

中银沪深 300 指数型证券投资基金
2025 年中期报告
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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月二十九日

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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 年 1 月 7 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 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	49
7.7 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	49
7.8 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	49
7.9 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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.3 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	52
9 开放式基金份额变动	52
10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	53
11 备查文件目录	55
11.1 备查文件目录	55
11.2 存放地点	55
11.3 查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银沪深 300 指数型证券投资基金	
基金简称	中银沪深 300 指数	
基金主代码	022859	
交易代码	022859	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 1 月 7 日	
基金管理人	中银基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	261,836,975.03 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 A	中银沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	022859	022860
报告期末下属分级基金的份额总额	252,826,253.45 份	9,010,721.58 份

2.2 基金产品说明

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>本基金为股票指数型基金，以沪深 300 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	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	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。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	陈卫星	张立学
	联系电话	021-38848999	010-68858113
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95580
传真		021-68873488	010-86353609
注册地址		上海市银城中路200号中银大厦45层	北京市西城区金融大街3号
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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		200120	100808
法定代表人		张家文（代行）	郑国雨

2.4 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

2.5 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 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 7 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日)	
	中银沪深 300 指数 A	中银沪深 300 指数 C
	10,202,569.55	208,547.26
本期已实现收益		
本期利润	13,145,257.12	162,306.55
加权平均基金份额本期利润	0.0245	0.0189
本期加权平均净值利润率	2.45%	1.90%
本期基金份额净值增长率	1.38%	1.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	中银沪深 300 指数 A	中银沪深 300 指数 C
	3,483,336.74	119,908.97
期末可供分配利润		
期末可供分配基金份额利润	0.0138	0.0133
期末基金资产净值	256,309,590.19	9,130,630.55
期末基金份额净值	1.0138	1.0133
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	中银沪深 300 指数 A	中银沪深 300 指数 C

基金份额累计净值增长率	1.38%	1.33%
-------------	-------	-------

注：1、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。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果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（已实现部分扣除未实现部分）。

3、本基金基金合同于 2025 年 1 月 7 日生效，截至报告期末生效未满半年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中银沪深 300 指数 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	3.23%	0.56%	2.37%	0.55%	0.86%	0.01%
过去三个月	2.36%	1.01%	1.21%	1.04%	1.15%	-0.03%
自基金合同生效日起	1.38%	0.79%	4.24%	0.94%	-2.86%	-0.15%

中银沪深 300 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
过去一个月	3.21%	0.56%	2.37%	0.55%	0.84%	0.01%
过去三个月	2.34%	1.01%	1.21%	1.04%	1.13%	-0.03%
自基金合同生效日起	1.33%	0.79%	4.24%	0.94%	-2.91%	-0.15%

