

**中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金**  
**2017 年半年度报告摘要**  
**2017 年 6 月 30 日**

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十九日

## 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中银新机遇混合	
基金主代码	002057	
交易代码	002057	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2015 年 11 月 19 日	
基金管理人	中银基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	782,144,005.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中银新机遇混合 A	中银新机遇混合 C
下属分级基金的交易代码	002057	002058
报告期末下属分级基金的份额总额	686,632,990.25 份	95,511,015.45 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点把握中国经济新常态下，经济结构转型升级过程中的投资机遇，在严格控制风险的基础上，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金前瞻性地研究经济结构转型升级过程中政策、产业和行业的发展变化，重点关注国有企业、金融、能源、价格、教育、医疗等核心改革领域，各大新兴产业，以及“一带一路”、自贸区等区域开发，挖掘具有中长期发展机遇和投资价值的个股。本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于大类资产配置、行业配置和个股筛选中，构建投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

### 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		中银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛文成	张志永
	联系电话	021-38834999	021-62677777-212004
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95561
传真		021-68873488	021-62159217

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	<a href="http://www.bocim.com">http://www.bocim.com</a>
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 200 号 26 楼

### 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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）	
	中银新机遇混合 A	中银新机遇混合 C
本期已实现收益	20,088,689.29	2,645,942.97
本期利润	38,731,013.75	5,109,010.33
加权平均基金份额本期利润	0.0570	0.0564
本期基金份额净值增长率	5.61%	5.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	中银新机遇混合 A	中银新机遇混合 C
期末可供分配基金份额利润	0.0106	0.0081
期末基金资产净值	712,181,152.83	98,822,140.95
期末基金份额净值	1.037	1.035

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.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，采用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（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果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（已实现部分扣除未实现部分）。

#### 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

中银新机遇混合 A

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	1.16%	0.13%	3.34%	0.41%	-2.18%	-0.28%
过去三个月	2.53%	0.12%	3.28%	0.38%	-0.75%	-0.26%
过去六个月	5.61%	0.11%	5.48%	0.35%	0.13%	-0.24%
过去一年	7.89%	0.10%	8.05%	0.41%	-0.16%	-0.31%
自基金合同生效起至今	10.05%	0.08%	-0.99%	0.74%	11.04%	-0.66%

中银新机遇混合 C

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	1.17%	0.11%	3.34%	0.41%	-2.17%	-0.30%
过去三个月	2.64%	0.10%	3.28%	0.38%	-0.64%	-0.28%
过去六个月	5.63%	0.10%	5.48%	0.35%	0.15%	-0.25%
过去一年	7.81%	0.09%	8.05%	0.41%	-0.24%	-0.32%
自基金合同生效起至今	9.86%	0.08%	-0.99%	0.74%	10.85%	-0.66%

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

中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2015 年 11 月 19 日至 2017 年 6 月 30 日)

中银新机遇混合 A



中银新机遇混合 C



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）的规定，即本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

## 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

中银基金管理有限公司前身为中银国际基金管理有限公司，于 2004 年 8 月 12 日正式成立，由中银国际和美林投资管理合资组建（2006 年 9 月 29 日美林投资管理有限公司与贝莱德投资管理有限公司合并，合并后新公司名称为“贝莱德投资管理有限公司”）。2007 年 12 月 25 日，经中国证券监督管理委员会批复，同意中国银行股份有限公司直接控股中银基金。公司注册地为中国上海市，注册资本为十亿元人民币，其中中国银行拥有 83.5% 的股权，贝莱德投资管理拥有 16.5% 的股权。截至 2017 年 6 月 30 日，本管理人共管理八十五只开放式证券投资基金：中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金、中银动态策略混合型证券投资基金、中银稳健增利债券型证券投资基金、中银行业优选灵活配置混合型证券投资基金、中银中证 100 指数增强型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银稳健双利债券型证券投资

资基金、中银全球策略证券投资基金（FOF）、上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、中银中小盘成长混合型证券投资基金、中银信用增利债券型证券投资基金、中银沪深 300 等权重指数证券投资基金(LOF)、中银主题策略混合型证券投资基金、中银保本混合型证券投资基金、中银理财 14 天债券型证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、中银理财 7 天债券型证券投资基金、中银理财 30 天债券型证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金、中银消费主题混合型证券投资基金、中银美丽中国混合型证券投资基金、中银盛利纯债一年定期开放债券型证券投资基金（LOF）、中银新回报混合型证券投资基金、中银互利分级债券型证券投资基金、中银惠利纯债半年定期开放债券型证券投资基金、中银中高等级债券型证券投资基金、中银优秀企业混合型证券投资基金、中银活期宝货币市场基金、中银多策略灵活配置混合型证券投资基金、中银健康生活混合型证券投资基金、中银聚利分级债券型证券投资基金、中银薪钱包货币市场基金、中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金、中银新经济灵活配置混合型证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、中银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、中银恒利半年定期开放债券型证券投资基金、中银新动力股票型证券投资基金、中银宏观策略灵活配置混合型证券投资基金，中银新趋势灵活配置混合型证券投资基金、中银智能制造股票型证券投资基金、中银互联网+股票型证券投资基金、中银国有企业债债券型证券投资基金，中银新财富灵活配置混合型证券投资基金，中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金，中银战略新兴产业股票型证券投资基金，中银机构现金管理货币市场基金，中银美元债债券型证券投资基金（QDII）、中银稳进保本混合型证券投资基金、中银宝利灵活配置混合型证券投资基金、中银瑞利灵活配置混合型证券投资基金、中银珍利灵活配置混合型证券投资基金、中银鑫利灵活配置混合型证券投资基金、中银益利灵活配置混合型证券投资基金、中银裕利灵活配置混合型证券投资基金、中银合利债券型证券投资基金、中银腾利灵活配置混合型证券投资基金、中银永利半年定期开放债券型证券投资基金、中银季季红定期开放债券型证券投资基金、中银宏利灵活配置混合型证券投资基金、中银颐利灵活配置混合型证券投资基金、中银丰利灵活配置混合型证券投资基金、中银尊享半年定期开放债券型证券投资基金、中银睿享债券型证券投资基金、中银悦享定期开放债券型证券投资基金、中银丰润定期开放债券型证券投资基金、中银量化精选灵活配置混合型证券投资基金、中银广利灵活配置混合型证券投资基金、中银润利灵活配置混合型证券投资基金、中银锦利灵活配置混合型证券投资基金、中银品质生活灵活配置混合型证券投资基金、中银理财 90 天债券型证券投资基金、中银丰庆定期开放债券型证券投资基金、中银富享债券型证券投资基金、中银文体娱乐灵活配置混合型证券投资基金、中银新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中银如意宝货币市场基金、中银丰实定期开放债券型发起式证券投资基金、

