

中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金
2017 年年度报告摘要
2017 年 12 月 31 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月三十日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|------------------|
| 基金简称 | 中银产业债定期开放债券 |
| 场内简称 | 中银产债 |
| 基金主代码 | 163827 |
| 交易代码 | 163827 |
| 基金运作方式 | 契约型、上市开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 9 月 4 日 |
| 基金管理人 | 中银基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 641,284,981.32 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2014 年 12 月 18 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在严格控制投资风险并保持资产流动性的基础上，通过对产业债券积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金根据对宏观经济趋势、国家政策方向、行业和企业盈利、信用状况及其变化趋势、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等因素的动态分析，在限定投资范围内，决定债券类资产的配置比例，并跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化，定期或不定期对大类资产配置比例进行调整。在充分论证债券市场宏观环境和仔细分析利率走势基础上，依次通过久期配置策略、期限结构配置策略、类属配置策略、个券精选策略等自上而下完成组合构建。本基金在整个投资决策过程中将认真遵守投资纪律并有效管理投资风险。 |
| 业绩比较基准 | 1 年期定期存款利率（税后）+1%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|---------------------------|---------------------|
| 名称 | | 中银基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 薛文成 | 郭明 |
| | 联系电话 | 021-38834999 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | clientservice@bocim.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 021-38834788 400-888-5566 | 95588 |
| 传真 | | 021-68873488 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2017 年 | 2016 年 | 2015 年 |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期已实现收益 | 38,755,871.15 | 38,046,376.96 | 69,383,541.49 |
| 本期利润 | 29,373,824.99 | 4,308,387.39 | 2,399,183.19 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0417 | 0.0051 | 0.0014 |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.95% | 0.30% | 2.24% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末 | 2016 年末 | 2015 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0022 | 0.0160 | 0.0401 |
| 期末基金资产净值 | 639,844,036.05 | 747,936,144.13 | 983,532,708.40 |
| 期末基金份额净值 | 0.998 | 1.028 | 1.095 |

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。期末可供分配收益，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.39% | 0.20% | 0.59% | 0.01% | -0.98% | 0.19% |
| 过去六个月 | 1.43% | 0.20% | 1.18% | 0.01% | 0.25% | 0.19% |
| 过去一年 | 3.95% | 0.17% | 2.37% | 0.01% | 1.58% | 0.16% |
| 过去三年 | 6.59% | 0.30% | 8.13% | 0.01% | -1.54% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.16% | 0.30% | 9.53% | 0.01% | 4.63% | 0.29% |

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

中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014 年 9 月 4 日至 2017 年 12 月 31 日)

