

**中银恒优 12 个月持有期债券型证券投资基金
2024 年第 3 季度报告
2024 年 9 月 30 日**

基金管理人：中银基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇二四年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|---|-------------------|
| 基金简称 | 中银恒优 12 个月持有期债券 | |
| 基金主代码 | 008232 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 4 月 29 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 234,690,871.16 份 | |
| 投资目标 | 本基金在控制风险和保持资产流动性的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，结合定性分析和定量分析的方法，形成对各大类资产的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定债券资产、权益类资产和现金类资产等的配置比例，并根据市场运行状况以及各类资产预期表现的相对变化，动态调整大类资产的配置比例，严格控制基金资产运作风险，提高基金资产风险调整后收益。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价(总值)指数收益率*95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)*5% | |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型证券投资基金，其预期风险和收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 中银基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 中银恒优 12 个月持有期债券 A | 中银恒优 12 个月持有期债券 C |
| 下属两级基金的交易代码 | 008232 | 008233 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 202,949,064.14 份 | 31,741,807.02 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2024年7月1日-2024年9月30日) | |
|----------------|-------------------------------|-----------------------|
| | 中银恒优 12 个月持有期 债券 A | 中银恒优 12 个月持有期 债券 C |
| 1.本期已实现收益 | 686,953.11 | 85,024.64 |
| 2.本期利润 | 549,295.93 | 51,292.56 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0029 | 0.0018 |
| 4.期末基金资产净值 | 222,690,441.40 | 34,576,584.00 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0973 | 1.0893 |

- 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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、中银恒优 12 个月持有期债券 A：

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.25% | 0.08% | 0.25% | 0.10% | 0.00% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.96% | 0.08% | 1.26% | 0.08% | 0.70% | 0.00% |
| 过去一年 | 4.48% | 0.07% | 3.37% | 0.07% | 1.11% | 0.00% |
| 过去三年 | 12.62% | 0.07% | 5.72% | 0.06% | 6.90% | 0.01% |
| 自基金合同 生效日起 | 12.85% | 0.08% | 4.38% | 0.06% | 8.47% | 0.02% |

