

# 中银证券安进债券型证券投资基金 2018 年半年度报告 摘要

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中银证券安进债券	
基金主代码	003929	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 5 日	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	32,063,346,551.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中银证券安进债券 A	中银证券安进债券 C
下属分级基金的交易代码:	003929	003930
报告期末下属分级基金的份额总额	32,063,333,067.31 份	13,484.24 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争获得超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过久期管理策略、类属配置策略、期限结构配置策略、信用债券投资策略及资产支持证券投资策略，以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其预期收益和预期风险低于股票型及混合型基金，高于货币市场基金。

### 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		中银国际证券股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵向雷	贺倩
	联系电话	021-20328000	010-66060069
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		021-61195566, 400-620-8888	95599
传真		021-50372474	010-68121816

## 2.4 信息披露方式

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	金管理人及基金托管人办公地址

## § 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

基金级别	中银证券安进债券 A	中银证券安进债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	758,374,897.59	1,341.30
本期利润	1,307,358,932.25	2,511.77
加权平均基金份额本期利润	0.0355	0.0425
本期基金份额净值增长率	3.59%	3.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0154	0.0158
期末基金资产净值	32,556,404,694.11	13,697.81
期末基金份额净值	1.0154	1.0158

注：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。

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

中银证券安进债券 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	0.65%	0.04%	0.34%	0.06%	0.31%	-0.02%
过去三个	1.82%	0.07%	1.01%	0.10%	0.81%	-0.03%

月						
过去六个月	3.59%	0.06%	2.16%	0.08%	1.43%	-0.02%
过去一年	4.02%	0.05%	0.83%	0.06%	3.19%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.06%	0.05%	-2.28%	0.09%	7.34%	-0.04%

中银证券安进债券 C

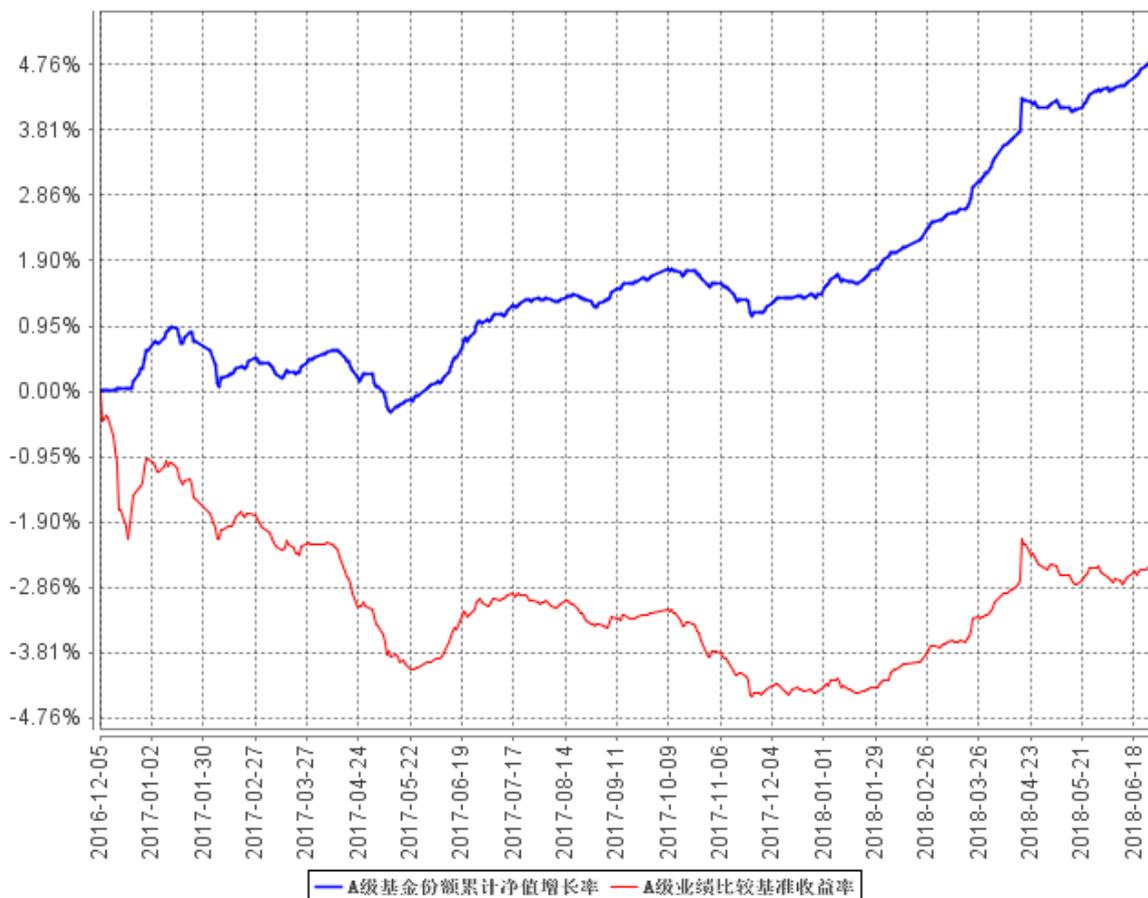
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.69%	0.04%	0.34%	0.06%	0.35%	-0.02%
过去三个月	1.87%	0.07%	1.01%	0.10%	0.86%	-0.03%
过去六个月	3.65%	0.05%	2.16%	0.08%	1.49%	-0.03%
过去一年	4.07%	0.05%	0.83%	0.06%	3.24%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.11%	0.05%	-2.28%	0.09%	7.39%	-0.04%

