

---

中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
(原中银上证科创板 50 成份指数型证券投资基金)  
2025 年第 2 季度报告  
2025 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：中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇二五年七月二十一日

## § 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 7 月 18 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 2025 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中，2025 年 4 月 17 日起，“中银上证科创板 50 成份指数型证券投资基金”转型为“中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，基金合同及托管协议即日生效。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金简称	中银上证科创板 50ETF 联接
基金主代码	022728
交易代码	022728
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 4 月 17 日
报告期末基金份额总额	283,288,638.29 份
投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。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

	<p>差进一步扩大。</p> <p>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>投资策略包括资产配置策略、目标 ETF 投资策略、成份股、备选成份股投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、融资、转融通证券出借业务投资策略。</p>	
业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	<p>本基金的目标 ETF 为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。</p>	
基金管理人	中银基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	中银上证科创板 50ETF 联接 A	中银上证科创板 50ETF 联接 C
下属两级基金的交易代码	022728	022729
报告期末下属两级基金的份额总额	52,904,932.29 份	230,383,706.00 份

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	588720
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 3 月 27 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 4 月 15 日
基金管理人名称	中银基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

### 2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。
业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪上证科创板 50 成份指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

## 2.2 中银上证科创板 50 成份指数型证券投资基金

基金简称	中银上证科创板 50 成份指数
基金主代码	022728
交易代码	022728
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 12 月 25 日
报告期末基金份额总额	284,799,683.49 份
投资目标	本基金为股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金为股票型指数基金，以上证科创板 50 成份指数为标的指数，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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。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。</p> <p>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>投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、融资、转融通证券出借业务投资策略。</p>
业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，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。本

	基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	中银基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	中银上证科创板 50 成份指数 A	中银上证科创板 50 成份指数 C
下属两级基金的交易代码	022728	022729
报告期末下属两级基金的份额总额	46,774,514.18 份	238,025,169.31 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

##### 3.1.1 中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2025 年 4 月 17 日（基金合同生效日）-2025 年 6 月 30 日)	
	中银上证科创板 50ETF 联接 A	中银上证科创板 50ETF 联接 C
1.本期已实现收益	-1,654,135.44	-8,220,542.65
2.本期利润	-201,626.67	-2,260,513.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0041	-0.0095
4.期末基金资产净值	54,524,364.25	237,318,297.97
5.期末基金份额净值	1.0306	1.0301

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、本基金由原中银上证科创板 50 成份指数型证券投资基金于 2025 年 4 月 17 日转型而

来。

3.1.2 中银上证科创板 50 成份指数型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期	
	(2025 年 4 月 1 日-2025 年 4 月 16 日)	
	中银上证科创板 50 成份指数 A	中银上证科创板 50 成份指数 C
1.本期已实现收益	-138,459.62	-720,114.70
2.本期利润	-394,177.85	-2,052,214.42
3.加权平均基金份额本期 利润	-0.0083	-0.0082
4.期末基金资产净值	48,643,022.44	247,461,753.21
5.期末基金份额净值	1.0399	1.0396

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 2025 年 4 月 17 日转型为中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

3.2 基金净值表现

3.2.1 中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

（报告期：2025年4月17日-2025年6月30日）

3.2.1.1 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. 中银上证科创板 50ETF 联接 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
自基金合同	-0.89%	0.77%	-1.03%	0.79%	0.14%	-0.02%