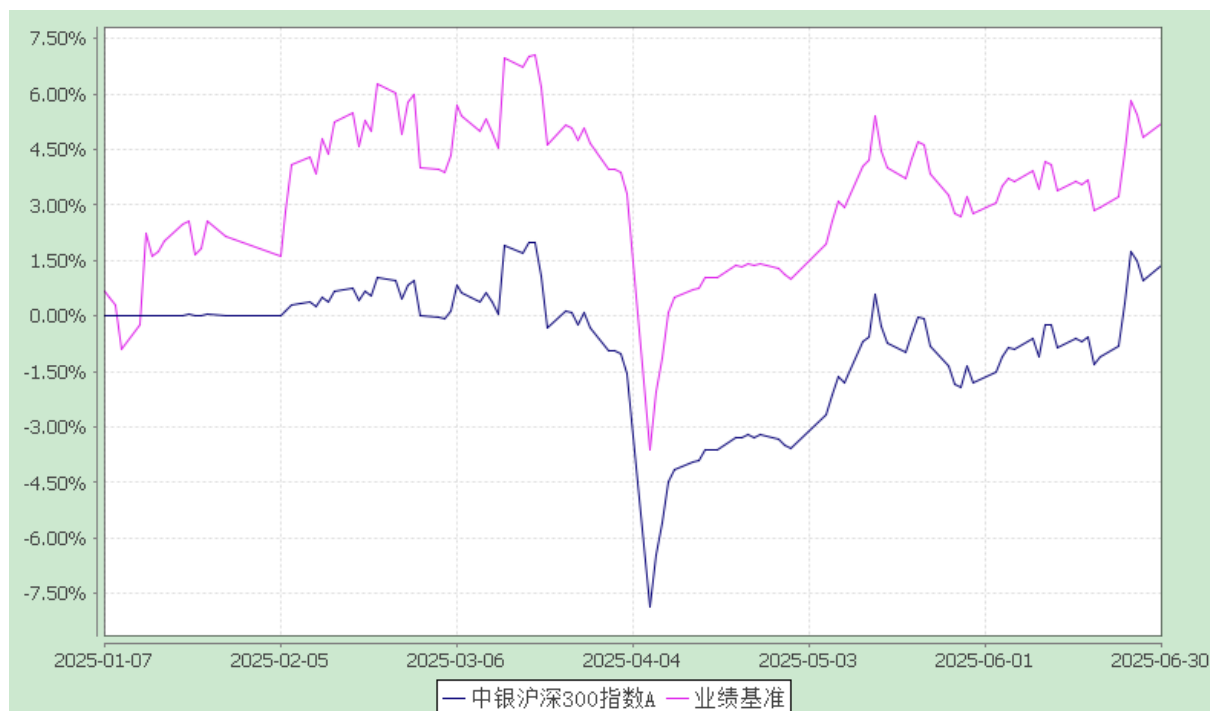
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中银沪深 300 指数型证券投资基金

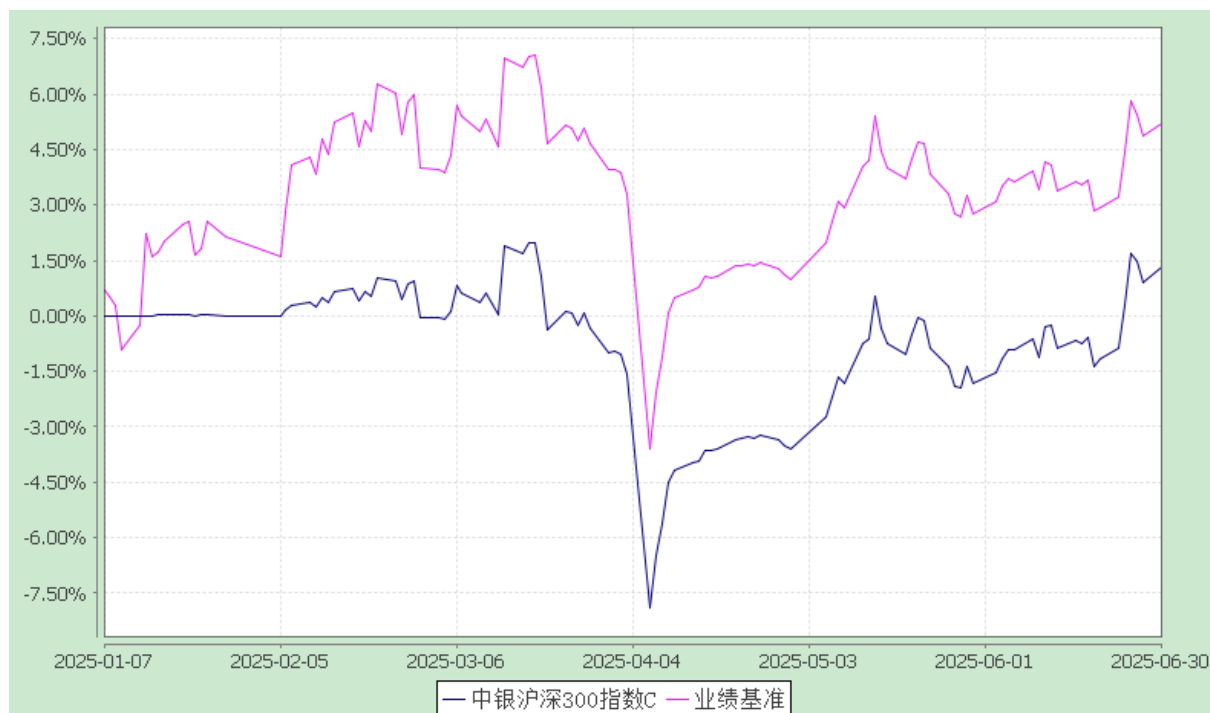
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2025 年 1 月 7 日至 2025 年 6 月 30 日）

