中银证券安誉债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:中银国际证券股份有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
送出日期:2019年3月28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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期自2018年3月29日起至2018年12月31日止。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中银证券安誉债券	
基金主代码	004956	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2018年3月29日	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	237,035,056.50份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C
下属分级基金的交易代码:	004956	004957
报告期末下属分级基金的份额总额	230,138,171.45份	6,896,885.05份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争获得超过业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金通过类属配置策略、期限结构配置策略、信用债券投资策略、中小企业私募债券投资策略及资产支持证券投资策略,以期获得长期稳定收益。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益和预期风险低于股票型及混合型基金,高于货币市场基金。	
	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C

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		中银国际证券股份有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵向雷	罗菲菲
	联系电话	021-20328000	010-58560666
	电子邮箱	gmkf@bocichina.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		021-61195566,400-620-8888	95568
传真		021-50372474	010-58560798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bocifunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

§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	2018年3月29日(基金合同生效日)-2018年12月31日		2017年		2016年	
	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C
本期已实现收益	44,827,436.61	848,147.92	-	-	-	-
本期利润	45,149,887.44	848,497.09	-	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0273	0.0274	-	-	-	-
本期基金份额净值增长率	2.89%	88.70%	-	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0129	0.8702	-	-	-	-
期末基金资产净值	233,299,710.36	12,909,563.37	-	-	-	-
期末基金份额净值	1.0137	1.8718	-	-	-	-

注:1、本基金合同于2018年3月29日生效,截至本报告期末基金成立未满一年。

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;

3、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;

4、期末可供分配利润是指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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银证券安誉债券A

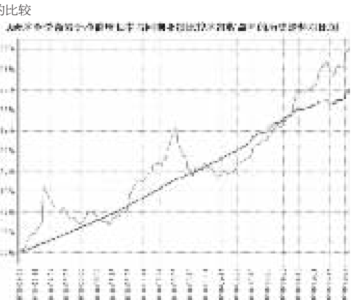
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.00%	0.02%	1.99%	0.05%	-0.99%	-0.03%
过去六个月	2.00%	0.02%	2.57%	0.06%	-0.57%	-0.04%
自基金合同生效起至今	2.89%	0.01%	3.65%	0.07%	-0.76%	-0.06%

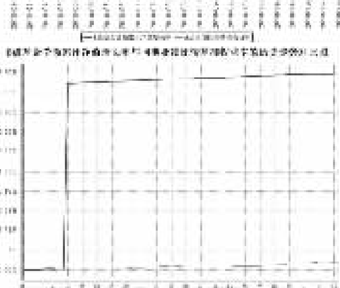
中银证券安誉债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.94%	0.02%	1.99%	0.05%	-1.05%	-0.03%
过去六个月	1.89%	0.02%	2.57%	0.06%	-0.68%	-0.04%
自基金合同生效起至今	88.70%	6.05%	3.65%	0.07%	85.05%	5.98%

注:本基金成立于2018年3月29日,本基金的业绩比较基准=中债综合全价指数收益率。

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

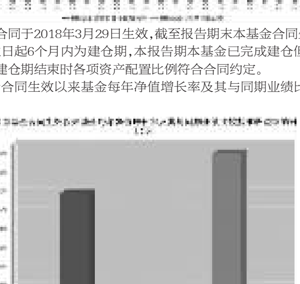




注:1、本基金合同于2018年3月29日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年;

2、自基金成立日起6个月内为建仓期,本报告期本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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



注:合同生效当年按实际存续期计算,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

中银证券安誉债券A					
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
2018	0.1500	36,000,680.91	5,129.92	36,005,810.83	
合计	0.1500	36,000,680.91	5,129.92	36,005,810.83	

单位:人民币元

中银证券安誉债券C					
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
2018	0.1500	107,076.52	5,015.10	112,091.62	
合计	0.1500	107,076.52	5,015.10	112,091.62	

