

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
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 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 15 |
| 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 | 15 |
| 5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 15 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 15 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表 | 16 |
| 6.2 利润表 | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 18 |
| 6.4 报表附注 | 19 |
| 7 投资组合报告 | 37 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 37 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 37 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 38 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 39 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 47 |
| 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 | 47 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 48 |
| 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 | 48 |
| 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 | 48 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 48 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 48 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 49 |
| 8 基金份额持有人信息 | 49 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 49 |

| | |
|---|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 50 |
| 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 | 50 |
| 9 开放式基金份额变动 | 50 |
| 10 重大事件揭示 | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 50 |
| 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 | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 50 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 50 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 50 |
| 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 | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 51 |
| 10.8 其他重大事件 | 52 |
| 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 52 |
| 12 备查文件目录 | 53 |
| 12.1 备查文件目录 | 53 |
| 12.2 存放地点 | 53 |
| 12.3 查阅方式 | 53 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称 | 中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 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 |
| 注册地址 | | 上海市银城中路200号中银大厦45层 | 福州市湖东路154号 |
| 办公地址 | | 上海市银城中路200号中银大厦 | 上海江宁路168号兴业大厦 |

| | | |
|-------|--------------|--------|
| | 厦26层、27层、45层 | 20楼 |
| 邮政编码 | 200120 | 200041 |
| 法定代表人 | 白志中 | 高建平 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.bocim.com |
| 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 |

2.5 其他相关资料

| | | |
|--------|------------|------------------------|
| 项目 | 名称 | 办公地址 |
| 注册登记机构 | 中银基金管理有限公司 | 上海市浦东新区银城中路 200 号 45 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 |
| 本期加权平均净值利润率 | 5.45% | 5.41% |
| 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 |
| 期末可供分配利润 | 7,255,217.06 | 771,789.18 |
| 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 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 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 |
| 基金份额累计净值增长率 | 10.05% | 9.86% |

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% |

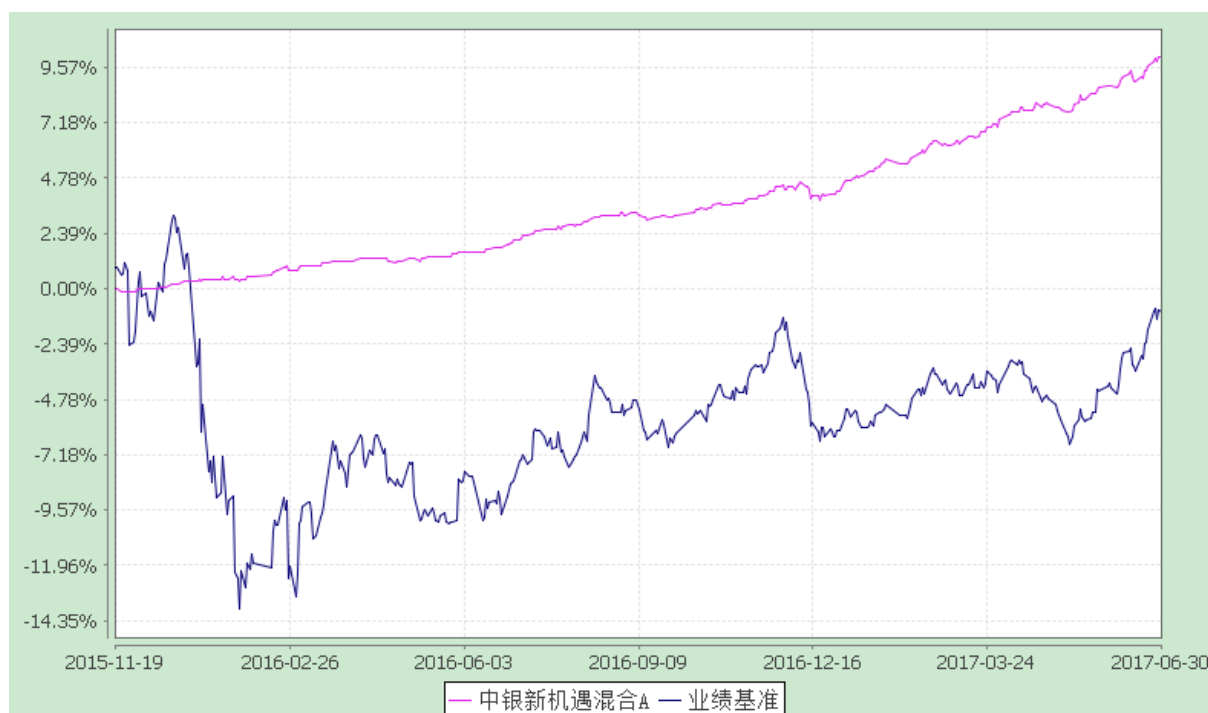
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金