中银丰和定期开放债券型发起式证券投资基金，同时管理着多个特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
白洁	本基金的基金经理、中银货币基金基金经理、中银理财 7 天债券基金基金经理、中银产业债基金基金经理、中银安心回报债券基金基金经理、中银颐利基金基金经理、中银睿享基金基金经理、中银悦享基金基金经理、中银富享基金基金经理、中银丰庆基金基金经理	2015-11-19	-	12	中银基金管理有限公司副总裁（VP），上海财经大学经济学硕士。曾任金盛保险有限公司投资部固定收益分析员。2007 年加入中银基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员、基金经理助理。2011 年 3 月至今任中银货币基金基金经理，2012 年 12 月至今任中银理财 7 天债券基金基金经理，2013 年 12 月至 2016 年 7 月任中银理财 21 天债券基金基金经理，2014 年 9 月至今任中银产业债基金基金经理，2014 年 10 月至今任中银安心回报债券基金基金经理，2015 年 11 月至今任中银新机遇基金基金经理，2016 年 8 月至今任中银颐利基金基金经理，2016 年 9 月至今任中银睿享基金基金经理，2016 年 9 月至今任中银悦享基金基金经理，2017 年 3 月至今任中银富享基金基金经理，2017 年 3 月至今任中银丰庆基金基金经理。具有 12 年证券从业年限。具备基金、证券、银行间本币市场交易员从业资格。
苗婷	本基金基金经理，中银新财富基金基金经理，中银瑞利基金基金经理，中银珍利基金基金经理，中银裕利基金基金经理，中银腾利基金基金经理，中银广利基金基金经理	2016-08-16	-	10	经济学硕士。曾任万家基金管理有限公司交易员。2010 年加入中银基金管理有限公司，曾任债券交易员。2016 年 8 月至今任中银新机遇基金基金经理，2016 年 8 月至今任中银瑞利基金基金经理，2016 年 8 月至今任中银珍利基金基金经理，2016 年 8 月至今任中银新财富基金基金经理，2016 年 8 月至今任中银裕利基金基金经理，2016 年 8 月至今任中银腾利基金基金经理，2016 年 12 月至今任中银广利基金基金经理。具有 10 年证券从业年限。具备基金从业资格。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 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》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发生异常交易行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 4.4 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

###### 1. 宏观经济分析

国外经济方面，全球经济继续处于较为稳定的复苏通道，美国仍是表现相对较好的经济体。从领先指标来看，上半年美国 ISM 制造业 PMI 指数从 54.5 大幅上升至 57.8 水平，就业市场整体改善，失业率稳定在 4.4% 左右。上半年欧元区经济强势复苏，制造业 PMI 指数从 54.9 上升至 57.4，CPI 同比增速稳定至 1.3% 左右；不过，英国公投脱欧后受到负面冲击，上半年制造业 PMI 从 56.1 小幅回落至 54.3；日本经济窄幅震荡，上半年 PMI 持平于 52.4。综合来看，美国仍是全球复苏前景最好的经济体，受美联储加息预期反复影响，美元指数一度攀升至 103 上方，后一路回落至 96 左右。

国内经济方面，在前期“稳增长”政策刺激及国内外需求复苏影响下，经济领先指标整体仍是震荡走强，经济下行压力降低。具体来看，二季度领先指标制造业 PMI 震荡上行至 51.7，上半年持续保持在 51 上方，同步指标工业增加值同比增速 1-6 月累计增长 6.9%，较去年末上行 0.9 个百分点。从经济增长动力来看，拉动经济的三驾马车以稳中有升为主：1-6 月消费增速小幅回升至 11%，6 月美元计价出口增速大幅回升至 11.3% 左右，1-6 月固定资产投资增速小幅上升至 8.6% 的水平。通胀方面，CPI 持续低位徘徊，6 月下行至 1.5% 的水平，PPI 冲高回落，6 月同比涨幅持平于 5.5% 左右。