§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

中银国际证券股份有限公司(以下简称"中银国际证券")经中国证监会批准于2002年2月28日在上海成立,注册资本25亿元人民币。股东包括中银国际控股有限公司、中国石油集团资本有限责任公司、上海金融发展投资基金(有限合伙)、云南省投资控股集团有限公司、江西铜业股份有限公司、凯瑞富海实业投资有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司、上海祥众投资合伙企业(有限合伙)、江苏洋河酒厂股份有限公司、上海郝乾企业管理中心(有限合伙)、江西铜业集团财务有限公司、达濠市政建设有限公司、万兴投资发展有限公司。中银国际证券的经营范围包括:证券经纪、证券投资咨询、与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券自营、证券资产管理、证券投资基金代销、融资融券、代销金融产品、公开募集证券投资基金管理业务、为期货公司提供中间介绍业务。截至2018年12月31日,本管理人共管理十六只证券投资基金,包括:中银证券保本1号混合型证券投资基金、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金。中银证券中高等级债券型证券投资基金于2019年1月25日成立。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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		
王玉玺	本基金基金经理	2018年3月29日	-	12	王玉玺,硕士研究生,中国国籍,已取得证券、基金从业资格。2006年7月至2008年7月任职于中国农业银行资金运营部,担任交易员;2008年8月至2016年6月任职于中国农业银行金融市场部,担任交易员、高级交易员;2016年6月加入中银国际证券股份有限公司,历任中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任基金管理部副总经理、中银国际证券中国红债券宝投资主办人、中银证券保本1号混合型证券投资基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债券型证券投资、中银证券瑞丰定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金基金经理。

注:1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期,离任日期为根据公司确定的解聘日期;首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券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遵规守信情况的说明

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》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规,建立了基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法、产品与交易部交易室异常交易监控与报告管理办法等公平交易相关制度体系。

公司基金管理业务、资产管理业务公平交易管理办法所规范的范围涵盖境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时涵盖包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

公平交易的控制方法主要包括:建立科学、制衡的投资决策体系,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,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;严格隔离投资管理职能和交易执行职能,实行包括所有投资品种的集中交易制度,并进行公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司一直严格遵循公平交易相关规章制度,执行严格的公平交易行为。在严格方针指导下,报告期内,公司未出现任何异常关联交易以及与禁止交易对手间的交易行为。

报告期内,公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下(如:1日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易开展交易价差分析。分析结果表明,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,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

今年以来由于去杠杆和金融严监管政策带来的信用紧缩使得基建和地产投资下行、环保政策趋严导致的部分行业去产能以及全球贸易摩擦等原因使得经济基本面逐季下行;央行采取了积极的逆周期调控政策,多次降低存款准备金率,且通过公开市场操作维持货币市场宽松,债市资金面总体充裕;加之权益市场大幅调整,市场避险情绪增加。以上因素对债市形成支撑,利率债和中高等级债券表现良好,但信用风险增加也导致信用事件频发,高低等级债券表现分化。

报告期内,本产品择机买入了利率债和存单;利用资金宽松的市场环境,保持适度的杠杆操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中银证券安誉债券A基金份额净值为1.0137元,本报告期基金份额净值增长率为2.89%;截至本报告期末中银证券安誉债券C基金份额净值为1.8718元,本报告期基金份额净值增长率为88.70%;同期业绩比较基准收益率为3.65%。

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2019年,预计经济基本面仍或将维持弱势:由于居民部门杠杆上升,收入增速放缓,消费增速或稳中有降;随着房企土地购置放缓以及棚改政策力度降低,房地产投资或将下行;随着PPI降低,企业利润或将承压,制造业投资或将高位回落;基建投资或将再次扮演托底经济的角色,增速或将上行,但地方政府债务高企或将制约基建投资力度;预计2019年全球经济有所放缓,中美贸易摩擦或将是一个艰难的博弈过程,净出口仍将对经济形成拖累。但随着央行宽货币宽信用政策以及管理层减税降费等逆周期调控政策效果逐步显现,下半年经济或将边际企稳。预计货币政策仍或将维持宽松,债市资金面仍或将无碍。总体来看,预计2019年上半年债市仍或将较好的表现,下半年或将面临一定压力。与此同时,由于收益率处于历史相对低位,债券长期配置价值有所下降,预计债市波动或将有所增大,且信用风险仍不可小觑。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,设立了中银国际证券股份有限公司估值委员会(以下简称"估值委员会"),制定了估值政策和估值程序。由公司领导担任组长,成员由基金管理部、业务营运部、内控与法律合规部、审计部、风险管理部等部门指派人员组成。估值委员会成员均具有专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力,具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金对本报告期内利润进行的收益分配情况如下:2018年9月1日公告每10份A\C级基金份额派发红利0.15元。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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,中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,不存在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,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有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。

