

中银沪深 300 指数增强型证券投资基金
(原中银量化价值混合型证券投资基金转型)

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十一日

§1 重要提示及目录

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。本中期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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 30 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中，2024 年 3 月 20 日起，“中银量化价值混合型证券投资基金”转型为“中银沪深 300 指数增强型证券投资基金”，基金合同及托管协议即日生效。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| §1 重要提示及目录 | 1 |
| §2 基金简介 | 4 |
| 2.1 基金基本情况 | 4 |
| 2.1.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 | 4 |
| 2.1.2 中银量化价值混合型证券投资基金 | 4 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.2.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 | 5 |
| 2.2.2 中银量化价值混合型证券投资基金 | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 | 9 |
| 3.1.1 主要会计数据和财务指标 | 9 |
| 3.1.2 基金净值表现 | 10 |
| 3.2 中银量化价值混合型证券投资基金 | 12 |
| 3.2.1 主要会计数据和财务指标 | 12 |
| 3.2.2 基金净值表现 | 12 |
| §4 管理人报告 | 14 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 15 |
| 4.1.2 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 | 15 |
| 4.1.3 中银量化价值混合型证券投资基金 | 16 |
| §5 托管人报告 | 20 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 20 |
| 6.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 | 21 |
| 6.1.1 资产负债表 | 21 |
| 6.1.2 利润表 | 22 |
| 6.1.3 净资产变动表 | 23 |
| 6.1.4 报表附注 | 24 |
| 6.2 中银量化价值混合型证券投资基金 | 46 |
| 6.2.1 资产负债表 | 46 |
| 6.2.2 利润表 | 48 |
| 6.2.3 净资产变动表 | 49 |
| 6.2.4 报表附注 | 50 |
| §7 投资组合报告 | 75 |
| 7.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 | 75 |
| 7.1.1 期末基金资产组合情况 | 75 |
| 7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 76 |
| 7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 77 |
| 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 82 |
| 7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 84 |
| 7.1.6 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 | 84 |
| 7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 84 |
| 7.1.8 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 | 84 |
| 7.1.9 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 | 84 |
| 7.1.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 84 |

| | |
|---|-----|
| 7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 84 |
| 7.1.12 投资组合报告附注 | 85 |
| 7.2 中银量化价值混合型证券投资基金 | 85 |
| 7.2.1 期末基金资产组合情况 | 85 |
| 7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 86 |
| 7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 87 |
| 7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 92 |
| 7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 93 |
| 7.2.6 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 | 94 |
| 7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 94 |
| 7.2.8 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 | 94 |
| 7.2.9 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 | 94 |
| 7.2.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 94 |
| 7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 94 |
| 7.2.12 投资组合报告附注 | 95 |
| §8 基金份额持有人信息 | 95 |
| 8.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 | 95 |
| 8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 96 |
| 8.1.3 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 | 96 |
| 8.2 中银量化价值混合型证券投资基金 | 97 |
| 8.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 97 |
| 8.2.3 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 | 97 |
| §9 开放式基金份额变动 | 98 |
| 9.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 | 98 |
| 9.2 中银量化价值混合型证券投资基金 | 98 |
| §10 重大事件揭示 | 98 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 105 |
| §12 备查文件目录 | 105 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

| | | |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 基金名称 | 中银沪深300指数增强型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中银沪深300指数增强 | |
| 基金主代码 | 004881 | |
| 交易代码 | 004881 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2024年3月20日 | |
| 基金管理人 | 中银基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 502,106,230.00份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中银沪深 300 指数增强 A | 中银沪深 300 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004881 | 010311 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 289,876,158.85 份 | 212,230,071.15 份 |

2.1.2 中银量化价值混合型证券投资基金

| | | |
|-------------|-----------------|------------|
| 基金名称 | 中银量化价值混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 中银量化价值混合 | |
| 基金主代码 | 004881 | |
| 交易代码 | 004881 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017年11月24日 | |
| 基金管理人 | 中银基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 299,329,771.22份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中银量化价值混合 A | 中银量化价值混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004881 | 010311 |

| | | |
|-----------------|------------------|------------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 178,937,583.46 份 | 120,392,187.76 份 |
|-----------------|------------------|------------------|

2.2 基金产品说明

2.2.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略。力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，通过提请召开临时投资决策委员会，及时对投资组合进行相应调整。</p> <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金为股票指数增强型证券投资基金，为实现有效跟踪标的指数并力争超越标的指数的投资目标，投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或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。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。指数增强量化投资策略主要运用不断迭代的量化模型预测股票超额回报，在力争有效控制组合风险的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股。</p> <p>本基金在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。</p> <p>（三）存托凭证投资策略</p> |

| | |
|--------|--|
| | <p>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</p> <p>（四）债券投资策略</p> <p>在大类资产配置的基础上，本基金将依托基金管理人固定收益团队的研究成果，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略。力争做到保证基金资产的流动性把握债券市场投资机会，实施积极主动的组合管理，精选个券，控制风险，提高基金资产的使用效率和投资收益。</p> <p>（五）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。</p> <p>（六）衍生品投资策略</p> <p>为了更好地实现投资目标，基金还有权投资于股指期货、股票期权、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生工具。</p> <p>基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。</p> <p>基金参与股票期权交易，应当按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的。基金管理人将根据审慎原则，建立期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。</p> <p>基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。</p> <p>（七）融资、转融通证券出借业务投资策略</p> <p>为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。</p> <p>为了更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。</p> <p>本基金可投资港股通标的股票，将面临需承担汇率风险、境外市场风险</p> |

| | |
|--|--|
| | 以及港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |
|--|--|

2.2.2 中银量化价值混合型证券投资基金

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过量化投资模型精选个股，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>本基金建立数量化投资策略投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。</p> <p>本基金的投资策略包括两部分：自上而下的资产配置策略，判断股票市场和债券市场的走势，以指导本基金的大类资产配置；自下而上投资标的的研究，借助量化模型选取低估值同时成长性较好的上市公司股票。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金采用“自上而下”的资产配置方法确定各类资产的配置比例。首先，本基金基于宏观经济情况及证券市场整体走势的前瞻性研究，通过研判股票市场和债券市场相对投资收益的周期性特征开展战略资产配置。其次，本基金将从资金与流动性、市场交易特征和市场结构特征等层面开展战术资产配置，在对证券市场当期的系统性风险及各类资产的预期风险收益进行充分分析的基础上，合理调整股票资产、债券资产和其他金融工具的投资权重，以达到控制风险、增加收益的目的。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金采用“自下而上”的数量化选股策略，在纪律化模型约束下，紧密跟踪策略，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，从而取得较高的收益。</p> <p>本基金基于大量历史数据的实证检验构建量化模型，将超额收益的来源归纳为成长因子、价值因子、动量因子、基本面因子、规模因子和流动性因子等。</p> <p>本基金将依据经济周期、行业周期、市场状态以及投资者情绪等多个层面，定期检验各类因子的有效性以及因子之间的关联度，采用定量的模式挑选有效的因子集合作为量化模型的因子，并依据投资目标，权衡风险与收益特征，构建定量选股模型。模型的使用以及因子的判定方法随着市场的变化根据不同的测试环境以及不同的测试结果进行动态的更新。本基金利用量化模型选取最具投资价值的个股进入本基金的股票投资组合。</p> <p>本基金还将考察对行业及板块有影响的政策制度、对个股有影响的潜在事件等内容，从而对股票投资组合进行优化，在控制风险的前提下追求</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>收益最大化。</p> <p>（三）存托凭证投资策略</p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</p> <p>（四）债券投资策略</p> <p>在大类资产配置的基础上，本基金将依托基金管理人固定收益团队的研究成果，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略。力争做到保证基金资产的流动性把握债券市场投资机会，实施积极主动的组合管理，精选个券，控制风险，提高基金资产的使用效率和投资收益。</p> <p>（五）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。</p> <p>（六）衍生品投资策略</p> <p>在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货、国债期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。 |

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 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 张家文 | 龚小武 |
| | 联系电话 | 021-38848999 | 021-52629999-212056 |
| | 电子邮箱 | clientservice@bocim.com | gongxiaowu@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 021-38834788 400-888-5566 | 95561 |
| 传真 | | 021-68873488 | 021-62159217 |
| 注册地址 | | 上海市银城中路200号中银大厦45层 | 福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦 |
| 办公地址 | | 上海市银城中路200号中银大厦10层、11层、26层、45层 | 上海市浦东新区银城路167号4楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 200120 |
| 法定代表人 | | 章砚 | 吕家进 |

2.5 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.bocim.com |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路 200 号 26 楼 |

2.6 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|---|
| 注册登记机构 | 中银基金管理有限公司 | 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 10 层、11 层、26 层、45 层 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2024 年 3 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日) | |
|-----------------|---------------------------------------|-----------------|
| | 中银沪深 300 指数增强 A | 中银沪深 300 指数增强 C |
| 1.本期已实现收益 | 7,583,986.53 | 5,318,226.83 |
| 2.本期利润 | 360,998.74 | -719,684.21 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0019 | -0.0049 |
| 4.本期加权平均净值利润率 | 0.18% | -0.47% |
| 5.本期基金份额净值增长率 | 0.47% | 0.36% |
| 3.1.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| | 中银沪深 300 指数增强 A | 中银沪深 300 指数增强 C |
| 1.期末可供分配利润 | 16,249,288.82 | 8,446,549.42 |
| 2.期末可供分配基金份额利润 | 0.0561 | 0.0398 |
| 3.期末基金资产净值 | 306,125,447.67 | 220,676,620.57 |
| 4.期末基金份额净值 | 1.0561 | 1.0398 |
| 3.1.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| | 中银沪深 300 指数增强 A | 中银沪深 300 指数增强 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 0.47% | 0.36% |

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要低

于所列数字。

3、本基金由原中银量化价值混合型证券投资基金于 2024 年 3 月 20 日转型而来。

3.1.2 基金净值表现

3.1.2.1 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

中银沪深 300 指数增强 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 |
|-----------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | -1.76% | 0.43% | -3.14% | 0.46% | 1.38% | -0.03% |
| 过去三个月 | 0.13% | 0.65% | -2.03% | 0.72% | 2.16% | -0.07% |
| 自基金合同生效日起 | 0.47% | 0.64% | -3.07% | 0.70% | 3.54% | -0.06% |

中银沪深 300 指数增强 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 |
|-----------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | -1.79% | 0.44% | -3.14% | 0.46% | 1.35% | -0.02% |
| 过去三个月 | 0.04% | 0.65% | -2.03% | 0.72% | 2.07% | -0.07% |
| 自基金合同生效日起 | 0.36% | 0.64% | -3.07% | 0.70% | 3.43% | -0.06% |

3.1.2.2 自基金转型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

中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

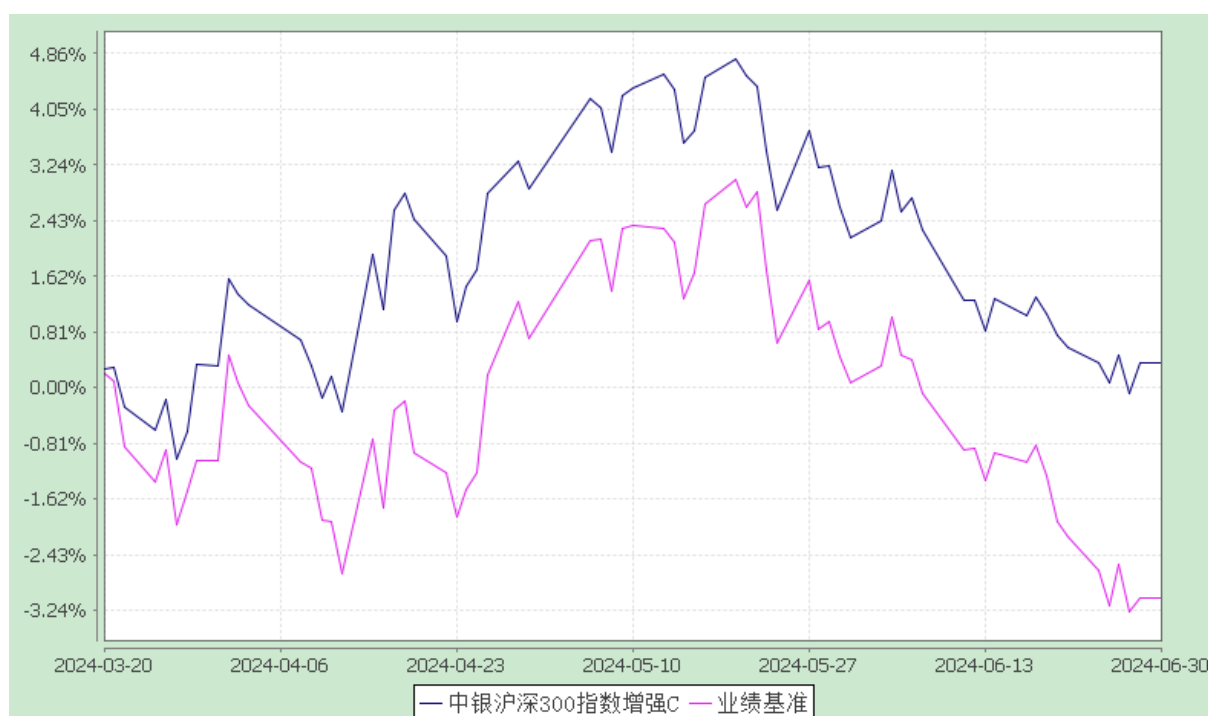
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024 年 3 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日)

中银沪深 300 指数增强 A



中银沪深 300 指数增强 C



注：本基金于 2024 年 3 月 20 日转型为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金。截至报告期末，本基金转型未满一年。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，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

3.2 中银量化价值混合型证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.2.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日) | |
|-----------------|--------------------------------------|----------------|
| | 中银量化价值混合 A | 中银量化价值混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -2,573,476.40 | -477,899.03 |
| 2.本期利润 | 7,975,009.79 | 5,997,207.55 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0455 | 0.0662 |
| 4.本期加权平均净值利润率 | 4.52% | 6.60% |
| 5.本期基金份额净值增长率 | -2.14% | -2.33% |
| 3.2.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 3 月 19 日) | |
| | 中银量化价值混合 A | 中银量化价值混合 C |
| 1.期末可供分配利润 | 8,648,111.66 | 4,020,946.38 |
| 2.期末可供分配基金份额利润 | 0.0483 | 0.0334 |
| 3.期末基金资产净值 | 188,092,115.88 | 124,742,778.41 |
| 4.期末基金份额净值 | 1.0512 | 1.0361 |
| 3.2.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024 年 3 月 19 日) | |
| | 中银量化价值混合 A | 中银量化价值混合 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 15.12% | -18.77% |

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要低于所列数字。

3、本基金于 2024 年 3 月 20 日转型为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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

中银量化价值混合 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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

| | | | | | | |
|---------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去一个月 | 3.69% | 0.73% | 4.16% | 0.68% | -0.47% | 0.05% |
| 过去三个月 | 6.54% | 0.91% | 6.24% | 0.85% | 0.30% | 0.06% |
| 过去六个月 | -2.14% | 0.77% | -2.61% | 0.74% | 0.47% | 0.03% |
| 过去一年 | -4.99% | 0.75% | -7.05% | 0.71% | 2.06% | 0.04% |
| 过去三年 | -20.03% | 0.97% | -22.15% | 0.85% | 2.12% | 0.12% |
| 自基金合同 生效日起 | 15.12% | 1.09% | -6.44% | 0.98% | 21.56% | 0.11% |

中银量化价值混合 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 |
|---------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 3.64% | 0.73% | 4.16% | 0.68% | -0.52% | 0.05% |
| 过去三个月 | 6.43% | 0.91% | 6.24% | 0.85% | 0.19% | 0.06% |
| 过去六个月 | -2.33% | 0.77% | -2.61% | 0.74% | 0.28% | 0.03% |
| 过去一年 | -5.38% | 0.75% | -7.05% | 0.71% | 1.67% | 0.04% |
| 过去三年 | -21.00% | 0.97% | -22.15% | 0.85% | 1.15% | 0.12% |
| 自基金合同 生效日起 | -18.77% | 1.02% | -20.42% | 0.88% | 1.65% | 0.14% |

