

中银证券保本 1 号混合型证券投资基金 2016 年年度报告

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。

本报告期自2016年4月29日起至2016年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50

8.7 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	51
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	51
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	51
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
8.12 投资组合报告附注	51
§9 基金份额持有人信息	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
9.3 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	53
§10 开放式基金份额变动	53
§11 重大事件揭示	53
11.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
11.4 基金投资策略的改变	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
11.8 其他重大事件	55
§12 影响投资者决策的其他重要信息	错误！未定义书签。
§13 备查文件目录	56
13.1 备查文件目录	56
13.2 存放地点	57
13.3 查阅方式	57

§ 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
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	田青
	联系电话	021-20328000	010-67595096
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	tianqingl.zh@ccb.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 200号中银大厦39F	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼

邮政编码	200120	100033
法定代表人	宁敏	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
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、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	-	-
本期加权平均净值利润率	0.37%	-	-
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
期末可供分配利润	15,983,881.26	-	-
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	-	-
3.1.3 累计期末指标	2016年末	2015年末	2014年末
基金份额累计净值增长率	0.35%	-	-

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

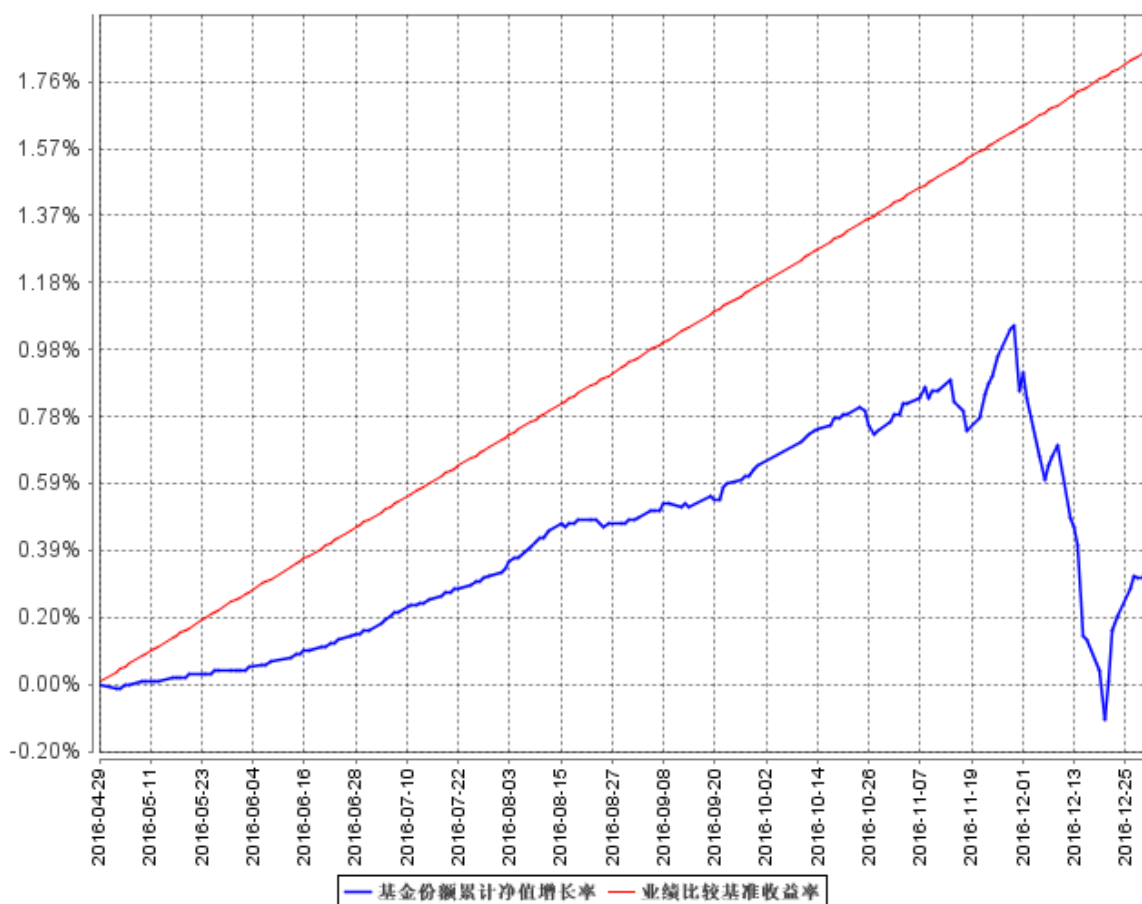
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