第4页共33页

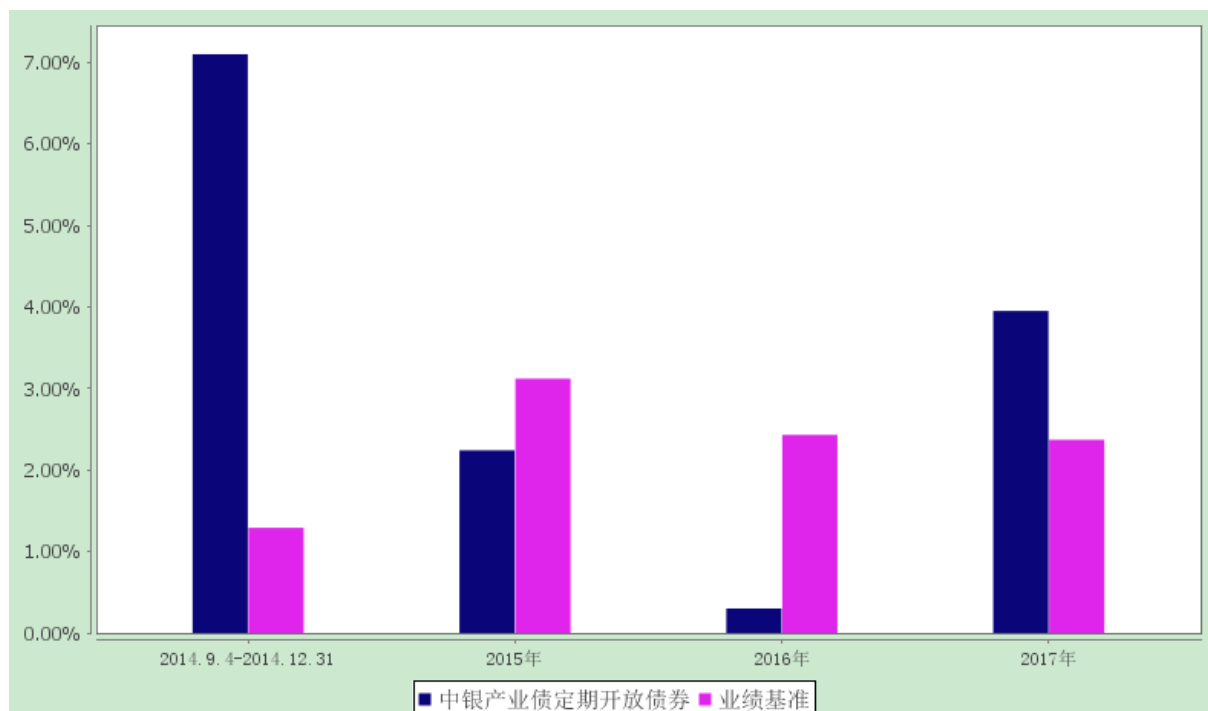


注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（二）的规定，即基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中产业债的投资比例不低于本基金非现金资产的 80%。应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。本基金还可投资于持有可转债转股所得股票以及权证等中国证监会允许基金投资的非固定收益类金融品种。本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。开放期内，基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2014 年 9 月 4 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满五年。合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 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 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|-------|-------------|----------------|-----------|----------------|----|
| 2017年 | 0.700 | 49,551,551.60 | 0.00 | 49,551,551.60 | - |
| 2016年 | 0.700 | 57,761,613.96 | 0.00 | 57,761,613.96 | - |
| 2015年 | - | - | - | - | - |
| 合计 | - | 107,313,165.56 | - | 107,313,165.56 | - |

§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

截至 2017 年 12 月 31 日，本管理人共管九十二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、中银移动互联灵活配置混合型证券投资基金、中银金融地产混合型证券投资基金、中银信享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银量化价值混合型证券投资基金、中银丰进定期开放债券型发起式证券投资基金、中银利享定期开放债券型证券投资基金、中银丰禧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、中银安心回报债券基金基金经理、中银新机遇基金基金经理、中银颐利基金基金经理、中银睿享基金基金经理、中银悦享基金基金经理、中银富享基金基金经理、中银丰庆基金基金经理、中银信享基金基金经理 | 2014-09-04 | - | 12 | 中银基金管理有限公司副总裁（VP），上海财经大学经济学硕士。曾任金盛保险有限公司投资部固定收益分析员。2007年加入中银基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员、基金经理助理。2011年3月至今任中银货币基金基金经理，2012年12月至今任中银理财7天债券基金基金经理，2013年12月至2016年7月任中银理财21天债券基金基金经理，2014年9月至今任中银产业债基金基金经理，2014年10月至今任中银安心回报债券基金基金经理，2015年11月至今任中银新机遇基金基金经理，2016年8月至今任中银颐利基金基金经理，2016年9月至今任中银睿享基金基金经理，2016年9月至今任中银悦享基金基金经理，2017年3月至今任中银富享基金基金经理，2017年3月至今任中银丰庆基金基金经理，2017年9月至今任中银信享基金基金经理。具有12年证券从业年限。具备基金、证券、银行间本币市场交易员从业资格。 |

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

本报告期内，本公司通过对公司管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，并对连续四个季度的不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.3 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

2017 年，全球经济稳定复苏，主要经济体经济走势均出现回升，全球货币政策逐渐退出宽松。具体情况来看，美国经济表现整体强势，经济景气不断提升，制造业 PMI 指数从 2016 年末的 54.5 大幅上升至 59.3 水平，通胀达到 2% 的长期均衡水平，就业持续改善，失业率从 4.7% 进一步下降至 4.1% 左右，美联储全年加息三次并公布缩表计划，货币政策逐步收紧。欧元区经济持续复苏，制造业 PMI 指数从 54.9 上升至 60.6，CPI 同比增速稳定至 1.3% 左右。日本经济从下半年开始小幅复苏，PMI 指数从 2016 年末的 52.4 上升至 54.1，通胀回暖，就业改善，失业率从 3.1% 降至 2.8%。