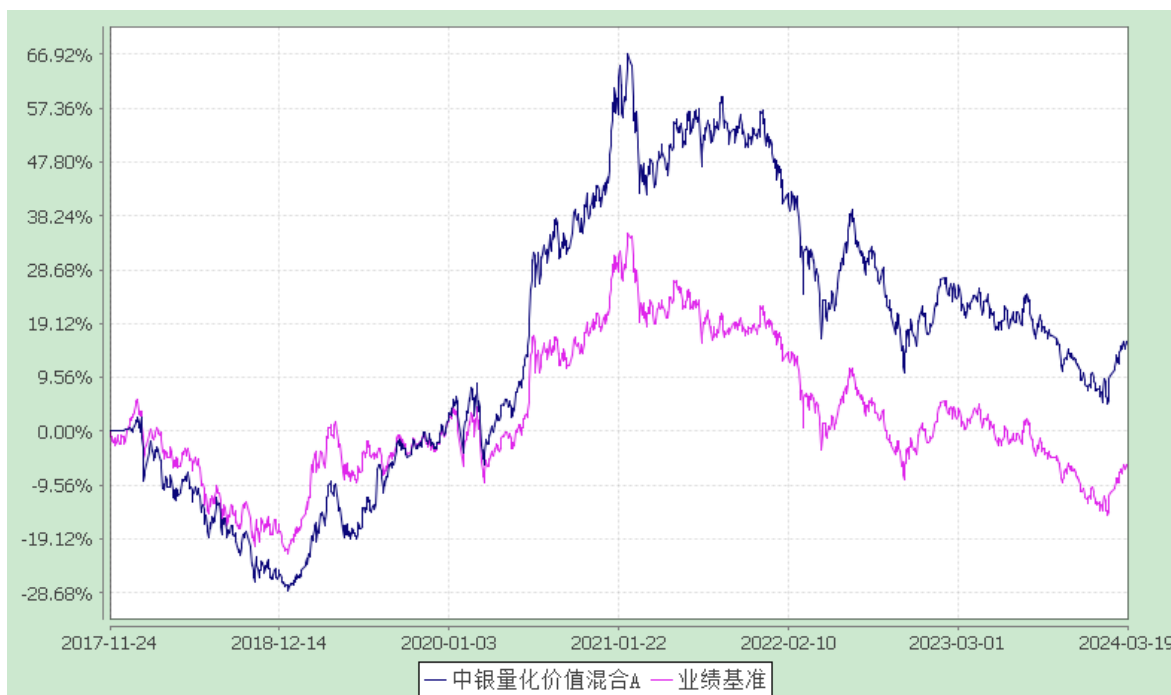
3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银量化价值混合型证券投资基金

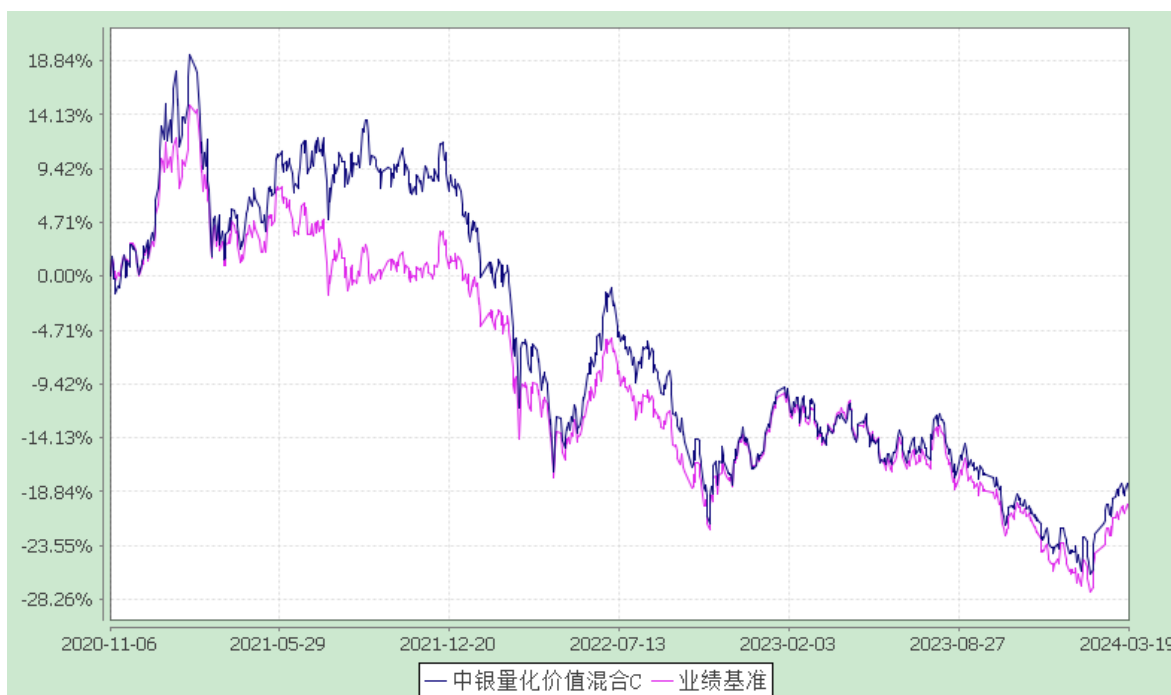
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 11 月 24 日至 2024 年 3 月 19 日)

中银量化价值混合 A



中银量化价值混合 C



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，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中银基金管理有限公司,由中国银行股份有限公司和贝莱德投资管理(英国)有限公司两大全球著名领先金融品牌强强联合组建的中外合资基金管理公司,致力于长期参与中国基金业的发展,努力成为国内领先的基金管理公司。

截至 2024 年 6 月 30 日,本基金管理人共管理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等 153 只开放式证券投资基金,同时管理着多个私募资产管理计划。

4.1.2 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

4.1.2.1 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 | | |
| 赵志华 | 基金经理 | 2017-11-24 | - | 19 | 中银基金管理有限公司助理副总裁(AVP),金融工程博士。曾任华泰证券金融创新部量化投资经理,资产管理总部投资主办。2011 年加入中银基金管理有限公司,曾担任基金经理助理、专户投资经理。2015 年 7 月至 2018 年 2 月任中银优秀企业基金基金经理,2016 年 6 月至 2018 年 2 月任中银腾利基金基金经理,2016 年 11 月至 2019 年 10 月任中银研究精选基金基金经理,2016 年 12 月至今任中银量化精选基金基金经理,2017 年 11 月至今任中银沪深 300 基金(原中银量化价值基金)基金经理,2023 年 7 月至今任中银新回报基金(原中银保本二号)基金经理,2023 年 10 月至今任中银新财富基金基金经理,2023 年 11 月至今任中银 MSCI 中国 A50 基金基金经理,2023 年 12 月至今任中银中证 1000 基金基金经理,2023 年 12 月至今任中银中证 500 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 基金基金经理, 2024 年 6 月至今任中银量化选股基金基金经理。具备基金从业资格。 |
|--|--|--|--|--|---|

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。

4.1.3 中银量化价值混合型证券投资基金

4.1.3.1 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 | | |
| 赵志华 | 基金经理 | 2017-11-24 | - | 19 | 中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），金融工程博士。曾任华泰证券金融创新部量化投资经理，资产管理总部投资主办。2011 年加入中银基金管理有限公司，曾担任基金经理助理、专户投资经理。2015 年 7 月至 2018 年 2 月任中银优秀企业基金基金经理，2016 年 6 月至 2018 年 2 月任中银腾利基金基金经理，2016 年 11 月至 2019 年 10 月任中银研究精选基金基金经理，2016 年 12 月至今任中银量化精选基金基金经理，2017 年 11 月至今任中银沪深 300 基金（原中银量化价值基金）基金经理，2023 年 7 月至今任中银新回报基金（原中银保本二号）基金经理，2023 年 10 月至今任中银新财富基金基金经理，2023 年 11 月至今任中银 MSCI 中国 A50 基金基金经理，2023 年 12 月至今任中银中证 1000 基金基金经理，2023 年 12 月至今任中银中证 500 基金基金经理，2024 年 6 月至今任中银量化选股基金基金经理。具备基金从业资格。 |

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公

司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1.宏观经济分析

国外经济方面，上半年全球发达国家通胀多回落，经济动能在限制性利率水平下趋弱。美国通胀波动回落，经济动能有所减弱，失业率升高，6 月 CPI 同比较 2023 年 12 月回落 0.4 个百分点至 3.0%，6 月制造业 PMI 较 2023 年 12 月抬升 1.4 个百分点至 48.5%，6 月服务业 PMI 较 2023 年 12 月回落 1.7 个百分点至 48.8%，6 月失业率较 2023 年 12 月抬升 0.4 个百分点至 4.1%，美联储在上半年维持政策目标利率在 5.5%高位不变。欧元区经济表现分化，服务业表现依然好于制造业，5 月失业率较 2023 年 12 月回落 0.1 个百分点至 6.0%，6 月制造业 PMI 较 2023 年 12 月回升 1.4 个百分点至 45.8%，6 月服务业 PMI 较 2023 年 12 月抬升 4.0 个百分点至 52.8%，欧央行在 6 月转为降息、当月降息 25bps。日本经济延续复苏不过斜率偏慢，通胀小幅抬升，6 月 CPI 同比较 2023 年 12 月抬升 0.2 个百分点至 2.8%，6 月制造业 PMI 较 2023 年 12 月回升 2.1 个百分点至 50.0%，6 月服务业 PMI 较 2023 年 12 月回落 2.1 个百分点至 49.4%，日本央行退出负利率政策。综合来看，全球经济下半年

仍有一定下行压力，在欧央行开启降息周期后，美联储货币政策也有望转向放松。

国内经济方面，经济内生修复动能仍待提振，国内经济数据边际走弱，出口与制造业韧性较强，基建投资与消费走弱，地产维持负增长，CPI 与 PPI 在低位徘徊。具体来看，上半年领先指标中采制造业 PMI 在荣枯线附近波动，6 月值较 2023 年 12 月值走高 0.5 个百分点至 49.5%，同步指标工业增加值 6 月同比增长 5.3%，较 2023 年 12 月回落 1.5 个百分点。从经济增长动力来看，出口仍有韧性，而投资与消费均走弱：6 月美元计价出口增速较 2023 年 12 月回升 6.5 个百分点至 8.6%，6 月社会消费品零售总额增速较 2023 年 12 月回落 5.4 个百分点至 2.0%，基建投资走弱，制造业投资提振，房地产投资延续负增长，1-6 月固定资产投资增速较 2023 年末回升 0.9 个百分点至 3.9%。通胀方面，CPI 维持在低位，6 月同比增速从 2023 年 12 月的-0.3%小幅提振 0.5 个百分点至 0.2%，PPI 负值收窄，6 月同比增速从 2023 年 12 月的-2.7%回升 1.9 个百分点至-0.8%。

2. 市场回顾

股票市场方面，上半年上证综指下跌 0.25%，中证 100 上涨 1.44%，沪深 300 上涨 0.89%，中证 500 下跌 8.96%，中证 1000 下跌 16.84%，中证 2000 下跌 23.28%，创业板指数下跌 10.99%。上半年行业方面分化较大，中信一级行业银行上涨 19.19%，煤炭上涨 12.79%，石油石化上涨 11.36%，家电上涨 10.77%；与此同时，综合下跌 37.1%，消费者服务下跌 23.82%，计算机下跌 21.62%，商贸零售下跌 21.47%

3. 运行分析

上半年基金严格按照量化指数增强模型运作，较为严格的控制了行业和风格偏离，努力在控制风险的基础上追求超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前（2024.1.1-2024.3.19）：

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 4.24%，同期业绩比较基准收益率为 3.72%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 4.15%，同期业绩比较基准收益率为 3.72%。

转型后（2024.3.20-2024.6.30）：

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 0.47%，同期业绩比较基准收益率为-3.07%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 0.36%，同期业绩比较基准收益率为-3.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球宏观方面，美国方面，内需、住宅地产和大企业是支撑经济韧性的三大支柱，而小企业和中低收入人群则是高利率下的两个脆弱点。预计降息前，经济增速将温和放缓；降息后，积压投资和消费需求释放或助推经济动能较快企稳回升。下半年通胀有望阶段性回落，但年底去通胀进程存在停滞的风险。货币政策方面，三季度末前后为降息关键时间窗口，年内降息幅度可能在 1-2 次。欧洲方面，经济增长动能偏弱，年内或仍有 1-2 次降息，降息刺激下有望延续小幅增长。能源危机阴霾未散，通胀风险未完全解除。日本方面，内外需双挤压下经济增长动能减弱，汇率贬值增加通胀压力。货币政策面临两难，短期或维持不变。在全球央行陆续开启降息周期的背景下，多数新兴市场有望继续保有经济韧性。预计下半年大部分经济体将扩大财政赤字率或者赤字率维持高位，并且进一步放松货币政策。国内宏观方面，随着价格对经济的负面拖累逐渐减弱，下半年名义经济增速将先于实际经济增速企稳，整体经济保持平稳增长。430 政治局会议以来，房地产调控政策发生重大转变，而整体宏观政策思路的转变也将逐渐反应在后续的经济增长上。新老动能共同驱动下制造业投资预计将保持高速增长，同时外需回暖也将助力出口保持韧性，而消费端来看，前瞻指数边际修复、服务型消费及银发经济将成为增长亮点，地产投资方面，在政策驱动下地产链条对经济的负面拖累效应预计也将有所减弱，基建投资来看，中央加杠杆和地方化债背景下基建预计将平稳增长。权益方面，市场总体偏于震荡。经济及盈利保持弱修复态势但缺乏弹性。宏观政策注重固本培元，新国九条体现对资本市场高度重视，国内政策面总体偏暖，但稳增长政策力度明显加码可能性不高。外部美国大选临近地缘风险扰动或明显加大。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，力争为投资人创造应有的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由基金运营、风险管理、研究及投资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。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、基金托管人的相关意见。当改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，会计师事务所应对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发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。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《证券投资基金投资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。

4.6.2 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。

4.6.3 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，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本报告期末 A 类基金份额可供分配利润为 16,249,288.82 元,C 类基金份额可供分配利润为 8,446,549.42 元。本基金本报告期末进行利润分配。

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合规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

6.1.1 资产负债表

会计主体：中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|
| 资产： | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 63,991,111.30 |
| 结算备付金 | | 5,392,750.66 |
| 存出保证金 | | 72,848.21 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 486,426,607.17 |
| 其中：股票投资 | | 486,426,607.17 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | - |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 其他投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - |
| 应收清算款 | | - |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 5,103,646.01 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - |
| 资产总计 | | 560,986,963.35 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付清算款 | | 33,337,435.63 |
| 应付赎回款 | | 27,109.98 |
| 应付管理人报酬 | | 267,906.22 |
| 应付托管费 | | 50,232.41 |
| 应付销售服务费 | | 60,094.92 |
| 应付投资顾问费 | | - |
| 应交税费 | | - |

| | | |
|-------------|---------|----------------|
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 442,115.95 |
| 负债合计 | | 34,184,895.11 |
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 502,106,230.00 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 24,695,838.24 |
| 净资产合计 | | 526,802,068.24 |
| 负债和净资产总计 | | 560,986,963.35 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 502,106,230.00 份，其中 A 类基金份额净值 1.0561 元，基金份额 289,876,158.85 份；C 类基金份额净值 1.0398 元，基金份额 212,230,071.15 份。