中银沪深 300 指数 A



中银沪深 300 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。

截至本报告期末,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一百余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 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		
赵建忠	基金经理	2025-01-07	-	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。
赵志华	基金经理	2025-01-07	-	20	中银基金管理有限公司高级助理副总裁 (SAVP), 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 2024 年 8 月任中银新回报基金 (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 2025 年 3 月任中银中证 1000 基金基金经理, 2023 年 12 月至 2025 年 1 月任中银中证 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, 2025 年 1 月至今任中银沪深 300 指数基金基金经理, 2025 年 4 月至今任中银新华中诚信红利价值指数基金基金经理, 2025 年 5 月至今任中银中证 A500 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

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

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 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，关税扰动使全球工业生产和商品贸易前置、活跃度提升，但服务业放缓。全球通胀粘性消退，关税成新主线。美国 2025 年 6 月制造业、服务业 PMI 均下降，CPI 微降，失业率持平，美联储上半年未调利率。欧元区经济分化，制造业 PMI 上升、服务业 PMI 下降，调和 CPI

回落，失业率持平，欧央行上半年四次降息共 100bps。日本 CPI 下降，制造业和服务业 PMI 回升，日央行上调利率 25bps。

国内上半年经济态势良好，消费和出口强劲，投资增速回落。6 月制造业 PMI 下降，工业增加值回升；消费增速加快，基建和制造业投资增速较高，房地产投资负增长，固定资产投资累计增速回落；CPI 稳定，PPI 负值扩大。

2、行情回顾

上半年 A 股市场呈现分化和波动的特征，沪深 300 指数震荡上行。年初市场延续震荡分化，国内流动性合理充裕，新质生产力相关板块开始受到关注，周期板块因需求端疲软表现低迷，资金在成长与周期板块间分化。3 月下旬市场出现风格切换，资金向大盘蓝筹迁移，此前领涨的部分成长板块略有回调，金融等权重板块表现相对稳健。4 月受美国“对等关税”冲击，市场出现急跌，科技成长板块首当其冲，前期涨幅较大的行业回调明显，市场避险情绪升温。5 月市场风格转向消费与金融，6 月沪指站上 3400 点创年内新高，通信、国防军工等板块持续强势，消费板块内部分化，食品饮料、家电表现较弱，市场信心在政策支撑下进一步恢复，行业轮动节奏加快。

3. 运行分析

本报告期为基金的正常运作期。我们严格遵守基金合同，采用完全复制策略跟踪指数，在因指数权重调整或基金申赎发生变动时，根据市场的流动性情况采用量化模型优化交易以降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 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 1.38%，同期业绩比较基准收益率为 4.24%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 1.33%，同期业绩比较基准收益率为 4.24%。

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，海外宏观方面，特朗普政策不确定性趋缓，减税等措施落地后，美国经济温和放缓但不衰退，通胀阶段性上行，货币政策继续宽松。国内宏观方面预计能完成全年增速目标，经济前高后低，通胀有所抬升。政策聚焦提升增长质量，通过建设统一大市场、推动化债、补短板等调结构、防风险。中美摩擦缓和利好外需，全年出口或小幅正增；服务消费成促内需重点，消费增速较高。债务压力缓解助力基建保持高增速，而受外需影响制造业投资增速略降。地产销售降幅收窄，投资占比下降，拖累减轻。

下半年权益市场的运行逻辑中，分母端因素仍是重要驱动力量。无风险利率与股市风险溢价的双重降低，正持续吸引居民与非银机构加大对权益资产的配置力度，叠加中长期资金有望进一步入市，微观资金面预计将保持充裕状态，为市场提供坚实支撑。从经济基本面来看，受抢出口效应减