## 2. 市场回顾

整体来看，上半年债市整体呈现出震荡下跌走势。其中，一季度中债总全价指数下跌 1.45%，中债银行间国债全价指数下跌 1.32%，中债企业债总全价指数下跌 3.51%；二季度中债总全价指数下跌 1.04%，中债银行间国债全价指数下跌 1.87%，中债企业债总全价指数下跌 3.42%。反映在收益率曲线上，上半年收益率曲线经历了由陡变平的变化。其中，一季度 10 年期国债收益率从 3.01% 上行至 3.28%，10 年期金融债（国开）收益率从 3.68% 上行至 4.06%；二季度，10 年期国债收益率从 3.28% 的水平上行 29 个 bp 至 3.57%，10 年期金融债（国开）收益率从 4.06% 上行 14 个 BP 至 4.20%。货币市场方面，上半年央行货币政策整体中性偏紧，资金面呈现总体偏紧，6 月季末偏松的格局。其中一季度，1 天回购加权平均利率均值在 2.44% 左右，较上季度均值上升 14bp，银行间 7 天回购利率均值在 3.07% 左右，较上季度均值上行 26bp；二季度，银行间 1 天回购利率上行 33 个 BP 至 2.77%，7 天回购加权平均利率上行 28 个 BP 至 3.35%。

权益方面，一季度上证综指上涨 3.83%，代表大盘股表现的沪深 300 指数上涨 4.41%，中小盘综合指数上涨 1.18%，创业板综合指数下跌 2.51%；二季度，上证综指下跌 0.93%，代表大盘股表现的沪深 300 指数上涨 6.10%，中小盘综合指数下跌 3.57%，创业板综合指数下跌 7.80%。

## 3. 运行分析

上半年股票市场出现分化，债券市场小幅震荡，本基金业绩表现好于比较基准。策略上，本基金延续绝对收益投资思路，即以高等级信用债券配置为主，结合银行存款，保持组合短久期，辅以配置高分红低波动率的个股，积极参与一级市场新股申购，借此提升基金的业绩表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

中银新机遇 A：截至 2017 年 6 月 30 日为止，本基金的基金份额净值为 1.037，本基金的累计单位净值为 1.099，报告期内本基金净值增长为 5.61%，同期业绩基准增长率为 5.48%。

中银新机遇 C：截至 2017 年 6 月 30 日为止，本基金的基金份额净值为 1.035，本基金的累计单位净值为 1.097，报告期内本基金净值增长为 5.63%，同期业绩基准增长率为 5.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，全球经济依然处于不均衡发展和复苏阶段，美国经济复苏态势回落，欧洲经济稳中向好，但能源价格低迷制约了各国通胀的上升。鉴于对当前经济和通胀增速的判断，对于国内情况，经济短期内维持在合理区间内运转，经济增速短期下滑压力较小，中长期 L 型增长走势的基本趋势仍未发生变化，宏观政策仍将注重于经济结构调整和金融风险防控，继续深入推进供给侧改革和“三去一降一补”，建立房地产市场平稳健康发展的长效机制，通过财税改革和国企混改等结构性改革为经济创造新的增长点。货币政策将保持稳健中性，整体基调不松不紧，适应货币供应方式新变化，调节好货币闸门，公开市场方面维护流动性基本稳定。社会融资方面，在银监会加强监管的背景下，不断完善风险管理，防范金融风险，规范表外融资，预计表外融资继续收缩，表内信贷投放也或将因为着力防控资产泡沫而放缓。

综合上述分析，我们对 2017 年下半年债券市场的走势判断保持谨慎乐观。预计 2017 年下半年宏观调控政策整体保持稳定，货币政策在中性偏紧的总体基调下，目前已经出现阶段性的放松，但进一步大幅放松的概率不大。预计银行间 7 天回购利率可能小幅下行，银行间资金面状况整体也有望保持稳定。经济基本面较为强劲，基建投资可能遵循以往年内“前高后低”的规律而出现下行，房地产投资在地产调控的大背景下，难以拉动经济增长，制造业投资保持稳中有升。物价方面，通胀对债市的压力较低，PPI 高位见顶后继续回落，同时对 CPI 的传导力度有限，CPI 上升步伐缓慢。美联储 9 月份加息概率较低，缩表计划可能要等到年末才开始实行，但欧央行退出量化宽松政策的预期上升对全球债市形成一定压力。考虑到经济增长动能延续韧性、货币政策取向总体中性、利率债供需压力渐增，预计下半年债券收益率中枢可能呈震荡走势，在出现经济下行、监管放松、流动性改善等情况时，适当捕捉债券市场的短期阶段性机会。信用债方面，允许刚性兑付打破，进一步完善金融市场建设，提高风险定价能力等因素，下半年或将存在个案违约风险发生，规避信用风险较大的品种。具体操作上，在做好组合流动性管理的基础上，维持适度杠杆和久期，均衡配置，合理分配各类资产，审慎精选信用债和可转债品种，积极把握利率债和可转债的投资交易机会。我们将坚持从自上而下的角度预判市场走势，并从自下而上的角度严防信用风险。权益方面，一带一路、国企混改等仍可能带来主题预期投资机会，估值处于相对低位、安全边际较高、有业绩或政策催化

预期的股票可能带来超额收益，我们将积极把握结构性与波段性行情，借此提升基金的业绩表现。

作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由研究部、风险管理部、基金运营部相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金运营部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金运营部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值委员会审议，同时按流程对外公布。