6.1.2 利润表

会计主体：中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 3 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|
| 一、营业总收入 | | 810,819.51 |
| 1.利息收入 | | 58,820.67 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 58,820.67 |
| 债券利息收入 | | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 14,003,527.65 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | 9,410,419.04 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 55,000.53 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | -174,845.34 |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | 4,712,953.42 |
| 其他投资收益 | | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | -13,260,898.83 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | 9,370.02 |
| 减：二、营业总支出 | | 1,169,504.98 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.7.16 | 801,170.33 |

| | | |
|---------------------|----------|-------------|
| 2.托管费 | | 150,219.42 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2 | 172,358.16 |
| 4.投资顾问费 | | - |
| 5.利息支出 | 6.4.10.2 | 349.32 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 349.32 |
| 6.信用减值损失 | | - |
| 7.税金及附加 | | 981.43 |
| 8.其他费用 | | 44,426.32 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -358,685.47 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -358,685.47 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | -358,685.47 |

6.1.3 净资产变动表

会计主体：中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 3 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|-------------------------------------|--|----------------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合 收益(若有) | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、本期期初净资产 | 299,329,771.22 | - | 13,505,123.07 | 312,834,894.29 |
| 二、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 202,776,458.78 | - | 11,190,715.17 | 213,967,173.95 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -358,685.47 | -358,685.47 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | 202,776,458.78 | - | 11,549,400.64 | 214,325,859.42 |
| 其中：1.基金申购款 | 216,248,074.50 | - | 12,423,093.01 | 228,671,167.51 |
| 2.基金赎回款 | -13,471,615.72 | - | -873,692.37 | -14,345,308.09 |
| （三）、本期向基金份额持有人分 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---------------------------|----------------|---|---------------|----------------|
| 配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | | | | |
| 四、本期期末净资产 | 502,106,230.00 | - | 24,695,838.24 | 526,802,068.24 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张家文，主管会计工作负责人：陈宇，会计机构负责人：乐妮

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 基金基本情况

中银沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”), 经 2024 年 1 月 29 日中国证券监督管理委员会证监许可（2024）184 号文准予变更注册，由中银量化价值混合型证券投资基金转型而来。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金资产投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、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他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的标的指数为沪深 300 指数。

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2024 年 8 月 30 日批准。

6.1.4.2 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.1.4.3 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自 2024 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 3 月 20 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.1.4.4 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

6.1.4.4.1 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系自 2024 年 3 月 20 日(基金合同生效日)起至 2024 年 6 月 30 日止。

6.1.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

6.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

6.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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。

6.1.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类基金份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

法律法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。

6.1.4.4.12 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.1.4.5.3 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。

6.1.4.6 税项

6.4.6.1 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‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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。

6.4.6.2 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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 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。

6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

6.1.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 63,991,111.30 |

| | |
|----------------|---------------|
| 等于：本金 | 63,986,510.17 |
| 加：应计利息 | 4,601.13 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 63,991,111.30 |

6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|-------|------------------------|------|----------------|---------------|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 491,871,895.63 | - | 486,426,607.17 | -5,445,288.46 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 491,871,895.63 | - | 486,426,607.17 | -5,445,288.46 |

6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.1.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.1.4.7.4 买入返售金融资产

6.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.1.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.1.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 3.29 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 365,035.66 |
| 其中：交易所市场 | 365,035.66 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付信息披露费 | 59,672.34 |
| 应付审计费 | 17,404.66 |
| 合计 | 442,115.95 |

6.1.4.7.7 实收基金

中银沪深300指数增强A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月20日（基金合同生效日）至2024年6月30日 | |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 178,937,583.46 | 178,937,583.46 |
| 本期申购 | 112,134,552.86 | 112,134,552.86 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,195,977.47 | -1,195,977.47 |
| 本期末 | 289,876,158.85 | 289,876,158.85 |

中银沪深300指数增强C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月20日（基金合同生效日）至2024年6月30日 | |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 120,392,187.76 | 120,392,187.76 |
| 本期申购 | 104,113,521.64 | 104,113,521.64 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -12,275,638.25 | -12,275,638.25 |
| 本期末 | 212,230,071.15 | 212,230,071.15 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.1.4.7.8 未分配利润

中银沪深 300 指数增强 A

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初 | 8,648,111.66 | 506,420.76 | 9,154,532.42 |
| 本期利润 | 7,583,986.53 | -7,222,987.79 | 360,998.74 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 9,616,137.07 | -2,882,379.41 | 6,733,757.66 |
| 其中：基金申购款 | 9,705,172.69 | -2,880,955.29 | 6,824,217.40 |
| 基金赎回款 | -89,035.62 | -1,424.12 | -90,459.74 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 25,848,235.26 | -9,598,946.44 | 16,249,288.82 |

中银沪深 300 指数增强 C

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|--------------|
| 本期期初 | 4,020,946.38 | 329,644.27 | 4,350,590.65 |
| 本期利润 | 5,318,226.83 | -6,037,911.04 | -719,684.21 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 6,037,823.53 | -1,222,180.55 | 4,815,642.98 |
| 其中：基金申购款 | 6,644,700.00 | -1,045,824.39 | 5,598,875.61 |
| 基金赎回款 | -606,876.47 | -176,356.16 | -783,232.63 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 15,376,996.74 | -6,930,447.32 | 8,446,549.42 |

6.1.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 3 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入 | 26,860.95 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 31,614.54 |
| 其他 | 345.18 |
| 合计 | 58,820.67 |

6.1.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 3 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------|--|
| 卖出股票成交总额 | 365,115,032.55 |
| 减：卖出股票成本总额 | 355,072,283.43 |

| | |
|----------|--------------|
| 减：交易费用 | 632,330.08 |
| 买卖股票差价收入 | 9,410,419.04 |

6.1.4.7.11 债券投资收益

6.1.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月20日至2024年6月30日 |
|------------------------------|-----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 5,727.53 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 49,273.00 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 55,000.53 |

6.1.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月20日至2024年6月30日 |
|------------------------|-----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 18,294,989.69 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 18,045,253.00 |
| 减：应计利息总额 | 200,463.69 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | 49,273.00 |

6.1.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.1.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.1.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月20日至2024年6月30日 |
|----------|-----------------------------|
| 股指期货投资收益 | -174,845.34 |

6.1.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月20日至2024年6月30日 |
|----|-----------------------------|
|----|-----------------------------|

| | |
|---------------|--------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 4,712,953.42 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 4,712,953.42 |

6.1.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2024年3月20日至2024年6月30日 |
|----------------------------|-----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -13,270,738.83 |
| ——股票投资 | -13,219,611.83 |
| ——债券投资 | -51,127.00 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | 9,840.00 |
| ——权证投资 | - |
| ——期货投资 | 9,840.00 |
| 4.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税 | - |
| 合计 | -13,260,898.83 |

6.1.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月20日至2024年6月30日 |
|---------|-----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 7,850.48 |
| 基金转换费收入 | 1,519.54 |
| 合计 | 9,370.02 |

6.1.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月20日至2024年6月30日 |
|---------|-----------------------------|
| 审计费用 | 9,849.89 |
| 信息披露费 | 33,770.61 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 805.82 |
| 合计 | 44,426.32 |

6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.1.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.1.4.8.2 资产负债表日后事项

为了更好地满足投资者投资理财需求、进一步提高产品的竞争力，本基金管理人根据相关法律法规、基金合同和招募说明书约定，经与本基金的基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，中银沪深 300 指数增强型证券投资基金自 2024 年 7 月 12 日起增加 E 类基金份额，同时相应修改《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》。

截至财务报表批准日，除上述增设基金份额事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.1.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.1.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|---------------------|
| 中银基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司(“兴业银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 基金管理人的控股股东、基金销售机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行交易。

6.1.4.10.2 关联方报酬

6.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月20日至2024年6月30日 |
|------------------|-----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 801,170.33 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 33,887.74 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 767,282.59 |

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数

6.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月20日至2024年6月30日 |
|----------------|-----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 150,219.42 |

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

6.1.4.10.2.3 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2024年3月20日至2024年6月30日 | | |
|----------------|-------------------------|-----------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中银沪深 300 指数增强 A | 中银沪深 300 指数增强 C | 合计 |
| 中国银行 | - | 1,388.92 | 1,388.92 |
| 中银基金管理有限公司 | - | 155,403.48 | 155,403.48 |
| 合计 | - | 156,792.40 | 156,792.40 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中银基金，再由中银基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

6.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.1.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.1.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.1.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.1.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.1.4.10.5.1 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内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.1.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.1.4.10.6 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 | |
|------------|-----------------------|-----------|
| | 2024年3月20日至2024年6月30日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 兴业银行股份有限公司 | 63,991,111.30 | 26,860.95 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.1.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.1.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.1.4.10.8.1 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。

6.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.1.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.12.1 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

| 6.1.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|------------------------|------|------------|------|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 603285 | 键邦股份 | 2024-06-28 | 1个月内 | 新股未上市 | 18.65 | 18.65 | 1,287 | 24,002.55 | 24,002.55 | - |
| 603350 | 安乃达 | 2024-06-26 | 1个月内 | 新股未上市 | 20.56 | 20.56 | 1,051 | 21,608.56 | 21,608.56 | - |
| 688692 | 达梦数据 | 2024-06-04 | 6个月 | 新股锁定期内 | 86.96 | 174.93 | 112 | 9,739.52 | 19,592.16 | - |
| 301536 | 星辰科技 | 2024-03-20 | 6个月 | 新股锁定期内 | 16.16 | 32.27 | 481 | 7,772.96 | 15,521.87 | - |
| 301538 | 骏鼎达 | 2024-03-13 | 6个月 | 新股锁定 | 39.82 | 91.24 | 150 | 5,972.74 | 13,686.00 | - |

| | | | | 期内 | | | | | | |
|--------|------|------------|------|----------------|-------|-------|-----|----------|-----------|---|
| 301565 | 中仑新材 | 2024-06-13 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 11.88 | 18.98 | 711 | 8,446.68 | 13,494.78 | - |
| 301580 | 爱迪特 | 2024-06-19 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 44.95 | 65.93 | 202 | 9,079.90 | 13,317.86 | - |
| 688709 | 成都华微 | 2024-01-31 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 15.69 | 18.79 | 422 | 6,621.18 | 7,929.38 | - |
| 301587 | 中瑞股份 | 2024-03-27 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 21.73 | 25.26 | 306 | 6,649.38 | 7,729.56 | - |
| 001389 | 广合科技 | 2024-03-26 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 17.43 | 34.56 | 222 | 3,869.46 | 7,672.32 | - |
| 688695 | 中创股份 | 2024-03-06 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 22.43 | 31.55 | 186 | 4,171.98 | 5,868.30 | - |
| 603341 | 龙旗科技 | 2024-02-23 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 26.00 | 37.49 | 135 | 3,510.00 | 5,061.15 | - |
| 601033 | 永兴股份 | 2024-01-11 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 16.20 | 15.96 | 266 | 4,309.20 | 4,245.36 | - |
| 603344 | 星德胜 | 2024-03-13 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 19.18 | 22.66 | 179 | 3,433.22 | 4,056.14 | - |
| 603381 | 永臻股份 | 2024-06-19 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 23.35 | 25.13 | 156 | 3,642.60 | 3,920.28 | - |
| 001359 | 平安电工 | 2024-03-19 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 17.39 | 20.60 | 184 | 3,199.76 | 3,790.40 | - |
| 603082 | 北自科技 | 2024-01-23 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 21.28 | 29.49 | 101 | 2,149.28 | 2,978.49 | - |
| 603375 | 盛景微 | 2024-01-17 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 38.18 | 38.90 | 59 | 2,252.62 | 2,295.10 | - |
| 603325 | 博隆技术 | 2024-01-03 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 72.46 | 68.06 | 32 | 2,318.72 | 2,177.92 | - |
| 603312 | 西典 | 2024-01-04 | 6 个月 | 新股 | 29.02 | 25.36 | 69 | 2,002.38 | 1,749.84 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--|----|--|--|----------|--|--|--|--|--|--|
| | 新能 | | | 锁定 期内 | | | | | | |
|--|----|--|--|----------|--|--|--|--|--|--|

6.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 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。

6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.1.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.1.4.13 金融工具风险及管理

6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险管理与内部控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理与内部控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.1.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.1.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.1.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|---------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 63,991,111.30 | - | - | - | 63,991,111.30 |
| 结算备付金 | 5,392,750.66 | - | - | - | 5,392,750.66 |
| 存出保证金 | 72,848.21 | - | - | - | 72,848.21 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 486,426,607.17 | 486,426,607.17 |
| 应收申购款 | 1,199.86 | - | - | 5,102,446.15 | 5,103,646.01 |
| 资产总计 | 69,457,910.03 | - | - | 491,529,053.32 | 560,986,963.35 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 33,337,435.63 | 33,337,435.63 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 27,109.98 | 27,109.98 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 267,906.22 | 267,906.22 |
| 应付托管费 | - | - | - | 50,232.41 | 50,232.41 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 60,094.92 | 60,094.92 |
| 其他负债 | - | - | - | 442,115.95 | 442,115.95 |
| 负债总计 | - | - | - | 34,184,895.11 | 34,184,895.11 |
| 利率敏感度缺口 | 69,457,910.03 | - | - | 457,344,158.21 | 526,802,068.24 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.1.4.13.4.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金净资产的比例低于 10%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

6.1.4.13.4.3 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金

的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.1.4.13.4.4 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.1.4.13.4.4.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|------------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | 486,426,607.17 | 92.34 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 486,426,607.17 | 92.34 |

6.1.4.13.4.5 其他价格风险的敏感性分析

| | | |
|----|--|---------------------------------|
| 假设 | 1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。 | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） |
| | | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
| | 1. 业绩比较基准上升 5% | 27,162,742.48 |
| | 2. 业绩比较基准下降 5% | -27,162,742.48 |

6.1.4.14 公允价值

6.1.4.14.1 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。

6.1.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.1.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次 | 486,245,909.15 |
| 第二层次 | 45,611.11 |
| 第三层次 | 135,086.91 |
| 合计 | 486,426,607.17 |

6.1.4.14.2.2 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、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.1.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.1.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.1.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

6.2 中银量化价值混合型证券投资基金

6.2.1 资产负债表

会计主体：中银量化价值混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 3 月 19 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 3 月 19 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|-----|-----|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |

| | | | |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 4,879,877.36 | 2,164,226.20 |
| 结算备付金 | | 7,588,462.72 | 3,493,004.62 |
| 存出保证金 | | 1,888,119.90 | 75,794.64 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 300,027,488.14 | 203,635,636.98 |
| 其中：股票投资 | | 281,736,371.98 | 191,974,935.61 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 18,291,116.16 | 11,660,701.37 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收清算款 | | 4,024,347.69 | 40,802.65 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 44,966.37 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 318,408,295.81 | 209,454,431.46 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 3 月 19 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 5,042,587.32 | 1,181.44 |
| 应付管理人报酬 | | 199,264.10 | 202,293.86 |
| 应付托管费 | | 33,210.67 | 33,715.64 |
| 应付销售服务费 | | 27,427.41 | 9,310.61 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 8,229.39 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 262,682.63 | 343,492.53 |
| 负债合计 | | 5,573,401.52 | 589,994.08 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 299,329,771.22 | 207,624,229.44 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 13,505,123.07 | 1,240,207.94 |
| 净资产合计 | | 312,834,894.29 | 208,864,437.38 |
| 负债和净资产总计 | | 318,408,295.81 | 209,454,431.46 |

注：报告截止日 2024 年 3 月 19 日，基金份额总额 299,329,771.22 份，其中 A 类基金份额净值

1.0512 元，基金份额 178,937,583.46 份；C 类基金份额净值 1.0361 元，基金份额 120,392,187.76 份。

6.2.2 利润表

会计主体：中银量化价值混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日 | 上年度可比期间 -至- |
|----------------------------|----------|--|---------------------|
| 一、营业总收入 | | 14,952,924.63 | 4,396,727.76 |
| 1.利息收入 | | 33,992.39 | 27,636.48 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 33,992.39 | 27,636.48 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -2,180,119.88 | -2,310,745.52 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -3,255,857.68 | -3,491,976.03 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 52,691.50 | 84,907.69 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | 1,039,429.99 | -262,880.72 |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | -16,383.69 | 1,359,203.54 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | 17,023,592.77 | 6,679,534.93 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | 75,459.35 | 301.87 |
| 减：二、营业总支出 | | 980,707.29 | 1,509,009.59 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.7.16 | 700,629.38 | 1,223,712.96 |
| 2.托管费 | | 116,771.56 | 203,952.12 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2 | 80,726.40 | 5,673.07 |
| 4.投资顾问费 | | - | - |
| 5.利息支出 | 6.4.10.2 | - | 7.22 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | 7.22 |
| 6.信用减值损失 | | - | - |
| 7.税金及附加 | | 3,751.69 | - |
| 8.其他费用 | | 78,828.26 | 75,664.22 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 13,972,217.34 | 2,887,718.17 |
| 减：所得税费用 | | - | - |

| | | | |
|-------------------|----------|---------------|--------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 13,972,217.34 | 2,887,718.17 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 13,972,217.34 | 2,887,718.17 |