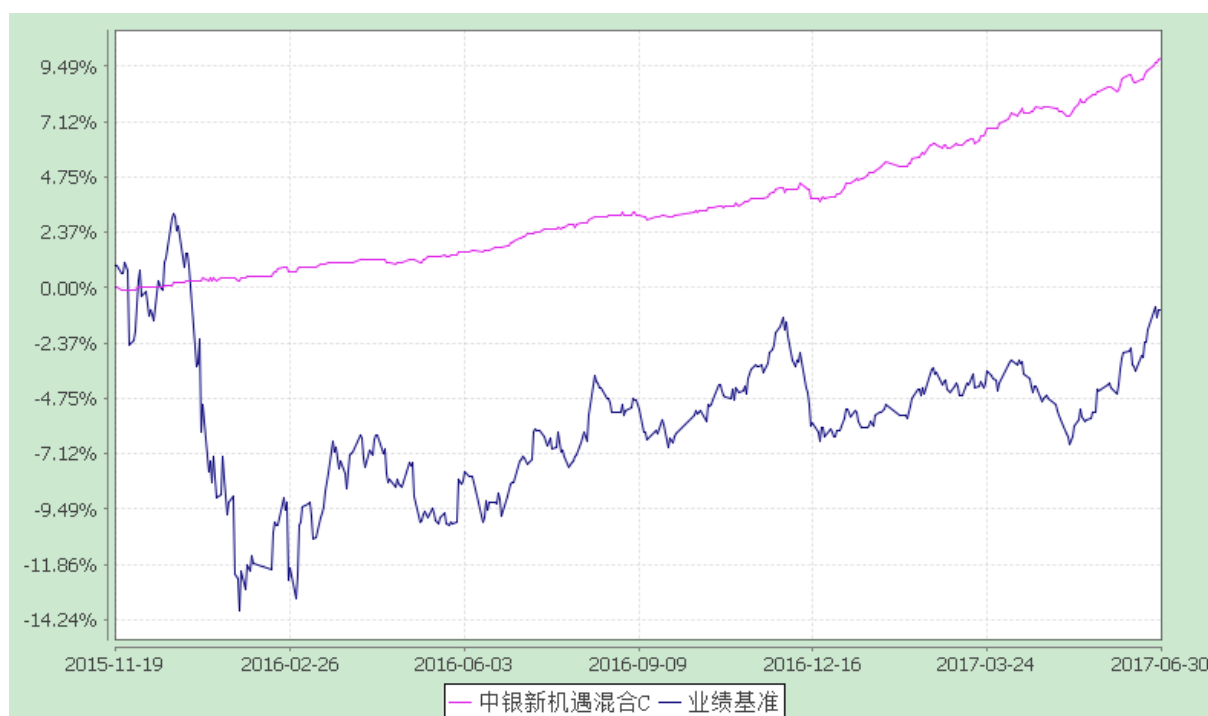
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(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 | | |
| 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 | 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 |