弱以及国内信用周期收敛的影响，三季度国内经济增长动能可能出现边际下滑，但整体仍将保持平稳运行态势，不会对市场形成剧烈冲击。短期而言，在流动性的支撑下，市场有望维持高位震荡格局。而从更长远的视角看，若后续美联储重启降息进程，且中美谈判协议取得进一步突破，市场在经历阶段性震荡后，有望迎来新一轮上涨行情。企业盈利方面，当前仍处于筑底阶段，随着经济环境的逐步改善，预计下半年增速将呈现边际小幅回升的态势，为权益市场的表现提供基本面助力。

本基金将严格按照契约规定，采用完全复制投资策略，被动跟踪指数，保持跟踪误差在较小范围内。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

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。

本报告期末 A 类基金份额可供分配利润为 3,483,336.74 元,C 类基金份额可供分配利润为 119,908.97 元。本基金本报告期末未进行利润分配。

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遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中银沪深 300 指数型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。”

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中银沪深 300 指数型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	23,003,129.91
结算备付金		10,410,769.47
存出保证金		979,524.00
交易性金融资产	6.4.7.2	240,338,704.38
其中：股票投资		240,338,704.38
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		18,467.56
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		274,750,595.32
负债和净资产	附注号	本期末 2025 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		-
应付赎回款		9,175,726.69
应付管理人报酬		42,158.80
应付托管费		14,052.93
应付销售服务费		800.65
应付投资顾问费		-
应交税费		2,716.27
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	74,919.24
负债合计		9,310,374.58
净资产:		
实收基金	6.4.7.7	261,836,975.03
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	3,603,245.71
净资产合计		265,440,220.74
负债和净资产总计		274,750,595.32

注：1.报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 261,836,975.03 份，其中 A 类基金份额净值 1.0138 元，基金份额 252,826,253.45 份；C 类基金份额净值 1.0133 元，基金份额 9,010,721.58 份。

2.本基金合同于 2025 年 1 月 7 日生效，无上年度末数据。

6.2 利润表

会计主体：中银沪深 300 指数型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 7 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 7 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
----	-----	---

一、营业总收入		13,907,869.25
1.利息收入		1,646,985.69
其中：存款利息收入	6.4.7.9	733,909.34
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		913,076.35
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,361,387.23
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,884,967.58
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	6,894.47
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	80,522.36
股利收益	6.4.7.14	3,389,002.82
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,896,446.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,049.47
减：二、营业总支出		600,305.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2	392,997.30
2. 托管费	6.4.10.2	130,999.07
3. 销售服务费		4,086.33
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		3,578.13
8. 其他费用	6.4.7.17	68,644.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,307,563.67
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,307,563.67
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		13,307,563.67

注：本基金合同于 2025 年 1 月 7 日生效，无上年度可比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：中银沪深 300 指数型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 7 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 7 日（基金合同生效日）至 2025 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、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	922,387,217.20	-	-	922,387,217.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-660,550,242.17	-	3,603,245.71	-656,946,996.46
（一）、综合收益总额	-	-	13,307,563.67	13,307,563.67
（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）	-660,550,242.17	-	-9,704,317.96	-670,254,560.13
其中：1.基金申购款	30,572,884.79	-	-463,339.09	30,109,545.70
2.基金赎回款	-691,123,126.96	-	-9,240,978.87	-700,364,105.83
（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	261,836,975.03	-	3,603,245.71	265,440,220.74

注：本基金合同于 2025 年 1 月 7 日生效，无上年度可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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：宁瑞洁，会计机构负责人：乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银沪深 300 指数型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2024]1719 号《关于准予中银沪深 300 指数型证券投资基金注册的批

复》准予注册并进行募集，由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2025 年 1 月 7 日正式生效，首次设立募集规模为 922,387,217.20 份该基金份额。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为中银基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

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 2025 年 8 月 28 日批准。

6.4.2 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内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《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。

6.4.3 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于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 7 日（基金合同生效日）起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2025 年 1 月 7 日（基金合同生效日）起至 2025 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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合同利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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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，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、本基金 A 类与 C 类基金份额在基金费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且不损害基金份额持有人利益的前提下，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。

6.4.4.12 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) 本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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

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；

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征增值税试点的通知》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。

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）及地方教育附加。

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[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。

