

中银证券现金管家货币市场基金 2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：中银国际证券有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 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。

基金托管人招商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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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	中银证券现金管家货币	
基金主代码	003316	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 7 日	
基金管理人	中银国际证券有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,002,086,953.57 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中银证券现金管家货币 A	中银证券现金管家货币 B
下属分级基金的交易代码:	003316	003317
报告期末下属分级基金的份额总额	4,263,922,268.16 份	1,738,164,685.41 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将根据宏观经济走势、货币政策、资金市场状况等因素对利率走势进行综合判断，并根据利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。
业绩比较基准	人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中低风险低收益的品种，其预期风险和收益水平低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

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		中银国际证券有限责任公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵向雷	张燕
	联系电话	021-20328000	0755-83199084
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-61195566, 400-620-8888	95555
传真		021-50372474	0755-83195201

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	基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	中银证券现金管家货币 A	中银证券现金管家货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	57,535,644.92	40,399,985.78
本期利润	57,535,644.92	40,399,985.78
本期净值收益率	1.7591%	1.8791%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	4,263,922,268.16	1,738,164,685.41
期末基金份额净值	1	1

注：1、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，本期利润为已实现收益加上公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金合同于 2016 年 12 月 7 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银证券现金管家货币 A

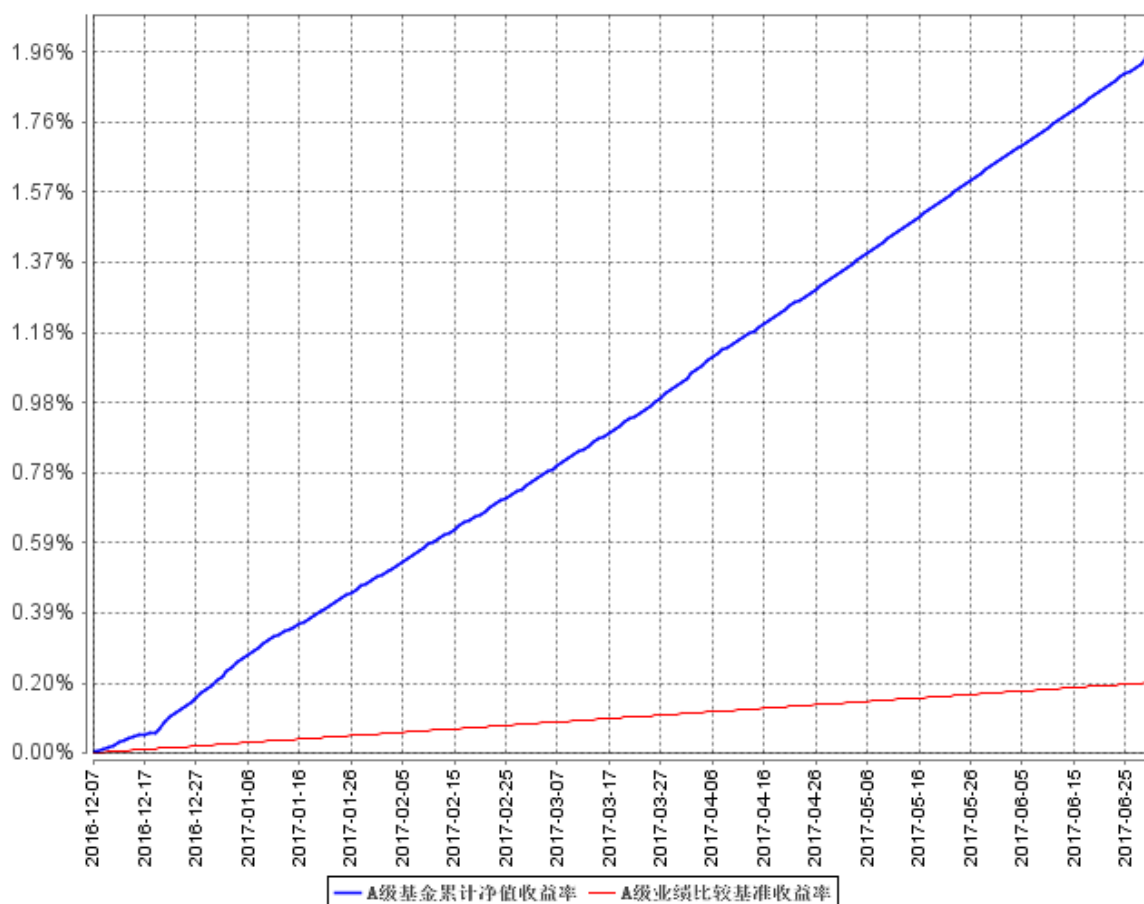
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3104%	0.0023%	0.0288%	0.0000%	0.2816%	0.0023%
过去三个月	0.9182%	0.0014%	0.0873%	0.0000%	0.8309%	0.0014%
过去六个月	1.7591%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.5855%	0.0014%
自基金合同生效起至今	1.9656%	0.0021%	0.1975%	0.0000%	1.7681%	0.0021%