| | | | | | |
|----|--|----------------|---|----|--|
| | 庆基金基金经 理 | | | | 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 and 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 | 附注号 | 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 | 6.4.7.1 | 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 | 6.4.7.2 | 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 139,905,729.86 | - |
| 应收证券清算款 | | 185,310.76 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 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 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 811,881,996.54 | 789,165,485.53 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 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 | 6.4.7.7 | 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 | 6.4.7.8 | 187,522.73 | 109,000.00 |
| 负债合计 | | 878,702.76 | 777,719.35 |
| 所有者权益： | | - | - |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 782,144,005.70 | 756,648,705.17 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 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 | 附注号 | 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 | | 47,556,434.66 | 20,088,517.56 |
| 1.利息收入 | | 12,993,691.66 | 16,158,903.32 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 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 | 6.4.7.12 | 14,020,859.91 | 10,860,231.66 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -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 | 6.4.7.14 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------------------|----------------------|
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 1,055,017.64 | 130,596.48 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 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） | 6.4.7.17 | 36,867.55 | 25,607.00 |
| 减：二、费用 | | 3,716,410.58 | 6,594,550.41 |
| 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 | 6.4.7.18 | 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 | 6.4.7.19 | 205,636.68 | 234,989.72 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 43,840,024.08 | 13,493,967.15 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 43,840,024.08 | 13,493,967.15 |

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基金净值变动数（本期利润） | - | 43,840,024.08 | 43,840,024.08 |
| 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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 11,838,070.41 |
| 定期存款 | 250,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | 250,000,000.00 |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 261,838,070.41 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | | |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 106,213,023.21 | 124,480,724.16 | 18,267,700.95 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |

| | | | | |
|--------|-------|----------------|----------------|---------------|
| 债券 | 交易所市场 | 45,851,888.33 | 44,866,763.50 | -985,124.83 |
| | 银行间市场 | 235,634,786.30 | 235,034,000.00 | -600,786.30 |
| | 合计 | 281,486,674.63 | 279,900,763.50 | -1,585,911.13 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 387,699,697.84 | 404,381,487.66 | 16,681,789.82 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 | |
|-------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 银行间市场 | 139,905,729.86 | - |
| 合计 | 139,905,729.86 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 7,354.41 |
| 应收定期存款利息 | 588,472.18 |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 130.30 |
| 应收债券利息 | 4,304,982.57 |
| 应收买入返售证券利息 | 284,319.04 |
| 应收申购款利息 | 1.63 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 20.40 |
| 合计 | 5,185,280.53 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 110,860.54 |
| 银行间市场应付交易费用 | 3,502.99 |
| 合计 | 114,363.53 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 2.43 |
| 预提费用 | 187,520.30 |
| 其他 | - |
| 合计 | 187,522.73 |

6.4.7.9 实收基金

中银新机遇混合 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 671,032,631.36 | 671,032,631.36 |
| 本期申购 | 25,289,091.38 | 25,289,091.38 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -9,688,732.49 | -9,688,732.49 |
| 本期末 | 686,632,990.25 | 686,632,990.25 |

中银新机遇混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 85,616,073.81 | 85,616,073.81 |
| 本期申购 | 44,156,697.24 | 44,156,697.24 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -34,261,755.60 | -34,261,755.60 |
| 本期末 | 95,511,015.45 | 95,511,015.45 |

6.4.7.10 未分配利润

中银新机遇混合 A

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 28,855,118.74 | -554,721.88 | 28,300,396.86 |
| 本期利润 | 20,088,689.29 | 18,642,324.46 | 38,731,013.75 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 151,473.15 | 205,342.94 | 356,816.09 |

| | | | |
|----------|----------------|---------------|----------------|
| 其中：基金申购款 | 565,239.13 | 294,602.39 | 859,841.52 |
| 基金赎回款 | -413,765.98 | -89,259.45 | -503,025.43 |
| 本期已分配利润 | -41,840,064.12 | - | -41,840,064.12 |
| 本期末 | 7,255,217.06 | 18,292,945.52 | 25,548,162.58 |

中银新机遇混合 C

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末 | 3,508,979.93 | -70,315.78 | 3,438,664.15 |
| 本期利润 | 2,645,942.97 | 2,463,067.36 | 5,109,010.33 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 238,899.17 | 146,584.74 | 385,483.91 |
| 其中：基金申购款 | 1,304,710.74 | 594,276.22 | 1,898,986.96 |
| 基金赎回款 | -1,065,811.57 | -447,691.48 | -1,513,503.05 |
| 本期已分配利润 | -5,622,032.89 | - | -5,622,032.89 |
| 本期末 | 771,789.18 | 2,539,336.32 | 3,311,125.50 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 134,532.90 |
| 定期存款利息收入 | 6,057,694.48 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 3,871.34 |
| 其他 | 859.64 |
| 合计 | 6,196,958.36 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额 | 80,149,660.43 |
| 减：卖出股票成本总额 | 66,128,800.52 |
| 买卖股票差价收入 | 14,020,859.91 |