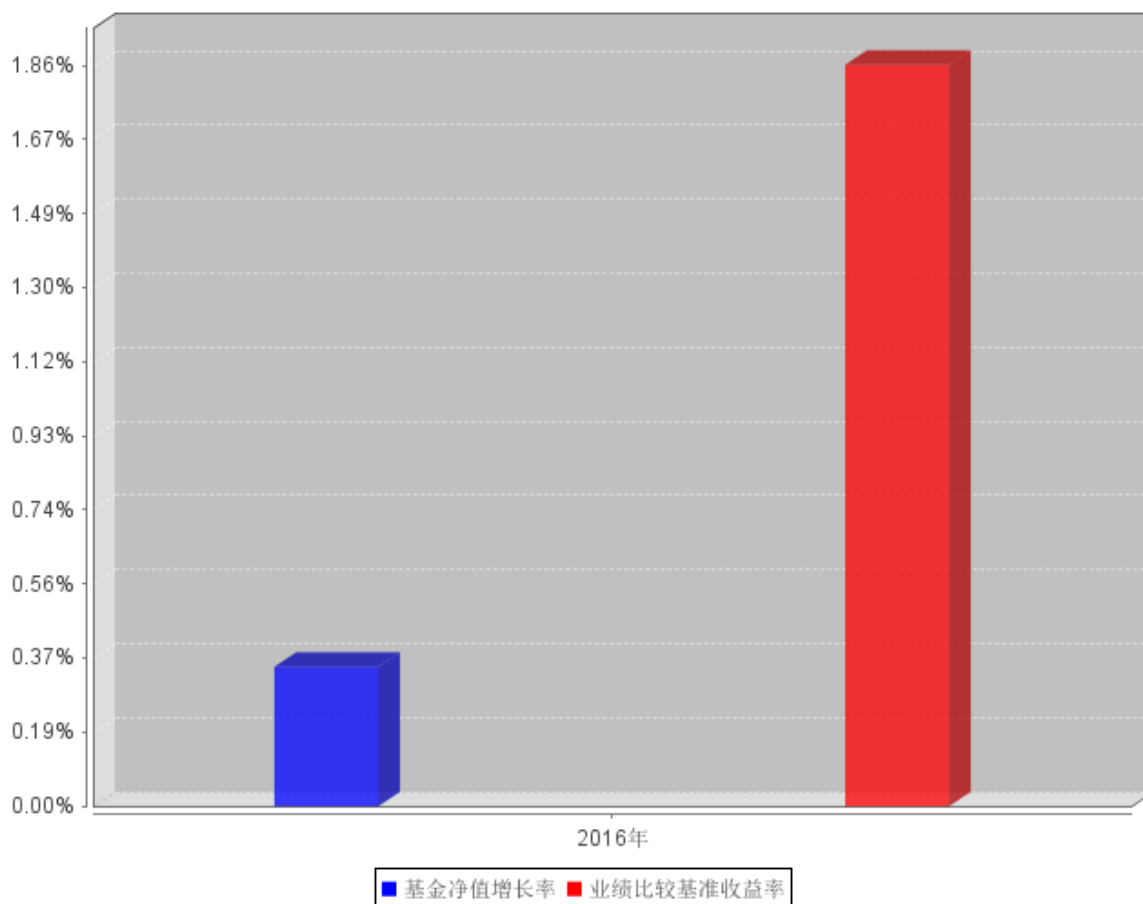


注：1. 本基金基金合同于2016年4月29日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 22150 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中银证券保本 1 号混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的中银证券保本 1 号混合型证券投资基金(以下简称“中银证券保本 1 号混合”)的财务报表，包括 2016 年 12