国内经济方面，在国内外需求复苏影响下，宏观经济保持韧性，经济结构出现重大变革，推进供给侧结构性改革。2017 年 GDP 实际同比增长 6.9%，较 2016 年提升 0.2 个百分点。通胀总体处于低位，CPI 同比增长 1.6%，PPI 从年初的 6.9% 回落到年末的 4.9%。从经济增长动力来看，基础设施投资建设和出口对经济增长贡献较多，基建投资同比增长约 14%，美元计价出口增速大幅回升至 11% 以上。政策方面，央行货币政策稳健中性，实际操作中性偏紧，抑制资产泡沫，防范金融风险，推进金融去杠杆，全年 M2 同比增长 8.2%，社会融资规模同比增长 12%，新增人民币贷款 13.5 万亿元。

2. 市场回顾

2017 年，债券收益率全年震荡上行，债券指数普遍下跌，全年中债总全价指数下跌 4.26%，中债银行间国债全价指数下跌 4.83%，中债企业债总全价指数下跌 9.84%。具体来看，一季度国内经济延续回暖趋势，债市还面临表外理财首次纳入 MPA 考核、央行两次上调货币政策工具利率、美联储在 3 月加息如期落地等多重利空，长端收益率震荡上行，十年国债收益率上行 27bp 至 3.28%，十年国开债上行 36bp 至 4.06%。二、三季度金融去杠杆和风险防范成为监管主基调，监管层表态加强监管协调后市场情绪略有平复，二季度债市收益率仍旧向上寻顶但上行趋缓，而在三季度，由于前期市场普遍预期下半年经济下行未被证实，债市收益率走势表现纠结，十年国开债上下波动在不到 20bp 区间内，呈现窄幅震荡走势。四季度基本面仍然维持较强的韧性，十九大会议后各项监管政策逐步落地，也强化了市场对强监管的预期，债券市场经历了快速的调整，10 年国债上行了 40bp、10 年国开债至高点上行约 75bp。货币市场方面，主要受货币政策与金融监管政策的

影响，年初上行速度较快，下半年央行维持“削峰填谷”操作后，资金利率表现较为平稳，全年利率中枢有所抬升，银行间 1 天回购加权平均利率均值在 2.72%，7 天回购加权平均利率均值在 3.35%。

可转债方面，整体跟随股市宽幅震荡。其中上半年中证转债指数上涨 2.58%，个券方面，歌尔、白云、宝钢 EB 等偏股价值型品种表现较好，分别上涨 21.10%、11.99%及 9.86%；下半年中证转债指数下跌 2.67%，个券方面，宝钢 EB、国资 EB、三一金融周期大盘转债表现较好，分别上涨 21.24%、16.84%及 2.02%，模塑、久其、九州等偏股型小盘转债表现较弱，分别下跌 19.33%、16.43%及 13.36%。

3. 运行分析

2017 年上半年债券市场震荡下跌，三季度债券市场窄幅震荡，四季度债券市场快速下跌，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

报告期内，本基金份额净值增长率为 3.95%，同期业绩比较基准收益率为 2.37%。

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，全球经济依然处于稳定复苏阶段，美国经济向好态势延续，欧洲经济势头强劲，能源价格的回升抬升了各国通胀预期。国内经济短期内维持在合理区间内运转，但从中央经济工作会议来看，经济从追求增速向追求质量和效益的方向转变，对经济下行的容忍度提升。宏观政策仍将注重于经济结构调整和金融风险防控，使宏观杠杆率得到有效控制，金融服务实体经济能力增强。财政政策积极的取向不变，但地方融资监管不会放松。货币政策基调偏紧，定位“管住货币供给总闸门”，但总体仍维持稳健中性。社会融资方面，受“早放贷早受益”信贷冲量影响，一季度实体融资仍有韧性。