##### 4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

##### 4.6.3 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

##### 4.6.4 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本报告期末中银新机遇混合 A 可供分配利润为 7,255,217.06 元，中银新机遇混合 C 可供分配利润为 771,789.18 元。2017 年 3 月 20 日本基金进行了利润分配，向 A 类基金份额持有人每 10 份基金份额派发现金红利 0.40 元，分红总金额为 26,733,703.73 元，向 C 类基金份额持有人每 10 份基金份额派发现金红利 0.40 元，分红总金额为 3,589,940.51 元；2017 年 6 月 15 日本基金进行了利润分配，向 A 类基金份额持有人每 10 份基金份额派发现金红利 0.22 元，分红总金额为 15,106,360.39 元，

向 C 类基金份额持有人每 10 份基金份额派发现金红利 0.22 元，分红总金额为 2,032,092.38 元。

#### 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

本基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### 5 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>	-	-
银行存款	261,838,070.41	221,739,552.04
结算备付金	289,469.37	2,768,349.05
存出保证金	45,359.62	27,143.79
交易性金融资产	404,381,487.66	556,878,942.70
其中：股票投资	124,480,724.16	101,562,659.90
基金投资	-	-
债券投资	279,900,763.50	455,316,282.80
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	139,905,729.86	-
应收证券清算款	185,310.76	-
应收利息	5,185,280.53	7,719,799.53
应收股利	-	-
应收申购款	51,288.33	31,698.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	811,881,996.54	789,165,485.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	35,975.31	10,060.89
应付管理人报酬	399,704.44	437,906.72
应付托管费	133,234.81	145,968.90
应付销售服务费	7,901.94	13,545.94
应付交易费用	114,363.53	61,236.90
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	187,522.73	109,000.00
负债合计	878,702.76	777,719.35
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	782,144,005.70	756,648,705.17
未分配利润	28,859,288.08	31,739,061.01
所有者权益合计	811,003,293.78	788,387,766.18
负债和所有者权益总计	811,881,996.54	789,165,485.53

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.037 元，基金份额总额 782,144,005.70 份，其中 A 类基金份额参考净值 1.037 元，份额总额 686,632,990.25 份；C 类基金份额参考净值 1.035 元，份额总额 95,511,015.45 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>47,556,434.66</b>	<b>20,088,517.56</b>
1.利息收入	12,993,691.66	16,158,903.32
其中：存款利息收入	6,196,958.36	1,821,729.52
债券利息收入	5,970,893.86	11,730,451.41
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	825,839.44	2,606,722.39
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	13,420,483.63	11,245,080.45
其中：股票投资收益	14,020,859.91	10,860,231.66
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,655,393.92	254,252.31
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	1,055,017.64	130,596.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	21,105,391.82	-7,341,073.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	36,867.55	25,607.00
<b>减：二、费用</b>	<b>3,716,410.58</b>	<b>6,594,550.41</b>
1. 管理人报酬	2,395,423.79	3,726,607.38
2. 托管费	798,474.62	1,242,202.45
3. 销售服务费	46,788.14	518,307.63
4. 交易费用	230,730.57	76,865.16
5. 利息支出	39,356.78	795,578.07
其中：卖出回购金融资产支出	39,356.78	795,578.07
6. 其他费用	205,636.68	234,989.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>43,840,024.08</b>	<b>13,493,967.15</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>43,840,024.08</b>	<b>13,493,967.15</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	756,648,705.17	31,739,061.01	788,387,766.18
二、本期经营活动产生的	-	43,840,024.08	43,840,024.08

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）	25,495,300.53	742,300.00	26,237,600.53
其中：1.基金申购款	69,445,788.62	2,758,828.48	72,204,617.10
2.基金赎回款	-43,950,488.09	-2,016,528.48	-45,967,016.57
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）	-	-47,462,097.01	-47,462,097.01
五、期末所有者权益（基金净值）	782,144,005.70	28,859,288.08	811,003,293.78
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 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）	3,987,985,897.40	13,031,238.95	4,001,017,136.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,493,967.15	13,493,967.15
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）	-3,206,426,741.05	-11,015,941.28	-3,217,442,682.33
其中：1.基金申购款	1,240,721,791.97	13,476,381.15	1,254,198,173.12
2.基金赎回款	-4,447,148,533.02	-24,492,322.43	-4,471,640,855.45
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）	781,559,156.35	15,509,264.82	797,068,421.17

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：

基金管理人负责人：李道滨，主管会计工作负责人：欧阳向军，会计机构负责人：乐妮

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系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[2015]1596 号文《关于准予中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合

同于 2015 年 11 月 19 日正式生效，首次设立募集规模为 2,277,187,104.04 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为中银基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资对象是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）、权证、股指期货等权益类品种，债券等固定收益类品种（包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等），国债期货，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的相关规定。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 6.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的通知》的规定，对资管产品在 2018 年 1 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。

### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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

本基金本会计期间内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 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
-------	---------

中银基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人
中国银行股份有限公司 (“中国银行”)	基金管理人的控股股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,395,423.79	3,726,607.38
其中：支付销售机构的客户维护费	56,357.32	110,828.26

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

###### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	798,474.62	1,242,202.45

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

###### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银新机遇混合 A	中银新机遇混合 C	合计
中银基金管理有限公司	-	74,418.87	74,418.87
中国银行	-	8,164.20	8,164.20
合计	-	82,583.07	82,583.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银新机遇混合A	中银新机遇混合C	合计
中银基金管理有限公司	-	487,156.19	487,156.19
中国银行	-	31,151.44	31,151.44
合计	-	518,307.63	518,307.63

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额销售服务费年费率为0.10%。本基金C类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

