银行	9, 628, 105. 23	0. 21
9	601009	南京银行	8, 883, 506. 20	0. 19
10	601688	华泰证券	6, 276, 994. 18	0. 14
11	601998	中信银行	3, 834, 931. 00	0. 08
12	000402	金融街	3, 808, 414. 20	0. 08
13	601555	东吴证券	3, 778, 253. 44	0. 08
14	002563	森马服饰	3, 207, 347. 00	0. 07
15	000650	仁和药业	3, 046, 610. 45	0. 07
16	000422	湖北宜化	2, 814, 697. 28	0. 06
17	000858	五粮液	2, 784, 941. 85	0. 06
18	000568	泸州老窖	2, 773, 879. 76	0. 06
19	601229	上海银行	2, 534, 660. 00	0. 05
20	601398	工商银行	2, 063, 300. 00	0. 04

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	399, 619, 103. 37
卖出股票收入（成交）总额	180, 713, 734. 65

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 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	51, 925, 000. 00	1. 13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	249, 341, 000. 00	5. 40
	其中：政策性金融债	249, 341, 000. 00	5. 40
4	企业债券	433, 284, 463. 20	9. 39
5	企业短期融资券	3, 001, 793, 000. 00	65. 04
6	中期票据	138, 733, 000. 00	3. 01
7	可转债（可交换债）	1, 904, 903. 40	0. 04
8	同业存单	589, 865, 000. 00	12. 78

9	其他	-	-
10	合计	4,466,846,366.60	96.78

## 8.6 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	011698181	16 首钢 SCP002	3,000,000	299,910,000.00	6.50
2	041654060	16 陕延油 CP002	3,000,000	297,450,000.00	6.44
3	011620002	16 中铝 SCP002	2,500,000	250,625,000.00	5.43
4	111607113	16 招行 CD113	2,500,000	246,350,000.00	5.34
5	011698042	16 徐工 SCP003	2,000,000	200,320,000.00	4.34

## 8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

### 8.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

### 8.12.3 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	81,001.52
2	应收证券清算款	11,308,338.44
3	应收股利	-
4	应收利息	47,779,359.91
5	应收申购款	1,974.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,170,674.20

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
27,065	169,934.30	159,910,145.34	3.48%	4,439,361,752.34	96.52%

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	270,683.94	0.0059%

#### 9.4 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	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	0.00
本基金基金经理持有本开放式基金	0.00

## § 10 开放式基金份额变动

	单位：份
基金合同生效日（2016年4月29日）基金份额总额	4,953,885,173.50
本报告期期初基金份额总额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,583,376.29
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	357,196,652.11
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	4,599,271,897.68

注：本基金合同于 2016 年 4 月 29 日生效。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

2016 年 6 月 3 日，聘任翟增军先生为公司董事会秘书，解聘王超先生董事会秘书职务。

2016 年 6 月 15 日，聘任沈锋先生为公司副执行总裁，聘任盖文国先生为公司稽核总监。

2016 年 9 月，高迎欣先生任公司董事长。

2016 年 10 月，赵向雷先生兼任公司合规总监。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

## 11.6 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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
中银国际	2	575,874,802.33	100.00%	421,138.05	100.00%	-

注：根据《关于完善证券投资基金管理席位制度有关问题的通知》的规定，“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的 30%。新成立的基金管理公司，自管理的首只基金成立后第二年起执行。”为了保护基金份额持有人的利益，降低交易成本，由于本基金管理人为证券公司，且综合目前系统、技术等各方面因素，本基金只能使用本公司的交易席位。

1、今后基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、今后基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
中银国际	420,187,992.42	100.00%	32,273,900,000.00	100.00%	-	-

中银国际证券有限责任公司  
2017 年 3 月 31 日