综合上述分析，我们对 2018 年一季度债券市场的走势判断保持谨慎乐观。经济基本面下行压力仍客观存在，固定资产投资增速延续下行，后续房地产投资仍然会缓中趋降，基建投资受制于财政空间有限，制造业投资可能成为亮点。在经济基本面转弱的背景下，货币政策基调整体维持稳健中性，央行年初定向降准及春节准备金率临时性下调安排，有助于稳定流动性预期。通胀对债市的压力相对可控，2018 年 CPI 中枢将略有抬升，一季度 CPI 在春节因素和猪肉价格季节性回升下将阶段性冲高，而 PPI 中枢将显著回落。欧洲经济基本面持续向好，美联储 2018 年将继续加息，美债收益率曲线变平压力增大，美国货币紧缩路径可能较市场预期温和，美元指数走势疲弱，人民币兑美元汇率稳中有升，内外利差维持较高水平，考虑到货币政策取向总体中性，但“双支柱”调控推

动金融生态链重塑的过程中，金融监管压力仍未完全消除，预计一季度债券收益率中枢可能呈高位震荡走势，在出现经济数据放缓、监管落地、流动性改善等情况时，适当捕捉利率债配置机会。信用债方面，当前中低等级信用利差保护不足，在地方政府债务监管趋严的背景下，融资平台、城投债压力也将增大，但短久期高收益的信用品种依然存在价值发掘的机会。具体操作上，在做好组合流动性管理的基础上，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，消费升级、金融地产、先进制造业等可能带来主题投资机会，风险偏好则随着流动性改善和地方两会陆续拉开帷幕有所抬升，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

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由研究部、风险管理部、基金运营部相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并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环境相适应的估值方法，基金运营部应征询会计师事务所、托管行的相关意见。公司按特殊流程改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，应就基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见，会计师事务所应对公司所采用的相关估值模型、假设、参数及输入的适当性发表审核意见，同时基金运营部按要求向公司信息披露部门提交临时公告，对外公布。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.7.2 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.7.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次；

基金合同生效满 3 个月后，若基金在每个封闭期最后一个工作日收盘后每 10 份基金份额可分配利润金额不低于 0.3 元（含），则基金须进行收益分配，并以该日为收益分配基准日，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 80%；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金于 2017 年 03 月 22 日进行了第一次利润分配，向基金份额持有人每份基金份额派发现金红利 0.025 元，分红总金额为 18,190,273.93 元，收益基准日为 2017 年 03 月 06 日，每份基金份额可供分配利润为 0.0253 元；本基金于 2017 年 09 月 19 日进行了第二次利润分配，向基金份额持有人每份基金份额派发现金红利 0.029 元，分红总金额为 21,100,717.92 元，收益基准日为 2017 年 09 月 06 日，每份基金份额可供分配利润为 0.0293；本基金于 2017 年 12 月 26 日进行了第三次利润分配，向基金份额持有人每份基金份额派发现金红利 0.016 元，分红总金额为 10,260,559.75 元，收益基准日为 2017 年 12 月 11 日，每份基金份额可供分配利润为 0.0165，本年分红符合基金合同的相关规定。

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

本报告期内，本基金托管人在对中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金的管理人——中银基金管理有限公司在中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了 3 次利润分配，分配金额为 49,551,551.60 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中银基金管理有限公司编制和披露的中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师徐艳 许培菁签字出具了安永华明（2018）审字第 61062100_B41 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表**7.1 资产负债表**

会计主体：中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | - | - |
| 银行存款 | 4,214,065.33 | 18,103,150.57 |
| 结算备付金 | 12,337,077.18 | 20,045,102.93 |
| 存出保证金 | 29,826.23 | 24,636.78 |
| 交易性金融资产 | 743,146,608.50 | 882,961,758.01 |
| 其中：股票投资 | 123,904,658.00 | 120,440,253.01 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 619,241,950.50 | 762,521,505.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 10,653,429.23 | 12,098,704.17 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 770,381,006.47 | 933,233,352.46 |
| | | |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2017 年 12 月 31 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 | 130,000,000.00 | 185,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - |

| | | |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - |
| 应付托管费 | 110,233.54 | 127,455.34 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 60,470.79 | 22,050.90 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 137,266.09 | 78,702.09 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 229,000.00 | 69,000.00 |
| 负债合计 | 130,536,970.42 | 185,297,208.33 |
| 所有者权益： | - | - |
| 实收基金 | 641,284,981.32 | 727,610,969.49 |
| 未分配利润 | -1,440,945.27 | 20,325,174.64 |
| 所有者权益合计 | 639,844,036.05 | 747,936,144.13 |
| 负债和所有者权益总计 | 770,381,006.47 | 933,233,352.46 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.998 元，基金份额总额 641,284,981.32 份。