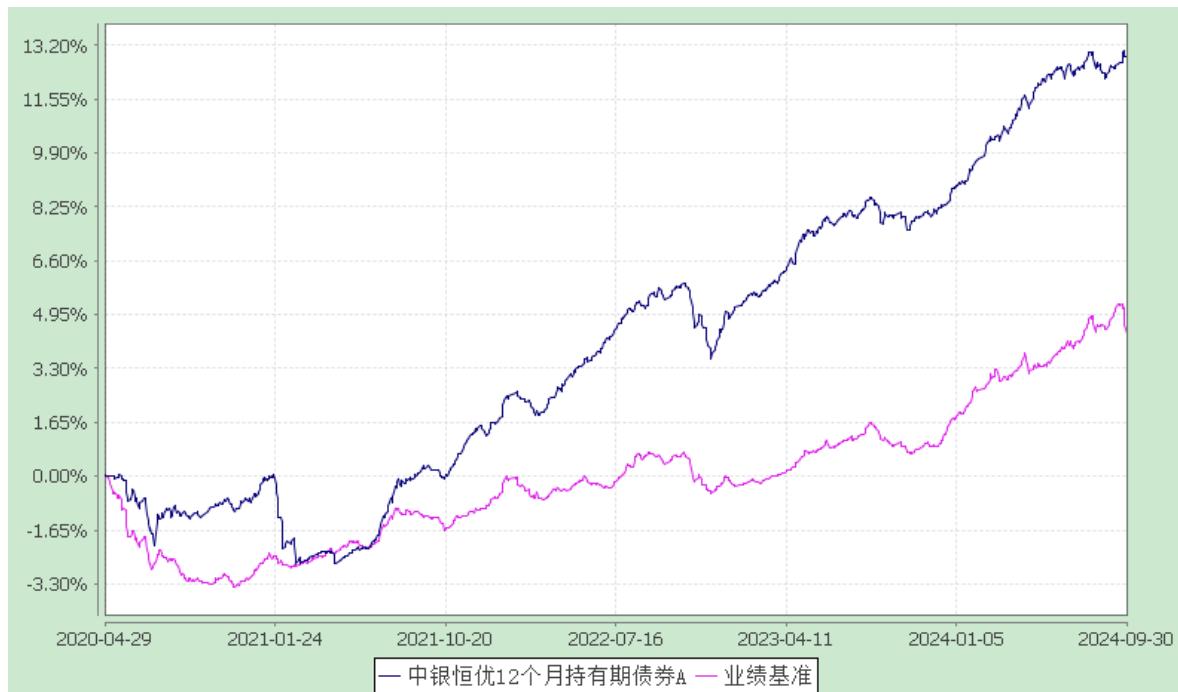
2、中银恒优 12 个月持有期债券 C：

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.17% | 0.08% | 0.25% | 0.10% | -0.08% | -0.02% |
| 过去六个月 | 1.80% | 0.08% | 1.26% | 0.08% | 0.54% | 0.00% |
| 过去一年 | 4.16% | 0.07% | 3.37% | 0.07% | 0.79% | 0.00% |
| 过去三年 | 11.60% | 0.07% | 5.72% | 0.06% | 5.88% | 0.01% |
| 自基金合同 生效日起 | 11.36% | 0.08% | 4.38% | 0.06% | 6.98% | 0.02% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

中银恒优 12 个月持有期债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2020 年 4 月 29 日至 2024 年 9 月 30 日)

1. 中银恒优 12 个月持有期债券 A:



2. 中银恒优 12 个月持有期债券 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈玮 | 基金经理 | 2021-02-25 | - | 16 | 中银基金管理有限公司固定收益投资部副总经理，董事（D），应用数学硕士。曾任上海浦东发展银行总行金融市场部高级交易员。2014 年加入中银基金管理有限公司，曾担任固定收益基金经理助理。2014 年 12 月至 2024 年 1 月任中银纯债基金基金经理，2014 年 12 月至今任中银添利基金基金经理，2014 年 12 月至 2020 年 12 月任中银盛利纯债基金基金经理，2015 年 5 月至 2018 年 2 月任中银新趋势基金基金经理，2015 年 6 月至 2021 年 5 月任中银聚利基金经理，2019 年 9 月至今任中银招利基金经理，2020 年 10 月至 2022 年 5 月任中银中高等级债券基金经理，2021 年 2 月至今任中银恒优基金经理，2021 年 6 月至今任中银通利基金经理，2022 年 1 月至今任中银恒悦 180 天基金基金经理，2022 年 3 月至今任中银民利基金经理，2023 |

| | | | | | |
|-----|------|------------|---|---|---|
| | | | | | 年 1 月至今任中银招盈基金基金经理，2023 年 10 月至今任中银稳汇短债基金基金经理，2024 年 1 月至今任中银荣享基金基金经理。具备基金从业资格。 |
| 武苇杭 | 基金经理 | 2023-12-11 | - | 9 | 统计学硕士。2016 年加入中银基金管理有限公司，曾任固定收益研究员、风控中台、基金经理助理。2023 年 12 月至今任中银恒优基金基金经理，2024 年 1 月至今任中银澳享基金经理。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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、中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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《中银基金管理有限公司公平交易管理办法》，建立了《新股询价申购和参与公开增发管理办法》、《债券询价申购管理办法》、《集中交易管理办法》等公平交易相关制度体系，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司证券池及组合风格库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施