注：1、业绩比较基准收益率=中债综合全价指数收益率。

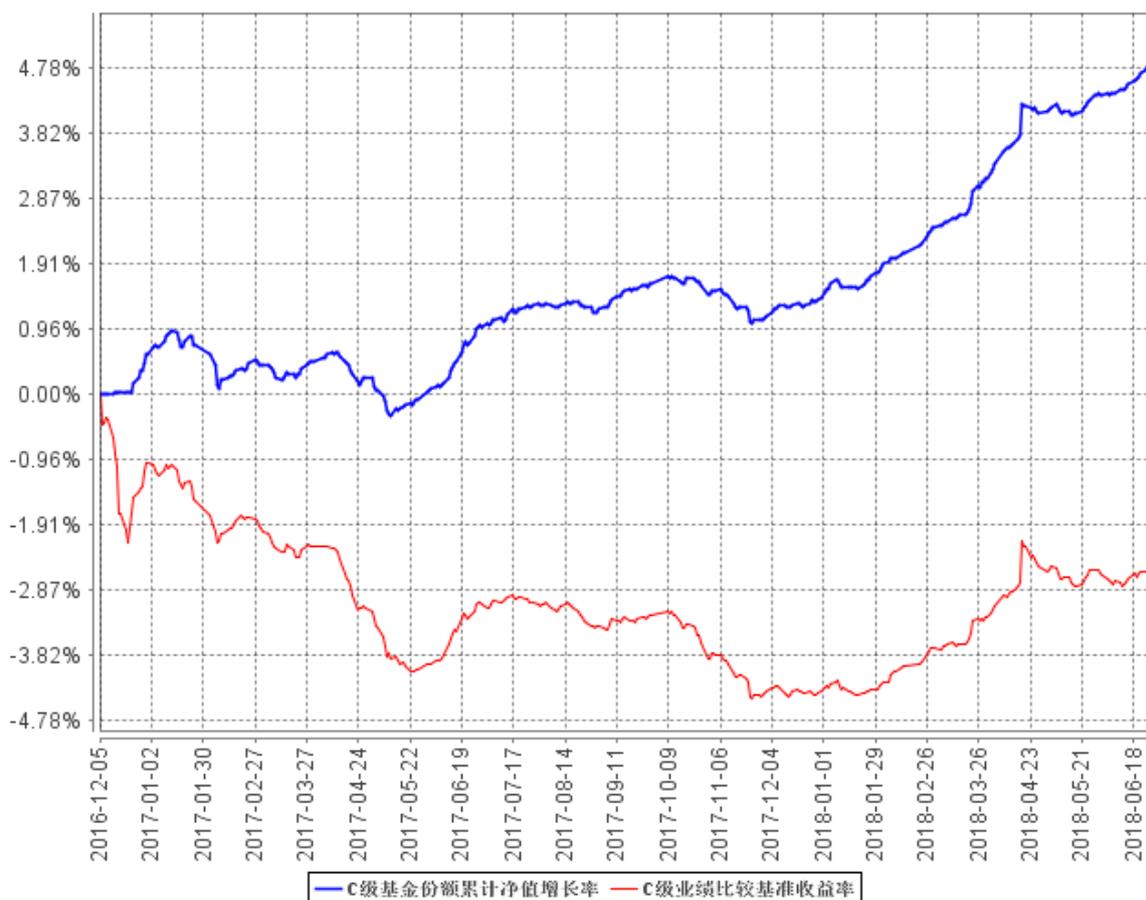
2、本基金合同于 2016 年 12 月 5 日生效。

### 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

A级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



C级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：本基金合同于 2016 年 12 月 5 日生效。