7.2 利润表

会计主体：中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
|---------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 一、收入 | 42,048,014.58 | 21,754,262.41 |
| 1.利息收入 | 35,497,263.79 | 43,810,887.21 |
| 其中：存款利息收入 | 289,664.56 | 456,175.60 |
| 债券利息收入 | 35,184,355.39 | 43,350,542.29 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 23,243.84 | 4,169.32 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 15,932,767.12 | 11,681,364.77 |
| 其中：股票投资收益 | 13,488,492.47 | -4,711,657.45 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -28,531.26 | 13,950,335.86 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 2,472,805.91 | 2,442,686.36 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填 | -9,382,046.16 | -33,737,989.57 |

| | | |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| 列) | | |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 29.83 | - |
| 减：二、费用 | 12,674,189.59 | 17,445,875.02 |
| 1. 管理人报酬 | 4,966,357.75 | 8,482,292.57 |
| 2. 托管费 | 1,441,484.51 | 1,787,948.83 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 299,402.88 | 542,101.32 |
| 5. 利息支出 | 5,565,693.09 | 6,221,564.26 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 5,565,693.09 | 6,221,564.26 |
| 6. 其他费用 | 401,251.36 | 411,968.04 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 29,373,824.99 | 4,308,387.39 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 29,373,824.99 | 4,308,387.39 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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） | 727,610,969.49 | 20,325,174.64 | 747,936,144.13 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 29,373,824.99 | 29,373,824.99 |
| 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） | -86,325,988.17 | -1,588,393.30 | -87,914,381.47 |
| 其中：1.基金申购款 | 49,231,546.92 | 836,966.60 | 50,068,513.52 |
| 2.基金赎回款 | -135,557,535.09 | -2,425,359.90 | -137,982,894.99 |
| 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） | - | -49,551,551.60 | -49,551,551.60 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 641,284,981.32 | -1,440,945.27 | 639,844,036.05 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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) | 898,332,139.55 | 85,200,568.85 | 983,532,708.40 |
| 二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润) | - | 4,308,387.39 | 4,308,387.39 |
| 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) | -170,721,170.06 | -11,422,167.64 | -182,143,337.70 |
| 其中：1.基金申购款 | 16,135,883.30 | 1,078,134.54 | 17,214,017.84 |
| 2.基金赎回款 | -186,857,053.36 | -12,500,302.18 | -199,357,355.54 |
| 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) | - | -57,761,613.96 | -57,761,613.96 |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 727,610,969.49 | 20,325,174.64 | 747,936,144.13 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1500 号文《关于核准中银产业债一年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》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 9 月 4 日正式生效。首次设立募集规模为 2,160,065,905.21 基金份额。本基金为契约型上市开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、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、可转换债券(含分离交易可转债)、债券回购、银行存款、货币市场工具等, 以及股票、权证等权益类品种和法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具, 但须符合中国证监会的相关规定。

本基金的业绩比较基准为: 1 年期定期存款利率(税后)+1%。每个封闭期首日, 1 年期定期存款利率根据当日中国人民银行公布并执行的利率水平调整。

7.4.2 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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 2 号《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>》及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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 增值税

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有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|-------------------|
| 中银基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(“工商银行”) | 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 |
| 中银国际证券有限责任公司(“中银证券”) | 受中国银行重大影响 |

| | |
|-----------------|-------------|
| 贝莱德投资管理（英国）有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 中银资产管理有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年 12月31日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,966,357.75 | 8,482,292.57 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 236,994.02 | 943,460.78 |

注：本基金在封闭期内不计提管理费，在每个开放期首日对管理费进行一次性计提并支付管理费的计算方法如下：

$$H = E \times m \div 365 \times \text{第 } N \text{ 个业绩考核周期实际天数}$$

其中，

H 为在第 N 个开放期首日应计提的基金管理费

E 为第 N 个封闭期最后一日的基金资产净值（未扣除管理费）

m 为第 N 个封闭期适用的基金管理费率。

本基金收取浮动年管理费，即本基金管理费的适用费率（m）是根据业绩考核周期内的基金份额净值增长率（R）和一年期定期存款基准利率（r）的大小来决定的。

| 基金份额净值增长率(R) | 管理费率(m) |
|----------------------------|----------------------------|
| $R \leq (r+1\%)$ | 0.20% |
| $(r+1\%) < R \leq (r+2\%)$ | $0.4 * R - 0.2\% - 0.4r$ |
| $(r+2\%) < R \leq (r+4\%)$ | $0.15 * R + 0.3\% - 0.15r$ |
| $R > (r+4\%)$ | 0.90% |

