

**中银活期宝货币市场基金**  
**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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	79,781,786,282.62 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	李修滨
	联系电话	021-38834999	4006800000
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	lixubin@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

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	<a href="http://www.bocim.com">http://www.bocim.com</a>
基金年度报告备置地点	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	1,237,776,669.43	288,562,400.24	193,148,117.54
本期利润	1,237,776,669.43	288,562,400.24	193,148,117.54
本期净值收益率	3.7621%	2.7134%	3.9058%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末

期末基金资产净值	79,781,786,282.62	17,314,347,407.67	7,496,724,944.92
期末基金份额净值	1.000	1.000	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，由于货币市场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

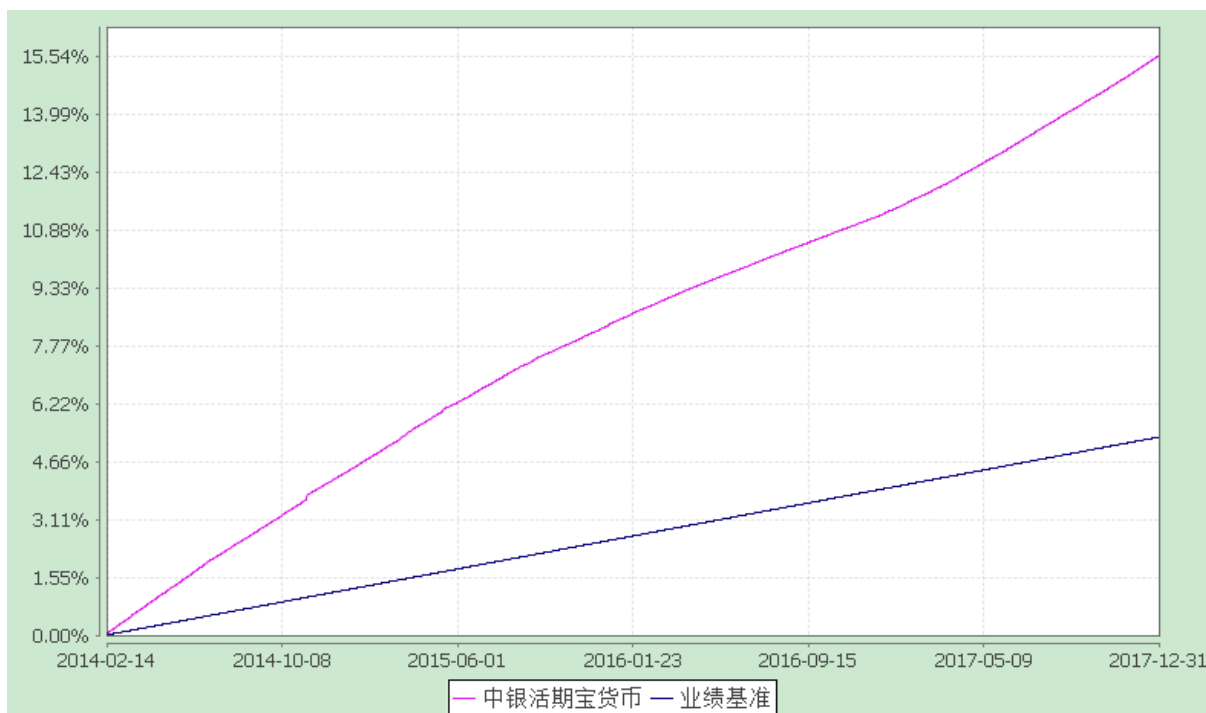
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0212%	0.0005%	0.3450%	0.0000%	0.6762%	0.0005%
过去六个月	2.0059%	0.0005%	0.6900%	0.0000%	1.3159%	0.0005%
过去一年	3.7621%	0.0012%	1.3688%	0.0000%	2.3933%	0.0012%
过去三年	10.7402%	0.0030%	4.1100%	0.0000%	6.6302%	0.0030%
自基金合同生效起至今	15.5459%	0.0039%	5.3138%	0.0000%	10.2321%	0.0039%