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|---------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 427,150,016.66 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 421,002,619.98 |

| | |
|----------|---------------|
| 减：应收利息总额 | 7,802,790.60 |
| 买卖债券差价收入 | -1,655,393.92 |

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,055,017.64 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,055,017.64 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 21,105,391.82 |
| ——股票投资 | 18,090,812.23 |
| ——债券投资 | 3,014,579.59 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 合计 | 21,105,391.82 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 36,861.78 |
| 转换费收入 | 5.77 |
| 合计 | 36,867.55 |

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 228,830.57 |
| 银行间市场交易费用 | 1,900.00 |

| | |
|----|------------|
| 合计 | 230,730.57 |
|----|------------|

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用 | 39,671.58 |
| 信息披露费 | 138,848.72 |
| 银行间账户维护费 | 18,000.00 |
| 银行汇划费 | 8,316.38 |
| 其他 | 800.00 |
| 合计 | 205,636.68 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 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。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 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 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 |
|----|-------------------------|----------------------------|
|----|-------------------------|----------------------------|

| | 30日 | 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

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 |
| 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。

6.4.10.2.3 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

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 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 |

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

中银新机遇混合 A

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每 10 份 基金份额 分红数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形 式发放总 额 | 利润分配合 计 | 备注 |
|----|-------|-----|-----------------------|--------------|-------------------|------------|----|
|----|-------|-----|-----------------------|--------------|-------------------|------------|----|

| | | 场内 | 场外 | | | | | |
|----|------------|----|------------|-------|---------------|------------|---------------|---|
| 1 | 2017-03-20 | - | 2017-03-20 | 0.400 | 26,716,884.74 | 16,818.99 | 26,733,703.73 | - |
| 2 | 2017-06-15 | - | 2017-06-15 | 0.220 | 15,075,417.46 | 30,942.93 | 15,106,360.39 | - |
| 合计 | | | | 0.620 | 41,792,302.20 | 314,900.06 | 41,840,064.12 | - |

中银新机遇混合 C

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|-----|------------|---------------|--------------|------------|--------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2017-03-20 | - | 2017-03-20 | 0.400 | 3,438,578.29 | 151,362.22 | 3,589,940.51 | - |
| 2 | 2017-06-15 | - | 2017-06-15 | 0.220 | 1,868,554.54 | 163,537.84 | 2,032,092.38 | - |
| 合计 | | | | 0.620 | 5,307,132.83 | 314,900.06 | 5,622,032.89 | - |

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 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 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|-------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | | | | 市 | | | | | | |
| 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 | - |
| 603933 | 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 | - |

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要为债券投资和股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部、法律合规部、稽核部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防

范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 29.60%（2016 年 12 月 31 日：30.35%）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2017年6月30日 | 上年末 2016年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1 | - | 30,156,000.00 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 205,445,000.00 | 266,128,400.00 |
| 合计 | 205,445,000.00 | 296,284,400.00 |

注：未评级债券为超短期融资券、政策性金融债和同业存单。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 | 上年末 |
|--------|-----|-----|
|--------|-----|-----|

| | 2017年6月30日 | 2016年12月31日 |
|--------|---------------|----------------|
| AAA | 45,025,600.00 | 79,140,720.00 |
| AAA 以下 | 29,430,163.50 | 79,891,162.80 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 74,455,763.50 | 159,031,882.80 |