中银证券现金管家货币 B

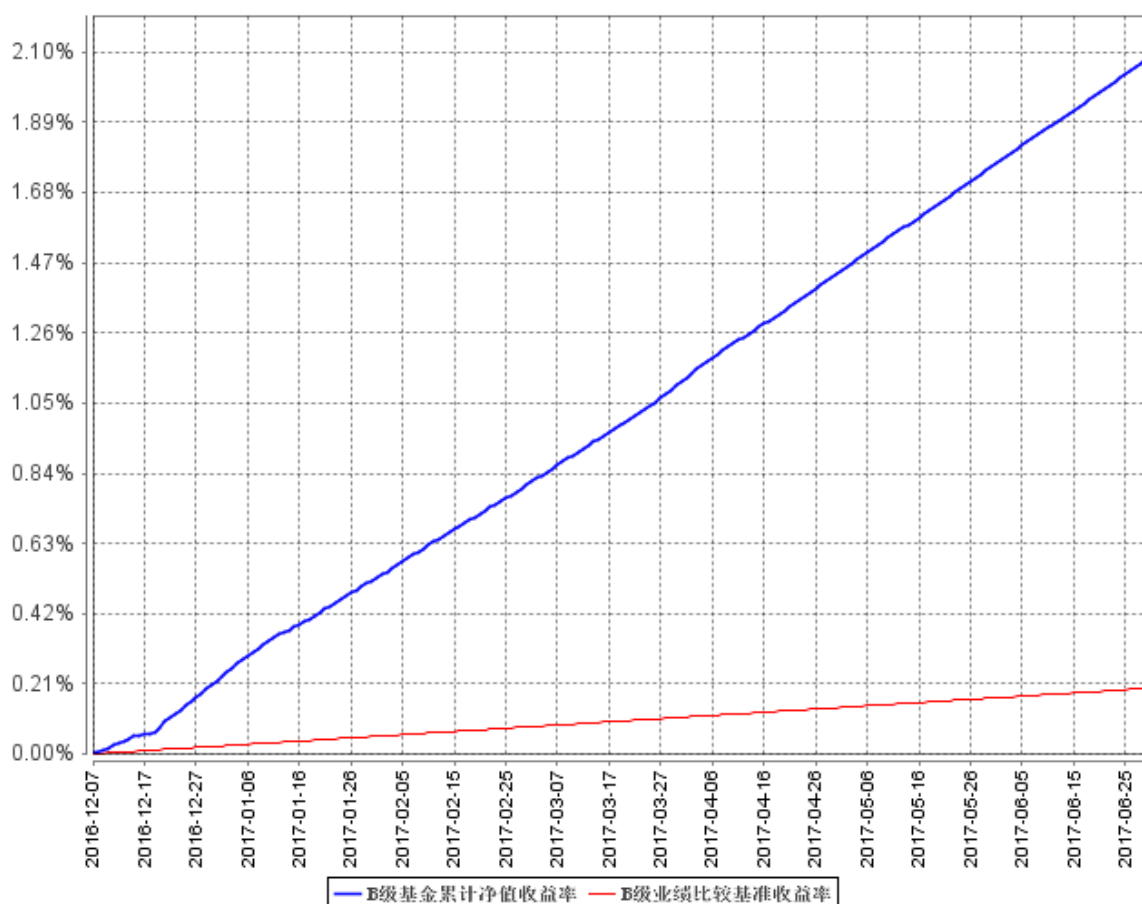
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3303%	0.0023%	0.0288%	0.0000%	0.3015%	0.0023%
过去三个月	0.9783%	0.0014%	0.0873%	0.0000%	0.8910%	0.0014%
过去六个月	1.8791%	0.0014%	0.1736%	0.0000%	1.7055%	0.0014%
自基金合同 生效起至今	2.1024%	0.0021%	0.1975%	0.0000%	1.9049%	0.0021%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1. 本基金的基金合同于 2016 年 12 月 7 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。建仓期结束时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。