#### 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12月31日)

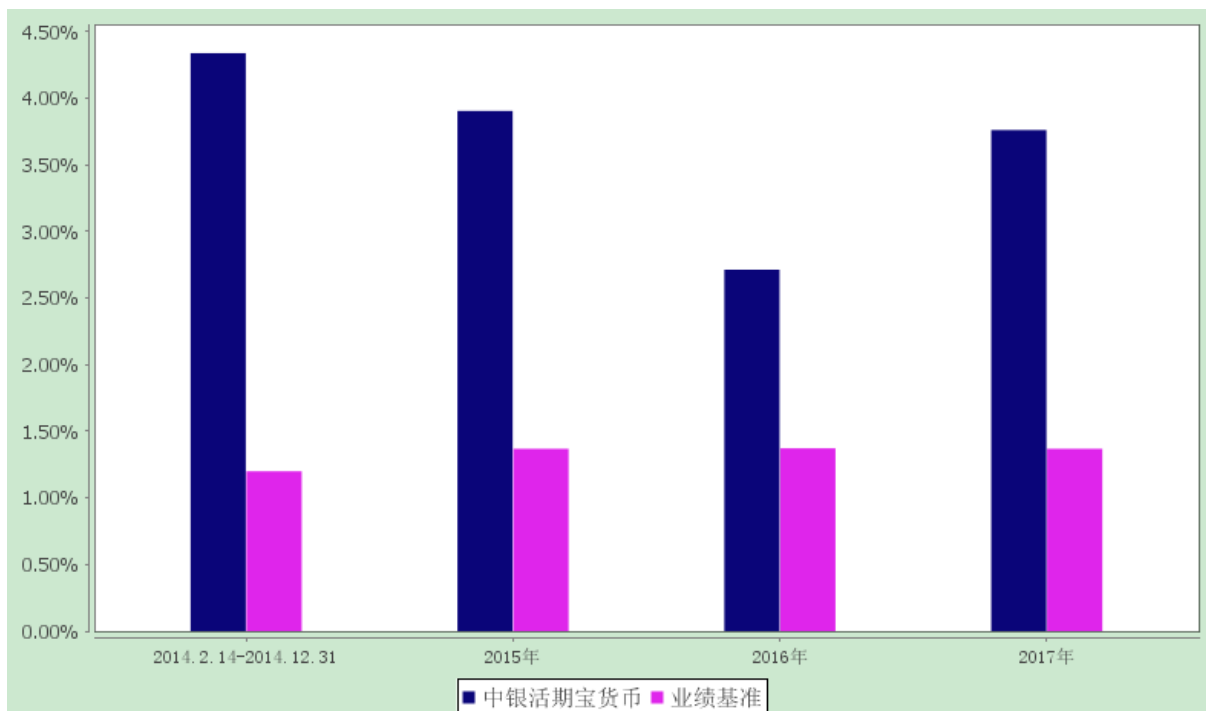


注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制的规定。

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

中银活期宝货币市场基金

自基金合同生效以来基金净值收益率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2014 年 2 月 14 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	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015	193,148,117.54	-	-	193,148,117.54	-
2016	288,562,400.24	-	-	288,562,400.24	-
2017	1,237,776,669.43	-	-	1,237,776,669.43	-
合计	1,719,487,187.21	-	-	1,719,487,187.21	-

## §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		
范静	本基金的基金经理、中银惠利纯债基金	2014-02-14	-	11	中银基金管理有限公司副总裁（VP），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

	基金经理、 中银薪钱 包货币基 金基金经 理			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 月至今担任中银薪钱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%。

## 3. 运行分析

2017 年，在国内金融“去杠杆”的背景下货币政策趋紧。上半年债券市场震荡下跌，下半年，三季度债券市场窄幅震荡，四季度债券市场快速下跌，整体表现不佳。资金面全年来看波动加大，资金利率中枢抬升。本基金加大了对同业存单和存款的配置，积极参与利率波动中交易性机会，保证了在低风险状况下的较好回报。

### 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 3.7621%，同期业绩比较基准收益率为 1.37%。

### 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 2018 年，全球经济进入普遍复苏阶段，美国经济继续温和扩张，通胀预期回升，欧洲日本经济持续复苏，全球主要经济体货币政策逐步正常化。鉴于对当前经济和通胀增速的判断，国内经济基本面下行压力仍客观存在，但宏观政策保持定力，从追求增速向追求质量和效益的方向转变，仍将注重于经济结构调整和金融风险防控，控制宏观杠杆率。积极的财政政策取向不变，重在结构调整，货币政策保持中性，管住货币供给总闸门，保持货币信贷和社会融资规模合理增长，金融监管持续推进。社会融资方面，银监会将重点控制居民杠杆率的过快增长，继续压缩同业投资，严格规范交叉金融产品，推动银行及尽早开始理财业务转型。