5. 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	23,003,129.91
等于：本金	22,998,674.64
加：应计利息	4,455.27
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	23,003,129.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		237,748,810.85	-	240,338,704.38	2,589,893.53
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		237,748,810.85	-	240,338,704.38	2,589,893.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 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	7,856,146.67	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,856,146.67	-	-	-

6.4.7.3.2 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
IF2509	IF2509	7.00	8,162,700.00	306,553.33
合计	-	-	-	306,553.33
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	306,553.33
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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	6,674.49
应付信息披露费	48,746.25
应付审计费	19,498.50
合计	74,919.24

6.4.7.7 实收基金

中银沪深 300 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	912,468,242.99	912,468,242.99
本期申购	19,479,998.96	19,479,998.96
本期赎回（以“-”号填列）	-679,121,988.50	-679,121,988.50
本期末	252,826,253.45	252,826,253.45

中银沪深 300 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	9,918,974.21	9,918,974.21
本期申购	11,092,885.83	11,092,885.83
本期赎回（以“-”号填列）	-12,001,138.46	-12,001,138.46
本期末	9,010,721.58	9,010,721.58

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

中银沪深 300 指数 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	10,202,569.55	2,942,687.57	13,145,257.12
本期基金份额交易产生的变动数	-3,498,372.81	-6,163,547.57	-9,661,920.38
其中：基金申购款	275,031.27	-641,641.92	-366,610.65
基金赎回款	-3,773,404.08	-5,521,905.65	-9,295,309.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,704,196.74	-3,220,860.00	3,483,336.74

中银沪深 300 指数 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	208,547.26	-46,240.71	162,306.55
本期基金份额交易产生的变动数	26,175.53	-68,573.11	-42,397.58
其中：基金申购款	142,747.76	-239,476.20	-96,728.44
基金赎回款	-116,572.23	170,903.09	54,330.86

本期已分配利润	-	-	-
本期末	234,722.79	-114,813.82	119,908.97

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 7 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	343,204.52
定期存款利息收入	210,062.50
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	180,642.32
其他	-
合计	733,909.34

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 7 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	310,654,663.89
减：卖出股票成本总额	304,392,714.70
减：交易费用	376,981.61
买卖股票差价收入	5,884,967.58

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	3.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,890.78
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	6,894.47

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	53,496.80

交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	46,600.00
减：应计利息总额	3.88
减：交易费用	2.14
买卖债券差价收入	6,890.78

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 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。

6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股指期货投资收益	80,522.36

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,389,002.82
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	3,389,002.82

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
1.交易性金融资产	2,589,893.53
——股票投资	2,589,893.53
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	306,553.33
——权证投资	-
——期货	306,553.33
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	2,896,446.86

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
基金赎回费收入	2,776.63
基金转换费收入	14.81
其他	258.03
合计	3,049.47

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
审计费用	19,498.50
信息披露费	48,746.25
证券出借违约金	-
其他	400.00
合计	68,644.75

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“邮储银行”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	392,997.30
其中：支付销售机构的客户维护费	194,851.95
应支付基金管理人的净管理费	198,145.35

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

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	130,999.07

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数

6.4.10.2.3 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 2025年1月7日（基金合同生效日）至2025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 A	中银沪深 300 指数 C	合计
中国银行	-	932.66	932.66
邮储银行	-	232.98	232.98
中银基金管理有限公司	-	1.64	1.64
合计	-	1,167.28	1,167.28

注：A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中银基金管理有限公司，再由中银基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类的基金资产净值 ×0.10%/ 当年天数。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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未投资本基金。

6.4.10.6 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	
	2025年1月7日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	23,003,129.91	343,204.52

注：本基金的银行存款由基金托管人邮政储蓄银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有 165,900 股基金管理人控股股东中国银行股份有限公司的 A 股普通股，市值占本基金资产净值的比例为 0.35%；本基金持有 127,800 股基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司的 A 股普通股，市值占本基金资产净值的比例为 0.26%。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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