#### 6.4.8.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
兴业银行股份有限公司	11,838,070.41	134,532.90	4,158,541.08	959,015.65
合计	11,838,070.41	134,532.90	4,158,541.08	959,015.65

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股未上市	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股未上市	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股未上市	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股未上市	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股未上市	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股未上市	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股未上市	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股未上市	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603993	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股未上市	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## 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	124,480,724.16	15.33
	其中：股票	124,480,724.16	15.33
2	固定收益投资	279,900,763.50	34.48
	其中：债券	279,900,763.50	34.48
	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	139,905,729.86	17.23
	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	262,127,539.78	32.29
7	其他各项资产	5,467,239.24	0.67
8	合计	811,881,996.54	100.00

### 7.2 报告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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,701,744.00	0.21
B	采矿业	5,757,508.16	0.71
C	制造业	35,558,607.31	4.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,568,058.60	2.78
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,103,067.36	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	16,728,670.11	2.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	31,383,859.00	3.87
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	3,671,570.00	0.45
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	124,480,724.16	15.35

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 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	002142	宁波银行	613,800	11,846,340.00	1.46
2	601398	工商银行	1,254,500	6,586,125.00	0.81
3	600900	长江电力	409,700	6,301,186.00	0.78
4	601939	建设银行	936,300	5,758,245.00	0.71
5	000651	格力电器	139,859	5,757,995.03	0.71
6	600028	中国石化	970,912	5,757,508.16	0.71
7	601607	上海医药	195,700	5,651,816.00	0.70
8	000858	五粮液	100,800	5,610,528.00	0.69
9	600377	宁沪高速	569,584	5,581,923.20	0.69
10	000027	深圳能源	717,021	4,825,551.33	0.60

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

### 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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	8,998,446.00	1.14
2	000027	深圳能源	4,999,175.23	0.63
3	600027	华电国际	4,799,116.00	0.61
4	000999	华润三九	3,993,916.00	0.51
5	000883	湖北能源	3,886,665.75	0.49
6	000888	峨眉山 A	3,598,572.00	0.46

7	000089	深圳机场	3,400,881.80	0.43
8	601288	农业银行	2,999,701.00	0.38
9	000876	新希望	2,999,535.00	0.38
10	600018	上港集团	2,999,451.00	0.38
11	000651	格力电器	2,996,754.00	0.38
12	002267	陕天然气	2,422,644.42	0.31
13	601985	中国核电	2,299,839.00	0.29
14	600377	宁沪高速	2,198,770.60	0.28
15	000333	美的集团	1,999,332.00	0.25
16	002415	海康威视	1,998,993.00	0.25
17	300498	温氏股份	1,996,136.00	0.25
18	002304	洋河股份	1,990,185.00	0.25
19	600009	上海机场	1,678,806.88	0.21
20	600548	深高速	1,499,278.00	0.19
21	600305	恒顺醋业	1,498,184.00	0.19
22	600660	福耀玻璃	999,845.00	0.13
23	600966	博汇纸业	499,968.00	0.06
24	601881	中国银河	335,876.01	0.04
25	002294	信立泰	326,586.60	0.04
26	600076	康欣新材	299,364.00	0.04
27	603833	欧派家居	116,636.32	0.01
28	601952	苏垦农发	97,161.00	0.01
29	601878	浙商证券	93,364.05	0.01
30	603225	新凤鸣	85,295.96	0.01
31	603839	安正时尚	76,349.00	0.01
32	300625	三雄极光	75,926.20	0.01
33	601228	广州港	75,366.19	0.01
34	601366	利群股份	74,088.00	0.01
35	601212	白银有色	71,125.24	0.01
36	002867	周大生	68,604.48	0.01
37	603980	吉华集团	59,322.80	0.01
38	603358	华达科技	55,126.24	0.01
39	603337	杰克股份	50,200.76	0.01
40	300660	江苏雷利	47,479.74	0.01
41	603920	世运电路	47,125.00	0.01
42	603626	科森科技	47,030.75	0.01
43	603113	金能科技	46,741.52	0.01
44	603768	常青股份	44,961.60	0.01
45	002872	天圣制药	44,807.11	0.01
46	603303	得邦照明	44,562.96	0.01
47	603586	金麒麟	43,723.02	0.01
48	002859	洁美科技	42,732.06	0.01
49	603630	拉芳家化	36,504.15	0.00
50	603385	惠达卫浴	36,492.50	0.00