生效日起						
------	--	--	--	--	--	--

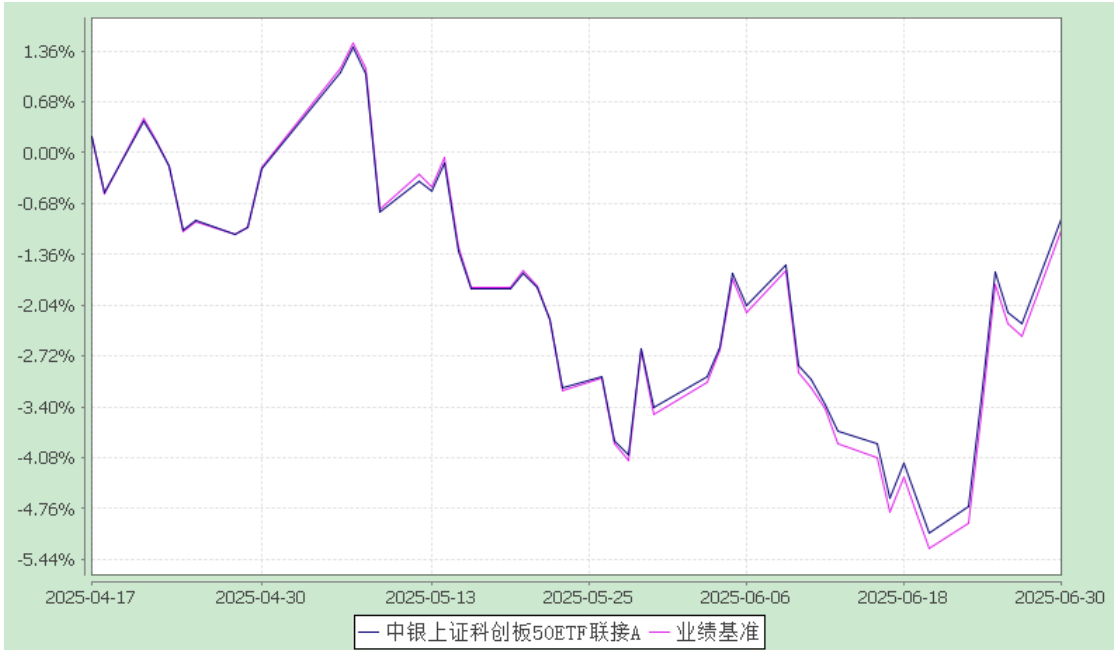
2. 中银上证科创板 50ETF 联接 C:

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
自基金合同生效日起	-0.91%	0.77%	-1.03%	0.79%	0.12%	-0.02%

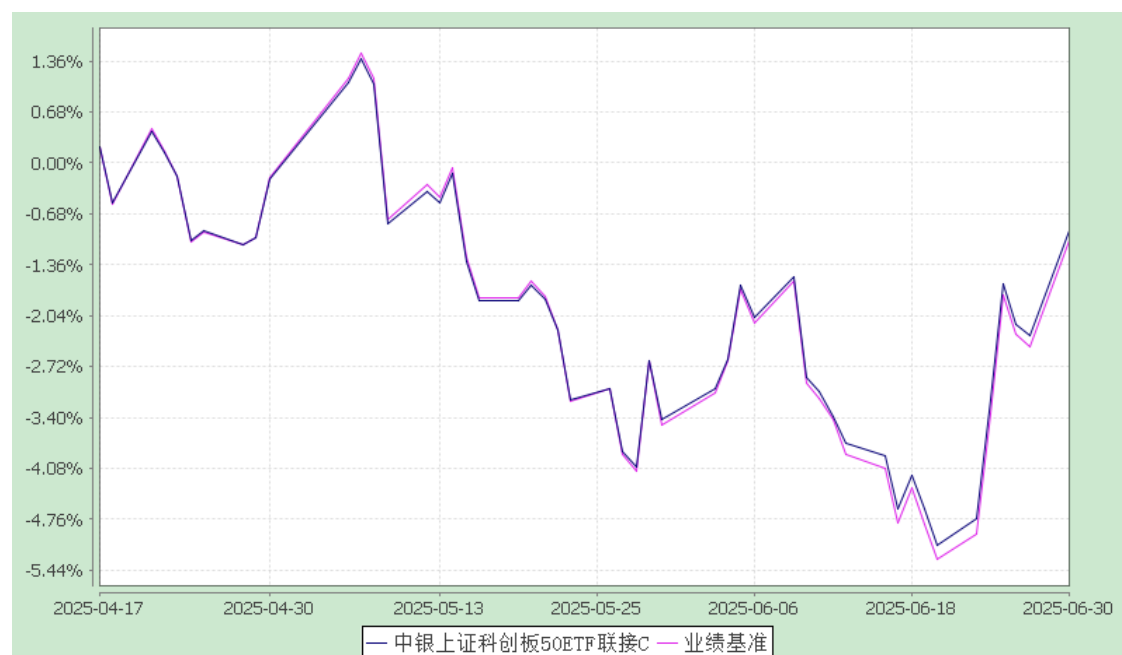
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
 份额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  
 (2025 年 4 月 17 日-2025 年 6 月 30 日)