综合上述分析，我们对 2018 年债券市场的走势判断保持谨慎乐观。预计 2018 年宏观调控政策

整体保持稳定，双支柱调控框架下金融监管持续推进，货币政策以稳健中性为主，加强监管协调，维护合理稳定的流动性。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。经济基本面有一定下行压力，赤字率下调及地方融资强监管后基建投资可能出现增速下行，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，通胀预期虽有所抬升但整体对债市的压力较低，PPI 持续回落。海外方面，美联储全年预计加息 3 到 4 次，欧央行也存在较大退出量化宽松政策的可能，因此对全球债市形成一定压力。考虑到金融改革的深化和金融监管的趋严，经济基本面存在下行压力，货币政策取向总体中性，但利率债供给压力不小，预计全年债券收益率中枢可能呈震荡下行走势，在出现经济下行、监管放松、供需压力下降、流动性改善等情况时，适当捕捉债券市场的阶段性机会。信用债方面，经济下行叠加去杠杆背景下违约风险事件发生概率较高，需规避信用风险较大的品种。

策略上，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。在做好组合流动性管理的基础上，我们将合理控制组合剩余期限和回购比例，精选个券，积极把握短融、同业存单和存款市场的投资机会，把握票息收入和资本利得，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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中银活期宝货币市场基金 2017 年度的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害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

本托管人认为，中银基金管理有限公司在中银活期宝货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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

本托管人认为，中银基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的中银活期宝货币市场基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现现有损害基金持有人利益的行为。

### §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\_B34 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：中银活期宝货币市场基金

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	25,196,169,914.51	9,475,144,918.36
结算备付金	-	327,300.18
存出保证金	323.01	3,306.78
交易性金融资产	56,487,617,948.62	4,878,139,691.83
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	56,487,617,948.62	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	3,956,962,920.78	1,992,942,027.32
应收证券清算款	-	-
应收利息	228,666,600.47	57,374,578.34
应收股利	-	-
应收申购款	1,171,666,858.67	1,189,825,937.54
递延所得税资产	-	-
其他资产	15,705.26	11,803.49
<b>资产总计</b>	<b>87,041,100,271.32</b>	<b>17,593,769,563.84</b>
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	7,218,249,167.15	272,599,391.10
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	17,101,380.31	3,115,110.38
应付托管费	3,166,922.29	576,872.28
应付销售服务费	15,834,611.39	2,884,361.46
应付交易费用	386,924.65	64,958.60
应交税费	-	-
应付利息	4,425,982.91	112,462.35
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	149,000.00	69,000.00
<b>负债合计</b>	<b>7,259,313,988.70</b>	<b>279,422,156.17</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	79,781,786,282.62	17,314,347,407.67

未分配利润	-	-
<b>所有者权益合计</b>	<b>79,781,786,282.62</b>	<b>17,314,347,407.67</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>87,041,100,271.32</b>	<b>17,593,769,563.84</b>

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 79,781,786,282.62 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

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
<b>一、收入</b>	<b>1,477,453,261.02</b>	<b>373,274,024.66</b>
1.利息收入	1,473,274,329.93	360,377,684.17
其中：存款利息收入	691,786,309.95	219,328,165.91
债券利息收入	717,485,746.75	133,733,866.45
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	64,002,273.23	7,315,651.81
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,161,431.09	12,896,340.49
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,161,431.09	12,896,340.49
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）	17,500.00	-
<b>减：二、费用</b>	<b>239,676,591.59</b>	<b>84,711,624.42</b>
1. 管理人报酬	86,132,710.33	29,258,060.39
2. 托管费	15,950,501.96	5,418,159.23
3. 销售服务费	79,752,509.57	27,090,796.58
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	57,481,296.26	22,657,442.12
其中：卖出回购金融资产支出	57,481,296.26	22,657,442.12
6. 其他费用	359,573.47	287,166.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>1,237,776,669.43</b>	<b>288,562,400.24</b>
减：所得税费用	-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,237,776,669.43	288,562,400.24
-------------------	------------------	----------------