其中， $R = (NAV1 + \Sigma D) / NAV0 - 1$

NAV1 为第 N 个封闭期最后一日的未扣除管理费的基金份额净值；NAV0

为第 N-1 个开放期最后一日的基金份额净值（若 N=1，则 NAV0=1.000）；ΣD

为以第 N 个业绩考核周期内的任一日为除息日的份额红利的总和；R 的计算，

保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。本基金的业绩考核周期为自每个封闭期首日起（包括该日）至该封闭期最后一日（包括该日）的期间。

7.4.8.2.2 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12月31日 | 2016年1月1日至2016年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,441,484.51 | 1,787,948.83 |

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期 | | | | | | |
|-----------------------|---------------|------|-------|------|-------|------|
| 2017年1月1日至2017年12月31日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| - | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 | | | | | | |
| 2016年1月1日至2016年12月31日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 工商银行 | 51,133,604.10 | - | - | - | - | - |

注：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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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12月31日 | | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日 | |
|--------------|-----------------------------|-----------|----------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行- 活期存款 | 4,214,065.33 | 91,557.90 | 18,103,150.57 | 134,076.85 |
| 中国工商银行- 定期存款 | - | - | - | - |
| 合计 | 4,214,065.33 | 91,557.90 | 18,103,150.57 | 134,076.85 |

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2017 年度获得的利息收入为人民币 196,850.29 元(2016 年：人民币 320,146.48 元)，2017 年末结算备付金余额为人民币 12,337,077.18 元(2016 年末：人民币 20,045,102.93 元)。

7.4.8.6 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均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.9.1.1 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 |
| 002466 | 天齐锂业 | 2017-12-26 | 2018-01-03 | 配股受限 | 11.06 | 53.21 | 11,700 | 129,402.00 | 622,557.00 | - |
| 7.4.9.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 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 |
| 110041 | 蒙电转债 | 2017-12-26 | 2018-01-09 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 7,990 | 799,000.00 | 799,000.00 | - |

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所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 130,000,000.00 元，其中人民币 5,000,000.00 元于 2018 年 01 月 02 日到期，人民币 125,000,000.00 元于 2017 年 01 月 04 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 136,547,020.90 元，属于第二层次的余额为人民币 606,599,587.60 元，无划分为第三层次余额（于 2016 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 119,736,451.31 元，属于第二层次的余额为人民币 763,225,306.70 元，无划分为第三层次余额）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期及上年度可比期间未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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 | 123,904,658.00 | 16.08 |
| | 其中：股票 | 123,904,658.00 | 16.08 |
| 2 | 固定收益投资 | 619,241,950.50 | 80.38 |
| | 其中：债券 | 619,241,950.50 | 80.38 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 16,551,142.51 | 2.15 |
| 7 | 其他各项资产 | 10,683,255.46 | 1.39 |
| 8 | 合计 | 770,381,006.47 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 49,482,347.68 | 7.73 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 1,082,400.00 | 0.17 |
| F | 批发和零售业 | 763,000.00 | 0.12 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 72,576,910.32 | 11.34 |
| 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 | - | - |
| 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 | 123,904,658.00 | 19.36 |

