

中银活期宝货币市场基金
2017 年半年度报告摘要
2017 年 6 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十九日

1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------|
| 基金简称 | 中银活期宝货币 |
| 基金主代码 | 000539 |
| 交易代码 | 000539 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 2 月 14 日 |
| 基金管理人 | 中银基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 20,641,966,879.53 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在有效控制投资风险和保持较高流动性的基础上，力争获得超过业绩比较基准的稳定回报。 |
| 投资策略 | 本基金通过综合考虑各类资产的收益性、流动性和风险特征，根据定量和定性方法，在保持投资组合较低风险和良好流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的稳定投资回报。 |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款税后利率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。 |

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 | | 中银基金管理有限公司 | 中信银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 薛文成 | 方韡 |
| | 联系电话 | 021-38834999 | 4006800000 |
| | 电子邮箱 | clientservice@bocim.com | fangwei@citicbank.com |
| 客户服务电话 | | 021-38834788 400-888-5566 | 95558 |
| 传真 | | 021-68873488 | 010-85230024 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址 | http://www.bocim.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市银城中路 200 号中银大厦 26 层 |

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） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 269,147,736.87 |
| 本期利润 | 269,147,736.87 |
| 本期净值收益率 | 1.7216% |
| 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 | 20,641,966,879.53 |
| 期末基金份额净值 | 1.000 |

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，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、本基金利润分配是按日结转份额。

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

| 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 | 0.3184% | 0.0004% | 0.1125% | 0.0000% | 0.2059% | 0.0004% |
| 过去三个月 | 0.9291% | 0.0005% | 0.3413% | 0.0000% | 0.5878% | 0.0005% |
| 过去六个月 | 1.7216% | 0.0013% | 0.6788% | 0.0000% | 1.0428% | 0.0013% |
| 过去一年 | 3.0359% | 0.0016% | 1.3688% | 0.0000% | 1.6671% | 0.0016% |
| 过去三年 | 11.1010% | 0.0041% | 4.1100% | 0.0000% | 6.9910% | 0.0041% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.2737% | 0.0042% | 4.6238% | 0.0000% | 8.6499% | 0.0042% |

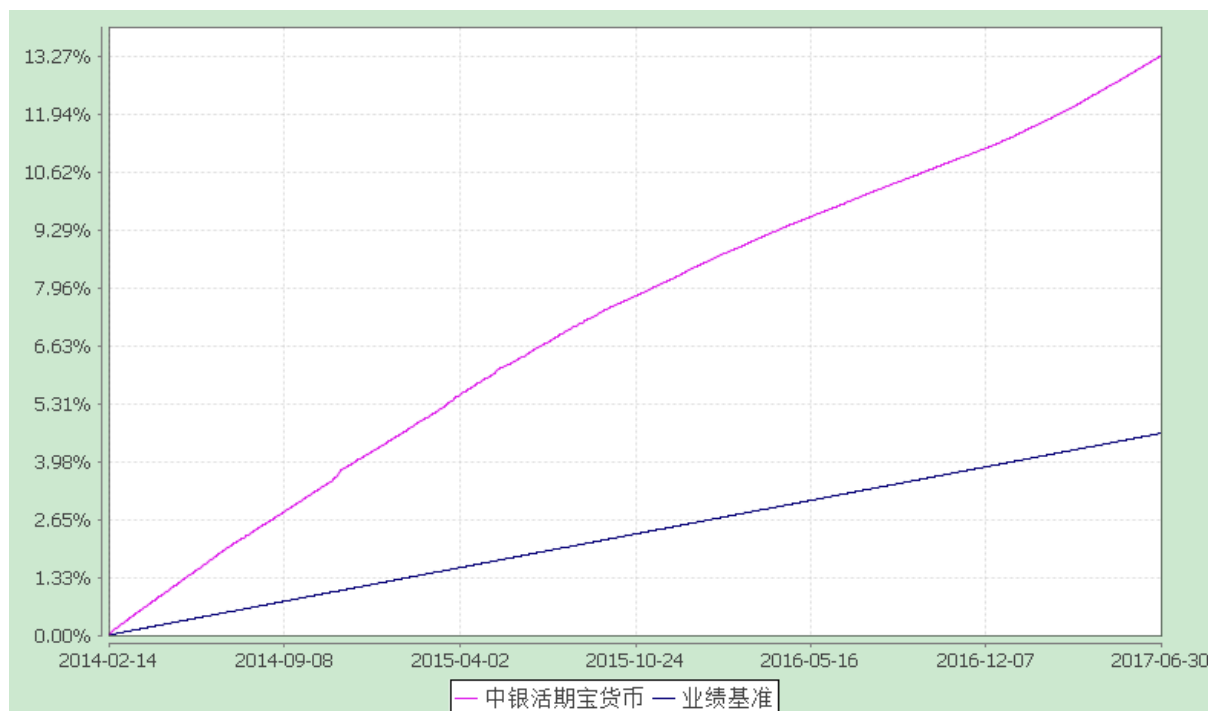
注：本基金的收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