## 7.3 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 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）	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）	-	1,237,776,669.43	1,237,776,669.43
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）	62,467,438,874.95	-	62,467,438,874.95
其中：1.基金申购款	241,363,935,688.00	-	241,363,935,688.00
2.基金赎回款	-178,896,496,813.05	-	-178,896,496,813.05
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）	-	-1,237,776,669.43	-1,237,776,669.43
五、期末所有者权益（基金净值）	79,781,786,282.62	-	79,781,786,282.62
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）	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）	-	288,562,400.24	288,562,400.24
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）	9,817,622,462.75	-	9,817,622,462.75
其中：1.基金申购款	56,751,106,127.84	-	56,751,106,127.84
2.基金赎回款	-46,933,483,665.09	-	-46,933,483,665.09
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）	-	-288,562,400.24	-288,562,400.24
五、期末所有者权益（基金净值）	17,314,347,407.67	-	17,314,347,407.67

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
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 4.8.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 4.8.1.1 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。

##### 4.8.1.2 关联方报酬

###### 4.8.1.2.1 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	86,132,710.33	29,258,060.39
其中：支付销售机构的客户维护费	82,341,866.56	48,682.44

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

###### 4.8.1.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年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托管费	15,950,501.96	5,418,159.23

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

#### 4.8.1.2.3 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12月31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	52,381,057.34	
中国银行	27,357,893.65	
合计	79,738,950.99	
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12月31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	27,000,643.84	
中国银行	90,152.74	
合计	27,090,796.58	

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

#### 4.8.1.3 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
中信银行	49,507,311.96	-	-	-	-	-
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
中信银行	-	-	-	-	-	-

#### 4.8.1.4 各关联方投资本基金的情况

##### 4.8.1.4.1 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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31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	2,172,189.68
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	-	82,510,539.89
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.48%

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。

#### 4.8.1.4.2 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。

#### 4.8.1.5 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		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	
	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	22,169,914.51	425,055.45	24,144,918.36	281,977.63
中信银行-定期存款	500,000,000.00	43,096,208.23	-	1,946,555.56
合计	522,169,914.51	43,521,263.68	24,144,918.36	2,228,533.19

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 1,424.17 元（2016 年度：人民币 128,541.65 元），2017 年末结算备付金余额为人民币 0.00 元（2016 年末：人民币 327,300.18 元）。

#### 4.8.1.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

中信银行	111708324	17 中信银行 CD324	网下分销	5,000,000	494,574,500.00
中信银行	111708264	17 中信银行 CD264	网下分销	6,000,000	593,463,000.00
中信银行	111708089	17 中信银行 CD089	网下分销	3,000,000	293,201,100.00
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：本基金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。

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

##### 4.8.2.1 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。

##### 4.8.2.2 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。

##### 4.8.2.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 4.8.2.3.1 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 7,218,249,167.15 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
170207	17 国开 07	2018-01-02	99.72	6,820,000	680,059,945.34
111707240	17 招商银行 CD240	2018-01-02	99.04	5,320,000	526,890,648.82
111709480	17 浦发银行 CD480	2018-01-02	99.13	2,240,000	222,048,535.10
111717251	17 光大银行 CD251	2018-01-02	99.73	7,100,000	708,057,763.70
111717263	17 光大银行 CD263	2018-01-02	99.63	4,430,000	441,355,709.27
111718413	17 华夏银行 CD413	2018-01-02	99.43	2,040,000	202,842,121.81
111718458	17 华夏银行 CD458	2018-01-04	97.91	4,600,000	450,392,179.16
111709493	17 浦发银行	2018-01-05	99.05	10,520,000	1,042,014,063.87

	CD493				
111718402	17 华夏银行 CD402	2018-01-05	99.60	5,270,000	524,891,062.78
111770590	17 贵阳银行 CD190	2018-01-08	99.10	770,000	76,304,371.66
111780052	17 广东南粤 银行 CD084	2018-01-08	98.97	1,380,000	136,577,524.18
111786555	17 重庆银行 CD163	2018-01-08	98.65	2,500,000	246,614,696.38
111787665	17 盛京银行 CD324	2018-01-08	99.63	4,740,000	472,262,193.27
111788024	17 华融湘江 银行 CD138	2018-01-08	99.54	6,000,000	597,248,113.28
111717290	17 光大银行 CD290	2018-01-10	98.16	11,970,000	1,174,977,246.13
150414	15 农发 14	2018-01-11	99.65	1,130,000	112,603,361.08
合计				76,830,000.00	7,615,139,535.83

