

中银证券保本 1 号混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 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：2016 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 4 月 29 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39

§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
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.....	40
§9 开放式基金份额变动	40
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
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.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	42
§11 备查文件目录	43
11.1 备查文件目录.....	43
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银证券保本 1 号混合型证券投资基金
基金简称	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	4,953,885,173.50 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保障保本周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	021-20328000
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com
客户服务电话	021-61195566, 400-620-8888	95533
传真	021-50372474	010-66275830
注册地址	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市浦东新区银城中路	北京市西城区闹市口大街 1 号

	200号中银大厦39F	院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	钱卫	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中银国际证券有限责任公司	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司	北京市海淀区西三环北路100号北京金玉大厦写字楼9层

§ 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(2016年4月29日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	7,384,246.16
本期利润	7,794,616.42
加权平均基金份额本期利润	0.0016
本期加权平均净值利润率	0.1600%
本期基金份额净值增长率	0.1600%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	7,384,246.16
期末可供分配基金份额利润	0.0015
期末基金资产净值	4,961,679,789.92
期末基金份额净值	1.0016
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.1600%

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

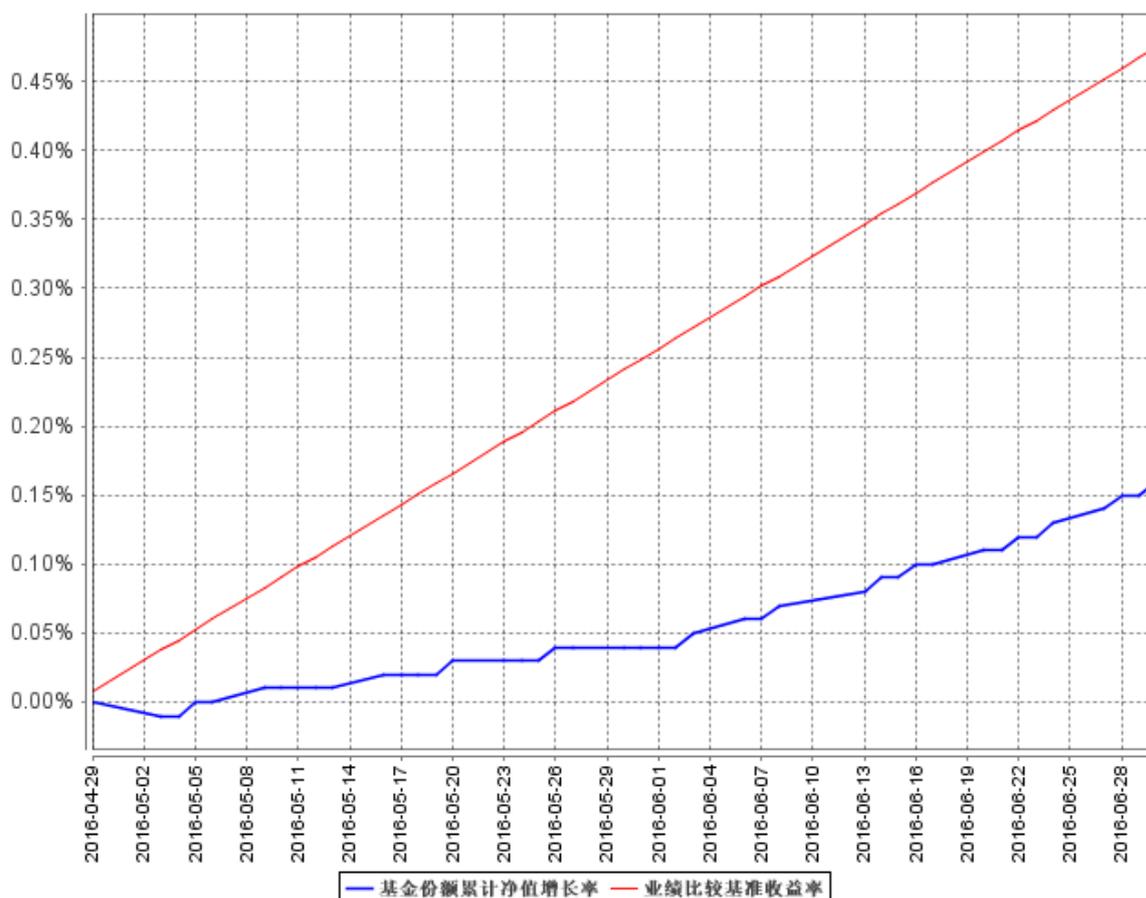
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.1200%	0.0100%	0.2300%	0.0100%	-0.1100%	0.0000%
自基金合同生效起至今	0.1600%	0.0100%	0.4700%	0.0100%	-0.3100%	0.0000%