## § 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

中银国际证券股份有限公司(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、上海郝乾企业管理中心(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。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 2018 年 6 月 30 日,本管理人共管理 14 只证券投资基金,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、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金。中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金成立于 2018 年 8 月 2 日。

#### 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 12 月 5 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股份有限公司，历任中银国际证券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，现任中银国际证券中国红货币宝投资主办人、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
王玉玺	本基金基金经	2017 年 1 月 12 日	-	12	王玉玺，硕士研究生，中国国籍，已取得证券、基

	理			<p>金从业资格。2006 年 7 月至 2008 年 7 月任职于中国农业银行资金运营部，担任交易员；2008 年 8 月至 2016 年 6 月任职于中国农业银行金融市场部，担任交易员、高级交易员；2016 年 6 月加入中银国际证券股份有限公司，现任基金管理部副总经理、中银国际证券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、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。</p>
--	---	--	--	---

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》、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，建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、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。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。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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，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。

### 4.4 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

上半年货币市场整体以宽松为主，除了 4 月中旬因缴税因素令市场有短暂紧张外，宽松态势贯穿始终，打破此前逢季未必紧的传统。公开市场操作看，一季度在去年四季度大幅投放的基础上回笼了 5645 亿资金，二季度则净投放了 7435 亿，上半年净投放资金共 1790 亿元。另外，上半年央行调降存款准备金率两次，宣示了货币政策在中性基础上略偏宽松的微调方向。债券市场方面，今年初期市场情绪受金融严监管影响，做多力量稍显犹豫。随着宽松资金面得以延续，特别是在一季末传统紧张时间段表现出的持续宽松令买盘信心大涨，市场收益率应声而下。进入

4 月后市场转为谨慎做多，但随后的央行调降存款准备金率举措直接点燃了买盘情绪，经短期调整后市场开启了慢牛格局，6 月中旬央行再次调降存款准备金率令买方力量达到井喷，各期限债券收益率连创阶段新低。

本基金遵循稳健管理原则，同时根据市场变化及组合变化及时调整组合结构。具体看，在已经按策略完成主要配置前提下，上半年主要继续进行流动性维护工作，通过场内与场外相应投资工具进行动态微调。总的看上半年组合状态保持良好。未来，我们继续坚持持有人利益优先原则，谨慎勤勉，努力为持有人实现资产保值增值。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中银证券安进债券 A 基金份额净值为 1.0154 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.59%；截至本报告期末中银证券安进债券 C 基金份额净值为 1.0158 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.65%；同期业绩比较基准收益率为 2.16%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们判断四季度前保持牛市格局可能性较大，四季度后需注意防范风险。7 月末召开的中央政治局会议决定了未来投资基本面格局，按照会议，当前与今后一段时间，去杠杆调结构的供给侧改革依然并将一直是政策运行主线，但是当前外部环境“稳中有变”，主要指中美贸易战的不期然发生并愈演愈烈，将使各项改革沿既定道路推进时遇到更多困难，需要考虑更多因素进行应对，因此更多强调稳字为主。由此推之，保持当前相对宽松资金面、政策上调整严监管为温和监管更加符合预期，这是当前牛市有望得以短暂继续的根本原因。另外，随着中美贸易战的持续，双方博弈必将更加深入，结果也将更接近于彼此平衡之达成，我们判断这种平衡达成的时间点有可能出现在美国 11 月份中期选举前后，因此之后的基本面有可能需要重新考虑，这也是市场风险形成的一个重要原因。

#### 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股份有限公司估值委员会（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