§ 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 2017 年 6 月 30 日，本管理人共管理六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、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和中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴谷亮	本基金经理	2016 年 12 月 7 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、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、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《中银证券现金管家货币市场基金基金合同》以及其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，建立了《中银国际证券有限责任公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法》、《中银国际证券有限责任公司产品与交易部交易室异常交易监控与报告管理办法》等公平交易相关制度体系。公司旗下投资组合严格按照制度的规定，参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，主要包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关环节。研究团队负责提供投资研究支持，投资团队负责投资决策，交易室负责实施交易并实时监控，风险管理部负责事前监督、事中检查和事后稽核，对交易情况进行合理性分析。公司通过多部门的协作互控，保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

公司一直严格遵循公平交易相关规章制度，执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下，报告期内，公司未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年货币市场资金总体维持紧平衡格局，资金价格中枢较之前略有抬升，出现紧张的概率有一定上升，央行继续通过公开市场操作调控流动性供应，一季度偏向回笼二季度更多进行投放，令整体资金面呈前紧后松特征。受 MPA 考核影响，市场资金价格出现割裂，非银机构融资成本普遍较银行机构高出 100BP 以上，临近季度月度末时点两者差异性更大。债券市场呈收益率震荡走高态势，一季度初因央行在春节前后分别提高 MLF 操作利率及公开市场操作利率，市场解读为实质性加息政策出台继而引发债券各期限收益率跳升，10 年期国开债突破 4% 的整数关口。季度中期市场做多情绪有所恢复，然而随着季度后期 PPI 数据新出，并创近 8 年新高令通胀预期快速抬头再令债市承压，调整持续到 3 月下旬美联储加息靴子落地。二季度前中期市场均维持窄幅震荡格局，收益率略有上行，曲线呈陡峭走势，进入 6 月份随着央行投放资金的规模显著扩大，及金融去杠杆等方面市场预期的变化，债市多头逐渐升温并于中旬走出一波罕见的“6 月小牛市”，短短一周内收益率曲线整体下移超过 20BP，短端下行幅度略大于中长端。

本基金操作上主要以流动性管理为主，同时根据市场环境变化及组合规模变化对结构进行调整。具体看，受去年末债券市场调整影响，多数债券收益大幅上涨涌现出较佳配置价值，我们年初配置了一定比例的政策性金融债，之后在控制合理安全比例前提下重仓投资存单，同时也择机参与性价比相对较高的短融品种。另外，结合央行公开市场操作节奏特点及市场流动性变化特征，相应进行了期限匹配的回购融出操作。投资期限选择上主动以季度末及半年末时点为约束，合理预期流动性，按稳健思路调整组合结构，组合久期主要在 20-80 天范围内变动，前低后高。总的看，上半年组合流动性状态保持良好，收益率保持相对稳定。未来，我们将继续管理好组合流动性，在此基础上兼顾收益，力争在安全稳定前提下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

本报告期内中银证券现金管家货币 A 的基金份额净值收益率为 1.7591%，本报告期内中银证券现金管家货币 B 的基金份额净值收益率为 1.8791%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

依据已公布经济数据，7 月中国采购经理人指数 PMI 小幅下滑 0.3 百分点至 51.4%，趋势上有继续向下可能。进一步依据高频数据信息，7 月房地产销量增速呈回落态势，各行业数据好坏参半，后期稳中趋缓的可能性更大。我们认为，供给侧改革将持续推进，金融去杠杆仍是未来监管改革政策重点。新成立的金融稳定发展委员会将成为防范系统性金融风险的重要制度保障，无序加杠杆、跨境资产转移、圈钱融资等将进一步受到调控。由此推之，未来资金面将主要维持中性，即不会出现大水漫灌式宽松，也不会收缩太紧以加重经济下行压力。纯债市场我们短期内