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。

§ 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、中国石油天然气集团公司、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6月30日, 本管理人共管理一只开放式证券投资基金: 中银证券保本1号混合型证券投资基金。

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	-	8	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, 现任

					中银国际证券中国红货币宝、中国红债券宝投资主办人、中银证券保本 1 号混合型证券投资基金基金经理。
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、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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

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。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，主要包括授权、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环节。研究团队负责提供投资研究支持，投资团队负责投资决策，交易室负责实施交易并实时监控，风险管理部负责事前监督、事中检查和事后稽核，对交易情况进行合理性分析。公司通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

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。

4.3.2 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

上半年央行继续实施稳健货币政策，运用多种货币工具确保资金总量有序供给，资金价格小幅先跌后涨，总体保持平稳。债券市场方面，整体走势跌宕起伏，在长牛渐尾趋势下 4 月份引来一波中等规模回调，以 4 月中旬央企中铁物资信用危机为催化，抛售情绪逐渐加深，至下旬恐慌情绪蔓延全市场。另外，5 月份推出的营改增令市场对融资成本及部分金融债券种受负面影响产生担忧也短暂加重做空情绪，整个 5 月份市场基本呈现震荡走势，下旬后收益率摸得高点，相较于 4 月初水平收益率曲线整体上行超过 20BP。6 月中旬开始，相关经济数据不及预期开始抬头令做多情绪逐渐积累，6 月底超预期的资金宽松加之英国脱欧令市场避险情绪骤然增加，利率品种价格开始快速上扬，并带动高评级券种持续走高，收益率曲线中长端几乎回到 4 月调整之前水平，但短端收益率下移幅度相对偏小。

本产品正式成立于 4 月底，按合同规定将在半年时间内完成建仓。产品成立初期投资以固定收益资产为主，权益资产需等待合理入场时机。固定资产投资方面暂时以短久期策略为主，并主动规避中低评级信用券种。另外，基于跨半年末资金有相对较好的短期投资价值，本产品也适量参与。总的看，上半年产品成立后在积极主动按策略建仓的同时也运用其他合理工具进行资金投放，组合整体运行平稳，有序积累安全垫。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0016 元，份额累计净值为 1.0016 元，报告期内净值增长率为 0.16%，同期业绩基准涨幅为 0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从已公开的最新宏观信息看，当前国内整体经济继续处在低位运行，领先指标观察亦难看到宏观经济明显改善迹象。这种环境下，管理层的多次表态已经否定了大幅放水的可能性，坚持推进以供给侧为主的改革短期内不会有变化，稳健的货币政策与积极的财政政策并举仍是当前货币

与债券市场最主要的基本面。未来，海外因素有可能相较于以往更多的影响到市场的变化。英国脱欧后的一系列影响会持续蔓延，资本市场避险情绪大概率进一步上升。美国方面，美联储年内升息的可能性较低，甚至不排除避险情绪继续加大的情况下降息的可能。在此背景下，我们判断未来一方面货币市场仍将以适度平衡为主，另一方面债券市场会有一波做多行情，持续时间应该不会小于一个月。不过风险同样不可忽视，信用风险事件随着供给侧改革的持续推进预计将难以避免，因此债券市场在总体看多的前提下，信用市场较大可能将进一步分化，投资管理上相较于以往将更加适宜自上而下与自下而上相结合的方式。