6.2.3 净资产变动表

会计主体：中银量化价值混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日 | | | |
|--|---------------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合 收益（若有） | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 207,624,229.44 | - | 1,240,207.94 | 208,864,437.38 |
| 二、本期期初净资产 | 207,624,229.44 | - | 1,240,207.94 | 208,864,437.38 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 91,705,541.78 | - | 12,264,915.13 | 103,970,456.91 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 13,972,217.34 | 13,972,217.34 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | 91,705,541.78 | - | -1,707,302.21 | 89,998,239.57 |
| 其中：1.基金申购款 | 119,405,484.47 | - | -1,536,181.01 | 117,869,303.46 |
| 2.基金赎回款 | -27,699,942.69 | - | -171,121.20 | -27,871,063.89 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 299,329,771.22 | - | 13,505,123.07 | 312,834,894.29 |
| 项目 | 上年度可比期间 -至- | | | |
| | 实收基金 | 其他综合 收益（若有） | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 157,327,515.62 | - | 29,731,940.96 | 187,059,456.5 |

| | | | | |
|--|----------------|---|----------------|----------------|
| 产 | | | | 8 |
| 二、本期期初净资产 | 157,327,515.62 | - | 29,731,940.96 | 187,059,456.58 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -33,224,004.51 | - | -5,008,769.12 | -38,232,773.63 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 2,887,718.17 | 2,887,718.17 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -33,224,004.51 | - | -7,896,487.29 | -41,120,491.80 |
| 其中：1.基金申购款 | 11,853,942.58 | - | 2,552,828.33 | 14,406,770.91 |
| 2.基金赎回款 | -45,077,947.09 | - | -10,449,315.62 | -55,527,262.71 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 124,103,511.11 | - | 24,723,171.84 | 148,826,682.95 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张家文，主管会计工作负责人：陈宇，会计机构负责人：乐妮

6.2.4 报表附注

6.2.4.1 基金基本情况

中银量化价值混合型证券投资基金(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]941 号文《关于准予中银量化价值混合型证券投资基金注册的批复》核准，由基金管理人中银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中银量化价值混合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 333,694,725.60 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2017)验字第 61062100_B14 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 333,826,575.55 份基金份额，其中认购资金利息折合 131,849.95 份基金份额。本基金的基金管

理人为中银基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2020 年 11 月 6 日发布的《关于中银量化价值混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》以及更新的《中银量化价值混合型证券投资基金基金合同》和《中银量化价值混合型证券投资基金托管协议》的有关规定，自 2020 年 11 月 6 日起，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用、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；在投资者申购时不收取申购费用，但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 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，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《中银量化价值混合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，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 X80%+中债综合指数收益率 X20%。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 2024 年 8 月 30 日批准。

6.2.4.2 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.2.4.3 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 2024 年 3 月 19 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 3 月 19 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.2.4.4 重要会计政策和会计估计

6.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 3 月 19 日止。

6.2.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1)金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅

为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.2.4.4.4 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

6.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。

6.2.4.4.6 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。

6.2.4.4.7 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。

6.2.4.4.8 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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)。

6.2.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额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扣除相关交易费用及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投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转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。

6.2.4.4.10 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。

以摊余成本计量的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。

6.2.4.4.11 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净资产转出。

6.2.4.4.12 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。

6.2.4.4.13 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股票投资、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)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)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》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于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(可转换债券和可交换债券除外)，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。

6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。根据中国证监会于 2023 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.2.4.5.3 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。

6.2.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《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》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。
- (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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。
- 对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。
- (4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。
- (5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

6.2.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 3 月 19 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款 | 4,879,877.36 |
| 等于：本金 | 4,867,498.01 |
| 加：应计利息 | 12,379.35 |

| | |
|----------------|--------------|
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 4,879,877.36 |

6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2024 年 3 月 19 日 | | | |
|--------|-------|------------------------|------------|----------------|--------------|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 273,962,048.61 | - | 281,736,371.98 | 7,774,323.37 |
| 债券 | 交易所市场 | 18,045,253.00 | 194,736.16 | 18,291,116.16 | 51,127.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 18,045,253.00 | 194,736.16 | 18,291,116.16 | 51,127.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 292,007,301.61 | 194,736.16 | 300,027,488.14 | 7,825,450.37 |

6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.2.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 3 月 19 日 | | | |
|--------|------------------------|------|----|----|
| | 合同/名义 金额 | 公允价值 | | 备注 |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | - |
| 货币衍生工具 | - | - | - | - |
| 权益衍生工具 | 12,916,560.00 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | 12,916,560.00 | - | - | - |

6.2.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值 | 公允价值变动 |
|--------|--------|----------|---------------|-----------|
| IF2404 | IF2404 | 12.00 | 12,906,720.00 | -9,840.00 |

| | | | | |
|------------|---|---|---|-----------|
| 合计 | - | - | - | -9,840.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 | - | - | - | -9,840.00 |
| 净额 | - | - | - | 0.00 |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.2.4.7.4 买入返售金融资产

6.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.2.4.7.5 其他权益工具投资

6.2.4.7.5.1 报告期末其他权益工具投资情况

6.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.2.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 3 月 19 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 199,226.13 |
| 其中：交易所市场 | 199,226.13 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付信息披露费 | 25,901.73 |
| 应付审计费 | 37,554.77 |
| 合计 | 262,682.63 |

6.2.4.7.8 实收基金

中银量化价值混合 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年3月19日 | |
|------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 170,766,173.35 | 170,766,173.35 |
| 本期申购 | 8,683,718.60 | 8,683,718.60 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -512,308.49 | -512,308.49 |
| 本期末 | 178,937,583.46 | 178,937,583.46 |

中银量化价值混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年3月19日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 36,858,056.09 | 36,858,056.09 |
| 本期申购 | 110,721,765.87 | 110,721,765.87 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -27,187,634.20 | -27,187,634.20 |
| 本期末 | 120,392,187.76 | 120,392,187.76 |

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.2.4.7.9 未分配利润

中银量化价值混合 A

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|--------------|
| 上年度末 | 10,795,447.30 | -9,363,288.32 | 1,432,158.98 |
| 本期期初 | 10,795,447.30 | -9,363,288.32 | 1,432,158.98 |
| 本期利润 | -2,573,476.40 | 10,548,486.19 | 7,975,009.79 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 426,140.76 | -678,777.11 | -252,636.35 |
| 其中：基金申购款 | 449,906.81 | -690,979.56 | -241,072.75 |
| 基金赎回款 | -23,766.05 | 12,202.45 | -11,563.60 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 8,648,111.66 | 506,420.76 | 9,154,532.42 |

中银量化价值混合 C

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 1,802,492.57 | -1,994,443.61 | -191,951.04 |
| 本期期初 | 1,802,492.57 | -1,994,443.61 | -191,951.04 |
| 本期利润 | -477,899.03 | 6,475,106.58 | 5,997,207.55 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,696,352.84 | -4,151,018.70 | -1,454,665.86 |
| 其中：基金申购款 | 3,616,598.31 | -4,911,706.57 | -1,295,108.26 |
| 基金赎回款 | -920,245.47 | 760,687.87 | -159,557.60 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 4,020,946.38 | 329,644.27 | 4,350,590.65 |

6.2.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 11,651.40 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 22,068.67 |
| 其他 | 272.32 |
| 合计 | 33,992.39 |

6.2.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 187,405,411.11 |
| 减：卖出股票成本总额 | 190,339,484.69 |
| 减：交易费用 | 321,784.10 |
| 买卖股票差价收入 | -3,255,857.68 |

6.2.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年3月19日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 52,691.50 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | - |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 52,691.50 |

6.2.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.2.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成
本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.2.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年3月19日 |
|----------|----------------------------|
| 股指期货投资收益 | 1,039,429.99 |

6.2.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年3月19日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | -16,383.69 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | -16,383.69 |

6.2.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2024年1月1日至2024年3月19日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 17,033,432.77 |
| ——股票投资 | 17,009,989.77 |
| ——债券投资 | 23,443.00 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | -9,840.00 |
| ——权证投资 | - |
| ——期货投资 | -9,840.00 |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税 | - |
| 合计 | 17,023,592.77 |

6.2.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年3月19日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 73,304.72 |
| 基金转换费收入 | 2,154.63 |
| 合计 | 75,459.35 |

6.2.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年3月19日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 7,554.77 |
| 信息披露费 | 25,901.73 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 371.76 |
| 其他 | 45,000.00 |

| | |
|----|-----------|
| 合计 | 78,828.26 |
|----|-----------|

6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.2.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.2.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.2.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.2.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|---------------------|
| 中银基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司(“兴业银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”) | 基金管理人的控股股东、基金销售机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.2.4.10.2 关联方报酬

6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年3月 19日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日 |
|------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 700,629.38 | 1,223,712.96 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 28,989.94 | 53,556.79 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 671,639.44 | 1,170,156.17 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。管理费从 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 23 日的年费率为 1.50%，自 2023 年 7 月 24 日起的年费率为 1.20%。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 年费率 / 当年天数。

6.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年3月 19日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 116,771.56 | 203,952.12 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。托管费从 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 23 日的年费率为 0.25%，自 2023 年 7 月 24 日起的年费率为 0.20%。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 年费率 / 当年天数。

6.2.4.10.2.3 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2024年1月1日至2024年3月19日 | | |
|--------------------|---------------------------------|------------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中银量化价值混合A | 中银量化价值混合 C | 合计 |
| 中国银行 | - | 123.81 | 123.81 |
| 中银基金管理有限 公司 | - | 69,201.99 | 69,201.99 |
| 合计 | - | 69,325.80 | 69,325.80 |
| 获得销售服务费的各 关联方名称 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 中银量化价值混合A | 中银量化价值混合C | 合计 |
| 中银基金管理有限 公司 | - | 3,209.15 | 3,209.15 |
| 中国银行 | - | 160.63 | 160.63 |
| 合计 | - | 3,369.78 | 3,369.78 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中银基金，再由中银基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

6.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.2.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.2.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证

券出借业务。

6.2.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.2.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.10.5.1 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内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.2.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.2.4.10.6 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 | |
|------------|---------------------------------|-----------|--------------|----------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 19 日 | | -至- | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 兴业银行股份有限公司 | 4,879,877.36 | 11,651.40 | 4,657,713.30 | 9,247.01 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.2.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

6.2.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.2.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.2.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.2.4.12 期末（2024 年 3 月 19 日）本基金持有的流通受限证券

6.2.4.12.1 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

| 6.2.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|------------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 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 |
| 301538 | 骏鼎 | 2024-03-13 | 1 个 | 新股 | 55.82 | 55.82 | 959 | 53,531.38 | 53,531.38 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | 达 | | 月内 | 未上市 | | | | | | |
| 603344 | 星德胜 | 2024-03-13 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 19.18 | 19.18 | 1,788 | 34,293.84 | 34,293.84 | - |
| 001359 | 平安电工 | 2024-03-19 | 1 个月内 | 新股未上市 | 17.39 | 17.39 | 1,833 | 31,875.87 | 31,875.87 | - |
| 301516 | 中远通 | 2023-12-01 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 6.87 | 20.56 | 598 | 4,108.26 | 12,294.88 | - |
| 301508 | 中机认检 | 2023-11-23 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 16.82 | 34.22 | 291 | 4,894.62 | 9,958.02 | - |
| 688709 | 成都华微 | 2024-01-31 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 15.69 | 21.45 | 422 | 6,621.18 | 9,051.90 | - |
| 301413 | 安培龙 | 2023-12-11 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 33.25 | 58.65 | 152 | 5,054.00 | 8,914.80 | - |
| 688652 | 京仪装备 | 2023-11-22 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 31.95 | 45.43 | 164 | 5,239.80 | 7,450.52 | - |
| 301555 | 惠柏新材 | 2023-10-24 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 22.88 | 32.32 | 224 | 5,125.12 | 7,239.68 | - |
| 688648 | 中邮科技 | 2023-11-06 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 15.18 | 23.08 | 303 | 4,599.54 | 6,993.24 | - |
| 688653 | 康希通信 | 2023-11-10 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 10.50 | 13.78 | 498 | 5,229.00 | 6,862.44 | - |
| 301568 | 思泰克 | 2023-11-21 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 23.23 | 40.64 | 168 | 3,902.64 | 6,827.52 | - |
| 688695 | 中创股份 | 2024-03-06 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 22.43 | 36.54 | 186 | 4,171.98 | 6,796.44 | - |
| 301459 | 丰茂股份 | 2023-12-06 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 31.90 | 40.78 | 163 | 5,199.70 | 6,647.14 | - |
| 688720 | 艾森股份 | 2023-11-29 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 28.03 | 40.01 | 157 | 4,400.71 | 6,281.57 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------|----------------|--------|-------|-----|----------|----------|---|
| 301538 | 骏鼎达 | 2024-03-13 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 55.82 | 55.82 | 107 | 5,972.74 | 5,972.74 | - |
| 603341 | 龙旗科技 | 2024-02-23 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 26.00 | 42.46 | 135 | 3,510.00 | 5,732.10 | - |
| 688716 | 中研股份 | 2023-09-13 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 29.66 | 31.96 | 158 | 4,686.28 | 5,049.68 | - |
| 688719 | 爱科赛博 | 2023-09-20 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 69.98 | 55.13 | 91 | 6,368.18 | 5,016.83 | - |
| 001378 | 德冠新材 | 2023-10-23 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 31.68 | 28.95 | 134 | 4,245.12 | 3,879.30 | - |
| 688657 | 浩辰软件 | 2023-09-25 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 103.40 | 67.24 | 55 | 5,687.00 | 3,698.20 | - |
| 601033 | 永兴股份 | 2024-01-11 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 16.20 | 13.40 | 266 | 4,309.20 | 3,564.40 | - |
| 603082 | 北自科技 | 2024-01-23 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 21.28 | 32.21 | 101 | 2,149.28 | 3,253.21 | - |
| 601083 | 锦江航运 | 2023-11-28 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 11.25 | 9.65 | 331 | 3,723.75 | 3,194.15 | - |
| 001326 | 联域股份 | 2023-11-01 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 41.18 | 37.85 | 83 | 3,417.94 | 3,141.55 | - |
| 001239 | 永达股份 | 2023-12-04 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 12.05 | 16.58 | 189 | 2,277.45 | 3,133.62 | - |
| 603107 | 上海汽配 | 2023-10-25 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 14.23 | 18.55 | 153 | 2,177.19 | 2,838.15 | - |
| 603375 | 盛景微 | 2024-01-17 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 38.18 | 47.58 | 59 | 2,252.62 | 2,807.22 | - |
| 603373 | 安邦护卫 | 2023-12-13 | 6 个月 | 新股 锁定 期内 | 19.10 | 27.29 | 87 | 1,661.70 | 2,374.23 | - |
| 603325 | 博隆技术 | 2024-01-03 | 6 个月 | 新股 锁定 | 72.46 | 72.22 | 32 | 2,318.72 | 2,311.04 | - |

| | | | | 期内 | | | | | | |
|--------|------|------------|------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 603062 | 麦加芯彩 | 2023-10-31 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 58.08 | 44.05 | 51 | 2,962.08 | 2,246.55 | - |
| 603193 | 润本股份 | 2023-10-09 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 17.38 | 16.05 | 139 | 2,415.82 | 2,230.95 | - |
| 603004 | 鼎龙科技 | 2023-12-20 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 16.80 | 18.69 | 108 | 1,814.40 | 2,018.52 | - |
| 603276 | 恒兴新材 | 2023-09-18 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 25.73 | 19.98 | 95 | 2,444.35 | 1,898.10 | - |
| 603312 | 西典新能 | 2024-01-04 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 29.02 | 26.87 | 69 | 2,002.38 | 1,854.03 | - |
| 603231 | 索宝蛋白 | 2023-12-06 | 6 个月 | 新股锁定期内 | 21.29 | 17.79 | 92 | 1,958.68 | 1,636.68 | - |