投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

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，本报告期内未发生异常交易行为。

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 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，增长回归中性水平，但分化依然明显，主要经济体经济周期参差不齐，美欧日分别呈现软着陆、弱复苏、再通胀的不同特征。全球通胀整体继续回落，部分新兴经济体通胀抬头。主要经济体正式进入新一轮降息周期。美国 8 月 CPI 同比较 6 月回落 0.4 个百分点至 2.6%，9 月制造业 PMI 较 6 月回落 1.3 个百分点至 47.2%，9 月服务业 PMI 较 6 月抬升 6.1 个百分点至 54.9%，8 月失业率较 6 月持平于 4.1%，美联储在 9 月将政策目标利率下调 50bps 至 5.0%。欧元区经济表现分化，8 月欧元区失业率较 6 月回落 0.1 个百分点至 6.4%，9 月欧元区制造业 PMI 较 6 月回落 0.8 个百分点至 45%，服务业 PMI 较 6 月回落 1.4 个百分点至 51.4%，欧央行在 9 月降息 25bps。日本三季度经济延续温和复苏，8 月 CPI 同比较 6 月抬升 0.2 个百分点至 3.0%，9 月制造业 PMI 较 6 月回落 0.3 个百分点至 49.7%，9 月服务业 PMI 较 6 月回升 3.7 个百分点至 53.1%，日本央行 7 月超预期加息后表态称通胀已得到缓解，暂缓加息进程。综合来看，降息周期从预期到陆续落地，高利率的滞后影响还将在一段时间内制约全球经济复苏动能。

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，三季度领先指标中采制造业 PMI 维持在荣枯线以下，9 月值较 6 月值走高 0.3 个百分点至 49.8%，8 月工业增加值同比增长 4.5%，较 6 月回落 0.8 个百分点。从经济增长动力来看，出口仍有韧性，而投资与消费均偏弱：8 月美元计价出口增速较 6 月回升 0.1 个百分点至 8.7%，8 月社会消费品零售总额增速较 6 月回升 0.1 个百分点至 2.1%，基建投资偏弱，制造业投资维持韧性，房地产投资延续负增长，1-8 月固定资产投资累计同比增速较 1-6 月回落 0.5 个百分点至 3.4%。通胀方面，CPI 维持在低位，8 月同比增速从 6 月的 0.2% 小幅提振 0.4 个百分点至 0.6%，PPI 负值小幅走阔，8 月同比

增速从 6 月的 -0.8% 回落 1 个百分点至 -1.8%。

2. 市场回顾

三季度债市分化，利率债表现相对信用债更好。其中，中债总财富指数上涨 1.05%，中债银行间国债财富指数上涨 1.2%，中债企业债总财富指数上涨 0.36%。在收益率曲线上，收益率曲线走势陡峭化。其中，10 年期国债收益率从 2.21% 下行 5.4bps 至 2.15%，10 年期金融债（国开）收益率从 2.29% 下行 4.6bps 至 2.25%。货币市场方面，三季度央行保持流动性合理充裕，9 月降准 50bps。银行间 1 天回购加权平均利率均值在 1.79% 左右，较上季度均值下行 5bps，银行间 7 天回购利率均值在 1.9% 左右，较上季度均值下行 4bps。

可转债方面，三季度中证转债指数上涨 0.58%。三季度末可转债跟随权益市场反弹。

股票市场方面，三季度上证综指上涨 12.44%，代表大盘股表现的沪深 300 指数上涨 16.07%，中小板综合指数上涨 15.2%，创业板综合指数上涨 26.08%。

3. 运行分析

三季度股票市场收涨，债券市场中利率债收涨、表现好于信用债，转债指数基本持平。策略上，我们维持适度杠杆，纯债方面重点把握中短期高等级信用债的修复和配置机会，积极把握利率波段交易机会，并在季末减持中长期债券降低久期，努力在不承担过多信用风险前提下维持适当的收益，并积极根据曲线形态、期限利差、信用利差等变化，选择较优品种择优投资并适时进行资产轮动调整，不断优化调整债券组合；转债方面追求转债投资的确定性，重点选择溢价率较低、风险收益较为均衡的个券进行投资。三季度转债估值下压后，把握债底支撑的高评级个券投资机会积极增持，季末部分仓位切换到估值性价比较高的平衡型和偏股型转债。始终规避弱资质品种，防范潜在风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 0.25%，同期业绩比较基准收益率为 0.25%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 0.17%，同期业绩比较基准收益率为 0.25%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 301,703,653.14 | 91.38 |
| | 其中：债券 | 301,703,653.14 | 91.38 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 14,303,946.22 | 4.33 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,221,802.74 | 1.28 |
| 7 | 其他各项资产 | 9,945,210.04 | 3.01 |
| 8 | 合计 | 330,174,612.14 | 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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 28,282,953.47 | 10.99 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 81,922,372.82 | 31.84 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,278,866.12 | 4.00 |
| 4 | 企业债券 | 102,187,090.42 | 39.72 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,273,295.08 | 3.99 |
| 6 | 中期票据 | 40,756,881.05 | 15.84 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 38,281,060.30 | 14.88 |
| 8 | 同业存单 | - | - |