本基金对本报告期内利润进行的收益分配情况如下：2017 年 3 月 29 日公告每 10 份 A\C 级基金份额派发红利 0.020 元；在 2017 年 6 月 22 日公告每 10 份 A\C 级基金份额派发红利 0.030 元；在 2017 年 9 月 19 日公告每 10 份 A\C 级基金份额派发红利 0.050 元；在 2017 年 12 月 26 日公告每 10 份 A\C 级基金份额派发红利 0.020 元；在 2018 年 3 月 22 日公告每 10 份 A\C 级基金份额派发红利 0.100 元；在 2018 年 6 月 19 日公告每 10 份 A\C 级基金份额派发红利 0.125 元。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—中银国际证券股份有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，中银国际证券股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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

本托管人认为，中银国际证券股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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：中银证券安进债券型证券投资基金  
报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		246,955,676.98	57,912,031.90
结算备付金		27,727,272.73	44,090,909.09
存出保证金		-	-
交易性金融资产		30,705,063,000.00	37,272,611,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		30,705,063,000.00	37,272,611,000.00
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		293,999,707.00	2,868,364,344.50

应收证券清算款		712,567,286.28	-
应收利息		583,549,547.45	826,181,156.22
应收股利		-	-
应收申购款		-	299.21
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		32,569,862,490.44	41,069,159,740.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017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		-	99.15
应付管理人报酬		8,057,898.29	10,471,228.14
应付托管费		2,685,966.11	3,490,409.38
应付销售服务费		3.27	141.68
应付交易费用		61,072.39	33,045.91
应交税费		2,290,556.96	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		348,601.50	500,020.00
负债合计		13,444,098.52	14,494,944.26
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		32,063,346,551.55	40,963,315,689.89
未分配利润		493,071,840.37	91,349,106.77
所有者权益合计		32,556,418,391.92	41,054,664,796.66
负债和所有者权益总计		32,569,862,490.44	41,069,159,740.92

注：1. 报告截止日 2018 年 6 月 30 日，中银证券安进债券型证券投资基金基金份额总额 32,063,346,551.55 份，其中中银证券安进债券型证券投资基金 A 类基金的份额总额 32,063,333,067.31 份，基金份额净值 1.0154 元；中银证券安进债券型证券投资基金 C 类基金的份额总额 13,484.24 份，基金份额净值 1.0158 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：中银证券安进债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
<b>一、收入</b>		1,383,281,896.54	278,131,482.78
1.利息收入		817,122,611.24	755,429,720.42
其中：存款利息收入		2,950,393.76	7,412,206.32
债券利息收入		803,384,795.81	686,461,377.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,787,421.67	61,556,136.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,174,022.25	-4,070,698.76
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		17,174,022.25	-4,070,698.76
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		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		548,985,205.13	-473,227,540.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		57.92	1.14
<b>减：二、费用</b>		75,920,452.52	72,606,432.23
1. 管理人报酬		55,631,445.90	54,152,013.09
2. 托管费		18,543,815.30	18,050,670.92
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	29.97	6.27
4. 交易费用		21,600.00	36,550.00
5. 利息支出		123,009.73	90,435.20
其中：卖出回购金融资产支出		123,009.73	90,435.20
6. 其他费用		205,411.71	276,756.75
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,307,361,444.02	205,525,050.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,307,361,444.02	205,525,050.55

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银证券安进债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	40,963,315,689.89	91,349,106.77	41,054,664,796.66
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	1,307,361,444.02	1,307,361,444.02
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)	-8,899,969,138.34	-124,211,593.54	-9,024,180,731.88
其中：1.基金申购款	401,288.76	4,868.80	406,157.56
2.基金赎回款	-8,900,370,427.10	-124,216,462.34	-9,024,586,889.44
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)	-	-781,427,116.88	-781,427,116.88
五、期末所有者权益 (基金净值)	32,063,346,551.55	493,071,840.37	32,556,418,391.92
项目	上年度可比期间 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)	29,991,170,110.32	178,164,233.56	30,169,334,343.88
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	205,525,050.55	205,525,050.55
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)	10,972,246,087.59	27,827,673.52	11,000,073,761.11
其中：1.基金申购款	10,972,274,427.75	27,827,774.71	11,000,102,202.46
2.基金赎回款	-28,340.16	-101.19	-28,441.35

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）	-	-204,816,982.34	-204,816,982.34
五、期末所有者权益（基金净值）	40,963,416,197.91	206,699,975.29	41,170,116,173.20