本基金对本报告期内利润进行的收益分配情况如下:2018年9月1日公告每10份A\C级基金份额派发红利0.15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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第21668号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	中银证券安誉债券型证券投资基金全体基金份额持有人	
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了中银证券安誉债券型证券投资基金(以下简称"中银证券安誉债券基金")的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年3月28日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了中银证券安誉债券基金2018年12月31日的财务状况以及2018年3月28日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中银证券安誉债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。	
强调事项	无。	
其他事项	无。	
其他信息	无。	
管理层和治理层对财务报表的责任	中银证券安誉债券基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中银证券安誉债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算中银证券安誉债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督中银证券安誉债券基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对中银证券安誉债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致中银证券安誉债券基金不能持续经营。 (五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张振波	叶尔甸
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼	
审计报告日期	2019年3月27日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:中银证券安誉债券型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	932,308.61	-
结算备付金		-	-
存出保证金		1,957.22	-
交易性金融资产	7.4.7.2	261,781,000.00	-
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		261,781,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	7,971,925.59	-
应收股利		-	-
应收申购款		300.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		270,687,491.42	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		23,958,844.06	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		74,658.76	-
应付管理人报酬		62,802.38	-
应付托管费		20,934.12	-
应付销售服务费		4,030.96	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,030.09	-
应交税费		-	-
应付利息		13,918.32	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	339,999.00	-
负债合计		24,478,217.69	-
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	237,035,056.50	-
未分配利润	7.4.7.10	9,174,217.23	-
所有者权益合计		246,209,273.73	-
负债和所有者权益总计		270,687,491.42	-

注:1.报告截止日2018年12月31日,基金份额总额237,035,056.50份,其中中银证券安誉债券型证券投资基金A类基金份额净值1.0137元,基金份额230,138,171.45份;中银证券安誉债券型证券投资基金C类基金份额净值1.8718元,基金份额6,896,885.05份。

2.本财务报表的实际编制期间为2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体:中银证券安誉债券型证券投资基金

本报告期:2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		53,659,317.97	-
1.利息收入		52,949,118.64	-
其中:存款利息收入	7.4.7.11	44,256,852.71	-
债券利息收入		7,270,308.36	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,421,957.57	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-107,734.68	-
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-107,734.68	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	322,800.00	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	495,134.01	-
减:二、费用		7,660,933.44	-
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	5,706,880.60	-
2.托管费	7.4.10.2.2	1,272,911.63	-
3.销售服务费	7.4.10.2.3	98,100.23	-
4.交易费用	7.4.7.19	3,610.83	-
5.利息支出		182,591.52	-
其中:卖出回购金融资产支出		182,591.52	-
6.税金及附加		-	-
7.其他费用	7.4.7.20	396,838.63	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		45,998,384.53	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		45,998,384.53	-

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中银证券安誉债券型证券投资基金

本报告期:2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018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)	2,600,034,880.40	-	2,600,034,880.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	45,998,384.53	45,998,384.53
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)	-2,362,999,823.90	-706,264.85	-2,363,706,088.75
其中:1.基金申购款	14,479,274.41	11,653,997.16	26,133,271.57
2.基金赎回款	-2,377,479,098.31	-12,360,262.01	-2,389,839,360.32
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)	-	-36,117,902.45	-36,117,902.45
五、期末所有者权益(基金净值)	237,035,056.50	9,174,217.23	246,209,273.73
项目	上年度可比期间 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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

______宁敏______ ______赵向雷______ ____戴景义____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中银证券安誉债券型证券投资基金(以下简称"本基金")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[2017]1124号《关于准予中银证券安誉债券型证券投资基金注册的批复》核准,由中银国际证券股份有限公司(原"中银国际证券有限责任公司",于2017年12月29日更名)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券安誉债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,600,034,866.70元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0229号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中银证券安誉债券型证券投资基金基金合同》于2018年3月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,600,034,880.40份基金份额,其中认购资金利息折合13.70份基金份额。本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称"民生银行")。