6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 3 月 19 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。

6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 3 月 19 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.2.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.2.4.13 金融工具风险及管理

6.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险管理与

内部控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理与内部控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.2.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.2.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力

测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.2.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.2.4.13.4.2 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024 年 3 月 19 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|---------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 4,879,877.36 | - | - | - | 4,879,877.36 |
| 结算备付金 | 7,588,462.72 | - | - | - | 7,588,462.72 |
| 存出保证金 | 1,888,119.90 | - | - | - | 1,888,119.90 |
| 交易性金融资产 | 18,291,116.16 | - | - | 281,736,371.98 | 300,027,488.14 |
| 应收清算款 | - | - | - | 4,024,347.69 | 4,024,347.69 |
| 资产总计 | 32,647,576.14 | - | - | 285,760,719.67 | 318,408,295.81 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 5,042,587.32 | 5,042,587.32 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 199,264.10 | 199,264.10 |
| 应付托管费 | - | - | - | 33,210.67 | 33,210.67 |

| | | | | | |
|--------------------------|---------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 应付销售服务费 | - | - | - | 27,427.41 | 27,427.41 |
| 应交税费 | - | - | - | 8,229.39 | 8,229.39 |
| 其他负债 | - | - | - | 262,682.63 | 262,682.63 |
| 负债总计 | - | - | - | 5,573,401.52 | 5,573,401.52 |
| 利率敏感度缺口 | 32,647,576.14 | - | - | 280,187,318.15 | 312,834,894.29 |
| 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 2,164,226.20 | - | - | - | 2,164,226.20 |
| 结算备付金 | 3,493,004.62 | - | - | - | 3,493,004.62 |
| 存出保证金 | 75,794.64 | - | - | - | 75,794.64 |
| 交易性金融资产 | 11,660,701.37 | - | - | 191,974,935.61 | 203,635,636.98 |
| 应收清算款 | - | - | - | 40,802.65 | 40,802.65 |
| 应收申购款 | - | - | - | 44,966.37 | 44,966.37 |
| 资产总计 | 17,393,726.83 | - | - | 192,060,704.63 | 209,454,431.46 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,181.44 | 1,181.44 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 202,293.86 | 202,293.86 |
| 应付托管费 | - | - | - | 33,715.64 | 33,715.64 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 9,310.61 | 9,310.61 |
| 其他负债 | - | - | - | 343,492.53 | 343,492.53 |
| 负债总计 | - | - | - | 589,994.08 | 589,994.08 |
| 利率敏感度缺口 | 17,393,726.83 | - | - | 191,470,710.55 | 208,864,437.38 |

6.2.4.13.4.2.1 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金持有的固定收益品种投资公允价值占基金净资产的比例低于 10%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度末：同）。

6.2.4.13.4.3 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.2.4.13.4.4 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能

来源于证券市场整体波动的影响。

6.2.4.13.4.4.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 3 月 19 日 | | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------------|--------------|--------------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | 281,736,371.98 | 90.06 | 191,974,935.61 | 91.91 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 281,736,371.98 | 90.06 | 191,974,935.61 | 91.91 |

6.2.4.13.4.4.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--|-----------------------------|--------------------------|
| 假设 | 1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2024 年 3 月 19 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| | 1. 业绩比较基准上升 5% | 27,162,742.48 | 11,377,987.66 |
| | 2. 业绩比较基准下降 5% | -27,162,742.48 | -11,377,987.66 |

6.2.4.14 公允价值

6.2.4.14.1 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。

6.2.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.2.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2024 年 3 月 19 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 281,487,795.33 | 191,782,263.86 |
| 第二层次 | 18,382,496.15 | 11,660,701.37 |
| 第三层次 | 157,196.66 | 192,671.75 |
| 合计 | 300,027,488.14 | 203,635,636.98 |

6.2.4.14.2.2 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、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.2.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.2.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.2.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

(报告期：2024年3月20日-2024年6月30日)

7.1.1 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 | 486,426,607.17 | 86.71 |
| | 其中：股票 | 486,426,607.17 | 86.71 |
| 2 | 基金投资 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 69,383,861.96 | 12.37 |
| 8 | 其他各项资产 | 5,176,494.22 | 0.92 |
| 9 | 合计 | 560,986,963.35 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票，本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.1.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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 | 287,760.00 | 0.05 |
| B | 采矿业 | 28,476,558.56 | 5.41 |
| C | 制造业 | 224,131,430.92 | 42.55 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 15,240,860.00 | 2.89 |
| E | 建筑业 | 13,882,887.00 | 2.64 |
| F | 批发和零售业 | 2,032,911.00 | 0.39 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 15,630,039.00 | 2.97 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 14,917,816.62 | 2.83 |
| J | 金融业 | 102,374,352.15 | 19.43 |
| K | 房地产业 | 3,233,316.00 | 0.61 |
| L | 租赁和商务服务业 | 76,200.00 | 0.01 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,351.40 | 0.00 |
| 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 | 420,286,482.65 | 79.78 |

7.1.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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 | 879,296.00 | 0.17 |
| B | 采矿业 | 6,688,684.00 | 1.27 |
| C | 制造业 | 45,945,968.70 | 8.72 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,493,953.00 | 1.42 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | 25,460.46 | 0.00 |
| J | 金融业 | 2,513,890.00 | 0.48 |
| 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 | 1,675,341.36 | 0.32 |
| 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 | 917,531.00 | 0.17 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 66,140,124.52 | 12.56 |

7.1.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.1.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 600519 | 贵州茅台 | 18,900 | 27,733,671.00 | 5.26 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 86,181 | 15,515,165.43 | 2.95 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 297,100 | 12,288,056.00 | 2.33 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 347,600 | 11,884,444.00 | 2.26 |
| 5 | 601658 | 邮储银行 | 1,904,400 | 9,655,308.00 | 1.83 |
| 6 | 600900 | 长江电力 | 314,800 | 9,104,016.00 | 1.73 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 7 | 601398 | 工商银行 | 1,465,900 | 8,355,630.00 | 1.59 |
| 8 | 000333 | 美的集团 | 121,100 | 7,810,950.00 | 1.48 |
| 9 | 300760 | 迈瑞医疗 | 25,700 | 7,476,387.00 | 1.42 |
| 10 | 601633 | 长城汽车 | 293,900 | 7,435,670.00 | 1.41 |
| 11 | 601668 | 中国建筑 | 1,381,100 | 7,333,641.00 | 1.39 |
| 12 | 601919 | 中远海控 | 468,500 | 7,257,065.00 | 1.38 |
| 13 | 601688 | 华泰证券 | 572,700 | 7,095,753.00 | 1.35 |
| 14 | 000725 | 京东方 A | 1,723,600 | 7,049,524.00 | 1.34 |
| 15 | 600887 | 伊利股份 | 263,900 | 6,819,176.00 | 1.29 |
| 16 | 600999 | 招商证券 | 488,300 | 6,792,253.00 | 1.29 |
| 17 | 600690 | 海尔智家 | 223,900 | 6,354,282.00 | 1.21 |
| 18 | 601328 | 交通银行 | 829,400 | 6,195,618.00 | 1.18 |
| 19 | 601899 | 紫金矿业 | 348,500 | 6,123,145.00 | 1.16 |
| 20 | 000651 | 格力电器 | 150,900 | 5,918,298.00 | 1.12 |
| 21 | 601939 | 建设银行 | 781,300 | 5,781,620.00 | 1.10 |
| 22 | 000858 | 五 粮 液 | 43,100 | 5,518,524.00 | 1.05 |
| 23 | 000001 | 平安银行 | 501,500 | 5,090,225.00 | 0.97 |
| 24 | 600276 | 恒瑞医药 | 130,101 | 5,003,684.46 | 0.95 |
| 25 | 600018 | 上港集团 | 838,400 | 4,845,952.00 | 0.92 |
| 26 | 600845 | 宝信软件 | 151,372 | 4,833,307.96 | 0.92 |
| 27 | 601728 | 中国电信 | 779,200 | 4,792,080.00 | 0.91 |
| 28 | 600660 | 福耀玻璃 | 99,600 | 4,770,840.00 | 0.91 |
| 29 | 002475 | 立讯精密 | 120,983 | 4,755,841.73 | 0.90 |
| 30 | 688981 | 中芯国际 | 95,400 | 4,397,940.00 | 0.83 |
| 31 | 603501 | 韦尔股份 | 42,300 | 4,203,351.00 | 0.80 |
| 32 | 600019 | 宝钢股份 | 620,700 | 4,127,655.00 | 0.78 |
| 33 | 002001 | 新 和 成 | 202,300 | 3,884,160.00 | 0.74 |
| 34 | 600938 | 中国海油 | 117,400 | 3,874,200.00 | 0.74 |
| 35 | 600011 | 华能国际 | 395,800 | 3,807,596.00 | 0.72 |
| 36 | 600893 | 航发动力 | 99,100 | 3,622,105.00 | 0.69 |
| 37 | 300408 | 三环集团 | 122,700 | 3,581,613.00 | 0.68 |
| 38 | 002594 | 比亚迪 | 14,000 | 3,503,500.00 | 0.67 |
| 39 | 002311 | 海大集团 | 73,800 | 3,472,290.00 | 0.66 |
| 40 | 601390 | 中国中铁 | 518,000 | 3,377,360.00 | 0.64 |
| 41 | 600436 | 片仔癀 | 15,900 | 3,294,003.00 | 0.63 |
| 42 | 600919 | 江苏银行 | 441,800 | 3,282,574.00 | 0.62 |
| 43 | 600048 | 保利发展 | 369,100 | 3,233,316.00 | 0.61 |
| 44 | 605499 | 东鹏饮料 | 14,900 | 3,214,675.00 | 0.61 |
| 45 | 600958 | 东方证券 | 418,604 | 3,181,390.40 | 0.60 |
| 46 | 002371 | 北方华创 | 9,600 | 3,070,944.00 | 0.58 |
| 47 | 600989 | 宝丰能源 | 174,700 | 3,027,551.00 | 0.57 |
| 48 | 600219 | 南山铝业 | 793,600 | 3,023,616.00 | 0.57 |
| 49 | 300628 | 亿联网络 | 82,000 | 3,015,140.00 | 0.57 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 50 | 000338 | 潍柴动力 | 178,700 | 2,902,088.00 | 0.55 |
| 51 | 600760 | 中航沈飞 | 72,320 | 2,900,032.00 | 0.55 |
| 52 | 600188 | 兖矿能源 | 125,400 | 2,850,342.00 | 0.54 |
| 53 | 002601 | 龙佰集团 | 151,400 | 2,811,498.00 | 0.53 |
| 54 | 603993 | 洛阳钼业 | 327,900 | 2,787,150.00 | 0.53 |
| 55 | 601088 | 中国神华 | 62,700 | 2,781,999.00 | 0.53 |
| 56 | 600183 | 生益科技 | 129,100 | 2,718,846.00 | 0.52 |
| 57 | 600000 | 浦发银行 | 328,400 | 2,702,732.00 | 0.51 |
| 58 | 688111 | 金山办公 | 11,777 | 2,679,267.50 | 0.51 |
| 59 | 601816 | 京沪高铁 | 492,600 | 2,645,262.00 | 0.50 |
| 60 | 601601 | 中国太保 | 94,100 | 2,621,626.00 | 0.50 |
| 61 | 601898 | 中煤能源 | 206,200 | 2,573,376.00 | 0.49 |
| 62 | 601877 | 正泰电器 | 132,000 | 2,515,920.00 | 0.48 |
| 63 | 601169 | 北京银行 | 414,100 | 2,418,344.00 | 0.46 |
| 64 | 601857 | 中国石油 | 231,100 | 2,384,952.00 | 0.45 |
| 65 | 688036 | 传音控股 | 30,451 | 2,330,719.54 | 0.44 |
| 66 | 600886 | 国投电力 | 127,700 | 2,329,248.00 | 0.44 |
| 67 | 002415 | 海康威视 | 75,000 | 2,318,250.00 | 0.44 |
| 68 | 600150 | 中国船舶 | 56,800 | 2,312,328.00 | 0.44 |
| 69 | 600161 | 天坛生物 | 94,320 | 2,301,408.00 | 0.44 |
| 70 | 000786 | 北新建材 | 76,800 | 2,277,888.00 | 0.43 |
| 71 | 300124 | 汇川技术 | 44,300 | 2,272,590.00 | 0.43 |
| 72 | 300979 | 华利集团 | 36,900 | 2,245,365.00 | 0.43 |
| 73 | 601800 | 中国交建 | 250,500 | 2,239,470.00 | 0.43 |
| 74 | 000596 | 古井贡酒 | 10,600 | 2,237,342.00 | 0.42 |
| 75 | 600031 | 三一重工 | 134,900 | 2,225,850.00 | 0.42 |
| 76 | 600309 | 万华化学 | 27,100 | 2,191,306.00 | 0.42 |
| 77 | 002142 | 宁波银行 | 97,900 | 2,159,674.00 | 0.41 |
| 78 | 600346 | 恒力石化 | 152,300 | 2,124,585.00 | 0.40 |
| 79 | 000963 | 华东医药 | 73,100 | 2,032,911.00 | 0.39 |
| 80 | 601229 | 上海银行 | 278,000 | 2,018,280.00 | 0.38 |
| 81 | 000063 | 中兴通讯 | 71,600 | 2,002,652.00 | 0.38 |
| 82 | 601808 | 中海油服 | 109,900 | 1,890,280.00 | 0.36 |
| 83 | 000999 | 华润三九 | 42,300 | 1,801,134.00 | 0.34 |
| 84 | 000538 | 云南白药 | 34,800 | 1,780,020.00 | 0.34 |
| 85 | 600406 | 国电南瑞 | 68,400 | 1,707,264.00 | 0.32 |
| 86 | 601818 | 光大银行 | 519,500 | 1,646,815.00 | 0.31 |
| 87 | 601600 | 中国铝业 | 209,900 | 1,601,537.00 | 0.30 |
| 88 | 000625 | 长安汽车 | 118,100 | 1,586,083.00 | 0.30 |
| 89 | 600426 | 华鲁恒升 | 57,300 | 1,526,472.00 | 0.29 |
| 90 | 600809 | 山西汾酒 | 7,200 | 1,518,336.00 | 0.29 |
| 91 | 601009 | 南京银行 | 145,000 | 1,506,550.00 | 0.29 |
| 92 | 601628 | 中国人寿 | 45,900 | 1,425,195.00 | 0.27 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 93 | 600926 | 杭州银行 | 99,500 | 1,298,475.00 | 0.25 |
| 94 | 300274 | 阳光电源 | 20,680 | 1,282,780.40 | 0.24 |
| 95 | 601766 | 中国中车 | 156,900 | 1,178,319.00 | 0.22 |
| 96 | 601916 | 浙商银行 | 423,800 | 1,169,688.00 | 0.22 |
| 97 | 600015 | 华夏银行 | 178,700 | 1,143,680.00 | 0.22 |
| 98 | 600028 | 中国石化 | 175,000 | 1,106,000.00 | 0.21 |
| 99 | 601225 | 陕西煤业 | 40,100 | 1,033,377.00 | 0.20 |
| 100 | 600875 | 东方电气 | 55,800 | 1,029,510.00 | 0.20 |
| 101 | 600332 | 白云山 | 34,800 | 1,020,684.00 | 0.19 |
| 102 | 603195 | 公牛集团 | 12,623 | 973,485.76 | 0.18 |
| 103 | 601186 | 中国铁建 | 108,800 | 932,416.00 | 0.18 |
| 104 | 601138 | 工业富联 | 32,100 | 879,540.00 | 0.17 |
| 105 | 601689 | 拓普集团 | 15,800 | 847,038.00 | 0.16 |
| 106 | 601336 | 新华保险 | 22,500 | 675,675.00 | 0.13 |
| 107 | 002241 | 歌尔股份 | 31,000 | 604,810.00 | 0.11 |
| 108 | 300433 | 蓝思科技 | 32,600 | 594,950.00 | 0.11 |
| 109 | 600050 | 中国联通 | 120,500 | 566,350.00 | 0.11 |
| 110 | 600030 | 中信证券 | 30,425 | 554,647.75 | 0.11 |
| 111 | 600547 | 山东黄金 | 20,000 | 547,600.00 | 0.10 |
| 112 | 000977 | 浪潮信息 | 14,900 | 541,913.00 | 0.10 |
| 113 | 601066 | 中信建投 | 27,800 | 534,872.00 | 0.10 |
| 114 | 000568 | 泸州老窖 | 3,700 | 530,913.00 | 0.10 |
| 115 | 600489 | 中金黄金 | 35,400 | 523,920.00 | 0.10 |
| 116 | 300316 | 晶盛机电 | 18,100 | 520,013.00 | 0.10 |
| 117 | 600089 | 特变电工 | 33,660 | 466,864.20 | 0.09 |
| 118 | 601319 | 中国人保 | 86,700 | 446,505.00 | 0.08 |
| 119 | 688187 | 时代电气 | 8,700 | 429,606.00 | 0.08 |
| 120 | 601998 | 中信银行 | 61,300 | 410,710.00 | 0.08 |
| 121 | 601021 | 春秋航空 | 7,000 | 394,310.00 | 0.07 |
| 122 | 600104 | 上汽集团 | 28,200 | 390,852.00 | 0.07 |
| 123 | 600029 | 南方航空 | 62,500 | 368,125.00 | 0.07 |
| 124 | 600132 | 重庆啤酒 | 5,600 | 339,920.00 | 0.06 |
| 125 | 002714 | 牧原股份 | 6,600 | 287,760.00 | 0.05 |
| 126 | 600941 | 中国移动 | 2,500 | 268,750.00 | 0.05 |
| 127 | 000807 | 云铝股份 | 18,800 | 253,988.00 | 0.05 |
| 128 | 300308 | 中际旭创 | 1,040 | 143,395.20 | 0.03 |
| 129 | 600009 | 上海机场 | 3,700 | 119,325.00 | 0.02 |
| 130 | 601888 | 中国中免 | 1,200 | 74,988.00 | 0.01 |
| 131 | 300442 | 润泽科技 | 2,900 | 69,455.00 | 0.01 |
| 132 | 601788 | 光大证券 | 2,600 | 38,012.00 | 0.01 |
| 133 | 603259 | 药明康德 | 60 | 2,351.40 | 0.00 |
| 134 | 600570 | 恒生电子 | 76 | 1,342.16 | 0.00 |
| 135 | 002027 | 分众传媒 | 200 | 1,212.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|----|--------|------|
| 136 | 601699 | 潞安环能 | 12 | 217.56 | 0.00 |
| 137 | 000100 | TCL 科技 | 10 | 43.20 | 0.00 |