持相对乐观观点，在经济总体上升乏力前提下社会资金有效需求总体不足，资金利率有下行压力，短期内利率中枢下移概率较大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了中银国际证券有限责任公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任组长，成员由基金事业部、业务营运部、内控与法律合规部、稽核部、风险管理部等部门指派人员组成。估值委员会成员均具有专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

中银证券现金管家 A 基金：本报告期内未实施利润分配。

中银证券现金管家 C 基金：本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份

额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：中银证券现金管家货币市场基金

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
资产：		
银行存款	279,902,077.57	202,119,678.20
结算备付金	49,954.22	-
存出保证金	3,542.50	-
交易性金融资产	6,246,558,106.55	497,578,439.55
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	6,246,558,106.55	497,578,439.55
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	989,832,404.74	1,011,941,529.76
应收证券清算款	644,606,477.22	-
应收利息	6,651,649.66	9,956,587.73
应收股利	-	-
应收申购款	2,045,961.04	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	2,756.17
资产总计	8,169,650,173.50	1,721,598,991.41
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017年6月30日	2016年12月31日
负 债:		
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	2,158,466,250.75	20,579,849.13
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	40,648.04	-
应付管理人报酬	2,296,611.36	783,342.41
应付托管费	612,429.74	208,891.34
应付销售服务费	4,308,914.63	198,747.14
应付交易费用	103,238.96	6,064.64
应交税费	-	-
应付利息	239,071.56	5,149.96
应付利润	1,270,448.78	426,108.13
递延所得税负债	-	-
其他负债	225,606.11	26,499.00
负债合计	2,167,563,219.93	22,234,651.75
所有者权益:		
实收基金	6,002,086,953.57	1,699,364,339.66
未分配利润	-	-
所有者权益合计	6,002,086,953.57	1,699,364,339.66
负债和所有者权益总计	8,169,650,173.50	1,721,598,991.41

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，中银证券现金管家 A 类基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 4,263,922,268.16 份；中银证券现金管家 C 类基金份额净值 1.00 元，中银证券现金管家 C 类基金份额总额合计为 1,738,164,685.41 份。

6.2 利润表

会计主体：中银证券现金管家货币市场基金

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	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	116,478,714.00	-
1.利息收入	115,362,330.45	-
其中：存款利息收入	2,189,790.34	-
债券利息收入	78,318,519.86	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	34,854,020.25	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,116,383.55	-
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,116,383.55	-
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）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	18,543,083.30	-
1. 管理人报酬	8,009,873.94	-
2. 托管费	2,135,966.35	-
3. 销售服务费	4,110,167.49	-
4. 交易费用	275.00	-
5. 利息支出	3,994,136.79	-
其中：卖出回购金融资产支出	3,994,136.79	-
6. 其他费用	292,663.73	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	97,935,630.70	-
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	97,935,630.70	-

注：本基金合同于 2016 年 12 月 07 日生效，本报告期自 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银证券现金管家货币市场基金

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)	1,699,364,339.66	-	1,699,364,339.66
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	97,935,630.70	97,935,630.70
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)	4,302,722,613.91	-	4,302,722,613.91
其中：1.基金申购款	29,514,031,739.27	-	29,514,031,739.27
2.基金赎回款	-25,211,309,125.36	-	-25,211,309,125.36
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)	-	-97,935,630.70	-97,935,630.70
五、期末所有者权益 (基金净值)	6,002,086,953.57	-	6,002,086,953.57
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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	-	-
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 12 月 07 日生效，本报告期自 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 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

中银证券现金管家货币市场基金(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]1943号《关于准予中银证券现金管家货币市场基金注册的批复》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《中银证券现金管家货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型证券投资基金,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 6,882,808,307.04 元,已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 1614 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券现金管家货币市场基金基金合同》于 2016 年 12 月 07 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额(包括认购资金利息折算部分)为 6,883,396,423.71 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券现金管家货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括:(1)现金;(2)期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;(3)剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;(4)中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本基金的业绩比较基准为:人民币活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券有限责任公司于 2017 年 08 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银证券保本 1 号混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

自基金合同成立以来,未进行会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

自基金合同成立以来,未进行会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

自基金合同成立以来,不存在需要说明的差错更正。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中银国际证券有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中国招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

注：报告期内本基金无股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：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	
	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
中银国际证券	41,199,760.00	100.00%	-	-