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 601318 | 中国平安 | 356,088 | 24,919,038.24 | 3.89 |
| 2 | 601211 | 国泰君安 | 607,950 | 11,259,234.00 | 1.76 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 570,000 | 10,317,000.00 | 1.61 |
| 4 | 600219 | 南山铝业 | 2,170,000 | 7,985,600.00 | 1.25 |
| 5 | 002557 | 洽洽食品 | 477,029 | 7,532,287.91 | 1.18 |
| 6 | 000538 | 云南白药 | 70,511 | 7,177,314.69 | 1.12 |
| 7 | 000060 | 中金岭南 | 585,024 | 6,534,718.08 | 1.02 |
| 8 | 600837 | 海通证券 | 456,571 | 5,876,068.77 | 0.92 |
| 9 | 601328 | 交通银行 | 850,000 | 5,278,500.00 | 0.82 |
| 10 | 002466 | 天齐锂业 | 89,700 | 4,772,937.00 | 0.75 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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 | 601328 | 交通银行 | 13,424,000.00 | 1.79 |
| 2 | 600219 | 南山铝业 | 11,885,700.00 | 1.59 |
| 3 | 601211 | 国泰君安 | 8,945,411.00 | 1.20 |
| 4 | 601939 | 建设银行 | 7,616,000.00 | 1.02 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 7,396,800.00 | 0.99 |
| 6 | 002466 | 天齐锂业 | 5,505,834.67 | 0.74 |
| 7 | 600837 | 海通证券 | 5,160,078.00 | 0.69 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 4,321,000.00 | 0.58 |
| 9 | 300146 | 汤臣倍健 | 3,867,100.00 | 0.52 |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 2,675,100.00 | 0.36 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 11 | 600820 | 隧道股份 | 2,001,800.00 | 0.27 |
| 12 | 000538 | 云南白药 | 1,523,000.00 | 0.20 |
| 13 | 002557 | 洽洽食品 | 1,483,316.00 | 0.20 |
| 14 | 601288 | 农业银行 | 1,472,000.00 | 0.20 |
| 15 | 600535 | 天士力 | 1,214,100.00 | 0.16 |
| 16 | 601668 | 中国建筑 | 1,131,600.00 | 0.15 |
| 17 | 000807 | 云铝股份 | 1,109,199.00 | 0.15 |
| 18 | 000783 | 长江证券 | 1,082,430.00 | 0.14 |
| 19 | 600036 | 招商银行 | 1,052,800.00 | 0.14 |
| 20 | 601888 | 中国国旅 | 1,029,185.22 | 0.14 |

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。

8.4.2 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 | 601318 | 中国平安 | 11,850,710.00 | 1.58 |
| 2 | 601328 | 交通银行 | 8,127,966.00 | 1.09 |
| 3 | 600219 | 南山铝业 | 6,978,000.00 | 0.93 |
| 4 | 601939 | 建设银行 | 6,501,000.00 | 0.87 |
| 5 | 601211 | 国泰君安 | 5,363,500.00 | 0.72 |
| 6 | 000060 | 中金岭南 | 4,490,200.00 | 0.60 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 3,799,840.00 | 0.51 |
| 8 | 600009 | 上海机场 | 3,763,440.10 | 0.50 |
| 9 | 601225 | 陕西煤业 | 3,629,550.00 | 0.49 |
| 10 | 601169 | 北京银行 | 3,628,779.60 | 0.49 |
| 11 | 000783 | 长江证券 | 3,574,727.75 | 0.48 |
| 12 | 601888 | 中国国旅 | 3,570,764.56 | 0.48 |
| 13 | 601336 | 新华保险 | 3,570,312.00 | 0.48 |
| 14 | 000538 | 云南白药 | 3,115,080.00 | 0.42 |
| 15 | 002078 | 太阳纸业 | 2,928,200.00 | 0.39 |
| 16 | 600019 | 宝钢股份 | 2,635,634.60 | 0.35 |
| 17 | 600837 | 海通证券 | 2,617,200.00 | 0.35 |
| 18 | 600900 | 长江电力 | 2,250,000.00 | 0.30 |
| 19 | 601166 | 兴业银行 | 2,116,250.00 | 0.28 |
| 20 | 002594 | 比亚迪 | 2,063,550.00 | 0.28 |

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。

8.4.3 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 | 85,848,853.89 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 104,441,854.42 |

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。

8.5 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 | 1,341,900.00 | 0.21 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 18,668,000.00 | 2.92 |
| | 其中：政策性金融债 | 18,668,000.00 | 2.92 |
| 4 | 企业债券 | 267,113,130.60 | 41.75 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,138,000.00 | 4.71 |
| 6 | 中期票据 | 287,917,000.00 | 45.00 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 14,063,919.90 | 2.20 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 619,241,950.50 | 96.78 |