7.1.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 002128 | 电投能源 | 234,700 | 4,952,170.00 | 0.94 |
| 2 | 002463 | 沪电股份 | 123,400 | 4,504,100.00 | 0.85 |
| 3 | 600642 | 申能股份 | 494,900 | 4,369,967.00 | 0.83 |
| 4 | 002340 | 格林美 | 550,300 | 3,505,411.00 | 0.67 |
| 5 | 601369 | 陕鼓动力 | 343,600 | 2,755,672.00 | 0.52 |
| 6 | 300724 | 捷佳伟创 | 48,700 | 2,630,287.00 | 0.50 |
| 7 | 600066 | 宇通客车 | 100,100 | 2,582,580.00 | 0.49 |
| 8 | 688208 | 道通科技 | 106,400 | 2,568,496.00 | 0.49 |
| 9 | 600901 | 江苏金租 | 497,800 | 2,513,890.00 | 0.48 |
| 10 | 002532 | 天山铝业 | 306,000 | 2,481,660.00 | 0.47 |
| 11 | 600160 | 巨化股份 | 97,800 | 2,359,914.00 | 0.45 |
| 12 | 603228 | 景旺电子 | 62,000 | 1,971,600.00 | 0.37 |
| 13 | 603605 | 珀莱雅 | 16,100 | 1,786,939.00 | 0.34 |
| 14 | 000975 | 山金国际 | 106,600 | 1,736,514.00 | 0.33 |
| 15 | 601717 | 郑煤机 | 113,100 | 1,673,880.00 | 0.32 |
| 16 | 603568 | 伟明环保 | 81,200 | 1,671,096.00 | 0.32 |
| 17 | 000883 | 湖北能源 | 246,300 | 1,480,263.00 | 0.28 |
| 18 | 002993 | 奥海科技 | 38,900 | 1,447,080.00 | 0.27 |
| 19 | 688249 | 晶合集成 | 73,300 | 1,075,311.00 | 0.20 |
| 20 | 601991 | 大唐发电 | 354,300 | 1,066,443.00 | 0.20 |
| 21 | 601615 | 明阳智能 | 106,800 | 1,008,192.00 | 0.19 |
| 22 | 688475 | 萤石网络 | 29,300 | 999,423.00 | 0.19 |
| 23 | 300251 | 光线传媒 | 109,100 | 917,531.00 | 0.17 |
| 24 | 600598 | 北大荒 | 70,400 | 879,296.00 | 0.17 |
| 25 | 605099 | 共创草坪 | 44,200 | 835,822.00 | 0.16 |
| 26 | 000921 | 海信家电 | 24,200 | 780,208.00 | 0.15 |
| 27 | 601636 | 旗滨集团 | 118,100 | 761,745.00 | 0.14 |
| 28 | 300502 | 新易盛 | 7,200 | 759,960.00 | 0.14 |
| 29 | 002078 | 太阳纸业 | 41,400 | 577,530.00 | 0.11 |
| 30 | 002039 | 黔源电力 | 32,800 | 577,280.00 | 0.11 |
| 31 | 688578 | 艾力斯 | 8,900 | 567,286.00 | 0.11 |
| 32 | 002166 | 莱茵生物 | 81,300 | 556,092.00 | 0.11 |
| 33 | 002984 | 森麒麟 | 23,000 | 554,070.00 | 0.11 |
| 34 | 688127 | 蓝特光学 | 29,600 | 544,344.00 | 0.10 |
| 35 | 600933 | 爱柯迪 | 35,600 | 526,524.00 | 0.10 |
| 36 | 688772 | 珠海冠宇 | 35,100 | 522,990.00 | 0.10 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 37 | 300735 | 光弘科技 | 23,800 | 514,080.00 | 0.10 |
| 38 | 002249 | 大洋电机 | 106,700 | 504,691.00 | 0.10 |
| 39 | 300529 | 健帆生物 | 18,200 | 495,222.00 | 0.09 |
| 40 | 688138 | 清溢光电 | 22,729 | 488,673.50 | 0.09 |
| 41 | 002859 | 洁美科技 | 24,200 | 485,936.00 | 0.09 |
| 42 | 600549 | 厦门钨业 | 24,300 | 419,175.00 | 0.08 |
| 43 | 002273 | 水晶光电 | 23,900 | 405,822.00 | 0.08 |
| 44 | 688525 | 佰维存储 | 5,000 | 320,750.00 | 0.06 |
| 45 | 600177 | 雅戈尔 | 44,400 | 316,128.00 | 0.06 |
| 46 | 600320 | 振华重工 | 88,200 | 301,644.00 | 0.06 |
| 47 | 688498 | 源杰科技 | 2,100 | 275,079.00 | 0.05 |
| 48 | 300119 | 瑞普生物 | 18,500 | 251,970.00 | 0.05 |
| 49 | 002701 | 奥瑞金 | 42,000 | 174,720.00 | 0.03 |
| 50 | 601222 | 林洋能源 | 26,600 | 166,782.00 | 0.03 |
| 51 | 603198 | 迎驾贡酒 | 2,800 | 161,000.00 | 0.03 |
| 52 | 000423 | 东阿阿胶 | 1,900 | 118,940.00 | 0.02 |
| 53 | 002444 | 巨星科技 | 2,300 | 56,810.00 | 0.01 |
| 54 | 603285 | 键邦股份 | 1,287 | 24,002.55 | 0.00 |
| 55 | 603350 | 安乃达 | 1,051 | 21,608.56 | 0.00 |
| 56 | 688692 | 达梦数据 | 112 | 19,592.16 | 0.00 |
| 57 | 301536 | 星宸科技 | 481 | 15,521.87 | 0.00 |
| 58 | 301538 | 骏鼎达 | 150 | 13,686.00 | 0.00 |
| 59 | 301565 | 中仑新材 | 711 | 13,494.78 | 0.00 |
| 60 | 301580 | 爱迪特 | 202 | 13,317.86 | 0.00 |
| 61 | 688709 | 成都华微 | 422 | 7,929.38 | 0.00 |
| 62 | 301587 | 中瑞股份 | 306 | 7,729.56 | 0.00 |
| 63 | 001389 | 广合科技 | 222 | 7,672.32 | 0.00 |
| 64 | 688695 | 中创股份 | 186 | 5,868.30 | 0.00 |
| 65 | 603341 | 龙旗科技 | 135 | 5,061.15 | 0.00 |
| 66 | 601033 | 永兴股份 | 266 | 4,245.36 | 0.00 |
| 67 | 603344 | 星德胜 | 179 | 4,056.14 | 0.00 |
| 68 | 603381 | 永臻股份 | 156 | 3,920.28 | 0.00 |
| 69 | 001359 | 平安电工 | 184 | 3,790.40 | 0.00 |
| 70 | 603082 | 北自科技 | 101 | 2,978.49 | 0.00 |
| 71 | 603375 | 盛景微 | 59 | 2,295.10 | 0.00 |
| 72 | 603325 | 博隆技术 | 32 | 2,177.92 | 0.00 |
| 73 | 603312 | 西典新能 | 69 | 1,749.84 | 0.00 |
| 74 | 603995 | 甬金股份 | 25 | 438.00 | 0.00 |

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1 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

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 | 占期末基金资产 |
|----|------|------|----------|---------|
|----|------|------|----------|---------|

| | | | | 净值比例 (%) |
|----|--------|-------|---------------|----------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 14,666,995.00 | 2.78 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 9,597,806.00 | 1.82 |
| 3 | 601919 | 中远海控 | 7,638,673.80 | 1.45 |
| 4 | 000725 | 京东方 A | 7,124,495.00 | 1.35 |
| 5 | 600900 | 长江电力 | 6,787,646.00 | 1.29 |
| 6 | 601390 | 中国中铁 | 6,604,993.00 | 1.25 |
| 7 | 600660 | 福耀玻璃 | 6,350,181.00 | 1.21 |
| 8 | 000333 | 美的集团 | 6,333,645.50 | 1.20 |
| 9 | 600690 | 海尔智家 | 6,198,694.00 | 1.18 |
| 10 | 603501 | 韦尔股份 | 6,148,816.00 | 1.17 |
| 11 | 601688 | 华泰证券 | 6,110,204.00 | 1.16 |
| 12 | 601633 | 长城汽车 | 6,061,948.46 | 1.15 |
| 13 | 300760 | 迈瑞医疗 | 6,053,637.00 | 1.15 |
| 14 | 600845 | 宝信软件 | 5,804,224.20 | 1.10 |
| 15 | 002128 | 电投能源 | 5,763,336.00 | 1.09 |
| 16 | 002001 | 新 和 成 | 5,583,369.00 | 1.06 |
| 17 | 600036 | 招商银行 | 5,555,769.00 | 1.05 |
| 18 | 601318 | 中国平安 | 5,537,141.36 | 1.05 |
| 19 | 688981 | 中芯国际 | 5,458,611.50 | 1.04 |
| 20 | 601728 | 中国电信 | 5,331,431.00 | 1.01 |

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.1.4.2 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

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 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|-------|--------------|-----------------|
| 1 | 002415 | 海康威视 | 4,998,156.00 | 0.95 |
| 2 | 600406 | 国电南瑞 | 4,757,509.00 | 0.90 |
| 3 | 601186 | 中国铁建 | 4,585,676.00 | 0.87 |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 4,272,789.00 | 0.81 |
| 5 | 600050 | 中国联通 | 4,236,173.00 | 0.80 |
| 6 | 601865 | 福莱特 | 4,138,664.00 | 0.79 |
| 7 | 600309 | 万华化学 | 4,050,638.00 | 0.77 |
| 8 | 600875 | 东方电气 | 4,028,368.00 | 0.76 |
| 9 | 601066 | 中信建投 | 4,017,130.00 | 0.76 |
| 10 | 601728 | 中国电信 | 3,989,529.00 | 0.76 |
| 11 | 688349 | 三一重能 | 3,946,336.29 | 0.75 |
| 12 | 600025 | 华能水电 | 3,869,757.86 | 0.73 |
| 13 | 603501 | 韦尔股份 | 3,840,663.60 | 0.73 |
| 14 | 002001 | 新 和 成 | 3,763,670.36 | 0.71 |
| 15 | 601225 | 陕西煤业 | 3,721,227.00 | 0.71 |
| 16 | 601600 | 中国铝业 | 3,643,850.00 | 0.69 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 17 | 000538 | 云南白药 | 3,522,840.40 | 0.67 |
| 18 | 600905 | 三峡能源 | 3,483,549.00 | 0.66 |
| 19 | 600030 | 中信证券 | 3,447,425.00 | 0.65 |
| 20 | 000338 | 潍柴动力 | 3,432,925.00 | 0.65 |

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.1.4.3 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

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 572,982,130.45 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 365,115,032.55 |

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。

7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.1.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.1.8 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。

7.1.9 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。

7.1.10 本基金投资股指期货的投资政策

基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.11.1 本期国债期货投资政策

基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.1.11.2 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。

7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.1.12.2 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。

7.1.13 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 | 72,848.21 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 5,103,646.01 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,176,494.22 |

7.1.13.1 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.1.13.2 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.1.13.2.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.1.13.2.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.1.13.3 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。

7.2 中银量化价值混合型证券投资基金

（报告期：2024年1月1日-2024年3月19日）

7.2.1 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 | 281,736,371.98 | 88.48 |
| | 其中：股票 | 281,736,371.98 | 88.48 |
| 2 | 基金投资 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 3 | 固定收益投资 | 18,291,116.16 | 5.74 |
| | 其中：债券 | 18,291,116.16 | 5.74 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 12,468,340.08 | 3.92 |
| 8 | 其他各项资产 | 5,912,467.59 | 1.86 |
| 9 | 合计 | 318,408,295.81 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票，本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 16,596,050.04 | 5.31 |
| C | 制造业 | 153,186,093.23 | 48.97 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,208,141.00 | 4.22 |
| E | 建筑业 | 7,768,071.00 | 2.48 |
| F | 批发和零售业 | 340,707.00 | 0.11 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,404,716.15 | 2.05 |
| H | 住宿和餐饮业 | 406,620.00 | 0.13 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 14,060,245.68 | 4.49 |
| J | 金融业 | 62,085,666.63 | 19.85 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 4,103,765.23 | 1.31 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 952,991.62 | 0.30 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 3,564.40 | 0.00 |
| 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 | 2,619,740.00 | 0.84 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 281,736,371.98 | 90.06 |