根据《中银证券安誉债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时收取赎回费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用,但赎回时收取赎回费,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值和基金份额累计净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银证券安誉债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,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、资产支持证券、次级债、可分离交易债券的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及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。本基金不投资于股票、权证等资产,也不参与新股申购或新股增发,同时本基金不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%;保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人中银国际证券股份有限公司于2019年3月27日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银证券安誉债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的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2018年12月31日的财务状况以及2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益转出的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若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,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。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,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中银国际证券股份有限公司("中银证券")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司("民生银行")	基金托管人
中银国际控股有限公司	基金管理人的股东
中国石油集团资本有限责任公司	基金管理人的股东
上海金融发展投资基金(有限合伙)	基金管理人的股东
云南省投资控股集团有限公司	基金管理人的股东
江西铜业股份有限公司	基金管理人的股东
江西铜业集团财务有限公司	基金管理人的股东
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金管理人股东的控股股东、基金销售机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

7.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中银证券	168,680,844.68	100.00%	-	-

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中银证券	450,000,000.00	100.00%	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

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 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,706,880.60	-
其中:支付销售机构的客户维护费	1,526,522.44	-

注:自2018年3月29日至2018年6月28日,支付基金管理人中银证券的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.60%/ 当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《关于中银证券安誉债券型证券投资基金调整管理费率有关事项的议案》,自2018年6月29日起,支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.30%/ 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,272,911.63	-

注: 支付基金托管行民生银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.10%/ 当年天数。

7.4.8.2.3 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 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C	合计
中银证券	-	74,928.28	74,928.28
中国银行	-	4,063.17	4,063.17
合计	-	78,991.45	78,991.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C	合计
-	-	-	-

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给中银证券,再由中银证券计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.35%。其计算公式为:

日销售服务费=前一日C类基金资产净值 X 约定年费率/ 当年天数。

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

注:本基金本报告期内未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

份额单位:份

项目	本期 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C
基金合同生效日(2018年3月29日)持有的基金份额	299,999,000.00	-
减:期间赎回/卖出总份额	299,999,000.00	-
期末持有的基金份额	0.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C
	-	-

注:基金管理人在本会计期间认购本基金的交易委托中银证券直销办理,适用费率为1,000.00元/笔。

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

注:于本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 2018年3月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
民生银行	932,308.61	256,860.85	-	-

注:本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2018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

注:本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本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 2018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证券款余额23,958,844.06元,是以如下债券作为抵押:

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
111803170	18农业银行CD170	2019年1月2日	97.55	247,000	24,094,850.00
合计				247,000	24,094,850.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法 公允价值计量结果所属的层次,由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决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018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二层次的余额为261,781,000.00元,无属于第一或第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)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应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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(%)
3	固定收益投资	261,781,000.00	96.71
	其中:债券	261,781,000.00	96.71
7	银行存款和结算备付金合计	932,308.61	0.34
8	其他各项资产	7,974,182.81	2.95
9	合计	270,687,491.42	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

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金报告期内未买入股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金报告期内未卖出股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金报告期内未买卖股票。

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(%)
3	金融债券	232,516,000.00	94.44
	其中:政策性金融债	232,516,000.00	94.44
8	同业存单	29,265,000.00	11.89
10	合计	261,781,000.00	106.32

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	180203	18国开03	700,000	72,023,000.00	29.25
2	140318	14进出18	500,000	50,275,000.00	20.42
3	180404	18农发04	500,000	50,125,000.00	20.36
4	180407	18农发07	300,000	30,129,000.00	12.24
5	160412	16农发12	300,000	29,964,000.00	12.17

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

注: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

注: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

注: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国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					0.00
国债期货投资本期收益(元)					0.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					0.00

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内,本基金无股票投资。

8.11.3 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	1,957.22
4	应收利息	7,971,925.59
5	应收申购款	300.00
9	合计	7,974,182.81

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券明细。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中银证券安誉债券A	33	6,973,883.98	229,998,000.00	99.94%	140,171.45	0.06%
中银证券安誉债券C	897	7,688.84	-	0.00%	6,896,885.05	100.00%
合计	930	254,876.40	229,998,000.00	97.03%	7,037,056.50	2.97%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

