

2018年6月30日  
基金管理人:中银国际证券股份有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:2018年7月19日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会在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、完整性承担责任。

基金托管人:中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定，于2018年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至2018年6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 中银证券保本1号混合

交易代码 002601

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2016年4月29日

报告期末基金份额总额 2,099,520,545.79份

投资目标 本基金在保证本金相对安全的前提下，力争实现基金资产的增值。

投资策略 本基金主要通过投资于股票、债券、货币市场工具等金融工具，结合对宏观经济、行业、公司基本面的深入研究，通过资产配置，力争在保证本金安全的前提下，实现基金资产的增值。

业绩比较基准 3个月期银行定期存款利率(税后)

本基金在保证本金相对安全的前提下，通过股票、债券、货币市场工具等金融工具，结合对宏观经济、行业、公司基本面的深入研究，通过资产配置，力争在保证本金安全的前提下，实现基金资产的增值。

风险收益特征 本基金为保本型基金，属于“中”风险收益特征的基金品种。

本基金在保证本金相对安全的前提下，通过股票、债券、货币市场工具等金融工具，结合对宏观经济、行业、公司基本面的深入研究，通过资产配置，力争在保证本金安全的前提下，实现基金资产的增值。

基金管理人 中银国际证券股份有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

基金保兑人 中国投资担保有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日～2018年6月30日

1.本期已实现收益 794,299.91

2.本期利润 -42,715,659.12

3.期初至报告期期末的累计利润 -0.0181

4.期末基金资产净值 2,119,263,685.32

5.期末基金份额净值 0.0094

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。

2.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将低于所列示的收益。

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日～2018年6月30日

1.本期已实现收益 794,299.91

2.本期利润 -42,715,659.12

3.期初至报告期期末的累计利润 -0.0181

4.期末基金资产净值 2,119,263,685.32

5.期末基金份额净值 0.0094

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。

2.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将低于所列示的收益。

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日～2018年6月30日

1.本期已实现收益 20,464,699.88

2.本期利润 20,351,614.79

3.期初至报告期期末的累计利润 0.0085

4.期末基金资产净值 4,421,220,973.70

5.期末基金份额净值 0.0093

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。

2.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将低于所列示的收益。

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日～2018年6月30日

1.本期已实现收益 20,464,699.88

2.本期利润 595,294.00

3.期初至报告期期末的累计利润 0.0085

4.期末基金资产净值 2,119,263,685.32

5.期末基金份额净值 0.0094

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。

2.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将低于所列示的收益。

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日～2018年6月30日

1.本期已实现收益 20,464,699.88

2.本期利润 595,294.00

3.期初至报告期期末的累计利润 0.0085

4.期末基金资产净值 2,119,263,685.32

5.期末基金份额净值 0.0094

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。

2.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将低于所列示的收益。

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日～2018年6月30日

1.本期已实现收益 20,464,699.88

2.本期利润 595,294.00

3.期初至报告期期末的累计利润 0.0085

4.期末基金资产净值 2,119,263,685.32

5.期末基金份额净值 0.0094

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。

2.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将低于所列示的收益。

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日～2018年6月30日

1.本期已实现收益 20,464,699.88

2.本期利润 595,294.00

3.期初至报告期期末的累计利润 0.0085

4.期末基金资产净值 2,119,263,685.32

5.期末基金份额净值 0.0094

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。

2.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将低于所列示的收益。

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日～2018年6月30日

1.本期已实现收益 20,464,699.88

2.本期利润 595,294.00

3.期初至报告期期末的累计利润 0.0085

4.期末基金资产净值 2,119,263,685.32

5.期末基金份额净值 0.0094

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。

2.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将低于所列示的收益。

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日～2018年6月30日

1.本期已实现收益 20,464,699.88

2.本期利润 595,294.00

3.期初至报告期期末的累计利润 0.0085

4.期末基金资产净值 2,119,263,685.32

5.期末基金份额净值 0.0094

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。

2.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将低于所列示的收益。

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日～2018年6月30日

1.本期已实现收益 20,464,699.88

2.本期利润 595,294.00

3.期初至报告期期末的累计利润 0.0085

4.期末基金资产净值 2,119,263,685.32

5.期末基金份额净值 0.0094

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。

2.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将低于所列示的收益。

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日～2018年6月30日

1.本期已实现收益 20,464,699.88

2.本期利润 595,294.00

3.期初至报告期期末的累计利润 0.0085

4.期末基金资产净值 2,119,263,685.32

5.期末基金份额净值 0.0094

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。

2.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将低于所列示的收益。

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2018年4月1日～2018年6月30日

1.本期已实现收益 20,464,699.88