8.6 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 | 101456059 | 14 云能投 MTN003 | 500,000 | 50,375,000.00 | 7.87 |
| 2 | 101453022 | 14 五矿股 MTN001 | 500,000 | 49,820,000.00 | 7.79 |
| 3 | 101460037 | 14 宝鸡钛业 MTN001 | 500,000 | 49,380,000.00 | 7.72 |
| 4 | 101355009 | 13 中铝业 MTN001 | 400,000 | 40,176,000.00 | 6.28 |
| 5 | 011763009 | 17 首钢 SCP007 | 300,000 | 30,138,000.00 | 4.71 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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 | 29,826.23 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 10,653,429.23 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,683,255.46 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值 |
|----|------|------|------|---------|
|----|------|------|------|---------|

| | | | | 比例(%) |
|---|--------|----------|--------------|-------|
| 1 | 113011 | 光大转债 | 5,739,306.30 | 0.90 |
| 2 | 132003 | 15 清控 EB | 747,978.50 | 0.12 |
| 3 | 110031 | 航信转债 | 576,868.00 | 0.09 |
| 4 | 113008 | 电气转债 | 395,120.00 | 0.06 |
| 5 | 127004 | 模塑转债 | 237,226.50 | 0.04 |
| 6 | 128013 | 洪涛转债 | 161,612.50 | 0.03 |
| 7 | 113012 | 骆驼转债 | 75,302.80 | 0.01 |

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|--------------|----------|
| 1 | 002466 | 天齐锂业 | 622,557.00 | 0.10 | 配股未上市 |

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 |
| 699 | 917,432.02 | 583,183,863.33 | 90.9399% | 58,101,117.99 | 9.0601% |

9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例 |
|----|------------------------|---------------|----------|
| 1 | 中银保险有限公司 | 13,328,300.00 | 88.29% |
| 2 | 北大方正人寿保险有限公司-投资连结产品稳健型 | 463,900.00 | 3.07% |
| 3 | 刘玉琼 | 217,400.00 | 1.44% |
| 4 | 朱斌 | 207,700.00 | 1.38% |
| 5 | 谭国财 | 201,073.00 | 1.33% |
| 6 | 谷永军 | 109,400.00 | 0.72% |
| 7 | 肖唯物 | 99,793.00 | 0.66% |
| 8 | 黎蕴妍 | 69,900.00 | 0.46% |
| 9 | 刘剑新 | 50,000.00 | 0.33% |
| 10 | 冯玮 | 33,905.00 | 0.22% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2014年9月4日)基金份额总额 | 2,160,065,905.21 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 727,610,969.49 |
| 本报告期基金总申购份额 | 49,231,546.92 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 135,557,535.09 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 641,284,981.32 |

§11 重大事件揭示**11.1 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。

11.2 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，公司监事赵绘坪先生退休；2017 年第二次股东会以书面形式审议同意章砚女士担任公司第四届董事会董事，并经公司第四届董事会第六次会议审议通过，白志中先生不再担任公司董事长，选举章砚女士担任第四届董事会董事长，详情请参见 2017 年 8 月 30 日刊登的《中银基金管理有限公司关于董事长变更的公告》。

本报告期内，经董事会决议通过杨军先生不再担任副执行总裁，详情请参见 2017 年 9 月 30 日刊登的《中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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，没有涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为基金进行审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 60,000.00 元，目前会计师事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 4 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 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 | |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 1 | 102,737,290.08 | 54.03% | 95,678.94 | 54.30% | - |
| 海通证券 | 1 | 43,934,009.23 | 23.10% | 40,037.11 | 22.72% | - |
| 东方证券 | 1 | 43,490,007.00 | 22.87% | 40,502.46 | 22.98% | - |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

11.7.2 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 |
| 申银万国 | 2,256,933.80 | 28.06% | 20,865,300,000.00 | 74.43% | - | - |
| 海通证券 | 540,600.64 | 6.72% | 489,000,000.00 | 1.74% | - | - |
| 东方证券 | 5,245,963.70 | 65.22% | 6,678,000,000.00 | 23.82% | - | - |

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 2017-12-31 | 500,021,500.00 | - | - | 500,021,500.00 | 77.9718% |
| 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> | | | | | | | |

中银基金管理有限公司

二〇一八年三月三十日