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：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	
	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
中银国际证券	5,975,400,000.00	100.00%	-	-

6.4.7.1.4 权证交易

注：报告期内本基金无权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

注：报告期内无需支付关联方佣金。

6.4.7.2 关联方报酬**6.4.7.2.1 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	8,009,873.94	-
其中：支付销售机构的客户维护费	4,046,419.51	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

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

6.4.7.2.2 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	2,135,966.35	-

的托管费		
------	--	--

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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

6.4.7.2.3 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		
	中银证券现金管家货币 A	中银证券现金管家货币 B	合计
中银国际证券	73,104.96	39,263.77	112,368.73
招商银行	3,246.14	0.00	3,246.14
中国银行	3,926,778.03	67,597.58	3,994,375.61
合计	4,003,129.13	106,861.35	4,109,990.48
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		
	中银证券现金管家货币 A	中银证券现金管家货币 B	合计
-	-	-	-

注：本基金分设两类基金份额：A 类基金份额和 B 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，收取不同的销售服务费并分别公布每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。

A 类基金份额：指按照 0.25% 年费率计提销售服务费的基金份额类别

B 类基金份额：指按照 0.01% 年费率计提销售服务费的基金份额类别

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：报告期内本基金未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.7.4.2 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

中银证券现金管家货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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
中银国际证券 有限责任公司 (中银全球配 置)	330,000.00	0.0100%	-	-

中银证券现金管家货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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
中银国际证券 有限责任公司 (厦门国际 1 号)	120,000,000.00	2.0000%	-	-
中银国际证券 有限责任公司 (厦门国际 1 号)	100,000,000.00	1.6700%	-	-
中银国际证券 有限责任公司 (中银全球配 置)	10,640,000.00	0.1800%	-	-
中银国际证券 有限责任公司 (中银全球配 置)	90,000,000.00	1.5000%	-	-
中银国际证券 有限责任公司 (中国红中银 2 号)	48,000,000.00	0.8000%	-	-

6.4.7.5 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
招商银行	79,902,077.57	920,348.25	-	-

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：报告期内本基金未参与关联方承销证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：报告期内本基金无流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：报告期内本基金未因认购新发/期末持有的暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易所形成的卖出回购证券款余额 2,158,466,250.75 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111709240	17 浦发银行 CD240	2017 年 7 月 3 日	99.05	1,995,000	197,604,750.00
111710223	17 兴业银行 CD223	2017 年 7 月 3 日	99.67	2,346,000	233,825,820.00
111710277	17 兴业银行 CD277	2017 年 7 月 3 日	99.03	1,000,000	99,030,000.00
111715131	17 民生银行 CD131	2017 年 7 月 3 日	99.59	2,000,000	199,180,000.00
111715214	17 民生银行 CD214	2017 年 7 月 3 日	98.94	3,000,000	296,820,000.00
111719202	17 恒丰银行 CD202	2017 年 7 月 3 日	96.68	2,090,000	202,061,200.00
111780382	17 广东南粤银行 CD095	2017 年 7 月 3 日	97.76	2,100,000	205,296,000.00
111794454	17 苏州银行 CD042	2017 年 7 月 3 日	98.90	500,000	49,450,000.00
170204	17 国开 04	2017 年 7 月 3 日	99.38	1,000,000	99,380,000.00
179917	17 贴现国债 17	2017 年 7 月 3 日	99.86	1,000,000	99,860,000.00

179921	17 贴现国 债 21	2017 年 7 月 3 日	99.69	2,550,000	254,209,500.00
111710223	17 兴业银 行 CD223	2017 年 7 月 5 日	99.67	10,000	996,700.00
111794598	17 唐山银 行 CD070	2017 年 7 月 5 日	98.88	1,000,000	98,880,000.00
111780386	17 贵阳银 行 CD089	2017 年 7 月 6 日	98.90	2,000,000	197,800,000.00
合计				22,591,000	2,234,393,970.00

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

报告期末本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.9 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 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 6,249,871,584.00 元，无属于第二层次及第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、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的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2016 年 4 月 29 日成立以来一直采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 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：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 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。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。

(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	固定收益投资	6,246,558,106.55	76.46