4.6 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。由公司领导担任组长，成员由基金事业部、业务营运部、内控与法律合规部、稽核部、风险管理部等部门指派人员组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，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人作出合理解释，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。

4.7 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。

4.8 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关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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银证券保本1号混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	38,251,580.03	-
结算备付金		84,038,797.71	-
存出保证金		3,334.48	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,459,265,380.70	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,459,265,380.70	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,365,801,327.40	-

应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	23,176,917.98	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,970,537,338.30	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,055,025.17	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,877,137.71	-
应付托管费		812,856.30	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	30,959.95	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	81,569.25	-
负债合计		8,857,548.38	-
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,953,885,173.50	-
未分配利润	6.4.7.10	7,794,616.42	-
所有者权益合计		4,961,679,789.92	-
负债和所有者权益总计		4,970,537,338.30	-

注：1、报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.0016元，基金份额总额4,953,885,173.50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6月30日。

6.2 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6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年4月29日(基 金合同生效日)至	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
----	-----	--------------------------------	-------------------------------------

		2016年6月30日	
一、收入		19,688,133.74	-
1.利息收入		19,178,703.98	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	792,673.42	-
债券利息收入		3,453,843.19	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,932,187.37	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	410,370.26	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	99,059.50	-
减：二、费用		11,893,517.32	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,075,528.28	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,679,254.73	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,073.94	-
5. 利息支出		47,999.97	-
其中：卖出回购金融资产支出		47,999.97	-
6. 其他费用	6.4.7.20	85,660.40	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,794,616.42	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,794,616.42	-

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6月30日。

6.3 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6月30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)	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(本期利润)	-	7,794,616.42	7,794,616.42
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)	4,953,885,173.50	7,794,616.42	4,961,679,789.92
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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6月30日。

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：

<u> 宁敏 </u>	<u> 赵向雷 </u>	<u> 戴景义 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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《关于核准中银证券保本 1 号混合型证券投资基金募集的批复》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。本基金为契约型证券投资基金,首次设立募集包括认购资金利息共募集 4,953,885,173.50 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)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(包括认购资金利息折算部分)为 4,953,885,173.50 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。

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,本基金投资于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)。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%。在每个开放期间的前 3 个月、开放期间及开放期的后 3 个月不受前述投资组合比例的限制。在开放期,本基金持有现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,在保本周期内(保本周期到期日除外),本基金不受该比例的限制。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)。

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 2016 年 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 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 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 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 6 月 30 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 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 4 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20%的年费率逐日计提。本基金到期操作期间内（除保本周期到期日）及过渡期内不收取基金管理费。若保本周期到期，本基金转型为中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金，则管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提。本基金到期操作期间内（除保本周期到期日）及过渡期内不收取基金托管费。若保本周期到期，本基金转型为中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金，则托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式：

(1) 保本周期内：仅采用现金分红一种收益分配方式；

(2) 转型为“中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金”后：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值：即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[2007]21号《关于证券

投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

自基金合同成立以来，未进行会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

自基金合同成立以来，未进行会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

自基金合同成立以来，不存在需要说明的差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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，对金

融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013年1月1日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起，对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。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	38,251,580.03
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	38,251,580.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	186,619,505.11	186,460,380.70
	银行间市场	1,272,235,505.33	1,272,805,000.00
	合计	1,458,855,010.44	1,459,265,380.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	1,458,855,010.44	1,459,265,380.70	410,370.26
----	------------------	------------------	------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上交所买入返售证券	150,000,000.00	-
银行间买入返售证券	3,215,801,327.40	1,625,796,342.40
合计	3,365,801,327.40	1,625,796,342.40

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	3,947.51
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	34,035.75
应收债券利息	19,452,281.67
应收买入返售证券利息	3,686,651.70
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.35
合计	23,176,917.98