1、中银上证科创板 50ETF 联接 A



2、中银上证科创板 50ETF 联接 C



注：截至报告期末，本基金成立未满一年。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。

### 3.2.2 中银上证科创板50成份指数型证券投资基金

(报告期：2025年4月1日-2025年4月16日)

#### 3.2.2.1 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. 中银上证科创板 50 成份指数 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	-0.74%	3.08%	-0.73%	3.20%	-0.01%	-0.12%
自基金合同 生效日起	3.99%	1.65%	0.13%	1.98%	3.86%	-0.33%

#### 2. 中银上证科创板 50 成份指数 C:

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.74%	3.08%	-0.73%	3.20%	-0.01%	-0.12%
自基金合同 生效日起	3.96%	1.65%	0.13%	1.98%	3.83%	-0.33%



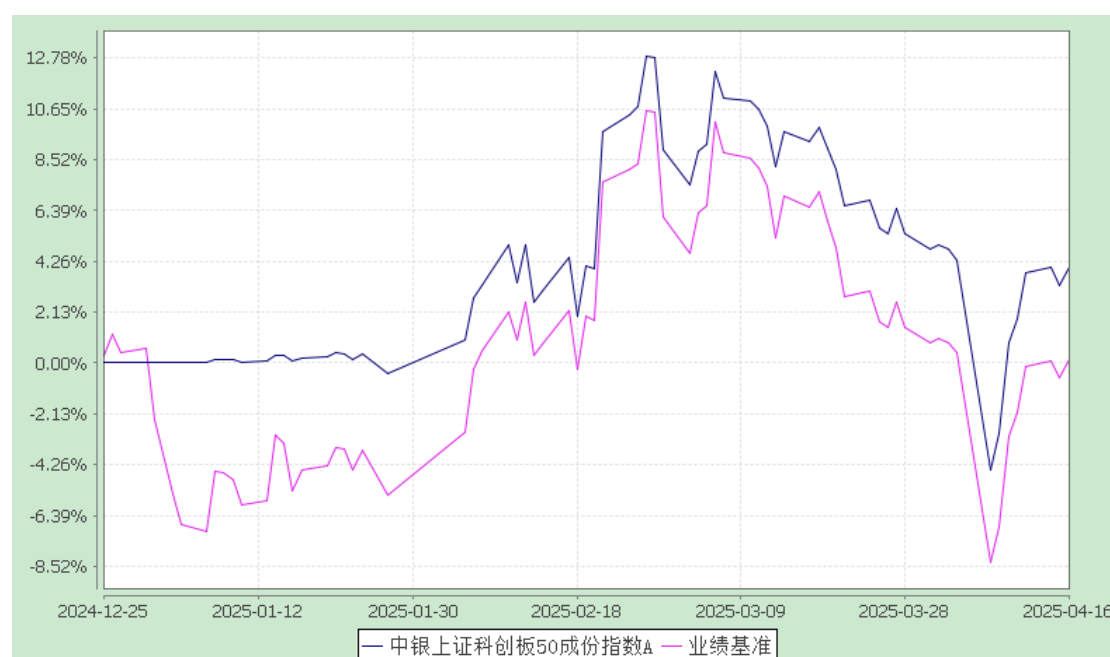
### 3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银上证科创板 50 成份指数型证券投资基金