中银活期宝货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年2月14日至2017年6月30日)



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）投资范围、（四）投资限制的规定。

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 | | |
| 范静 | 本基金的 基金经理、 中银惠利 纯债基金 基金经理、 中银薪金 包货币基 金基金经 理 | 2014-02-14 | - | 11 | 中银基金管理有限公司助理副总裁 (AVP), 金融市场学硕士。曾任日本瑞穗银行 (中国) 有限公司资金部交易员。2007 年加入中银基金管理有限公司, 历任债券交易员、固定收益研究员、专户投资经理、固定收益基金经理助理。2013 年 12 月至今任中银惠利纯债基金基金经理, 2014 年 2 月至今任中银活期宝货币基金基金经理, 2014 年 6 月至今担任中银薪金包货币基金基金经理。特许公认会计师公会 (ACCA) 准会员。具有 11 年证券从业年限。具备基金、银行间本币市场交易员从业资格。 |

注: 1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日, 非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期, 基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期;

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《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%。

可转债方面，上半年跟随权益及债券市场，整体先抑后扬。其中一季度中证转债指数微涨 0.08%，个券方面，歌尔、广汽、白云等转债偏股性、正股偏价值的品种表现较好，分别上涨 7.41%、4.47% 及 4.14%；二季度中证转债指数上涨 2.50%，个券方面，14 宝钢 EB、歌尔、白云等转债偏股性、正股偏蓝筹的品种继续走好，分别上涨 15.46%、12.74% 及 7.54%。股票市场方面，整体维持震荡之势，但分化明显。其中，一季度上证综指上涨 3.83%，代表大盘股表现的沪深 300 指数上涨 4.41%，中小盘综合指数上涨 1.18%，创业板综合指数下跌 2.51%；二季度，上证综指下跌 0.93%，代表大盘股表现的沪深 300 指数上涨 6.10%，中小盘综合指数下跌 3.57%，创业板综合指数下跌 7.80%。

3. 运行分析

上半年股票市场出现分化，债券市场小幅震荡，本基金业绩表现好于比较基准。策略上，我们保持合适的久期和杠杆比例，积极参与波段投资机会，优化配置结构，重点配置中短期、中高评级信用债，合理分配类属资产比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

中银活期宝基金 2017 年上半年度净值收益率为 1.7216%，高于业绩比较基准 104bp。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，全球经济依然处于不均衡发展和复苏阶段，美国经济复苏态势回落，欧洲经济稳中向好，但能源价格低迷制约了各国通胀的上升。鉴于对当前经济和通胀增速的判断，对于国内情况，经济短期内维持在合理区间内运转，经济增速短期下滑压力较小，中长期 L 型增长走势的基本趋势仍未发生变化，宏观政策仍将注重于经济结构调整和金融风险防控，继续深入推进供给侧改革和“三去一降一补”，建立房地产市场平稳健康发展的长效机制，通过财税改革和国企混改等结构性改革为经济创造新的增长点。货币政策将保持稳健中性，整体基调不松不紧，适应货币供应方式新变

化，调节好货币闸门，公开市场方面维护流动性基本稳定。社会融资方面，在银监会加强监管的背景下，不断完善风险管理，防范金融风险，规范表外融资，预计表外融资继续收缩，表内信贷投放也或将因为着力防控资产泡沫而放缓。