	月31日的资产负债表、2016年4月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是中银证券保本1号混合的基金管理人中银国际证券有限责任公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述中银证券保本1号混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了中银证券保本1号混合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。
注册会计师的姓名	薛 竞 崔 崑
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
审计报告日期	2017年3月31日

§ 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	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	49,957,817.47	-
应收证券清算款		11,308,338.44	-
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,827,230,867.57	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31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	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	383,333.75	-
负债合计		211,975,088.63	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,599,271,897.68	-
未分配利润	7.4.7.10	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	附注号	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
一、收入		66,294,021.61	-
1. 利息收入		88,406,677.07	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	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	7.4.7.12	6,216,302.45	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-5,970,688.56	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	337,038.17	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-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）	7.4.7.18	2,119,141.62	-

减：二、费用		48,256,697.62	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	39,236,325.55	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	6,539,387.59	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	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	7.4.7.20	365,136.32	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,037,323.99	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		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
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	-	-	-
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 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 17 页至 45 页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

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，第一个保本周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。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，本基金的保本周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。

7.4.4.1 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为2016年4月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

本基金目前以交易目的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变动计入当期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其他各类应收款项等。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。

7.4.4.4 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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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/(累计亏损)。

7.4.4.9 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或者发行价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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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，其处置价格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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。在保本周期内，本基金收益仅以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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和债券，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、市盈率法和现金流量法等估值技术进行估值。

(2) 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。

(3) 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。

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

本基金在本报告期间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税收政策的通知》、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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	21,649,822.66	-
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-

合计:	21,649,822.66	-
-----	---------------	---

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	225,121,671.17	221,082,771.65	-4,038,899.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	474,061,246.20	467,377,366.60
	银行间市场	4,013,560,670.02	3,999,469,000.00
	合计	4,487,621,916.22	4,466,846,366.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,712,743,587.39	4,687,929,138.25	-24,814,449.14
项目	上年度末 2015年12月31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	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

银行间买入返售证券	49,957,817.47	49,957,817.47
合计	49,957,817.47	49,957,817.47
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中：已出售或再质押总额
期末买断式逆回购交易中取得的债券	011698613	16 奇瑞 SCP006	2017年2月9日	99.43	500,000	49,957,542.47	-
合计					500,000	49,715,000.00	-
项目	上年度末 2015年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中：已出售或再质押总额
合计					-	-	-

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	8,855.78	-
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	3,835.50	-
应收债券利息	47,625,071.04	-
应收买入返售证券利息	141,561.09	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	36.50	-
合计	47,779,359.91	-

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	421,138.05	-
银行间市场应付交易费用	77,695.21	-
合计	498,833.26	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	63,533.75	-
预提费用	319,800.00	-
合计	383,333.75	-

7.4.7.9 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12月31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	2,583,376.29	2,583,376.29
本期赎回(以“-”号填列)	-357,196,652.11	-357,196,652.11
- 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	4,599,271,897.68	4,599,271,897.68

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自2016年4月6日至2016年4月26日止期间公开发售，共募集有效净认购资金4,952,975,233.25元。根据《中银证券保本1号混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入909,940.25元在本基金成立后，折算为909,940.25份基

金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《中银证券保本1号混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于2016年4月29日(基金合同生效日)至2016年7月28日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自2016年7月29日起开始办理。

7.4.7.10 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	42,851,773.13	-24,814,449.14	18,037,323.99
本期基金份额交易产生的变动数	-2,114,574.36	61,131.63	-2,053,442.73
其中：基金申购款	15,129.79	-303.00	14,826.79
基金赎回款	-2,129,704.15	61,434.63	-2,068,269.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,737,198.77	-24,753,317.51	15,983,881.26