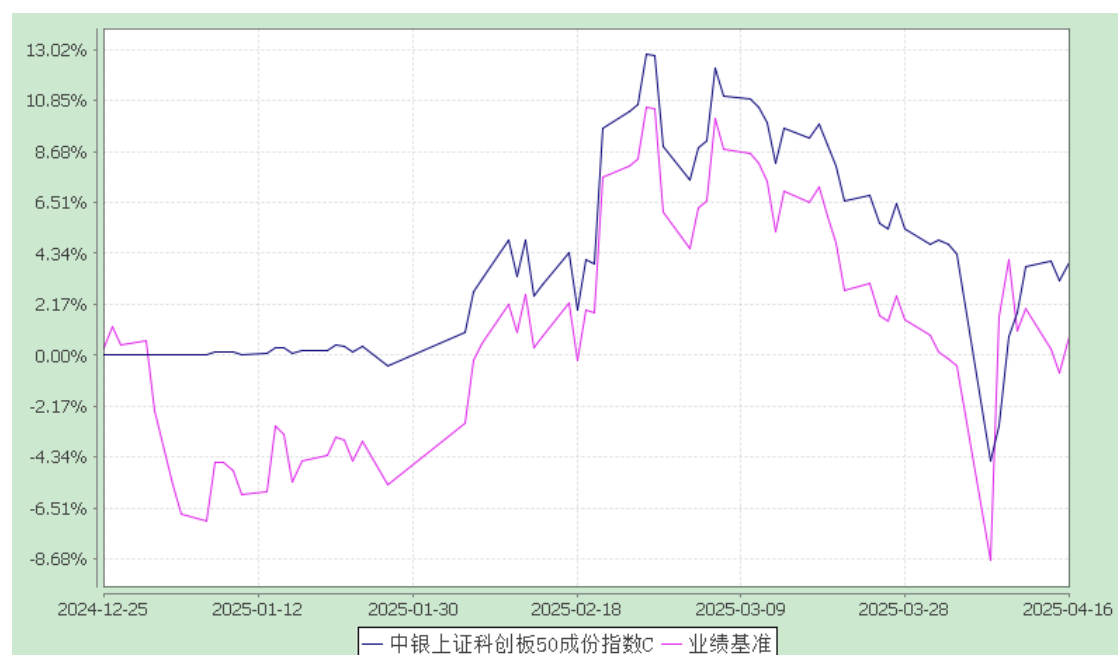
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024 年 12 月 25 日至 2025 年 4 月 16 日)

#### 1、中银上证科创板 50 成份指数 A



#### 2、中银上证科创板 50 成份指数 C



注：截至报告期末，本基金成立未满一年。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。

## § 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		
赵建忠	基金经理	2024-12-25	-	19	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），金融学硕士。2007 年加入中银基金管理有限公司，曾担任基金运营部基金会计、研究部研究员、基金经理助理。2015 年 6 月至今任中证 A100 指数基金基金经理，2015 年 6 月至今任国企 ETF 基金基金经理，2015 年 6 月至今任中银 300E 基金基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 2 月任中银宏利基金基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 2 月任中银丰利基金基金经理，2020 年 4 月至 2024 年 6 月任中银 100 基金基金经理，2020 年 7 月至 2022 年 8 月任中银 800 基金基金经理，2020 年 8 月至今任中银黄金基金基金经理，2020 年 9 月至今任中银上海金 ETF 联接基金基金经理，2020 年 11 月至 2024 年 2 月任中银中证 100ETF 联接基金基金经理，2021 年 12