	其中：债券	6,246,558,106.55	76.46
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	989,832,404.74	12.12
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	279,952,031.79	3.43
4	其他各项资产	653,307,630.42	8.00
5	合计	8,169,650,173.50	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额		3.91
	其中：买断式回购融资		0.32
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	2,158,466,250.75	35.96
	其中：买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

序号	发生日期	融资余额 占基金资产 净值比例 (%)	原因	调整期
1	2017 年 3 月 31 日	23.06	-	-
2	2017 年 4 月 1 日	23.05	-	-
3	2017 年 4 月 5 日	30.78	-	-
4	2017 年 4 月 6 日	23.45	-	-
5	2017 年 6 月 30 日	35.94	-	-

注：基金巨额赎回导致正回购的资金余额超过基金资产净值 20%，基金申购份额增加后自动调整。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	105

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限（天数）	原因	调整期
----	------	------------	----	-----

注：报告期内，本基金投资组合平均剩余期限未有超过 120 天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	45.53	35.96
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	7.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	15.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	23.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	44.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	135.97	35.96

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过 240 天。

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	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	370,456,239.76	6.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	129,451,307.19	2.16

	其中：政策性金融债	129,451,307.19	2.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	519,876,279.49	8.66
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,076,760,338.15	84.58
8	其他	150,013,941.96	2.50
9	合计	6,246,558,106.55	104.07
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111719202	17 恒丰银行 CD202	5,000,000	483,376,565.68	8.05
2	111713056	17 浙商银行 CD056	5,000,000	483,203,423.38	8.05
3	111715214	17 民生银行 CD214	3,000,000	296,816,033.95	4.95
4	111780438	17 富滇银行 CD173	3,000,000	296,671,867.04	4.94
5	111780382	17 广东南粤银行 CD095	3,000,000	293,275,882.26	4.89
6	179921	17 贴现国债 21	2,600,000	259,186,739.37	4.32
7	011758034	17 广州金融 SCP001	2,500,000	250,012,952.32	4.17
8	111710223	17 兴业银行 CD223	2,500,000	249,173,702.94	4.15
9	111715131	17 民生银行 CD131	2,000,000	199,188,930.72	3.32
10	111709240	17 浦发银行 CD240	2,000,000	198,096,272.48	3.30

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0579%
报告期内偏离度的最低值	-0.0271%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0151%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：报告期内本基金负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：报告期内本基金正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

7.8 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：报告期内本基金未投资资产支付证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.00 人民币元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

7.9.2 声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。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,542.50
2	应收证券清算款	644,606,477.22
3	应收利息	6,651,649.66
4	应收申购款	2,045,961.04

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	653,307,630.42

7.9.4 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
中银证券现金管家货币 A	174,129	24,487.15	19,553,981.43	0.46%	4,244,368,286.73	99.54%
中银证券现金管家货币 B	134	12,971,378.25	607,488,571.94	34.95%	1,130,676,113.47	65.05%
合计	174,263	12,995,865.40	627,042,553.37	10.45%	5,375,044,400.20	89.55%

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	中银证券现金管家货币 A	1,588,716.24	0.0373%
	中银证券现金管家货币 B	0.00	0.0000%
	合计	1,588,716.24	0.0373%

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	中银证券现金管家货币 A	0.008984

持有本开放式基金	中银证券现金管家货币 B	0
	合计	0.008984
本基金基金经理持有本开放式基金	中银证券现金管家货币 A	0
	中银证券现金管家货币 B	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中银证券现金管家货币 A	中银证券现金管家货币 B
基金合同生效日（2016 年 12 月 7 日）基金份额总额	1,532,918,442.71	5,350,477,981.00
本报告期期初基金份额总额	699,671,169.43	999,693,170.23
本报告期基金总申购份额	20,230,644,651.45	9,283,387,087.82
减：本报告期基金总赎回份额	16,666,393,552.72	8,544,915,572.64
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	4,263,922,268.16	1,738,164,685.41

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入及基金份额自动升降级调增份额；总赎回份额含转换出及基金份额自动升降级调减份额。

§ 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

本报告期内本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金继续以流动性管理为主，投资策略按此展开。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银国际	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

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；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	41,199,760.00	100.00%	5,775,400,000.00	100.00%	0.00	0.00%

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。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

注：报告期内本基金偏离度的绝对值未达到 0.5%。

§ 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

注：报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

中银国际证券有限责任公司
2017 年 8 月 29 日