综合上述分析，我们对 2017 年下半年债券市场的走势判断保持谨慎乐观。预计 2017 年下半年宏观调控政策整体保持稳定，货币政策在中性偏紧的总体基调下，目前已经出现阶段性的放松，但进一步大幅放松的概率不大。预计银行间 7 天回购利率可能小幅下行，银行间资金面状况整体也有望保持稳定。经济基本面较为强劲，基建投资可能遵循以往年内“前高后低”的规律而出现下行，房地产投资在地产调控的大背景下，难以拉动经济增长，制造业投资保持稳中有升。物价方面，通胀对债市的压力较低，PPI 高位见顶后继续回落，同时对 CPI 的传导力度有限，CPI 上升步伐缓慢。美联储 9 月份加息概率较低，缩表计划可能要等到年末才开始实行，但欧央行退出量化宽松政策的预期上升对全球债市形成一定压力。考虑到经济增长动能延续韧性、货币政策取向总体中性、利率债供需压力渐增，预计下半年债券收益率中枢可能呈震荡走势，在出现经济下行、监管放松、流动性改善等情况时，适当捕捉债券市场的短期阶段性机会。信用债方面，允许刚性兑付打破，进一步完善金融市场建设，提高风险定价能力等因素，下半年或将存在个案违约风险发生，规避信用风险较大的品种。具体操作上，在做好组合流动性管理的基础上，维持适度杠杆和久期，均衡配置，合理分配各类资产，审慎精选信用债和可转债品种，积极把握利率债和可转债的投资交易机会。我们将坚持从自上而下的角度预判市场走势，并从自下而上的角度严防信用风险。作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 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

根据本基金合同有关规定：本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，基金托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期，中银基金管理有限公司在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金每日进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

本报告期，由中银基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关本基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

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：中银活期宝货币市场基金

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 | 11,567,936,111.21 | 9,475,144,918.36 |
| 结算备付金 | - | 327,300.18 |
| 存出保证金 | 9,758.76 | 3,306.78 |
| 交易性金融资产 | 9,637,552,419.33 | 4,878,139,691.83 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 9,637,552,419.33 | 4,878,139,691.83 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 863,975,855.97 | 1,992,942,027.32 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 54,539,379.49 | 57,374,578.34 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 122,274,050.92 | 1,189,825,937.54 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | 14,197.94 | 11,803.49 |
| 资产总计 | 22,246,301,773.62 | 17,593,769,563.84 |
| 负债和所有者权益 | 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 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 1,593,287,512.35 | 272,599,391.10 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | 118,239.48 | - |
| 应付管理人报酬 | 4,944,723.59 | 3,115,110.38 |
| 应付托管费 | 915,689.53 | 576,872.28 |
| 应付销售服务费 | 4,578,447.74 | 2,884,361.46 |
| 应付交易费用 | 83,948.65 | 64,958.60 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 301,341.60 | 112,462.35 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 104,991.15 | 69,000.00 |
| 负债合计 | 1,604,334,894.09 | 279,422,156.17 |
| 所有者权益： | - | - |
| 实收基金 | 20,641,966,879.53 | 17,314,347,407.67 |

| | | |
|-------------------|--------------------------|--------------------------|
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 20,641,966,879.53 | 17,314,347,407.67 |
| 负债和所有者权益总计 | 22,246,301,773.62 | 17,593,769,563.84 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 20,641,966,879.53 份。

6.2 利润表

会计主体：中银活期宝货币市场基金

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 | 317,441,461.31 | 169,134,518.54 |
| 1.利息收入 | 317,814,513.35 | 160,921,136.53 |
| 其中：存款利息收入 | 217,752,265.00 | 95,250,054.14 |
| 债券利息收入 | 81,643,404.41 | 64,342,937.13 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 18,418,843.94 | 1,328,145.26 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -373,052.04 | 8,213,382.01 |
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -373,052.04 | 8,213,382.01 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 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 | 48,293,724.44 | 38,089,252.98 |
| 1. 管理人报酬 | 20,781,856.00 | 12,694,812.59 |
| 2. 托管费 | 3,848,491.86 | 2,350,891.21 |
| 3. 销售服务费 | 19,242,459.20 | 11,754,456.08 |
| 4. 交易费用 | - | - |
| 5. 利息支出 | 4,255,409.57 | 11,148,840.31 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 4,255,409.57 | 11,148,840.31 |
| 6. 其他费用 | 165,507.81 | 140,252.79 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 269,147,736.87 | 131,045,265.56 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 269,147,736.87 | 131,045,265.56 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银活期宝货币市场基金

