

**中银丰庆定期开放债券型证券投资基金**  
**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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 3 月 20 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	中银丰庆定期开放债券
基金主代码	003770
交易代码	003770
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 20 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
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	5,000,038,561.13 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，进行债券投资时机的选择和久期、类属配置，实施积极的债券投资组合管理，力争获取超越业绩比较基准的稳定投资收益。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场型证券投资基金。

### 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		中银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛文成	田青
	联系电话	021-38834999	010-66275853
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	010-67595096
传真		021-68873488	010-66275853

### 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 3 月 20 日（基金合同生效日） 至 2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	50,143,415.03
本期利润	59,517,782.14

加权平均基金份额本期利润	0.0119
本期基金份额净值增长率	1.19%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2017年6月30日)</b>
期末可供分配基金份额利润	0.0100
期末基金资产净值	5,059,556,329.48
期末基金份额净值	1.0119

注：1.本合同于 2017 年 3 月 20 日生效，截止报告期末未满半年。

2.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。

3.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

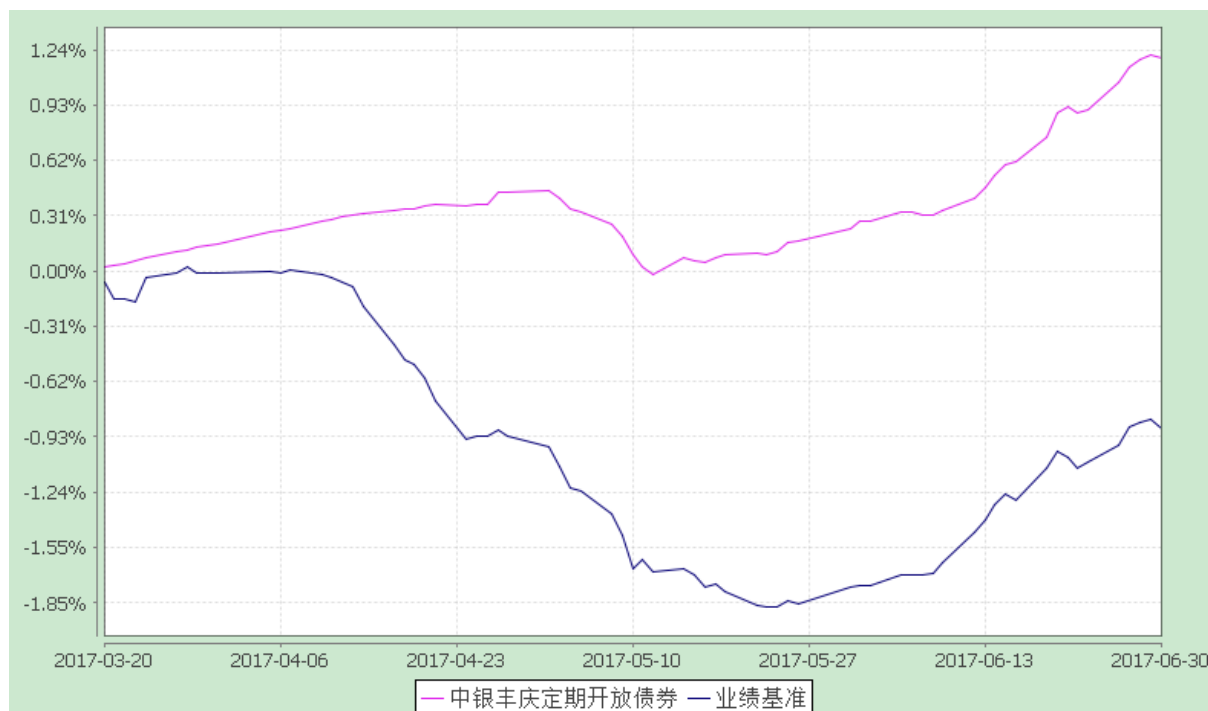
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.95%	0.05%	0.90%	0.06%	0.05%	-0.01%
过去三个月	1.04%	0.05%	-0.88%	0.08%	1.92%	-0.03%
过去六个月	1.19%	0.04%	-0.88%	0.08%	2.07%	-0.04%
自基金合同生效起至今	1.19%	0.04%	-0.88%	0.08%	2.07%	-0.04%