7.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 600519 | 贵州茅台 | 9,900 | 16,909,398.00 | 5.41 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 50,280 | 9,414,930.00 | 3.01 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 168,900 | 7,065,087.00 | 2.26 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 198,000 | 6,098,400.00 | 1.95 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 34,500 | 5,429,265.00 | 1.74 |
| 6 | 601658 | 邮储银行 | 973,500 | 4,585,185.00 | 1.47 |
| 7 | 002371 | 北方华创 | 15,200 | 4,485,216.00 | 1.43 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 153,300 | 4,459,497.00 | 1.43 |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 845,200 | 4,352,780.00 | 1.39 |
| 10 | 601688 | 华泰证券 | 291,500 | 4,180,110.00 | 1.34 |
| 11 | 000333 | 美的集团 | 64,200 | 4,018,920.00 | 1.28 |
| 12 | 002415 | 海康威视 | 113,600 | 3,785,152.00 | 1.21 |
| 13 | 000651 | 格力电器 | 96,200 | 3,682,536.00 | 1.18 |
| 14 | 600309 | 万华化学 | 46,400 | 3,646,112.00 | 1.17 |
| 15 | 600999 | 招商证券 | 259,100 | 3,637,764.00 | 1.16 |
| 16 | 601668 | 中国建筑 | 699,200 | 3,628,848.00 | 1.16 |
| 17 | 601600 | 中国铝业 | 524,200 | 3,506,898.00 | 1.12 |
| 18 | 600900 | 长江电力 | 140,700 | 3,478,104.00 | 1.11 |
| 19 | 600905 | 三峡能源 | 691,200 | 3,262,464.00 | 1.04 |
| 20 | 000001 | 平安银行 | 310,700 | 3,231,280.00 | 1.03 |
| 21 | 600150 | 中国船舶 | 92,200 | 3,206,716.00 | 1.03 |
| 22 | 000338 | 潍柴动力 | 197,000 | 3,197,310.00 | 1.02 |
| 23 | 600332 | 白云山 | 108,700 | 3,162,083.00 | 1.01 |
| 24 | 601728 | 中国电信 | 547,500 | 3,126,225.00 | 1.00 |
| 25 | 600406 | 国电南瑞 | 125,500 | 3,053,415.00 | 0.98 |
| 26 | 600028 | 中国石化 | 490,400 | 3,015,960.00 | 0.96 |
| 27 | 600276 | 恒瑞医药 | 65,101 | 2,992,692.97 | 0.96 |
| 28 | 600030 | 中信证券 | 140,025 | 2,916,720.75 | 0.93 |
| 29 | 300760 | 迈瑞医疗 | 9,800 | 2,869,146.00 | 0.92 |
| 30 | 601939 | 建设银行 | 414,500 | 2,785,440.00 | 0.89 |
| 31 | 601328 | 交通银行 | 441,600 | 2,707,008.00 | 0.87 |
| 32 | 688036 | 传音控股 | 16,220 | 2,660,080.00 | 0.85 |
| 33 | 600050 | 中国联通 | 564,700 | 2,620,208.00 | 0.84 |
| 34 | 600025 | 华能水电 | 278,700 | 2,619,780.00 | 0.84 |
| 35 | 601766 | 中国中车 | 398,200 | 2,564,408.00 | 0.82 |
| 36 | 601899 | 紫金矿业 | 165,000 | 2,562,450.00 | 0.82 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 37 | 600690 | 海尔智家 | 104,700 | 2,477,202.00 | 0.79 |
| 38 | 688349 | 三一重能 | 83,787 | 2,437,363.83 | 0.78 |
| 39 | 000625 | 长安汽车 | 140,300 | 2,422,981.00 | 0.77 |
| 40 | 600019 | 宝钢股份 | 363,900 | 2,398,101.00 | 0.77 |
| 41 | 601186 | 中国铁建 | 272,100 | 2,288,361.00 | 0.73 |
| 42 | 603228 | 景旺电子 | 106,500 | 2,279,100.00 | 0.73 |
| 43 | 601633 | 长城汽车 | 94,300 | 2,266,029.00 | 0.72 |
| 44 | 600919 | 江苏银行 | 295,400 | 2,247,994.00 | 0.72 |
| 45 | 002601 | 龙佰集团 | 118,000 | 2,213,680.00 | 0.71 |
| 46 | 600875 | 东方电气 | 138,400 | 2,181,184.00 | 0.70 |
| 47 | 601066 | 中信建投 | 94,100 | 2,175,592.00 | 0.70 |
| 48 | 002001 | 新和成 | 123,100 | 2,140,709.00 | 0.68 |
| 49 | 601006 | 大秦铁路 | 290,100 | 2,109,027.00 | 0.67 |
| 50 | 000538 | 云南白药 | 41,000 | 2,102,070.00 | 0.67 |
| 51 | 600104 | 上汽集团 | 139,600 | 2,057,704.00 | 0.66 |
| 52 | 603501 | 韦尔股份 | 20,000 | 2,016,200.00 | 0.64 |
| 53 | 300124 | 汇川技术 | 32,000 | 2,014,080.00 | 0.64 |
| 54 | 300442 | 润泽科技 | 80,300 | 2,005,894.00 | 0.64 |
| 55 | 000895 | 双汇发展 | 68,500 | 1,957,730.00 | 0.63 |
| 56 | 600737 | 中粮糖业 | 207,400 | 1,928,820.00 | 0.62 |
| 57 | 600061 | 国投资本 | 284,500 | 1,911,840.00 | 0.61 |
| 58 | 601857 | 中国石油 | 208,900 | 1,859,210.00 | 0.59 |
| 59 | 600362 | 江西铜业 | 80,900 | 1,851,801.00 | 0.59 |
| 60 | 600438 | 通威股份 | 68,100 | 1,791,711.00 | 0.57 |
| 61 | 601985 | 中国核电 | 208,300 | 1,772,633.00 | 0.57 |
| 62 | 603993 | 洛阳钼业 | 211,900 | 1,629,511.00 | 0.52 |
| 63 | 000063 | 中兴通讯 | 53,700 | 1,560,522.00 | 0.50 |
| 64 | 002739 | 万达电影 | 98,500 | 1,543,495.00 | 0.49 |
| 65 | 601225 | 陕西煤业 | 61,700 | 1,530,160.00 | 0.49 |
| 66 | 601888 | 中国中免 | 17,100 | 1,496,250.00 | 0.48 |
| 67 | 601138 | 工业富联 | 58,300 | 1,487,233.00 | 0.48 |
| 68 | 600188 | 兖矿能源 | 62,300 | 1,475,887.00 | 0.47 |
| 69 | 000301 | 东方盛虹 | 137,600 | 1,450,304.00 | 0.46 |
| 70 | 601800 | 中国交建 | 169,700 | 1,401,722.00 | 0.45 |
| 71 | 601865 | 福莱特 | 46,300 | 1,347,793.00 | 0.43 |
| 72 | 002142 | 宁波银行 | 63,200 | 1,324,040.00 | 0.42 |
| 73 | 002236 | 大华股份 | 68,400 | 1,320,804.00 | 0.42 |
| 74 | 300433 | 蓝思科技 | 98,700 | 1,320,606.00 | 0.42 |
| 75 | 600000 | 浦发银行 | 187,200 | 1,312,272.00 | 0.42 |
| 76 | 601169 | 北京银行 | 233,900 | 1,267,738.00 | 0.41 |
| 77 | 601601 | 中国太保 | 53,500 | 1,234,245.00 | 0.39 |
| 78 | 600801 | 华新水泥 | 91,400 | 1,222,018.00 | 0.39 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 79 | 002064 | 华峰化学 | 174,200 | 1,189,786.00 | 0.38 |
| 80 | 600547 | 山东黄金 | 45,400 | 1,141,356.00 | 0.36 |
| 81 | 002475 | 立讯精密 | 38,483 | 1,133,709.18 | 0.36 |
| 82 | 688012 | 中微公司 | 7,200 | 1,105,776.00 | 0.35 |
| 83 | 002027 | 分众传媒 | 168,900 | 1,075,893.00 | 0.34 |
| 84 | 600867 | 通化东宝 | 103,200 | 1,072,248.00 | 0.34 |
| 85 | 600031 | 三一重工 | 75,100 | 1,062,665.00 | 0.34 |
| 86 | 000581 | 威孚高科 | 61,300 | 1,058,038.00 | 0.34 |
| 87 | 300001 | 特锐德 | 51,900 | 1,057,722.00 | 0.34 |
| 88 | 601898 | 中煤能源 | 85,800 | 1,048,476.00 | 0.34 |
| 89 | 600845 | 宝信软件 | 25,360 | 1,048,382.40 | 0.34 |
| 90 | 601816 | 京沪高铁 | 209,300 | 1,046,500.00 | 0.33 |
| 91 | 601229 | 上海银行 | 157,200 | 1,032,804.00 | 0.33 |
| 92 | 600642 | 申能股份 | 137,700 | 1,032,750.00 | 0.33 |
| 93 | 601088 | 中国神华 | 27,100 | 1,011,643.00 | 0.32 |
| 94 | 601211 | 国泰君安 | 65,500 | 966,780.00 | 0.31 |
| 95 | 002648 | 卫星化学 | 56,600 | 966,728.00 | 0.31 |
| 96 | 000061 | 农产品 | 153,000 | 963,900.00 | 0.31 |
| 97 | 601818 | 光大银行 | 293,400 | 947,682.00 | 0.30 |
| 98 | 603259 | 药明康德 | 18,560 | 943,033.60 | 0.30 |
| 99 | 002156 | 通富微电 | 36,200 | 924,548.00 | 0.30 |
| 100 | 600918 | 中泰证券 | 130,100 | 908,098.00 | 0.29 |
| 101 | 600941 | 中国移动 | 8,500 | 877,030.00 | 0.28 |
| 102 | 600066 | 宇通客车 | 42,900 | 806,520.00 | 0.26 |
| 103 | 601628 | 中国人寿 | 26,000 | 751,140.00 | 0.24 |
| 104 | 601009 | 南京银行 | 81,800 | 723,930.00 | 0.23 |
| 105 | 601919 | 中远海控 | 69,500 | 713,070.00 | 0.23 |
| 106 | 000630 | 铜陵有色 | 179,200 | 697,088.00 | 0.22 |
| 107 | 600038 | 中直股份 | 16,900 | 696,956.00 | 0.22 |
| 108 | 601916 | 浙商银行 | 241,100 | 694,368.00 | 0.22 |
| 109 | 300115 | 长盈精密 | 61,900 | 674,710.00 | 0.22 |
| 110 | 000725 | 京东方 A | 163,900 | 662,156.00 | 0.21 |
| 111 | 600760 | 中航沈飞 | 17,120 | 649,875.20 | 0.21 |
| 112 | 000568 | 泸州老窖 | 3,400 | 648,516.00 | 0.21 |
| 113 | 002911 | 佛燃能源 | 48,300 | 648,186.00 | 0.21 |
| 114 | 601098 | 中南传媒 | 49,600 | 634,384.00 | 0.20 |
| 115 | 600926 | 杭州银行 | 57,700 | 626,045.00 | 0.20 |
| 116 | 600015 | 华夏银行 | 99,600 | 622,500.00 | 0.20 |
| 117 | 603187 | 海容冷链 | 39,100 | 615,043.00 | 0.20 |
| 118 | 688208 | 道通科技 | 28,800 | 612,000.00 | 0.20 |
| 119 | 002304 | 洋河股份 | 5,800 | 604,650.00 | 0.19 |
| 120 | 600685 | 中船防务 | 22,600 | 584,436.00 | 0.19 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 121 | 002352 | 顺丰控股 | 15,100 | 581,501.00 | 0.19 |
| 122 | 000776 | 广发证券 | 41,300 | 579,026.00 | 0.19 |
| 123 | 601233 | 桐昆股份 | 41,200 | 568,972.00 | 0.18 |
| 124 | 600057 | 厦门象屿 | 85,400 | 565,348.00 | 0.18 |
| 125 | 000708 | 中信特钢 | 37,100 | 555,016.00 | 0.18 |
| 126 | 000921 | 海信家电 | 19,900 | 551,230.00 | 0.18 |
| 127 | 300735 | 光弘科技 | 19,000 | 534,090.00 | 0.17 |
| 128 | 688516 | 奥特维 | 4,567 | 521,094.70 | 0.17 |
| 129 | 600018 | 上港集团 | 98,500 | 518,110.00 | 0.17 |
| 130 | 601111 | 中国国航 | 68,900 | 512,616.00 | 0.16 |
| 131 | 600377 | 宁沪高速 | 43,600 | 502,708.00 | 0.16 |
| 132 | 002422 | 科伦药业 | 16,200 | 486,324.00 | 0.16 |
| 133 | 300017 | 网宿科技 | 45,800 | 454,336.00 | 0.15 |
| 134 | 601618 | 中国中冶 | 132,100 | 449,140.00 | 0.14 |
| 135 | 601238 | 广汽集团 | 47,400 | 445,086.00 | 0.14 |
| 136 | 601928 | 凤凰传媒 | 39,700 | 441,861.00 | 0.14 |
| 137 | 688439 | 振华风光 | 5,300 | 434,123.00 | 0.14 |
| 138 | 603919 | 金徽酒 | 19,700 | 430,642.00 | 0.14 |
| 139 | 601163 | 三角轮胎 | 26,300 | 427,901.00 | 0.14 |
| 140 | 601890 | 亚星锚链 | 47,900 | 410,503.00 | 0.13 |
| 141 | 002859 | 洁美科技 | 17,400 | 409,770.00 | 0.13 |
| 142 | 600258 | 首旅酒店 | 27,000 | 406,620.00 | 0.13 |
| 143 | 601336 | 新华保险 | 13,000 | 403,390.00 | 0.13 |
| 144 | 601699 | 潞安环能 | 17,512 | 396,997.04 | 0.13 |
| 145 | 003816 | 中国广核 | 103,200 | 394,224.00 | 0.13 |
| 146 | 002230 | 科大讯飞 | 7,800 | 393,900.00 | 0.13 |
| 147 | 600535 | 天士力 | 20,900 | 360,316.00 | 0.12 |
| 148 | 605499 | 东鹏饮料 | 1,900 | 359,784.00 | 0.12 |
| 149 | 601958 | 金钼股份 | 31,800 | 358,068.00 | 0.11 |
| 150 | 601028 | 玉龙股份 | 33,700 | 340,707.00 | 0.11 |
| 151 | 000088 | 盐田港 | 65,500 | 311,780.00 | 0.10 |
| 152 | 603195 | 公牛集团 | 2,985 | 310,260.90 | 0.10 |
| 153 | 688235 | 百济神州 | 2,200 | 307,362.00 | 0.10 |
| 154 | 002078 | 太阳纸业 | 21,500 | 300,570.00 | 0.10 |
| 155 | 300866 | 安克创新 | 3,500 | 298,655.00 | 0.10 |
| 156 | 600938 | 中国海油 | 10,200 | 289,884.00 | 0.09 |
| 157 | 002594 | 比亚迪 | 1,300 | 281,840.00 | 0.09 |
| 158 | 600985 | 淮北矿业 | 16,300 | 276,448.00 | 0.09 |
| 159 | 688599 | 天合光能 | 10,400 | 271,336.00 | 0.09 |
| 160 | 600837 | 海通证券 | 29,200 | 264,260.00 | 0.08 |
| 161 | 603288 | 海天味业 | 6,400 | 260,544.00 | 0.08 |
| 162 | 600219 | 南山铝业 | 77,200 | 257,848.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 163 | 603345 | 安井食品 | 2,800 | 252,896.00 | 0.08 |
| 164 | 601319 | 中国人保 | 47,900 | 243,811.00 | 0.08 |
| 165 | 688111 | 金山办公 | 800 | 243,640.00 | 0.08 |
| 166 | 300803 | 指南针 | 4,900 | 237,650.00 | 0.08 |
| 167 | 002373 | 千方科技 | 20,800 | 224,848.00 | 0.07 |
| 168 | 688041 | 海光信息 | 2,600 | 209,690.00 | 0.07 |
| 169 | 601717 | 郑煤机 | 12,500 | 180,000.00 | 0.06 |
| 170 | 600482 | 中国动力 | 7,800 | 156,702.00 | 0.05 |
| 171 | 600893 | 航发动力 | 3,500 | 123,445.00 | 0.04 |
| 172 | 002032 | 苏泊尔 | 2,000 | 112,540.00 | 0.04 |
| 173 | 601021 | 春秋航空 | 1,900 | 106,210.00 | 0.03 |
| 174 | 301538 | 骏鼎达 | 1,066 | 59,504.12 | 0.02 |
| 175 | 000596 | 古井贡酒 | 200 | 51,378.00 | 0.02 |
| 176 | 600901 | 江苏金租 | 10,800 | 50,652.00 | 0.02 |
| 177 | 603344 | 星德胜 | 1,788 | 34,293.84 | 0.01 |
| 178 | 001359 | 平安电工 | 1,833 | 31,875.87 | 0.01 |
| 179 | 301516 | 中远通 | 598 | 12,294.88 | 0.00 |
| 180 | 301508 | 中机认检 | 291 | 9,958.02 | 0.00 |
| 181 | 688709 | 成都华微 | 422 | 9,051.90 | 0.00 |
| 182 | 301413 | 安培龙 | 152 | 8,914.80 | 0.00 |
| 183 | 688652 | 京仪装备 | 164 | 7,450.52 | 0.00 |
| 184 | 301555 | 惠柏新材 | 224 | 7,239.68 | 0.00 |
| 185 | 688648 | 中邮科技 | 303 | 6,993.24 | 0.00 |
| 186 | 688653 | 康希通信 | 498 | 6,862.44 | 0.00 |
| 187 | 301568 | 思泰克 | 168 | 6,827.52 | 0.00 |
| 188 | 688695 | 中创股份 | 186 | 6,796.44 | 0.00 |
| 189 | 301459 | 丰茂股份 | 163 | 6,647.14 | 0.00 |
| 190 | 688720 | 艾森股份 | 157 | 6,281.57 | 0.00 |
| 191 | 603341 | 龙旗科技 | 135 | 5,732.10 | 0.00 |
| 192 | 688716 | 中研股份 | 158 | 5,049.68 | 0.00 |
| 193 | 688719 | 爱科赛博 | 91 | 5,016.83 | 0.00 |
| 194 | 001378 | 德冠新材 | 134 | 3,879.30 | 0.00 |
| 195 | 688657 | 浩辰软件 | 55 | 3,698.20 | 0.00 |
| 196 | 601033 | 永兴股份 | 266 | 3,564.40 | 0.00 |
| 197 | 603082 | 北自科技 | 101 | 3,253.21 | 0.00 |
| 198 | 601083 | 锦江航运 | 331 | 3,194.15 | 0.00 |
| 199 | 001326 | 联域股份 | 83 | 3,141.55 | 0.00 |
| 200 | 001239 | 永达股份 | 189 | 3,133.62 | 0.00 |
| 201 | 603107 | 上海汽配 | 153 | 2,838.15 | 0.00 |
| 202 | 603375 | 盛景微 | 59 | 2,807.22 | 0.00 |
| 203 | 600346 | 恒力石化 | 200 | 2,622.00 | 0.00 |
| 204 | 603373 | 安邦护卫 | 87 | 2,374.23 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|-----|----------|------|
| 205 | 603325 | 博隆技术 | 32 | 2,311.04 | 0.00 |
| 206 | 603062 | 麦加芯彩 | 51 | 2,246.55 | 0.00 |
| 207 | 603193 | 润本股份 | 139 | 2,230.95 | 0.00 |
| 208 | 603004 | 鼎龙科技 | 108 | 2,018.52 | 0.00 |
| 209 | 603276 | 恒兴新材 | 95 | 1,898.10 | 0.00 |
| 210 | 600570 | 恒生电子 | 76 | 1,872.64 | 0.00 |
| 211 | 603312 | 西典新能 | 69 | 1,854.03 | 0.00 |
| 212 | 603231 | 索宝蛋白 | 92 | 1,636.68 | 0.00 |
| 213 | 600089 | 特变电工 | 60 | 945.00 | 0.00 |
| 214 | 000100 | TCL 科技 | 10 | 46.40 | 0.00 |
| 215 | 600958 | 东方证券 | 4 | 34.88 | 0.00 |