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） | 17,314,347,407.67 | - | 17,314,347,407.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 269,147,736.87 | 269,147,736.87 |
| 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） | 3,327,619,471.86 | - | 3,327,619,471.86 |
| 其中：1.基金申购款 | 49,427,504,013.92 | - | 49,427,504,013.92 |
| 2.基金赎回款 | -46,099,884,542.06 | - | -46,099,884,542.06 |
| 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） | - | -269,147,736.87 | -269,147,736.87 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 20,641,966,879.53 | - | 20,641,966,879.53 |
| 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） | 7,496,724,944.92 | - | 7,496,724,944.92 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 131,045,265.56 | 131,045,265.56 |
| 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） | 2,688,175,728.60 | - | 2,688,175,728.60 |
| 其中：1.基金申购款 | 23,388,898,824.62 | - | 23,388,898,824.62 |
| 2.基金赎回款 | -20,700,723,096.02 | - | -20,700,723,096.02 |
| 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） | - | -131,045,265.56 | -131,045,265.56 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 10,184,900,673.52 | - | 10,184,900,673.52 |

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

中银活期宝货币市场基金(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[2014]127 号文《关于核准中银活期宝货币市场基金募集的批复》的核准,由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开募集,基金合同于 2014 年 2 月 14 日正式生效。首次设立募集规模为 300,056,196.44 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为中银基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金投资于法律法规或监管机构允许投资的金融工具,包括:现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大量存单;剩余期限(或回售期限)在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据;期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券,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。

本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款税后利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 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

本基金在本报告期间没有需作说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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[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。

6.4.6.3 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。

6.4.7 关联方关系

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

本基金本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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|---------------------|
| 中银基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中信银行股份有限公司（“中信银行”） | 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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 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管理费 | 20,781,856.00 | 12,694,812.59 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,901,648.77 | - |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.27% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 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 | 3,848,491.86 | 2,350,891.21 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 |
|----------------|----------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 中银基金管理有限公司 | 16,161,330.21 |
| 中国银行 | 3,078,111.55 |
| 合计 | 19,239,441.76 |
| 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 |
| 中银基金管理有限公司 | 11,754,456.08 |
| 合计 | 11,754,456.08 |

注：销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。本基金基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，具体的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 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 |
|-----------------------|--------------------------|--------------------------|
| 期初持有的基金份额 | 82,510,539.89 | 80,338,350.21 |
| 期间申购/买入总份额 | 1,118,922.38 | 1,127,764.91 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | 83,629,462.27 | - |
| 期末持有的基金份额 | - | 81,466,115.12 |
| 期末持有的基金份额占基金总 份额比例 | - | 0.80% |

注：（1）期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

（2）本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

6.4.8.4.2 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及上年度末均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
|-----------|----------------------------|---------------|---------------------------------|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中信银行-活期存款 | 12,936,111.21 | 195,357.58 | 7,369,051.55 | 81,297.23 |
| 中信银行-定期存款 | 700,000,000.00 | 17,078,055.61 | - | 1,946,555.56 |
| 合计 | 712,936,111.21 | 17,273,413.19 | 7,369,051.55 | 2,027,852.79 |

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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形成的卖出回购

金融资产款余额为人民币 1,593,287,512.35 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 |
|-----------|--------------------|------------|------------|---------------|------------------|
| 179920 | 17 贴现国债 20 | 2017-07-03 | 99.75 | 2,500,000 | 249,376,274.31 |
| 120415 | 12 农发 15 | 2017-07-03 | 100.09 | 500,000 | 50,045,683.39 |
| 111697823 | 16 哈尔滨银 行 CD027 | 2017-07-03 | 98.85 | 300,000 | 29,655,955.52 |
| 111708089 | 17 中信银行 CD089 | 2017-07-03 | 98.91 | 2,490,000 | 246,284,990.30 |
| 150417 | 15 农发 17 | 2017-07-03 | 100.04 | 800,000 | 80,032,578.52 |
| 170009 | 17 付息国债 09 | 2017-07-03 | 99.68 | 500,000 | 49,842,430.51 |
| 160419 | 16 农发 19 | 2017-07-03 | 99.95 | 600,000 | 59,972,947.96 |
| 111613111 | 16 浙商 CD111 | 2017-07-03 | 99.55 | 1,030,000 | 102,537,368.76 |
| 140020 | 14 付息国债 20 | 2017-07-03 | 100.07 | 1,000,000 | 100,071,614.15 |
| 179925 | 17 贴现国债 25 | 2017-07-03 | 99.45 | 1,000,000 | 99,453,515.05 |
| 179921 | 17 贴现国债 21 | 2017-07-03 | 99.69 | 2,000,000 | 199,379,584.73 |
| 170204 | 17 国开 04 | 2017-07-03 | 99.35 | 500,000 | 49,672,530.42 |
| 179916 | 17 贴现国债 16 | 2017-07-03 | 99.93 | 500,000 | 49,964,535.33 |
| 140220 | 14 国开 20 | 2017-07-03 | 100.13 | 300,000 | 30,039,111.07 |
| 179922 | 17 贴现国债 22 | 2017-07-03 | 99.62 | 2,700,000 | 268,975,052.45 |
| 179924 | 17 贴现国债 24 | 2017-07-03 | 99.55 | 500,000 | 49,773,797.74 |
| 合计 | | | | 17,220,000.00 | 1,715,077,970.21 |