| | | | |
|----|----|----------------|--------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 301,703,653.14 | 117.27 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|--------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 170022 | 17 附息国债 22 | 100,000 | 13,644,273.22 | 5.30 |
| 2 | 2128033 | 21 建设银行二级 03 | 100,000 | 10,590,311.48 | 4.12 |
| 3 | 2228014 | 22 交通银行二级 01 | 100,000 | 10,472,147.54 | 4.07 |
| 4 | 185245 | 22 中金 Y1 | 100,000 | 10,458,939.73 | 4.07 |
| 5 | 240351 | 23 云控 05 | 100,000 | 10,418,932.06 | 4.05 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货，无相关政策。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。管理人将按照相关法律法规的规定，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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，国家金融监督管理总局多个下属机构对建设银行、交通银行进行了行政处罚，中国证券监督管理委员会及各地派出机构对中金公司、海通证券进行了行政处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 5,273.92 |
| 2 | 应收证券清算款 | 8,179,895.74 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,760,040.38 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 9,945,210.04 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 113052 | 兴业转债 | 4,060,940.59 | 1.58 |
| 2 | 113050 | 南银转债 | 2,388,377.04 | 0.93 |
| 3 | 123107 | 温氏转债 | 1,723,281.10 | 0.67 |
| 4 | 110073 | 国投转债 | 1,382,602.19 | 0.54 |
| 5 | 127045 | 牧原转债 | 1,156,709.86 | 0.45 |
| 6 | 128109 | 楚江转债 | 844,756.36 | 0.33 |
| 7 | 113058 | 友发转债 | 844,028.36 | 0.33 |
| 8 | 128081 | 海亮转债 | 783,291.56 | 0.30 |
| 9 | 123184 | 天阳转债 | 779,989.97 | 0.30 |
| 10 | 118033 | 华特转债 | 770,018.22 | 0.30 |
| 11 | 113637 | 华翔转债 | 749,881.64 | 0.29 |
| 12 | 110094 | 众和转债 | 742,414.52 | 0.29 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 13 | 127040 | 国泰转债 | 681,016.44 | 0.26 |
| 14 | 127086 | 恒邦转债 | 596,736.58 | 0.23 |
| 15 | 127041 | 弘亚转债 | 596,481.51 | 0.23 |
| 16 | 113044 | 大秦转债 | 592,602.69 | 0.23 |
| 17 | 123101 | 拓斯转债 | 582,969.86 | 0.23 |
| 18 | 113045 | 环旭转债 | 577,506.03 | 0.22 |
| 19 | 127015 | 希望转债 | 564,841.86 | 0.22 |
| 20 | 123217 | 富仕转债 | 552,986.71 | 0.21 |
| 21 | 123170 | 南电转债 | 544,010.63 | 0.21 |
| 22 | 127095 | 广泰转债 | 529,930.19 | 0.21 |
| 23 | 113621 | 彤程转债 | 527,621.37 | 0.21 |
| 24 | 123087 | 明电转债 | 509,213.70 | 0.20 |
| 25 | 110067 | 华安转债 | 486,909.59 | 0.19 |
| 26 | 123237 | 佳禾转债 | 473,993.42 | 0.18 |
| 27 | 123239 | 锋工转债 | 460,007.12 | 0.18 |
| 28 | 123224 | 宇邦转债 | 453,602.08 | 0.18 |
| 29 | 118028 | 会通转债 | 449,790.68 | 0.17 |
| 30 | 110089 | 兴发转债 | 443,678.90 | 0.17 |
| 31 | 110059 | 浦发转债 | 443,242.52 | 0.17 |
| 32 | 128106 | 华统转债 | 437,629.40 | 0.17 |
| 33 | 123168 | 惠云转债 | 428,001.21 | 0.17 |
| 34 | 113634 | 珀莱转债 | 403,022.88 | 0.16 |
| 35 | 113663 | 新化转债 | 382,729.32 | 0.15 |
| 36 | 123226 | 中富转债 | 363,730.27 | 0.14 |