注：本基金合同于 2016 年 12 月 5 日生效。

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：

_____ 宁敏	_____ 赵向雷	_____ 戴景义
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

中银证券安进债券型证券投资基金(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]2774号《关于准予中银证券安进债券型证券投资基金注册的批复》核准,由中银国际证券股份有限公司(原“中银国际证券有限责任公司”,于2017年12月29日更名)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券安进债券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200,009,175.49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1606号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券安进债券型证券投资基金基金合同》于2016年12月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,013,175.57份基金份额,其中认购资金利息折合4,000.08份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中银证券安进债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时收取赎回费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用,但赎回时收取赎回费,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券安进债券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，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、资产支持证券、次级债、可分离交易债券的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金不投资于股票、权证等，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于 2018 年 8 月 28 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(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》、《中银证券安进债券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、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 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。

## 6.4.5 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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)对证券投资基金管理人运用基金买卖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，包括买卖债券的差价收入，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。

#### 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

注：无。

##### 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
中银国际证券股份有限公司(“中银证券”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金管理人股东的控股股东、基金销售机构

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	46,813,000,000.00	100.00%	365,857,100,000.00	100.00%

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

## 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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	55,631,445.90	54,152,013.09

其中：支付销售机构的客户维护费	44,404,109.96	43,080,453.36
-----------------	---------------	---------------

注：支付基金管理人中银证券的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	18,543,815.30	18,050,670.92

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

#### 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		
	2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银证券安进债券 A	中银证券安进债券 C	合计
中国银行	-	29.77	29.77
中银证券	-	0.23	0.23
合计	-	30.00	30.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	中银证券安进债券 A	中银证券安进债券 C	合计
中国银行	-	5.18	5.18
中银证券	-	1.09	1.09
合计	-	6.27	6.27

注：支付基金销售机构的中银证券安进债券型证券投资基金 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中银证券，再由中银证券计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C 类基金份额日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未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自有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

#### 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

份额单位：份

中银证券安进债券 A				
关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中国银行	32,063,230,004.97	100.0000%	40,963,233,004.97	100.0000%

份额单位：份

中银证券安进债券 C				
关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
-	-	-	-	-

### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
中国农业银行	246,955,676.98	2,531,677.86	76,657,925.61	4,948,203.02

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### **6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间内无须作说明的其他关联交易事项。

#### **6.4.9 期末（2018 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**

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### **6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：本基金本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**

截止本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无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。

###### **6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### **6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### **(1) 公允价值**

(a) 金融工具公允价值计量的方法 公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 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二层次的余额为 30,705,063,000.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额（2017 年 6 月 30 日：属于第二层次的余额 39,528,305,000.00 元，无第一层次和第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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 2018 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(2017 年 6 月 30 日：同)。

(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

(3)除公允价值和增值税外，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	30,705,063,000.00	94.27
	其中：债券	30,705,063,000.00	94.27
	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	293,999,707.00	0.90
	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	274,682,949.71	0.84
7	其他各项资产	1,296,116,833.73	3.98
8	合计	32,569,862,490.44	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：本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 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

注：本基金报告期内未买入股票。

### 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

注：本基金报告期内未卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金报告期内未买卖股票。

## 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	10,665,371,000.00	32.76
	其中：政策性金融债	10,665,371,000.00	32.76
4	企业债券	12,742,736,000.00	39.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	7,296,956,000.00	22.41
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,705,063,000.00	94.31

## 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	1728006	17 中信银行债	17,000,000	1,693,540,000.00	5.20
2	170407	17 农发 07	14,300,000	1,430,000,000.00	4.39
3	170302	17 进出 02	13,000,000	1,297,140,000.00	3.98
4	1380372	13 铁道 11	12,000,000	1,285,200,000.00	3.95
5	1480411	14 铁道 07	10,000,000	1,061,900,000.00	3.26

## 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

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。

## 7.11 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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					0.00
国债期货投资本期收益（元）					0.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

## 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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金持有的“17 北京银行绿色金融 01”的发行主体北京银行于 2017 年 8 月 8 日收到北京银监局出具的行政处罚（京银监罚决字[2017]12 号），因北京银行未经核准提前授权部分人员实际履行高管人员职责、北京银行同业业务严重违反审慎经营规则，北京银监局责令北京银行改正，并对北京银行处以 100 万元罚款。