注:本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中银证券安誉债券A	中银证券安誉债券C
基金合同生效日(2018年3月29日)基金份额总额	2,400,007,076.73	200,027,803.67
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	857,899.51	13,621,374.90
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,170,726,804.79	206,752,293.52
本报告期期末基金份额总额	230,138,171.45	6,896,885.05

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

2018年6月28日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,基金管理人无重大人事变动。

本报告期内,2018年4月19日,基金托管人中国民生银行股份有限公司根据工作需要,任命张庆先生担任本公司资产托管部总经理,主持资产托管部相关工作。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

一、本报告期内,涉及基金管理人的诉讼事项如下:

1、彭阳因不服2017年9月27日武汉市劳动人事争议仲裁委员会作出的关于劳动争议的仲裁结果,诉中银国际证券武汉黄孝河路证券营业部。2018年4月24日,武汉市中级人民法院作出(2018)鄂01民终1836号民事判决书,驳回上诉。

2、上海普鑫投资管理有限公司因正当财产保全权利的实施是否受阻碍争议诉中银国际证券财产损害赔偿纠纷案,该案于2011年开始诉讼程序,2018年3月1日,上海市一中院作出(2018)沪01执复23号执行裁定书,驳回中银国际证券复议申请,执行法院扣划执行加倍债务利息3107409.55元。案件已执行结案。

3、郑宇因指令未接受撤销争议诉中银国际证券武汉黄孝河路证券营业部证券交易合同纠纷案,该案于2017年7月开始诉讼程序。2018年3月28日,武汉市中级人民法院作出"(2018)鄂01民终557号"民事判决书,驳回郑宇上诉请求,维持原判,即驳回原告郑宇的全部诉讼请求。

4、中银国际证券于2018年4月底将股票质押式回购交易违约债务人天津顺航海运有限公司诉至天津市第二中级人民法院。2018年5月,双方已达成调解。

5、中银国际证券股份有限公司因质押式证券回购争议诉刘德群质押式证券回购纠纷案。该案于2018年8月开始诉讼程序。

6、中银国际证券股份有限公司因质押式证券回购争议诉程顺玲、罗志伟质押式证券回购纠纷案。该案于2018年11月开始诉讼程序。目前案件处于一审程序中。

7、中银国际证券股份有限公司因质押式证券回购争议诉上海刚泰投资咨询股份有限公司等质押式证券回购纠纷案。该案于2018年10月开始诉讼程序。目前案件处于一审程序中。

中银国际证券股份有限公司因担保物权争议诉上海刚泰投资咨询股份有限公司实现担保物权案。该案于2018年11月开始诉讼程序。2018年12月25日,上海市浦东新区人民法院作出2018沪0115民特637号民事裁定书。目前案件处于执行程序中。

8、浙江嘉兴高速公路有限责任公司因股权登记争议诉中银国际证券股份有限公司请求变更公司登记纠纷。该案于2018年12月开始诉讼程序。

9、中银国际证券股份有限公司因债券交易争议诉中国华阳经贸集团有限公司公司债券交易纠纷案(代资管计划起诉案件)。相关案件于2018年11月开始诉讼程序。

10、中银国际证券股份有限公司因发行协议争议诉上海云峰(集团)有限公司债务融资工具非公开定向发行协议争议案(代资管计划起诉案件)。该案于2018年6月开始仲裁程序。目前案件处于审理程序中。

二、本报告期内,无涉及基金财产的诉讼事项;

三、本报告期内,无涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本报告期内本基金未有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度应支付给审计机构普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为90,000.00元人民币,其已提供审计服务的连续年限为一年。

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,未有管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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	
中银证券	2	0.00	0.00%	-	-	-

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
中银证券	168,680,844.68	100.00%	450,000,000.00	100.00%	-	-

§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	3	20180329 - 20180925	999,999,000.00	-	999,999,000.00	0.00	0.00%
	2	20180329 - 20181231	999,999,000.00	-	789,999,000.00	210,000,000.00	88.58%
	1	20180329 - 20180926	299,999,000.00	-	299,999,000.00	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过20%的情况,如遇市场行情突变可能存在大额赎回甚至巨额赎回的风险,增加基金管理人的流动性管理压力。同时,基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响,避免单一投资者集中度继续提高,同时将完善流动性风险投资管控机制,加强对基金持有人利益的保护。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

中银国际证券股份有限公司

2019年3月28日