| 37 | 113066 | 平煤转债 | 351,836.16 | 0.14 |
| 38 | 118038 | 金宏转债 | 345,879.86 | 0.13 |
| 39 | 127088 | 赫达转债 | 344,395.89 | 0.13 |
| 40 | 123212 | 立中转债 | 340,206.99 | 0.13 |
| 41 | 113671 | 武进转债 | 336,842.88 | 0.13 |
| 42 | 118012 | 微芯转债 | 335,914.36 | 0.13 |
| 43 | 111018 | 华康转债 | 333,068.22 | 0.13 |
| 44 | 123071 | 天能转债 | 329,729.59 | 0.13 |
| 45 | 127084 | 柳工转 2 | 327,109.64 | 0.13 |
| 46 | 123169 | 正海转债 | 321,670.60 | 0.13 |
| 47 | 110085 | 通 22 转债 | 308,934.00 | 0.12 |
| 48 | 127049 | 希望转 2 | 303,611.67 | 0.12 |
| 49 | 118034 | 晶能转债 | 283,511.34 | 0.11 |
| 50 | 113669 | 景 23 转债 | 259,034.52 | 0.10 |
| 51 | 123203 | 明电转 02 | 253,797.26 | 0.10 |
| 52 | 123228 | 震裕转债 | 246,003.34 | 0.10 |
| 53 | 113666 | 爱玛转债 | 238,762.19 | 0.09 |
| 54 | 127027 | 能化转债 | 238,119.73 | 0.09 |
| 55 | 127090 | 兴瑞转债 | 229,920.99 | 0.09 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 56 | 113619 | 世运转债 | 214,507.60 | 0.08 |
| 57 | 113654 | 永 02 转债 | 208,174.25 | 0.08 |
| 58 | 123219 | 宇瞳转债 | 132,995.89 | 0.05 |
| 59 | 118046 | 诺泰转债 | 128,468.99 | 0.05 |
| 60 | 127072 | 博实转债 | 120,899.73 | 0.05 |
| 61 | 123114 | 三角转债 | 119,204.11 | 0.05 |
| 62 | 110090 | 爱迪转债 | 115,037.53 | 0.04 |
| 63 | 110093 | 神马转债 | 114,564.47 | 0.04 |
| 64 | 127070 | 大中转债 | 113,798.63 | 0.04 |
| 65 | 111017 | 蓝天转债 | 76,030.75 | 0.03 |
| 66 | 113651 | 松霖转债 | 62,985.00 | 0.02 |
| 67 | 123182 | 广联转债 | 55,695.75 | 0.02 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中银恒优12个月持有期 债券A | 中银恒优12个月持有期 债券C |
|---------------|--------------------|--------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 183,885,853.75 | 21,915,711.05 |
| 本报告期基金总申购份额 | 38,434,374.04 | 11,578,673.92 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 19,371,163.65 | 1,752,577.95 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 202,949,064.14 | 31,741,807.02 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 中银恒优 12 个月持有期债 券 A | 中银恒优 12 个月持有期债 券 C |
|------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基 金份额 | 15,518,695.62 | - |
| 本报告期内买入/申购总份额 | 0.00 | - |
| 本报告期内卖出/赎回总份额 | 0.00 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基 金份额 | 15,518,695.62 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额 占基金总份额比例（%） | 7.65 | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金。

§§ 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银恒优 12 个月持有期债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《中银恒优 12 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银恒优 12 个月持有期债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中银恒优 12 个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

8.2 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。

8.3 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。

中银基金管理有限公司
二〇二四年十月二十四日