51	300623	捷捷微电	34,316.46	0.00
52	603801	志邦股份	32,998.82	0.00
53	002841	视源股份	32,020.80	0.00
54	603803	瑞斯康达	30,801.40	0.00
55	603728	鸣志电器	30,534.37	0.00
56	603208	江山欧派	30,317.43	0.00
57	603639	海利尔	30,089.70	0.00
58	600939	重庆建工	29,640.00	0.00
59	603096	新经典	27,368.50	0.00
60	002869	金溢科技	27,359.00	0.00
61	603081	大丰实业	26,904.44	0.00
62	603906	龙蟠科技	26,808.32	0.00
63	603758	秦安股份	26,362.80	0.00
64	002880	卫光生物	25,059.78	0.00
65	603197	保隆科技	24,836.82	0.00
66	603615	茶花股份	24,398.55	0.00
67	300580	贝斯特	23,869.51	0.00
68	603043	广州酒家	23,855.80	0.00
69	002879	长缆科技	23,660.26	0.00
70	603881	数据港	22,440.60	0.00
71	603826	坤彩科技	22,400.21	0.00
72	300599	雄塑科技	22,211.20	0.00
73	603926	铁流股份	22,072.80	0.00
74	300658	延江股份	21,545.10	0.00
75	002774	快意电梯	20,990.10	0.00
76	603179	新泉股份	20,944.95	0.00
77	002851	麦格米特	20,786.36	0.00
78	603855	华荣股份	20,705.52	0.00
79	002855	捷荣技术	19,986.24	0.00
80	603767	中马传动	19,974.15	0.00
81	002875	安奈儿	19,767.06	0.00
82	603178	圣龙股份	19,412.34	0.00
83	603133	碳元科技	19,242.15	0.00
84	300639	凯普生物	19,235.94	0.00
85	603637	镇海股份	19,209.96	0.00
86	603360	百傲化学	19,136.04	0.00
87	300627	华测导航	19,129.46	0.00
88	002868	绿康生化	18,756.80	0.00
89	002882	金龙羽	18,389.20	0.00
90	603933	睿能科技	17,311.40	0.00
91	002845	同兴达	16,757.52	0.00
92	603896	寿仙谷	16,063.68	0.00
93	603538	美诺华	15,741.66	0.00
94	603383	顶点软件	15,449.55	0.00

95	300600	瑞特股份	15,432.52	0.00
96	002860	星帅尔	15,392.37	0.00
97	300652	雷迪克	15,340.08	0.00
98	603226	菲林格尔	15,312.32	0.00
99	603305	旭升股份	15,212.26	0.00
100	603811	诚意药业	15,019.28	0.00
101	300597	吉大通信	14,632.38	0.00
102	603628	清源股份	14,376.17	0.00
103	300611	美力科技	14,375.97	0.00
104	603326	我乐家居	14,331.24	0.00
105	002847	盐津铺子	14,194.42	0.00
106	603488	展鹏科技	14,089.79	0.00
107	603578	三星新材	14,000.92	0.00
108	603042	华脉科技	13,872.32	0.00
109	603380	易德龙	13,862.64	0.00
110	300670	大烨智能	13,760.87	0.00
111	603041	美思德	13,359.28	0.00
112	603139	康惠制药	13,258.70	0.00
113	603050	科林电气	12,924.24	0.00
114	603496	恒为科技	12,895.68	0.00
115	002849	威星智能	12,804.80	0.00
116	603797	联泰环保	12,736.52	0.00
117	603089	正裕工业	12,641.81	0.00
118	603668	天马科技	12,519.36	0.00
119	603316	诚邦股份	12,439.68	0.00
120	002846	英联股份	12,428.36	0.00
121	002877	智能自控	12,062.40	0.00
122	603938	三孚股份	12,011.44	0.00
123	002824	和胜股份	11,867.80	0.00
124	603501	韦尔股份	11,632.14	0.00
125	300620	光库科技	11,269.98	0.00
126	603787	新日股份	11,260.41	0.00
127	300647	超频三	11,146.24	0.00
128	603638	艾迪精密	11,021.50	0.00
129	300662	科锐国际	10,846.80	0.00
130	603388	元成股份	10,781.10	0.00
131	300672	国科微	10,659.36	0.00
132	002842	翔鹭钨业	10,643.44	0.00
133	300666	江丰电子	10,560.64	0.00
134	603229	奥翔药业	10,465.40	0.00
135	300606	金太阳	10,266.08	0.00
136	603903	中持股份	10,186.28	0.00
137	603177	德创环保	10,004.40	0.00
138	300659	中孚信息	9,971.60	0.00

139	603331	百达精工	9,620.37	0.00
140	603505	金石资源	9,611.80	0.00
141	603320	迪贝电气	9,512.94	0.00
142	300663	科蓝软件	9,400.11	0.00
143	300669	沪宁股份	9,251.00	0.00
144	002881	美格智能	8,861.44	0.00
145	300643	万通智控	8,711.80	0.00
146	300609	汇纳科技	8,420.44	0.00
147	002843	泰嘉股份	8,372.16	0.00
148	603879	永悦科技	8,282.25	0.00
149	603335	迪生力	8,072.60	0.00
150	300657	弘信电子	7,933.17	0.00
151	603536	惠发股份	7,691.04	0.00
152	300671	富满电子	7,639.62	0.00
153	603679	华体科技	7,636.96	0.00
154	603617	君禾股份	7,429.76	0.00
155	603286	日盈电子	7,057.70	0.00
156	300601	康泰生物	6,938.61	0.00
157	300655	晶瑞股份	6,041.16	0.00
158	300603	立昂技术	4,704.70	0.00

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000001	平安银行	10,818,874.95	1.37
2	000725	京东方 A	7,852,996.87	1.00
3	000709	河钢股份	5,008,702.63	0.64
4	600660	福耀玻璃	4,280,331.01	0.54
5	601998	中信银行	4,020,000.00	0.51
6	000963	华东医药	3,969,208.18	0.50
7	000600	建投能源	3,703,104.00	0.47
8	600018	上港集团	3,419,071.00	0.43
9	000651	格力电器	3,001,379.40	0.38
10	600028	中国石化	2,499,990.26	0.32
11	000333	美的集团	2,207,370.00	0.28
12	600741	华域汽车	2,000,140.26	0.25
13	600009	上海机场	2,000,077.28	0.25
14	300498	温氏股份	1,988,572.00	0.25
15	000501	鄂武商 A	1,500,313.90	0.19
16	600027	华电国际	1,499,999.76	0.19