					月至 2025 年 2 月任中银中证 800 基金（原目标 ETF 基金）基金经理，2024 年 3 月至今任中银中证央企红利 50 基金基金经理，2024 年 12 月至今任中银上证科创板 50ETF 联接基金（原中银上证科创板 50 成分指数基金）基金经理，2025 年 1 月至今任中银沪深 300 指数基金基金经理，2025 年 3 月至今任中银上证科创板 50ETF 基金基金经理，2025 年 5 月至今任中银中证全指自由现金流 ETF 基金基金经理，2025 年 6 月至今任中银中证港股通高股息基金基金经理。具备基金、期货从业资格。
--	--	--	--	--	--

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 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《新股询价申购管理办法》、《投资流通受限类证券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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

#### 1. 宏观和市场分析

当前，全球经济在关税扰动下呈现出复杂态势。国外方面，关税冲击促使全球工业生产和商品贸易前置，经济活跃度有所提振，但服务业延续放缓态势。全球通胀粘性逐渐消退，关税成为新的通胀主线。美国 6 月制造业 PMI 维持在 49%，服务业 PMI 回落至 49.9%，通胀与就业形势平稳，美联储二季度维持利率不变。欧元区经济分化，制造业 PMI 有所回升，服务业 PMI 回落，通胀放缓，欧央行二季度两次降息共 50bps。日本制造业和服务业 PMI 均有所回升，通胀略有下降，日央行维持利率不变。国内经济二季度增速略有回落，但整体态势良好。消费动

---

能强劲，投资增速有所放缓，抢出口动能减弱。价格方面，CPI 与 PPI 低位徘徊。制造业 PMI 连续三个月低于荣枯线，工业增加值增速回落但仍处于较高水平。消费增速加快，基建和制造业投资保持较高增速，房地产投资延续负增长。通胀方面，CPI 稳定在-0.1%，PPI 负值小幅扩大至-3.3%。整体来看，国内经济在外部扰动下展现出较强韧性，消费成为经济增长的重要支撑，但需关注投资和出口的后续变化。

二季度科创 50 指数下跌 1.89%，4 月初美国“对等关税”政策引发市场恐慌，科创 50 指数跌幅较大，但随后政策支撑下修复至事件前水平。二季度后半段，外部政策不确定性及内部经济弱复苏压力导致市场整体震荡。科创 50 指数二季度受中美关税博弈的不确定性导致的市场风险偏好下降、盈利修复缓慢及公募新规下资金配置流出等因素压制，表现弱于成长型指数。尽管外部扰动频繁，但算力突破、AI 技术突围等政策支撑为科创提供托底动力，建议关注三季度政策落地与业绩兑现的双重催化。

## 2. 投资策略和运行分析

本基金自 4 月 17 日起转型为中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金，基金转型不影响各类基金份额净值的计算，转型后各类基金份额的申购费率、赎回费率及销售服务费率保持不变。我们严格遵守基金合同，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

#### 4.4.2.1 中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-0.89%，同期业绩比较基准收益率为-1.03%（转型后）。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为-0.91%，同期业绩比较基准收益率为-1.03%（转型后）。

#### 4.4.2.2 中银上证科创板 50 成份指数型证券投资基金

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-0.74%，同期业绩比较基准收益率为-0.73%（转型前）。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为-0.74%，同期业绩比较基准收益率为-0.73%（转型前）。

### 4.4.3 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 中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

(报告期：2025年4月17日-2025年6月30日)

5.1.1 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	基金投资	272,290,973.15	93.01
3	固定收益投资	501,545.07	0.17
	其中：债券	501,545.07	0.17
	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	19,575,715.11	6.69
8	其他各项资产	379,897.94	0.13
9	合计	292,748,131.27	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。

5.1.1.1 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	中银上证科创板 50ETF	股票型	交易型开放式 (ETF)	中银基金管理有限公司	272,290,973.15	93.30

### 5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.1.2.1 指数投资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指数投资股票。

#### 5.1.2.2 积极投资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积极投资股票。

#### 5.1.2.3 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。

### 5.1.3 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

#### 5.1.3.1 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前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有指数投资的股票。