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	30,959.95
合计	30,959.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	81,569.25
合计	81,569.25

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年4月29日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	4,953,885,173.50	4,953,885,173.50
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,953,885,173.50	4,953,885,173.50

注：本基金合同于2016年4月29日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币4,952,975,233.25元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币909,940.25元，以上实收基金（本息）合计为人民币4,953,885,173.50元，折合4,953,885,173.50份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	7,384,246.16	410,370.26	7,794,616.42
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-

其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,384,246.16	410,370.26	7,794,616.42

6.4.7.11 存款利息收入

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6月30日
活期存款利息收入	678,042.10
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	105,888.92
其他	8,742.40
合计	792,673.42

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年4月29日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
1. 交易性金融资产	410,370.26
——股票投资	-
——债券投资	410,370.26
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	410,370.26

6.4.7.18 其他收入

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6月30日
基金赎回费收入	-
其他	99,059.50
合计	99,059.50

6.4.7.19 交易费用

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6月30日
交易所市场交易费用	448.94
银行间市场交易费用	4,625.00
合计	5,073.94

6.4.7.20 其他费用

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6月30日
审计费用	30,607.29
信息披露费	50,961.96
银行汇划费	3,731.15
其他	360.00
合计	85,660.40

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本报告期存在控制关系或其他重要利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
中国银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 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6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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
中银证券	106,619,505.11	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 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6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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
中银证券	22,756,400,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期不存在应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年4月29日(基金合同生效日)至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,075,528.28	-
其中：支付销售机构的客户维护费	3,663,031.39	-

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年4月29日(基金合同生效日)至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,679,254.73	-

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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

6.4.10.4.2 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外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
建设银行	38,251,580.03	678,042.10	-	-

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末通过关联方购买其承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项需要说明。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.2 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
136453	16中工01	2016年6月20日	-	新债未上市	100.00	100.00	800,000	80,000,000.00	80,000,000.00	-

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金没有因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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为保本基金，通过第三方担保机制的引入和投资组合保险技术的运用实现基金资产的保值增值目标。本基金主要投资于股票、债券等具有良好流动性的金融工具。与这些金融工具相关的风险，以及本基金的基金管理人对于相关风险采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在保障保本周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。

本基金的基金管理人在公司风险管理体系的基础上构建明晰基金业务的风险管理组织架构和职能，由董事会及其风险控制委员会、执行委员会、风险管理委员会、风险管理部、基金管理部、中后线部门等相关业务部门构成多层次风险管理框架体系。董事会决定公司风险偏好，并在风险控制委员会的协助下监察公司基金业务的总体风险及管理状况。执行委员会领导公司基金业务的风险管理。风险管理委员会协助执行委员会在董事会授权范围内确定、调整基金业务的业务权限、讨论重大决策以及检查风险管理状况。风险管理部负责监控和报告公司基金业务的风险敞口和限额使用情况。业务主管对各自业务的风险管理负有首要责任。财务、业务营运、稽核、法律及合规等中后线部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

对于与债券、资产支持证券等金融工具相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	150,720,000.00	-
A-1以下	-	-
未评级	200,515,000.00	-
合计	351,235,000.00	-

注：1. 表中所列示的债券投资为短期融资券及超短期融资券，其中超短期融资券无信用评级。

2. 上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	74,489,326.30	-
AAA以下	100,349,054.40	-
未评级	-	-
合计	174,838,380.70	-

注：1. 表中所列示的债券投资为除短期融资券以外的信用债券。

2. 上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合

理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严格监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