17	000031	中粮地产	1,291,302.00	0.16
18	002508	老板电器	1,278,804.90	0.16
19	600305	恒顺醋业	1,256,554.00	0.16
20	002078	太阳纸业	1,088,274.00	0.14
21	000778	新兴铸管	1,007,036.00	0.13
22	002304	洋河股份	993,440.00	0.13
23	000538	云南白药	746,224.00	0.09
24	603018	中设集团	615,588.00	0.08
25	600966	博汇纸业	565,830.00	0.07
26	601881	中国银河	543,786.44	0.07
27	601212	白银有色	426,751.44	0.05
28	601228	广州港	348,856.60	0.04
29	002267	陕天然气	331,772.00	0.04
30	600076	康欣新材	329,242.00	0.04
31	603833	欧派家居	270,513.35	0.03
32	601375	中原证券	237,852.45	0.03
33	300625	三雄极光	219,123.80	0.03
34	601952	苏垦农发	198,075.00	0.03
35	601878	浙商证券	185,512.71	0.02
36	603839	安正时尚	172,354.50	0.02
37	601366	利群股份	163,884.00	0.02
38	600939	重庆建工	155,348.00	0.02
39	603225	新凤鸣	153,728.76	0.02
40	002867	周大生	151,588.12	0.02
41	603630	拉芳家化	142,920.00	0.02
42	002851	麦格米特	137,459.84	0.02
43	300623	捷捷微电	132,471.72	0.02
44	000910	大亚圣象	131,100.00	0.02
45	603877	太平鸟	126,182.40	0.02
46	603881	数据港	124,487.79	0.02
47	603980	吉华集团	113,092.71	0.01
48	002841	视源股份	111,602.40	0.01
49	603626	科森科技	110,279.00	0.01
50	603303	得邦照明	109,602.54	0.01
51	603768	常青股份	109,373.50	0.01
52	603298	杭叉集团	109,157.18	0.01
53	603920	世运电路	108,125.00	0.01
54	603113	金能科技	104,460.48	0.01
55	002859	洁美科技	100,310.00	0.01
56	603358	华达科技	99,892.00	0.01
57	603586	金麒麟	98,644.80	0.01
58	300660	江苏雷利	95,262.20	0.01
59	603133	碳元科技	93,667.95	0.01
60	603337	杰克股份	93,177.37	0.01

61	002872	天圣制药	92,738.90	0.01
62	603385	惠达卫浴	92,400.00	0.01
63	603615	茶花股份	91,822.50	0.01
64	603177	德创环保	91,714.42	0.01
65	300627	华测导航	91,407.96	0.01
66	002855	捷荣技术	87,340.48	0.01
67	002847	盐津铺子	84,949.10	0.01
68	300599	雄塑科技	82,030.00	0.01
69	603578	三星新材	81,584.82	0.01
70	300601	康泰生物	80,837.97	0.01
71	603218	日月股份	78,816.92	0.01
72	603081	大丰实业	78,492.80	0.01
73	603906	龙蟠科技	78,228.08	0.01
74	603728	鸣志电器	77,491.50	0.01
75	002880	卫光生物	76,621.66	0.01
76	002774	快意电梯	75,181.22	0.01
77	603803	瑞斯康达	73,748.25	0.01
78	603208	江山欧派	72,026.79	0.01
79	603096	新经典	70,612.00	0.01
80	603050	科林电气	69,581.98	0.01
81	603179	新泉股份	69,547.40	0.01
82	002849	威星智能	69,483.00	0.01
83	300597	吉大通信	69,060.60	0.01
84	300580	贝斯特	68,074.15	0.01
85	603360	百傲化学	67,811.87	0.01
86	603886	元祖股份	67,596.30	0.01
87	300611	美力科技	67,496.20	0.01
88	002845	同兴达	67,112.37	0.01
89	603797	联泰环保	65,792.51	0.01
90	300609	汇纳科技	64,916.20	0.01
91	300600	瑞特股份	64,839.98	0.01
92	603178	圣龙股份	64,450.00	0.01
93	603416	信捷电气	63,591.60	0.01
94	603197	保隆科技	60,516.96	0.01
95	300582	英飞特	59,796.00	0.01
96	300620	光库科技	59,779.00	0.01
97	603811	诚意药业	59,619.68	0.01
98	002869	金溢科技	59,375.95	0.01
99	002846	英联股份	59,247.54	0.01
100	603758	秦安股份	58,486.36	0.01
101	603826	坤彩科技	58,228.36	0.01
102	300606	金太阳	57,065.16	0.01
103	603929	亚翔集成	56,623.26	0.01
104	603638	艾迪精密	56,615.00	0.01