#### 5.1.3.2 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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 5.1.4 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	501,545.07	0.17
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	501,545.07	0.17

### 5.1.5 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	019773	25 国债 08	5,000	501,545.07	0.17

#### **5.1.6 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。

#### **5.1.7 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。

#### **5.1.8 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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

#### **5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

##### **5.1.9.1 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。

##### **5.1.9.2 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。

#### **5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

##### **5.1.10.1 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。

##### **5.1.10.2 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。

##### **5.1.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货，无相关投资评价。

#### **5.1.11 投资组合报告附注**



5.1.11.1 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。

5.1.11.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 5.1.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	379,897.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	379,897.94

#### 5.1.11.4报告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。

#### 5.1.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.1.11.6 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末未持有指数投资的股票。

#### 5.1.11.7 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末未持有积极投资的股票。

#### 5.1.11.8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。

## 5.2 中银上证科创板 50 成份指数型证券投资基金

（报告期：2025年4月1日-2025年4月16日）

### 5.2.1 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	270,834,667.98	91.05
	其中：股票	270,834,667.98	91.05
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	23,612,989.08	7.94
8	其他各项资产	2,994,552.40	1.01
9	合计	297,442,209.46	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。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	207,124,080.38	69.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	63,710,587.60	21.52
J	金融业	-	-
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	-	-
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	270,834,667.98	91.47

#### 5.2.2.2 积极投资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积极投资股票。

#### 5.2.2.2 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。

### 5.2.3 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

#### 5.2.3.1 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前十名股票投资明细

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	688981	中芯国际	311,286	28,638,312.00	9.67

---

2	688041	海光信息	165,700	25,600,650.00	8.65
3	688256	寒武纪	37,584	24,279,264.00	8.20
4	688012	中微公司	78,900	15,205,608.00	5.14
5	688008	澜起科技	203,200	14,817,344.00	5.00
6	688111	金山办公	44,200	13,613,600.00	4.60
7	688271	联影医疗	77,990	10,371,890.10	3.50
8	688036	传音控股	88,200	7,491,708.00	2.53
9	688521	芯原股份	66,200	6,719,300.00	2.27
10	688126	沪硅产业	311,000	5,737,950.00	1.94

### 5.2.3.2 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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 5.2.4 报告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。

### 5.2.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.2.6 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。

### 5.2.7 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。

### 5.2.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.2.9.1 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。

#### 5.2.9.2 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。

## 5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.2.10.1 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。

### 5.2.10.2 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。

### 5.2.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货，无相关投资评价。

## 5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,994,552.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,994,552.40

### 5.2.11.4 报告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。

5.2.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.2.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

5.2.11.5.2 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。

5.2.11.6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

6.1 中银上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

单位：份

项目	中银上证科创板50ETF 联接A	中银上证科创板50ETF 联接C
基金合同生效日基金份额总额	46,774,514.18	238,025,169.31
报告期间基金总申购份额	13,009,783.38	76,222,478.50
减：报告期间基金总赎回份额	6,879,365.27	83,863,941.81
报告期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	52,904,932.29	230,383,706.00

注：本基金合同生效日为2025年4月17日。

6.2 中银上证科创板 50 成份指数型证券投资基金

单位：份

项目	中银上证科创板50成份 指数A	中银上证科创板50成份 指数C
本报告期期初基金份额总额	47,948,335.27	262,384,121.71
基金合同生效日起至报告期期末基金总	1,397,648.02	28,399,951.75

申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,571,469.11	52,758,904.15
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	46,774,514.18	238,025,169.31

注：本基金本报告期末为2025年4月16日。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金

#### 7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

#### 7.1.2 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。

### 7.2 中银上证科创板 50 成份指数型证券投资基金

#### 7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

#### 7.2.2 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。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银上证科创板 50 成份指数型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《中银上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 4、关于申请募集中银上证科创板 50 成份指数型证券投资基金之法律意见；
- 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。

---

## 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  
二〇二五年七月二十一日