#### 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

中银丰庆定期开放债券型证券投资基金

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

（2017年3月20日至2017年6月30日）



注：截至报告期末，本基金成立未满一年。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，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

## 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，注册资本为一亿元人民币，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		
吴旅忠	本基金基金经理、中银理财 7 天债券基金基金经理、中银理财 14 天债券基金基金经理、中银理财 30 天债券基金基金经理、中银理财 90 天债券基金基金经理、中银如意宝基金基金经理	2017-03-20	-	10	金融学硕士。曾任国泰君安证券固定收益证券投资经理。2015 年加入中银基金管理有限公司，曾任固定收益基金经理助理。2016 年 3 月至今任中银理财 7 天债券基金基金经理，2016 年 3 月至今任中银理财 14 天债券基金基金经理，2016 年 3 月至 2016 年 7 月任中银理财 21 天债券基金基金经理，2016 年 3 月至今任中银理财 30 天债券基金基金经理，2016 年 3 月至 2016 年 7 月任中银理财 60 天债券基金基金经理，2017 年 3 月至今任中银丰庆基金基金经理，2017 年 4 月至今任中银理财 90 天债券基金基金经理，2017 年 5 月至今任中银如意宝基金基金经理。具有 10 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。
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、中银新机遇基金基金经理、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	2017-03-29	-	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。
--	--	--	--	--	--

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《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%。

可转债方面，上半年跟随权益及债券市场，整体先抑后扬。其中一季度中证转债指数微涨 0.08%，个券方面，歌尔、广汽、白云等转债偏股性、正股偏价值的品种表现较好，分别上涨 7.41%、4.47% 及

4.14%；二季度中证转债指数上涨 2.50%，个券方面，14 宝钢 EB、歌尔、白云等转债偏股性、正股偏蓝筹的品种继续走好，分别上涨 15.46%、12.74%及 7.54%。股票市场方面，整体维持震荡之势，但分化明显。其中，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，我们保持合适的久期和杠杆比例，积极参与波段投资机会，优化配置结构，重点配置中短期、中高评级信用债，合理分配类属资产比例。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日为止，本基金的单位净值为 1.0119 元，本基金的累计单位净值为 1.0119 元。季度内本基金份额净值增长率为 1.19%，同期业绩比较基准收益率为-0.88%。

#### 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。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

##### 4.7.1 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。

##### 4.7.2 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。

##### 4.7.3 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。

##### 4.7.4 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

根据基金合同，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，具体方案以公告为准进行收益分配，若《基金合同》生效不满不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金合同于 2017 年 03 月 20 日生效，暂未进行收益分配。

#### 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

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

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中银丰庆定期开放债券型证券投资基金

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
资产：	-
银行存款	25,189,927.37
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	4,869,696,000.00

其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	4,869,696,000.00
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	128,120,512.18
应收证券清算款	-
应收利息	38,341,206.41
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
<b>资产总计</b>	<b>5,061,347,645.96</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017年6月30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	-
应付管理人报酬	1,240,422.53
应付托管费	413,474.17
应付销售服务费	-
应付交易费用	19,574.78
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	117,845.00
<b>负债合计</b>	<b>1,791,316.48</b>
<b>所有者权益：</b>	-
实收基金	5,000,038,561.13
未分配利润	59,517,768.35
<b>所有者权益合计</b>	<b>5,059,556,329.48</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>5,061,347,645.96</b>

注：1.本基金合同于 2017 年 03 月 20 日生效，无上年度可比数据。

2.报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0119 元，基金份额总额 5,000,038,561.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中银丰庆定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>65,250,225.33</b>
1.利息收入	55,575,855.43
其中：存款利息收入	18,725,754.85
债券利息收入	31,458,789.05
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	5,391,311.53
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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）	9,374,367.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	300,002.79
<b>减：二、费用</b>	<b>5,732,443.19</b>
1. 管理人报酬	4,205,811.49
2. 托管费	1,401,937.15
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	-
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	124,694.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>59,517,782.14</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>59,517,782.14</b>