105	603787	新日股份	56,061.68	0.01
106	002842	翔鹭钨业	55,975.92	0.01
107	603639	海利尔	55,958.40	0.01
108	603505	金石资源	55,913.30	0.01
109	300591	万里马	54,727.47	0.01
110	603926	铁流股份	54,651.82	0.01
111	603637	镇海股份	53,338.56	0.01
112	002868	绿康生化	52,815.20	0.01
113	603668	天马科技	51,408.00	0.01
114	603855	华荣股份	50,768.08	0.01
115	603239	浙江仙通	50,709.12	0.01
116	603089	正裕工业	49,595.83	0.01
117	300639	凯普生物	49,382.74	0.01
118	603903	中持股份	49,127.15	0.01
119	300658	延江股份	48,951.00	0.01
120	002875	安奈儿	48,714.66	0.01
121	002843	泰嘉股份	48,497.94	0.01
122	603767	中马传动	47,481.00	0.01
123	603628	清源股份	45,425.60	0.01
124	002835	同为股份	44,587.83	0.01
125	603488	展鹏科技	44,179.85	0.01
126	300647	超频三	43,726.60	0.01
127	002877	智能自控	43,625.68	0.01
128	300662	科锐国际	42,757.92	0.01
129	603501	韦尔股份	42,419.20	0.01
130	002860	星帅尔	42,284.34	0.01
131	002840	华统股份	42,233.88	0.01
132	300643	万通智控	41,897.68	0.01
133	603896	寿仙谷	41,787.84	0.01
134	603042	华脉科技	41,690.88	0.01
135	603041	美思德	40,819.34	0.01
136	300603	立昂技术	40,222.60	0.01
137	603383	顶点软件	39,739.00	0.01
138	603139	康惠制药	39,202.80	0.00
139	603538	美诺华	38,574.36	0.00
140	300657	弘信电子	38,501.91	0.00
141	603496	恒为科技	37,574.40	0.00
142	603316	诚邦股份	37,027.20	0.00
143	300652	雷迪克	36,708.00	0.00
144	603320	迪贝电气	35,062.80	0.00
145	002824	和胜股份	34,973.68	0.00
146	603388	元成股份	33,679.80	0.00
147	603226	菲林格尔	33,464.11	0.00
148	300586	美联新材	33,023.27	0.00

149	603326	我乐家居	32,937.96	0.00
150	300663	科蓝软件	32,919.78	0.00
151	300659	中孚信息	31,738.40	0.00
152	300655	晶瑞股份	31,603.62	0.00
153	603229	奥翔药业	29,493.40	0.00
154	002838	道恩股份	29,473.68	0.00
155	603879	永悦科技	27,244.98	0.00
156	603536	惠发股份	24,595.20	0.00

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	70,956,052.55
卖出股票的收入（成交）总额	80,149,660.43

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”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。

#### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,832,000.00	4.91
	其中：政策性金融债	39,832,000.00	4.91
4	企业债券	44,572,060.00	5.50
5	企业短期融资券	30,033,000.00	3.70
6	中期票据	29,589,000.00	3.65
7	可转债（可交换债）	294,703.50	0.04
8	同业存单	135,580,000.00	16.72
9	其他	-	-
10	合计	279,900,763.50	34.51

#### 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	111616175	16 上海银行 CD175	1,000,000	97,000,000.00	11.96
2	111780083	17 深圳前海微众银行	400,000	38,580,000.00	4.76

		CD030			
3	011751033	17 鲁黄金 SCP001	300,000	30,033,000.00	3.70
4	101653040	16 国联 MTN001	300,000	29,589,000.00	3.65
5	136147	16 中粮 01	298,000	29,135,460.00	3.59

### 7.7 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

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

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

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

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

### 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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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 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。

### 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	45,359.62
2	应收证券清算款	185,310.76
3	应收股利	-
4	应收利息	5,185,280.53
5	应收申购款	51,288.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,467,239.24

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 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

份额级别	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
中银新机遇混合 A	550	1,248,423.62	673,539,758.51	98.09%	13,093,231.74	1.91%
中银新机遇混合 C	3,059	31,222.95	53,455,984.17	55.97%	42,055,031.28	44.03%
合计	3,609	216,720.42	726,995,742.68	92.95%	55,148,263.02	7.05%

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	份额级别	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	中银新机遇混合 A	999.20	0.0001%
	中银新机遇混合 C	-	-
	合计	999.20	0.0001%

**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	份额级别	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	中银新机遇混合 A	0~10
	中银新机遇混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中银新机遇混合 A	0
	中银新机遇混合 C	0
	合计	0

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	中银新机遇混合 A	中银新机遇混合 C
基金合同生效日（2015 年 11 月 19 日）基金份额总额	33,399,741.65	2,243,787,362.39
本报告期期初基金份额总额	671,032,631.36	85,616,073.81
本报告期基金总申购份额	25,289,091.38	44,156,697.24
减：本报告期基金总赎回份额	9,688,732.49	34,261,755.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	686,632,990.25	95,511,015.45

**10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内没有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**

本报告期内，基金管理人、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**

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内基金投资策略没有发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内没有改聘会计师事务所。

**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**

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

**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	
天风证券	2	67,658,265.44	45.86%	62,284.11	45.97%	-
国金证券	1	35,084,135.05	23.78%	31,971.96	23.60%	-
东北证券	2	26,873,572.47	18.22%	24,537.59	18.11%	-
海通证券	2	17,134,090.54	11.61%	15,955.40	11.78%	-
国信证券	1	779,743.21	0.53%	726.20	0.54%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低选择基金专用交易单元并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

**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		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
天风证券	5,257,373.20	6.46%	283,000,000.00	81.32%	-	-
国金证券	391,622.00	0.48%	-	-	-	-
东北证券	-	-	30,000,000.00	8.62%	-	-
海通证券	21,984,685.00	27.01%	25,000,000.00	7.18%	-	-
国信证券	53,774,93	66.06%	10,000,00	2.87%	-	-

	9.46		0.00			
--	------	--	------	--	--	--

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-01-01 至 2017-06-30	546,806,673.98	-	-	546,806,673.98	69.9113%
产品特有风险							
<p>本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险；（4）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险。</p>							

中银基金管理有限公司

二〇一七年八月二十九日