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2017年6月 30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|----------------|---------------|------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 261,838,070.41 | - | - | - | 261,838,070.41 |
| 结算备付金 | 289,469.37 | - | - | - | 289,469.37 |
| 存出保证金 | 45,359.62 | - | - | - | 45,359.62 |
| 交易性金融资产 | 205,503,940.70 | 74,396,822.80 | 0.00 | 124,480,724.16 | 404,381,487.66 |
| 买入返售金融资产 | 139,905,729.86 | - | - | - | 139,905,729.86 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 185,310.76 | 185,310.76 |
| 应收利息 | - | - | - | 5,185,280.53 | 5,185,280.53 |
| 应收股利 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应收申购款 | 0.00 | - | - | 51,288.33 | 51,288.33 |
| 其他资产 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | 607,582,569.96 | 74,396,822.80 | 0.00 | 129,902,603.78 | 811,881,996.54 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 0.00 | - | - | - | 0.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 35,975.31 | 35,975.31 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 399,704.44 | 399,704.44 |
| 应付托管费 | - | - | - | 133,234.81 | 133,234.81 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 7,901.94 | 7,901.94 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 114,363.53 | 114,363.53 |
| 应交税费 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应付利息 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应付利润 | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 其他负债 | - | - | - | 187,522.73 | 187,522.73 |
| 负债总计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 878,702.76 | 878,702.76 |
| 利率敏感度缺口 | 607,582,569.96 | 74,396,822.80 | 0.00 | 129,023,901.02 | 811,003,293.74 |

| 上年度末 2016 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------------|----------------|----------------|-------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 221,739,552.04 | - | - | - | 221,739,552.04 |
| 结算备付金 | 2,768,349.05 | - | - | - | 2,768,349.05 |
| 存出保证金 | 27,143.79 | - | - | - | 27,143.79 |
| 交易性金融资产 | 326,849,328.56 | 128,466,954.24 | - | 101,562,659.90 | 556,878,942.70 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 7,719,799.53 | 7,719,799.53 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 31,698.42 | 31,698.42 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 551,384,373.44 | 128,466,954.24 | - | 109,314,157.85 | 789,165,485.53 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 10,060.89 | 10,060.89 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 437,906.72 | 437,906.72 |
| 应付托管费 | - | - | - | 145,968.90 | 145,968.90 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 13,545.94 | 13,545.94 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 61,236.90 | 61,236.90 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 109,000.00 | 109,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 777,719.35 | 777,719.35 |
| 利率敏感度缺口 | 551,384,373.44 | 128,466,954.24 | - | 108,536,438.50 | 788,387,766.18 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元） |
|----|-----------|----------------------------------|
| | | |

| | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 市场利率上升 25 个基点 | 减少约 61 | 减少约 92 |
| 市场利率下降 25 个基点 | 增加约 62 | 增加约 93 |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外币汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括特定指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 | |
|--------------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 124,480,724.16 | 15.35 | 101,562,659.90 | 12.88 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 279,900,763. | 34.51 | 455,316,282.8 | 57.75 |

| | | | | |
|---------------|-----------------------|--------------|-----------------------|--------------|
| | 50 | | 0 | |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 404,381,487.66 | 49.86 | 556,878,942.70 | 70.64 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|------------------------|--|------------------------------|---------------------|
| 假设 | 1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元） | |
| | | 本期末 2017年6月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
| | 1. 业绩比较基准(附注7.4.1)上升5% | 增加约626 | 增加约157 |
| 2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5% | 减少约626 | 减少约157 | |