本基金持有的“17 浦发银行 02”的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2018 年 2 月 12 日收到中国银监会出具的行政处罚（银监罚决字（2018）4 号），因“内控管理严重违反审慎经营规则”等，对其罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。

信评团队负责对证券进行信用分析和筛选入池。基金经理通过对宏观经济、货币市场资金面和基金的持仓情况进行分析，决定证券投资的期限、品种和数量，在符合规定的证券池内选择合适的证券进行投资。

### 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。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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	-
2	应收证券清算款	712,567,286.28
3	应收股利	-
4	应收利息	583,549,547.45
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,296,116,833.73

#### 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明细。

#### 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。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 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
中银证券安进债券 A	139	230,671,460.92	32,063,230,004.97	100.00%	103,062.34	0.00%
中银证券安进债券 C	89	151.51	0.00	0.00%	13,484.24	100.00%
合计	228	140,628,712.95	32,063,230,004.97	100.00%	116,546.58	0.00%

### 8.3 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	中银证券安进债券 A	0.00	0.0000%
	中银证券安进债券 C	10.00	0.0742%
	合计	10.00	0.0000%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中银证券安进债券 A	0
	中银证券安进债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中银证券安进债券 A	0
	中银证券安进债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银证券安进债券 A	中银证券安进债券 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 5 日）基金份额总额	200,007,239.53	5,936.04
本报告期期初基金份额总额	40,963,293,859.74	21,830.15
本报告期基金总申购份额	176,603.42	224,685.34
减：本报告期基金总赎回份额	8,900,137,395.85	233,031.25
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	32,063,333,067.31	13,484.24

注：本基金合同于 2016 年 12 月 5 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

中银国际证券股份有限公司董事长由高迎新变更为林景臻。

中银国际证券股份有限公司董事由潘其方变更为廖胜森。

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

一、本报告期内，涉及基金管理人的诉讼事项如下：

1. 上海普鑫投资管理有限公司因正当财产保全权利的实施是否受阻碍争议诉中银国际证券财产损害赔偿纠纷案，该案于 2011 年开始诉讼程序，2018 年 3 月 1 日，上海市一中院作出（2018）沪 01 执复 23 号执行裁定书，驳回中银国际证券复议申请，执行法院扣划执行加倍债务利息 3107409.55 元。案件已执行结案。

2. 郑宇因指令未接受撤销争议诉中银国际证券武汉黄孝河路证券营业部证券交易合同纠纷案，该案于 2017 年 7 月开始诉讼程序。2018 年 3 月 28 日，武汉市中级人民法院作出“（2018）鄂 01 民终 557 号”民事判决书，驳回郑宇上诉请求，维持原判，即驳回原告郑宇的全部诉讼请求。

3. 彭阳因不服 2017 年 9 月 27 日武汉市劳动人事争议仲裁委员会作出的关于劳动争议的仲裁结果，诉中银国际证券武汉黄孝河路证券营业部。2018 年 4 月 24 日，武汉市中级人民法院作出（2018）鄂 01 民终 1836 号民事判决书，驳回上诉。

4. 2018 年 4 月底，中银国际证券将股票质押式回购交易违约债务人刘德群诉至深圳市福田区人民法院，申请拍卖、变卖刘德群持有的已质押给中银国际证券的股票。2018 年 6 月，中银国际证券从深圳福田区人民法院申请撤诉。

5. 中银国际证券于 2018 年 4 月底将股票质押式回购交易违约债务人天津顺航海运有限公司诉至天津市第二中级人民法院。2018 年 5 月，双方已达成调解。

二、本报告期内，无涉及基金财产的诉讼事项；

三、本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 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。

## 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

未有管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

## 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	
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、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。

3、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
中银国际	-	-	46,813,000,000.00	100.00%	-	-

注：1、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能再租用其他证券公司的交易单元。

2、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。

3、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 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------

别	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	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	40,763,230,004.97	0.00	8,700,000,000.00	32,063,230,004.97	100.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20% 的情况，如遇市场行情突变可能存在大额赎回甚至巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力。同时，基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，避免单一投资者集中度继续提高，同时将完善流动性风险风险管控机制，加强对基金持有人利益的保护。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

中银国际证券股份有限公司  
2018 年 8 月 28 日