7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1 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 | 600519 | 贵州茅台 | 6,786,443.00 | 3.25 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 3,742,756.00 | 1.79 |
| 3 | 601728 | 中国电信 | 3,595,072.00 | 1.72 |
| 4 | 600150 | 中国船舶 | 3,521,992.00 | 1.69 |
| 5 | 002371 | 北方华创 | 3,419,399.75 | 1.64 |
| 6 | 601600 | 中国铝业 | 3,353,524.00 | 1.61 |
| 7 | 600050 | 中国联通 | 3,327,530.00 | 1.59 |
| 8 | 000333 | 美的集团 | 3,310,587.00 | 1.59 |
| 9 | 600905 | 三峡能源 | 3,293,574.00 | 1.58 |
| 10 | 601985 | 中国核电 | 3,290,221.00 | 1.58 |
| 11 | 000858 | 五 粮 液 | 3,286,521.00 | 1.57 |
| 12 | 600887 | 伊利股份 | 3,132,302.00 | 1.50 |
| 13 | 600332 | 白云山 | 3,046,627.00 | 1.46 |
| 14 | 600028 | 中国石化 | 3,011,989.00 | 1.44 |
| 15 | 300760 | 迈瑞医疗 | 2,932,316.00 | 1.40 |
| 16 | 600690 | 海尔智家 | 2,728,289.00 | 1.31 |
| 17 | 600061 | 国投资本 | 2,705,950.00 | 1.30 |
| 18 | 688349 | 三一重能 | 2,691,965.90 | 1.29 |
| 19 | 600900 | 长江电力 | 2,654,508.00 | 1.27 |
| 20 | 600875 | 东方电气 | 2,639,370.00 | 1.26 |

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.2.4.2 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 | 000333 | 美的集团 | 2,889,192.00 | 1.38 |
| 2 | 002493 | 荣盛石化 | 2,731,988.00 | 1.31 |
| 3 | 601138 | 工业富联 | 2,715,923.00 | 1.30 |
| 4 | 601985 | 中国核电 | 2,457,910.00 | 1.18 |
| 5 | 603501 | 韦尔股份 | 2,447,877.60 | 1.17 |
| 6 | 000596 | 古井贡酒 | 2,348,856.00 | 1.12 |
| 7 | 601899 | 紫金矿业 | 2,191,398.00 | 1.05 |
| 8 | 600048 | 保利发展 | 2,179,608.00 | 1.04 |
| 9 | 601728 | 中国电信 | 2,154,519.00 | 1.03 |
| 10 | 300760 | 迈瑞医疗 | 2,109,902.00 | 1.01 |
| 11 | 600519 | 贵州茅台 | 1,968,262.76 | 0.94 |
| 12 | 600104 | 上汽集团 | 1,942,144.00 | 0.93 |
| 13 | 601800 | 中国交建 | 1,935,349.00 | 0.93 |
| 14 | 601021 | 春秋航空 | 1,932,289.00 | 0.93 |
| 15 | 601088 | 中国神华 | 1,927,876.00 | 0.92 |
| 16 | 000858 | 五 粮 液 | 1,910,925.00 | 0.91 |
| 17 | 600845 | 宝信软件 | 1,845,122.00 | 0.88 |
| 18 | 603885 | 吉祥航空 | 1,839,320.00 | 0.88 |
| 19 | 300274 | 阳光电源 | 1,838,846.00 | 0.88 |
| 20 | 002475 | 立讯精密 | 1,811,377.00 | 0.87 |

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.2.4.3 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

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 263,090,931.29 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 187,405,411.11 |

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。

7.2.5 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 | 18,291,116.16 | 5.85 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |

| | | | |
|----|------|---------------|------|
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 18,291,116.16 | 5.85 |

7.2.6 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 | 019709 | 23 国债 16 | 181,000 | 18,291,116.16 | 5.85 |

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.2.8 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。

7.2.9 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。

7.2.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.2.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.2.11.2 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。

7.2.12 投资组合报告附注

7.2.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.2.12.2 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。

7.2.13 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 | 1,888,119.90 |
| 2 | 应收清算款 | 4,024,347.69 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,912,467.59 |

7.2.13.1 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.2.13.2 前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.2.13.3 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

（报告期：2024年3月20日-2024年6月30日）

8.1.1 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 | 持有份额 | 占总份额比 |

| | | | | 例 | | 例 |
|----------------------------|-------|------------|----------------|---------|---------------|--------|
| 中银沪 深 300 指数增 强 A | 981 | 295,490.48 | 272,110,841.58 | 93.8714 | 17,765,317.27 | 6.1286 |
| 中银沪 深 300 指数增 强 C | 1,055 | 201,165.94 | 207,668,323.97 | 97.8506 | 4,561,747.18 | 2.1494 |
| 合计 | 2,036 | 246,614.06 | 479,779,165.55 | 95.5533 | 22,327,064.45 | 4.4467 |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 中银沪深 300 指数增 强 A | 385,172.87 | 0.1329% |
| | 中银沪深 300 指数增 强 C | 8,394.15 | 0.0040% |
| | 合计 | 393,567.02 | 0.0784% |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.1.3 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 | 份额级别 | 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 | 中银沪深 300 指数增强 A | 10~50 |
| | 中银沪深 300 指数增强 C | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式 基金 | 中银沪深 300 指数增强 A | 0~10 |
| | 中银沪深 300 指数增强 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

8.2 中银量化价值混合型证券投资基金

(报告期: 2024年1月1日-2024年3月19日)

8.2.1 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 |
| 中银量化价值混合 A | 490 | 365,178.74 | 165,829,039.89 | 92.6742 | 13,108,543.57 | 7.3258 |
| 中银量化价值混合 C | 329 | 365,933.70 | 119,614,128.03 | 99.3537 | 778,059.73 | 0.6463 |
| 合计 | 819 | 365,482.02 | 285,443,167.92 | 95.3608 | 13,886,603.30 | 4.6392 |

注: 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中, 对下属分级基金, 比例的分母采用各自级别的份额, 对合计数, 比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 中银量化价值混合 A | 384,249.17 | 0.2147% |
| | 中银量化价值混合 C | 8,394.15 | 0.0070% |
| | 合计 | 392,643.32 | 0.1312% |

注: 分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中, 对下属分级基金, 比例的分母采用各自级别的份额, 对合计数, 比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2.3 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 | 份额级别 | 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 | 中银量化价值混合 A | 10~50 |
| | 中银量化价值混合 C | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中银量化价值混合 A | 0~10 |
| | 中银量化价值混合 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

§9 开放式基金份额变动

9.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

(报告期: 2024年3月20日-2024年6月30日)

单位: 份

| 项目 | 中银沪深 300 指数增强 A | 中银沪深 300 指数增强 C |
|--------------------------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日(2024 年 3 月 20 日)基金份额总额 | 178,937,583.46 | 120,392,187.76 |
| 本报告期基金总申购份额 | 112,134,552.86 | 104,113,521.64 |
| 减: 本报告期基金总赎回份额 | 1,195,977.47 | 12,275,638.25 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 289,876,158.85 | 212,230,071.15 |

9.2 中银量化价值混合型证券投资基金

(报告期: 2024年1月1日-2024年3月19日)

单位: 份

| 项目 | 中银量化价值混合 A | 中银量化价值混合 C |
|---------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2017 年 11 月 24 日)基金份额总额 | 333,826,575.55 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 170,766,173.35 | 36,858,056.09 |
| 本报告期基金总申购份额 | 8,683,718.60 | 110,721,765.87 |
| 减: 本报告期基金总赎回份额 | 512,308.49 | 27,187,634.20 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 178,937,583.46 | 120,392,187.76 |

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内,基金份额持有人大会于 2024 年 3 月 12 日表决通过了议《关于中银量化价值混合型证券投资基金转型的议案》。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,经 2024 年第一次股东会决议同意王志强先生、袁淳先生担任基金管理人独立董事,赵欣舸先生、杜惠芬女士不再担任基金管理人独立董事。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

2024 年 3 月 20 日原“中银量化价值混合型证券投资基金”转型为“中银沪深 300 指数增强型证券投资基金”。中银沪深 300 指数增强型证券投资基金投资策略详见 2024 年 3 月 19 日刊登在本公司网站的《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内没有改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

（报告期：2024 年 3 月 20 日-2024 年 6 月 30 日）

10.7.1.1 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 | |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | 900,059,874.72 | 96.00% | 382,687.88 | 98.21% | - |
| 中信证券股份有限公司 | 1 | 26,722,511.27 | 2.85% | 4,966.75 | 1.27% | - |
| 长江证券 | 2 | 10,777,919.06 | 1.15% | 2,003.56 | 0.51% | - |

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：退租兴业证券和国泰君安证券上海、深圳交易单元各一个。

10.7.1.2 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 | | 基金交易 | |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|----------------------------|---------------|---------|--------------|---------|---|---|---|---|
| 君安 | | | | | | | | |
| 华泰 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西南 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 信达 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 光大 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东北 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 德邦 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风 证券 | 18,094,526.00 | 100.00% | 6,000,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |
| 中信 证券 股份 有限 公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

10.7.2 中银量化价值混合型证券投资基金

(报告期: 2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 19 日)

10.7.2.1 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 | |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|----------------|---------|------------|---------|---|
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | 450,098,372.97 | 100.00% | 199,226.13 | 100.00% | - |

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：退租兴业证券和国泰君安证券上海、深圳交易单元各一个。

10.7.2.2 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 | | 基金交易 | |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|----------------------------|--------------|---------|---|---|---|---|---|---|
| 兴业 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华西 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万 宏源 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰 君安 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西南 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 光大 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东北 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 德邦 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信 证券 股份 有限 公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 信达 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风 证券 | 6,496,137.00 | 100.00% | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--------------------------------|-----------|------------|
| 1 | 中银量化价值混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-01-19 |
| 2 | 中银基金管理有限公司关于提醒投资者及时 | 中国证监会规定媒介 | 2024-02-02 |

| | | | |
|----|--|-----------|------------|
| | 提供或更新身份信息资料的公告 | | |
| 3 | 中银基金管理有限公司关于以通讯方式召开中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-02-08 |
| 4 | 中银基金管理有限公司关于以通讯方式召开中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-02-19 |
| 5 | 中银基金管理有限公司关于以通讯方式召开中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-02-20 |
| 6 | 中银量化价值混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效及决议生效后的基金转型安排的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-13 |
| 7 | 中银基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-19 |
| 8 | 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-19 |
| 9 | 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同 | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-19 |
| 10 | 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议 | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-19 |
| 11 | 关于中银量化价值混合型证券投资基金转型为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金的提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-19 |
| 12 | 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书 | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-20 |
| 13 | 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金（中银沪深 300 指数增强 C）产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-20 |
| 14 | 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金（中银沪深 300 指数增强 A）产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-20 |
| 15 | 中银量化价值混合型证券投资基金 2023 年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-29 |
| 16 | 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-04-19 |
| 17 | 中银基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-05-10 |
| 18 | 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金（中银沪深 300 指数增强 A）产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-26 |
| 19 | 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金（中银沪深 300 指数增强 C）产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-26 |
| 20 | 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2024 年第 1 号） | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-26 |
| 21 | 中银基金管理有限公司关于提醒投资者及时 | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-28 |

提供或更新身份信息资料的公告

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 中银沪深 300 指数增强型证券投资基金

11.1.1 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 | 20240320-20240623 | 70,060,378.04 | 9,351,037.97 | - | 79,411,416.01 | 15.8157% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 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：（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。 | | | | | | | |

11.2 中银量化价值混合型证券投资基金

11.2.1 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 | 20240101-20240207 | 49,631,333.04 | - | - | 49,631,333.04 | 16.5808% |
| | 2 | 20240101-20240207 | 50,446,080.49 | - | - | 50,446,080.49 | 16.8530% |
| | 3 | 20240227-20240319 | - | 70,060,378.04 | - | 70,060,378.04 | 23.4058% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 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：（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。 | | | | | | | |

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予中银量化价值混合型证券投资基金变更注册为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金的文件；

- 2、《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请中银量化价值混合型证券投资基金变更注册为中银沪深 300 指数增强型证券投资基金之法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地，供公众查阅。

12.3 查阅方式

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

二〇二四年八月三十一日