关于投资品种变现的流动性风险方面，本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资；持有的利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6 月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	38,251,580.03	-	-	-	-	-	38,251,580.03
结算备付金	84,038,797.71	-	-	-	-	-	84,038,797.71
存出保证金	3,334.48	-	-	-	-	-	3,334.48
交易性金融资产	-	377,986,000.00	938,540,514.50	121,122,866.20	21,616,000.00	-	1,459,265,380.70
买入返售金融资产	3,365,801,327.40	-	-	-	-	-	3,365,801,327.40
应收利息	-	-	-	-	-	23,176,917.98	23,176,917.98
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	3,488,095,039.62	377,986,000.00	938,540,514.50	121,122,866.20	21,616,000.00	23,176,917.98	4,970,537,338.30
负债							
应付证券清算款						3,055,025.17	3,055,025.17
应付管理人报酬						4,877,137.71	4,877,137.71
应付托管费						812,856.30	812,856.30
应付交易费用						30,959.95	30,959.95
其他负债						81,569.25	81,569.25
负债总计						8,857,548.38	8,857,548.38
利率敏感度缺口	3,488,095,039.62	377,986,000.00	938,540,514.50	121,122,866.20	21,616,000.00	14,319,369.60	4,961,679,789.92
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
负债							

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-2,121,950.72	-
	市场利率下降 25 个基点	2,136,895.15	-

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,459,265,380.70	29.41	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,459,265,380.70	29.41	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本报告期内，本基金主要投资于债券，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）

6.4.14 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 6 月 30 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 1,459,265,380.70 元，无属于第二层次及第三层次的余额。

(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，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）、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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本基金于 2016 年 4 月 29 日成立以来一直采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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 6 月 30 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。

§ 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	-	-

	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,459,265,380.70	29.36
	其中：债券	1,459,265,380.70	29.36
	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	3,365,801,327.40	67.72
	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	122,290,377.74	2.46
7	其他各项资产	23,180,252.46	0.47
8	合计	4,970,537,338.30	100.00

7.2 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

注：本基金本报告期无境内股票投资。

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期无股票投资。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注：本基金本报告期无股票投资。

7.4.2 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

注：本基金本报告期无股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期无股票投资。

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	51,682,000.00	1.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	134,778,380.70	2.72
5	企业短期融资券	351,235,000.00	7.08
6	中期票据	40,060,000.00	0.81
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	881,510,000.00	17.77
9	其他	-	-
10	合计	1,459,265,380.70	29.41

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	111610020	16 兴业 CD020	5,000,000	488,950,000.00	9.85
2	111612031	16 北京银行 CD031	2,000,000	197,080,000.00	3.97
3	111610017	16 兴业 CD017	2,000,000	195,480,000.00	3.94
4	041556037	15 珠轨交 CP001	1,000,000	100,640,000.00	2.03
5	011699152	16 中核建 SCP001	1,000,000	100,240,000.00	2.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 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。

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

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

报告期内，本基金无股票投资。

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	3,334.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,176,917.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,180,252.46

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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。

§ 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

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
30,989	159,859.47	160,686,417.72	3.24%	4,793,198,755.78	96.76%

8.2 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	0.0055%

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	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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 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	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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）	-

本报告期末基金份额总额	4,953,885,173.50
-------------	------------------

注：本基金合同于2016年4月29日生效。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未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

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。

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 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。

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，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。

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		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	

中银证券	2	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注：根据《关于完善证券投资基金交易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，交易佣金费用为零。

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。

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		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
中银证券	106,619,505.11	0.47%	22,756,400,000.00	99.53%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中银证券保本1号混合型证券投资基金发售公告、基金合同、基金合同摘要、招募说明书、托管协议、保证合同	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月2日

2	中银证券保本1号混合型证券投资基金提前结束募集的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月27日
3	中银证券保本1号混合型证券投资基金募集期认购申请确认比例的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月27日
4	中银证券保本1号混合型证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月30日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银证券保本1号混合型证券投资基金注册的批复
- 2、《中银证券保本1号混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中银证券保本1号混合型证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人的业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人的业务资格批件、营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人基金网站 www.bocifunds.com。

11.3 查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登陆基金管理人基金网站 www.bocifunds.com 查阅。

中银国际证券有限责任公司
2016年8月24日