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	858,940.10	-
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	204,608.47	-
其他	8,950.29	-
合计	1,072,498.86	-

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	180,713,734.65	-
减：卖出股票成本总额	174,497,432.20	-
买卖股票差价收入	6,216,302.45	-

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,970,688.56	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-5,970,688.56	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,024,809,015.53	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,983,243,065.23	-
减：应收利息总额	47,536,638.86	-
买卖债券差价收入	-5,970,688.56	-

7.4.7.13.3 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。

7.4.7.13.4 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。

7.4.7.13.5 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.14.3 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。

7.4.7.14.4 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。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 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。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年4月29日(基金合同生效 日)至2016年12月31日	上年度可比期间收益金额 2015年1月1日至2015年12月31 日
股指期货-投资收益	-	-

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	337,038.17	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	337,038.17	-

7.4.7.17 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12月	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日

	31日	
1. 交易性金融资产	-24,814,449.14	-
——股票投资	-4,038,899.52	-
——债券投资	-20,775,549.62	-
——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	-24,814,449.14	-

7.4.7.18 其他收入

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	2,019,055.50	-
其他	100,086.12	-
合计	2,119,141.62	-

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	654,068.38	-
银行间市场交易费用	42,675.00	-
合计	696,743.38	-

7.4.7.20 其他费用

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	120,000.00	-
信息披露费	199,800.00	-
银行汇划费	34,076.32	-
其他	760.00	-

债券帐户维护费	10,500.00	
合计	365,136.32	-

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，2017年7月1日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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%的股权受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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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%	-	-

7.4.10.1.2 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%	-	-

7.4.10.1.3 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%	-	-

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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。

7.4.10.2.2 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。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期无销售服务费。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 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。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
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	2016年	2017年	新股流	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

	信息	12月27日	1月5日	通受限					
--	----	--------	------	-----	--	--	--	--	--

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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关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级风险管理框架体系。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。

7.4.13.2 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	804,893,000.00	-
A-1以下	-	-
未评级	3,005,629,000.00	-
合计	3,810,522,000.00	-

注：未评级部分包括超短期融资券、同业存单和期限在一年以内(含)的政策性金融债。

7.4.13.2.2 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12月31日	上年度末 2015年12月31日
AAA	323,134,985.60	-
AAA以下	250,787,381.00	-
未评级	82,402,000.00	-
合计	656,324,366.60	-

注：未评级部分包括国债和期限大于一年的政策性金融债。

7.4.13.3 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密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中设计了巨额赎回条款，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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标以及组合在短期内变现能力的综合指标等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大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，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于2016年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有200,000,000.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产、卖出回购金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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							
银行存款	21,649,822.66	-	-	-	-	-	21,649,822.66
结算备付金	8,523,414.99	-	-	-	-	-	8,523,414.99
存出保证金	81,001.52	-	-	-	-	-	81,001.52
交易性金融资产	684,770,000.00	536,339,000.00	2,695,988,092.20	529,399,274.40	20,350,000.00	221,082,771.65	4,687,929,138.25
买入返售金融资产	-	49,957,542.47	-	-	-	-	49,957,542.47
应收证券清算款	-	-	-	-	-	11,308,338.44	11,308,338.44
应收利息	-	-	-	-	-	47,779,359.91	47,779,359.91
应收申购款	-	-	-	-	-	1,974.33	1,974.33
其他资产	-	-	-	-	-	275.00	275.00
资产总计	715,024,239.17	586,296,542.47	2,695,988,092.20	529,399,274.40	20,350,000.00	280,172,719.33	4,827,230,867.57
负债							
卖出回购金融资产款	200,000,000.00	-	-	-	-	-	200,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,562,739.71	5,562,739.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,735,462.49	4,735,462.49
应付托管费	-	-	-	-	-	789,243.78	789,243.78