注：本基金合同于 2017 年 03 月 20 日生效，无上年度可比数据。

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银丰庆定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月20日（基金合同生效日）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）	5,000,040,161.27	-	5,000,040,161.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	59,517,782.14	59,517,782.14
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）	-1,600.14	-13.79	-1,613.93
其中：1.基金申购款	984.98	9.06	994.04
2.基金赎回款	-2,585.12	-22.85	-2,607.97
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）	5,000,038,561.13	59,517,768.35	5,059,556,329.48

注：本基金合同于 2017 年 03 月 20 日生效，无上年度可比数据。

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

中银丰庆定期开放债券型证券投资基金（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[2016]2563号文《关于准予中银丰庆定期开放债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人中银基金管理有限公司于2017年3月14日至2017年03月15日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2017)验字第61062100\_B04号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年03月20日生效。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币5,000,040,161.07元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币0.20元，以上实收基金（本息）合计为人民币5,000,040,161.27元，折合5,000,040,161.27份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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，对于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 3 月 30 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的编制期间系 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票和债券投资



等；

本基金目前持有的其他金融资产分类为贷款和应收款项，包括银行存款、结算备付金、存出保证金和各类应收款项等。

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债；

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

##### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

##### 金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，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，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，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，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，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。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.3% 的年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提；

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类别份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 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、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.8 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3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,205,811.49
其中：支付销售机构的客户维护费	3,364,425.28

注：1.基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3%年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

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

2.本基金合同于 2017 年 03 月 20 日生效，无上年度可比数据。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,401,937.15

注：1.基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

2.本基金合同于 2017 年 03 月 20 日生效，无上年度可比数据。

### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

中国银行股份有限公司	4,999,999,000.00	100.00%
------------	------------------	---------

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

#### 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3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行股份有限公司	25,189,927.37	184,415.42
合计	25,189,927.37	184,415.42

注：1.本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

2.本基金合同于 2017 年 03 月 20 日生效，无上年度可比数据。

#### 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 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的股票。

##### 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

截至本报告期末 2017 年 06 月 30 日止，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

截至本报告期末 2017 年 06 月 30 日止，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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	4,869,696,000.00	96.21
	其中：债券	4,869,696,000.00	96.21
	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	128,120,512.18	2.53
	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	25,189,927.37	0.50
7	其他各项资产	38,341,206.41	0.76
8	合计	5,061,347,645.96	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

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

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

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末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

本基金本报告期无股票变动。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

本基金本报告期无股票变动。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期无股票变动。

## 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	4,869,696,000.00	96.25
	其中：政策性金融债	4,263,976,000.00	84.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,869,696,000.00	96.25

#### 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	170205	17 国开 05	13,700,000	1,363,698,000.00	26.95
2	170407	17 农发 07	11,300,000	1,125,480,000.00	22.24
3	170305	17 进出 05	10,000,000	994,600,000.00	19.66
4	1722013	17 大众汽车债	4,000,000	405,920,000.00	8.02
5	170204	17 国开 04	3,000,000	298,710,000.00	5.90

#### 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

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

#### 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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

**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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,341,206.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,341,206.41

**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

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

274	18,248,315. 92	4,999,999,000. 00	99.9992 %	39,561.13	0.0008 %
-----	-------------------	----------------------	--------------	-----------	-------------

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	9,148.37	0.0002%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2017年3月20日）基金份额总额	5,000,040,161.27
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	984.98
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,585.12
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,000,038,561.13

**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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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》（证监基金字[2007]48号）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》，然后根据评分高低进行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
中信证券	-	-	23,216,000.00	100.00%	-	-

## 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	2017-03-20 至 2017-06-30	-	4,999,999.00	-	4,999,999.00	99.9990%
产品特有风险							
(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。

中银基金管理有限公司  
二〇一七年八月二十九日