#### 4.8.2.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 4.8.3 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，因其剩余期限不长，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工具中属于第二层次的余额为人民币 56,487,617,948.62 元，无划分为第一层次和第三层次的余额（于 2016 年 12 月 31 日，属于第二层次的余额为人民币 4,878,139,691.83 元，无划分为第一层次和第三层次的余额）。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 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要承诺事项。

#### 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。

## §5 投资组合报告

### 5.1 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	56,487,617,948.62	64.90
	其中：债券	56,487,617,948.62	64.90
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,956,962,920.78	4.55
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	992,259,027.23	1.14
3	银行存款和结算备付金合计	25,196,169,914.51	28.95
4	其他各项资产	1,400,349,487.41	1.61
5	合计	87,041,100,271.32	100.00

### 5.2 债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额		3.82
	其中：买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	7,218,249,167.15	9.05
	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。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	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。

#### 5.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	19.67	9.05
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	17.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	32.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	5.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	31.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	107.34	9.05

#### 5.4 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。

#### 5.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	76,941,187.28	0.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,972,505,252.10	4.98
	其中：政策性金融债	3,972,505,252.10	4.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,349,435,291.79	1.69

6	中期票据	-	-
7	同业存单	51,088,736,217.45	64.04
8	其他	-	-
9	合计	56,487,617,948.62	70.80
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

## 5.6 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	111719410	17 恒丰银行 CD410	40,000,000	3,954,501,985.43	4.96
2	111709493	17 浦发银行 CD493	16,000,000	1,584,812,264.44	1.99
3	111718402	17 华夏银行 CD402	15,000,000	1,493,997,332.38	1.87
4	111718458	17 华夏银行 CD458	15,000,000	1,468,670,149.45	1.84
5	111717251	17 光大银行 CD251	14,000,000	1,396,170,238.29	1.75
6	170207	17 国开 07	13,400,000	1,336,188,162.39	1.67
7	111717290	17 光大银行 CD290	12,000,000	1,177,922,051.26	1.48
8	111787040	17 南京银行 CD161	11,000,000	1,097,004,397.37	1.38
9	111715469	17 民生银行 CD469	11,000,000	1,076,150,761.93	1.35
10	111709512	17 浦发银行 CD512	10,800,000	1,054,816,801.92	1.32

## 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0595%
报告期内偏离度的最低值	-0.0749%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0269%

## 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。

**5.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

**5.9 投资组合报告附注****5.9.1 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。

**5.9.2** 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。

**5.9.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	323.01
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	228,666,600.47
4	应收申购款	1,171,666,858.67
5	其他应收款	-
6	待摊费用	15,705.26
7	其他	-
8	合计	1,400,349,487.41

**5.9.4 其他需说明的重要事项标题**

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。

**§6 基金份额持有人信息****6.1 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
3,547,222	22,491.34	10,836,234,926.54	13.5823%	68,945,551,356.08	86.4177%

**6.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况**

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	6,001,028,591.73	7.52%



2	银行类机构	2,015,307,641.52	2.53%
3	银行类机构	1,001,634,975.46	1.26%
4	券商类机构	1,000,346,935.00	1.25%
5	银行类机构	218,259,186.46	0.27%
6	保险类机构	100,267,100.53	0.13%
7	基金类机构	100,034,693.50	0.13%
8	个人	100,000,000.00	0.13%
9	个人	86,333,235.27	0.11%
10	个人	83,071,342.30	0.10%

### 6.3 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	23,816,160.39	0.0299%

### 6.4 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

## §7 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	241,363,935,688.00
减：本报告期基金总赎回份额	178,896,496,813.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	79,781,786,282.62

## §8 重大事件揭示

### 8.1 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。

### 8.2 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。

### 8.3 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。

### 8.4 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。

### 8.5 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 100,000.00 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。

### 8.6 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。

### 8.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 8.7.1 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	
国金证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-

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：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。

### 8.7.2 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	83,320,490.00	99.62%	40,000,000.00	100.00%	-	-
中金公司	315,890.50	0.38%	-	-	-	-

### 8.8 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

二〇一八年三月三十日