6.4.14 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 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 |
| 11 | 000999 | 华润三九 | 145,200 | 4,610,100.00 | 0.57 |
| 12 | 000883 | 湖北能源 | 785,185 | 3,941,628.70 | 0.49 |
| 13 | 000089 | 深圳机场 | 405,396 | 3,790,452.60 | 0.47 |
| 14 | 000888 | 峨眉山 A | 289,100 | 3,671,570.00 | 0.45 |
| 15 | 601006 | 大秦铁路 | 416,600 | 3,495,274.00 | 0.43 |
| 16 | 601288 | 农业银行 | 928,700 | 3,269,024.00 | 0.40 |
| 17 | 002508 | 老板电器 | 71,561 | 3,111,472.28 | 0.38 |
| 18 | 000876 | 新希望 | 377,300 | 3,101,406.00 | 0.38 |
| 19 | 600027 | 华电国际 | 636,622 | 3,074,884.26 | 0.38 |
| 20 | 601818 | 光大银行 | 742,500 | 3,007,125.00 | 0.37 |
| 21 | 002415 | 海康威视 | 91,950 | 2,969,985.00 | 0.37 |
| 22 | 600104 | 上汽集团 | 86,300 | 2,679,615.00 | 0.33 |
| 23 | 601985 | 中国核电 | 316,600 | 2,472,646.00 | 0.30 |
| 24 | 600009 | 上海机场 | 62,101 | 2,316,988.31 | 0.29 |
| 25 | 000895 | 双汇发展 | 93,500 | 2,220,625.00 | 0.27 |
| 26 | 600741 | 华域汽车 | 81,958 | 1,986,661.92 | 0.24 |
| 27 | 002267 | 陕天然气 | 222,089 | 1,952,162.31 | 0.24 |
| 28 | 300498 | 温氏股份 | 72,600 | 1,701,744.00 | 0.21 |
| 29 | 600548 | 深高速 | 170,800 | 1,544,032.00 | 0.19 |
| 30 | 002304 | 洋河股份 | 17,100 | 1,484,451.00 | 0.18 |
| 31 | 000501 | 鄂武商 A | 78,616 | 1,451,251.36 | 0.18 |
| 32 | 000725 | 京东方 A | 294,593 | 1,225,506.88 | 0.15 |
| 33 | 601169 | 北京银行 | 100,000 | 917,000.00 | 0.11 |
| 34 | 002294 | 信立泰 | 11,052 | 394,114.32 | 0.05 |
| 35 | 603801 | 志邦股份 | 1,406 | 47,522.80 | 0.01 |
| 36 | 603043 | 广州酒家 | 1,810 | 45,738.70 | 0.01 |
| 37 | 300666 | 江丰电子 | 2,276 | 43,448.84 | 0.01 |
| 38 | 603380 | 易德龙 | 1,298 | 35,370.50 | 0.00 |
| 39 | 603335 | 迪生力 | 2,230 | 24,864.50 | 0.00 |
| 40 | 002879 | 长缆科技 | 1,313 | 23,660.26 | 0.00 |
| 41 | 002881 | 美格智能 | 989 | 22,608.54 | 0.00 |
| 42 | 603679 | 华体科技 | 809 | 21,438.50 | 0.00 |
| 43 | 603938 | 三孚股份 | 1,246 | 20,932.80 | 0.00 |
| 44 | 002882 | 金龙羽 | 2,966 | 18,389.20 | 0.00 |
| 45 | 603933 | 睿能科技 | 857 | 17,311.40 | 0.00 |
| 46 | 603305 | 旭升股份 | 1,351 | 15,212.26 | 0.00 |
| 47 | 300669 | 沪宁股份 | 841 | 14,650.22 | 0.00 |
| 48 | 300670 | 大烨智能 | 1,259 | 13,760.87 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 49 | 603286 | 日盈电子 | 890 | 13,528.00 | 0.00 |
| 50 | 300672 | 国科微 | 1,257 | 10,659.36 | 0.00 |
| 51 | 603331 | 百达精工 | 999 | 9,620.37 | 0.00 |
| 52 | 300671 | 富满电子 | 942 | 7,639.62 | 0.00 |
| 53 | 603617 | 君禾股份 | 832 | 7,429.76 | 0.00 |

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 | 新风鸣 | 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 CD030 | 400,000 | 38,580,000.00 | 4.76 |
| 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所有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、基金投资和研究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 | 53,774,939.46 | 66.06% | 10,000,000.00 | 2.87% | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|--------------------------------------|------------|
| 1 | 中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com | 2017-01-20 |
| 2 | 中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金分红公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com | 2017-03-15 |
| 3 | 中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告（摘要） | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com | 2017-03-31 |
| 4 | 中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告 | www.bocim.com | 2017-03-31 |
| 5 | 中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com | 2017-04-21 |
| 6 | 中银基金管理有限公司关于新增上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金开通定期定额投资及转换的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com | 2017-05-19 |
| 7 | 中银基金管理有限公司关于新增上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com | 2017-05-20 |
| 8 | 中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金分红公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时 | 2017-06-12 |

| | | | |
|---|-------------------------------------|--------------------------------------|------------|
| | | 报》、www.bocim.com | |
| 9 | 中银基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或身份证明文件的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、www.bocim.com | 2017-06-15 |

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：</p> <p>（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> | | | | | | | |

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中银新机遇灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人处，供公众查阅。

12.3 查阅方式

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

中银基金管理有限公司
二〇一七年八月二十九日