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1 | 固定收益投资 | 9,637,552,419.33 | 43.32 |
| | 其中：债券 | 9,637,552,419.33 | 43.32 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 863,975,855.97 | 3.88 |
| | 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 | 11,567,936,111.21 | 52.00 |
| 4 | 其他各项资产 | 176,837,387.11 | 0.79 |
| 5 | 合计 | 22,246,301,773.62 | 100.00 |

| 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 | 1.76 | |
| | 其中：买断式回购融资 | - | |
| | 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 | 1,593,287,512.35 | 7.72 |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定：“本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

7.2 基金投资组合平均剩余期限

7.2.1 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 | 86 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 96 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 48 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过 120 天的情况。

7.2.2 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 | 9.40 | 7.72 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 | - | - |

| | | | |
|---|----------------------------|--------|------|
| | 浮动利率债 | | |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 20.21 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 56.97 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 3.39 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 16.94 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 106.92 | 7.72 |

7.3 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余存续期未出现超过 240 天的情况。

7.4 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 | 1,066,836,804.27 | 5.17 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 269,762,851.36 | 1.31 |
| | 其中：政策性金融债 | 269,762,851.36 | 1.31 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 849,338,889.04 | 4.11 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 7,451,613,874.66 | 36.10 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 9,637,552,419.33 | 46.69 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债券 | - | - |

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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 | 111710305 | 17 兴业银行 CD305 | 9,000,000 | 880,400,182.97 | 4.27 |
| 2 | 111710277 | 17 兴业银行 CD277 | 4,000,000 | 396,124,913.71 | 1.92 |
| 3 | 111710281 | 17 兴业银行 | 4,000,000 | 395,990,734.93 | 1.92 |

| | | CD281 | | | |
|----|-----------|------------------|-----------|----------------|------|
| 4 | 111799843 | 17 宁波银行 CD106 | 4,000,000 | 395,756,249.88 | 1.92 |
| 5 | 111708089 | 17 中信银行 CD089 | 3,000,000 | 296,728,903.97 | 1.44 |
| 6 | 111709259 | 17 浦发银行 CD259 | 3,000,000 | 293,493,930.07 | 1.42 |
| 7 | 111715193 | 17 民生银行 CD193 | 3,000,000 | 293,409,407.93 | 1.42 |
| 8 | 179922 | 17 贴现国债 22 | 2,700,000 | 268,975,052.45 | 1.30 |
| 9 | 111710042 | 17 兴业银行 CD042 | 2,650,000 | 264,220,699.74 | 1.28 |
| 10 | 179920 | 17 贴现国债 20 | 2,500,000 | 249,376,274.31 | 1.21 |

7.6“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 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0401% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0626% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0299% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度绝对值达到0.5%的情况。

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法计价，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

7.8.2 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。

7.8.3 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 | 9,758.76 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |

| | | |
|---|-------|----------------|
| 3 | 应收利息 | 54,539,379.49 |
| 4 | 应收申购款 | 122,274,050.92 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | 14,197.94 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 176,837,387.11 |

7.8.4 其他需说明的重要事项

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|-----------|---------------|-------------------|------------|-----------------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比 例 | 持有份额 | 占总份额比 例 |
| 2,222,951 | 9,285.84 | 60,441,41 2.82 | 0.29% | 20,581,52 5,466.71 | 99.71% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|---------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 24,567,330.18 | 0.1190% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | >100 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2014年2月14日）基金份额总额 | 300,109,959.31 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 17,314,347,407.67 |
| 本报告期基金总申购份额 | 49,427,504,013.92 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 46,099,884,542.06 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 20,641,966,879.53 |

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，本基金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，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，未发生涉及基金管理业务、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，本基金的投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

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未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 | |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》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:报告期内新租民生证券上海、深圳交易单元各一个,新租东吴证券上海、深圳交易单元各一个。

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 |
| 长江证券 | 80,320,590.00 | 100.00% | - | - | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值均未超过 0.5%。

中银基金管理有限公司
二〇一七年八月二十九日