应付交易费用	-	-	-	-	-	498,833.26	498,833.26
应付利息	-	-	-	-	-	5,475.64	5,475.64
其他负债	-	-	-	-	-	383,333.75	383,333.75
负债总计	200,000,000.00	-	-	-	-	11,975,088.63	211,975,088.63
利率敏感度缺口	515,024,239.17	586,296,542.47	2,695,988,092.20	529,399,274.40	20,350,000.00	268,197,630.70	4,615,255,778.94
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，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-7,448,091.79	-
市场利率下降 25 个基点	7,494,492.10	-	

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。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。

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。

本基金投资组合中股票等风险资产的比例不高于基金资产的40%，债券、货币市场工具等稳健资产的比例不低于基金资产净值的60%；每个交易日日终，现金或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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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	221,082,771.65	4.79	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	4,466,846,366.60	96.78	-	-
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	4,687,929,138.25	101.57	-	-

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于2016年12月31日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为4.79%，因此除市场利率和外汇汇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。

7.4.14 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所有股票投资明细

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
11	000333	美的集团	306,895	8,645,232.15	0.19
12	601555	东吴证券	620,251	8,230,730.77	0.18
13	000963	华东医药	104,500	7,531,315.00	0.16
14	601688	华泰证券	399,152	7,128,854.72	0.15
15	002202	金风科技	299,937	5,131,922.07	0.11
16	000400	许继电气	262,090	4,756,933.50	0.10
17	600166	福田汽车	1,500,000	4,635,000.00	0.10
18	000999	华润三九	161,125	3,984,621.25	0.09
19	601998	中信银行	600,000	3,846,000.00	0.08
20	002422	科伦药业	225,250	3,631,030.00	0.08
21	000776	广发证券	200,000	3,372,000.00	0.07
22	000423	东阿阿胶	60,000	3,232,200.00	0.07
23	600104	上汽集团	121,500	2,849,175.00	0.06
24	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
25	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.00
26	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
27	603098	森特股份	4,293	103,332.51	0.00
28	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
29	603878	武进不锈	2,000	80,000.00	0.00
30	603585	苏利股份	1,041	72,578.52	0.00
31	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
32	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
33	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
34	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00

35	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
36	002827	高争民爆	2,059	60,905.22	0.00
37	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.00
38	601882	海天精工	2,148	54,215.52	0.00
39	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
40	603036	如通股份	2,114	51,771.86	0.00
41	603559	中通国脉	899	48,447.11	0.00
42	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
43	603389	亚振家居	1,963	47,327.93	0.00
44	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
45	603886	元祖股份	2,242	39,683.40	0.00
46	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
47	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
48	603239	N 仙通	924	29,059.80	0.00
49	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
50	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
51	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
52	603929	N 亚翔	2,193	15,592.23	0.00
53	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
54	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
55	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
56	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
57	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
58	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
59	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

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	湖北宣化	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(成交单价乘以成交数量)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	湖北宣化	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(成交单价乘以成交数量)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(成交单价乘以成交数量)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。

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

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。

§ 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%

9.2 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	0.0059%

9.3 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、基金投资和研发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。

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；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

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
中银国际	420,187,992.42	100.00%	32,273,900,000.00	100.00%	-	-

11.8 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
5	中银国际证券有限责任公司旗下基金2016年6月30日基金净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月1日
6	中银证券保本1号混合型证券投资基金2016年第2季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月19日
7	中银证券保本1号混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年7月27日

8	中银证券保本1号混合型证券投资基金2016年半年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年8月24日
9	中银证券保本1号混合型证券投资基金2016年第3季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年10月26日
10	中银证券保本1号混合型证券投资基金开放日常定期定额投资及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年11月18日
11	中银国际证券有限责任公司旗下开放式基金转换业务规则	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年11月18日
12	中银国际证券有限责任公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年11月23日
13	中银国际证券有限责任公司关于公司股东变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年12月2日
14	中银证券保本1号混合型证券投资基金更新招募说明书(2016年第1号)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年12月13日

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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。

12.3 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
2017年3月31日