688775	影石创新	2025-06-04	1-6 个月 (含)	新股 锁定 期内	47.27	124.16	265	12,526 .55	32,902 .40	-
301678	新恒汇	2025-06-13	1-6 个月 (含)	新股 锁定 期内	12.80	44.54	382	4,889. 60	17,014 .28	-
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	16.42	16.42	937	15,385 .54	15,385 .54	-
301590	优优绿能	2025-05-28	1-6 个月 (含)	新股 锁定 期内	89.60	139.48	73	6,540. 80	10,182 .04	-
603014	威高血净	2025-05-12	1-6 个月 (含)	新股 锁定 期内	26.50	32.68	158	4,187. 00	5,163. 44	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	1-6 个月 (含)	新股 锁定 期内	12.08	18.12	178	2,150. 24	3,225. 36	-
603400	华之杰	2025-06-12	1-6 个月 (含)	新股 锁定 期内	19.88	43.81	57	1,133. 16	2,497. 17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	1-6 个月 (含)	新股 锁定 期内	11.50	22.39	105	1,207. 50	2,350. 95	-

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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六个月以内且不计息，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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	23,003,129.91	-	-	-	23,003,129.91
结算备付金	10,410,769.47	-	-	-	10,410,769.47
存出保证金	-	-	-	979,524.00	979,524.00
交易性金融资产	-	-	-	240,338,704.38	240,338,704.38
应收申购款	40.00	-	-	18,427.56	18,467.56
资产总计	33,413,939.38	-	-	241,336,655.94	274,750,595.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,175,726.69	9,175,726.69
应付管理人报酬	-	-	-	42,158.80	42,158.80

应付托管费	-	-	-	14,052.93	14,052.93
应付销售服务费	-	-	-	800.65	800.65
应交税费	-	-	-	2,716.27	2,716.27
其他负债	-	-	-	74,919.24	74,919.24
负债总计	-	-	-	9,310,374.58	9,310,374.58
利率敏感度缺口	33,413,939.38	-	-	232,026,281.36	265,440,220.74

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。

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	240,338,704.38	90.54
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	240,338,704.38	90.54

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金成立未满半年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	240,249,983.20
第二层次	15,385.54
第三层次	73,335.64
合计	240,338,704.38

6.4.14.2.2 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。

对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

7 投资组合报告

7.1 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	240,338,704.38	87.48
	其中：股票	240,338,704.38	87.48
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	33,413,899.38	12.16
8	其他各项资产	997,991.56	0.36
9	合计	274,750,595.32	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 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	2,377,151.00	0.90
B	采矿业	12,116,895.00	4.56
C	制造业	120,068,236.20	45.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,687,445.00	3.27
E	建筑业	4,527,956.00	1.71
F	批发和零售业	583,320.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	8,440,770.00	3.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,224,532.00	4.23
J	金融业	65,151,392.00	24.54
K	房地产业	1,764,906.00	0.66
L	租赁和商务服务业	2,174,880.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	2,463,572.00	0.93
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	668,928.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	240,249,983.20	90.51

7.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	88,721.18	0.03
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	-	-
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	88,721.18	0.03

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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	7,200	10,148,544.00	3.82
2	300750	宁德时代	30,500	7,692,710.00	2.90
3	601318	中国平安	124,500	6,907,260.00	2.60
4	600036	招商银行	144,000	6,616,800.00	2.49
5	601166	兴业银行	194,400	4,537,296.00	1.71
6	600900	长江电力	141,100	4,252,754.00	1.60
7	000333	美的集团	56,900	4,108,180.00	1.55
8	601899	紫金矿业	193,300	3,769,350.00	1.42
9	002594	比亚迪	10,600	3,518,246.00	1.33
10	300059	东方财富	146,300	3,383,919.00	1.27
11	600030	中信证券	113,200	3,126,584.00	1.18
12	601398	工商银行	403,800	3,064,842.00	1.15
13	600276	恒瑞医药	52,100	2,703,990.00	1.02
14	000858	五粮液	22,600	2,687,140.00	1.01
15	601211	国泰海通	131,400	2,517,624.00	0.95
16	601328	交通银行	310,600	2,484,800.00	0.94
17	000651	格力电器	52,100	2,340,332.00	0.88
18	601288	农业银行	370,900	2,180,892.00	0.82
19	600919	江苏银行	171,200	2,044,128.00	0.77
20	600887	伊利股份	73,200	2,040,816.00	0.77
21	688981	中芯国际	22,700	2,001,459.00	0.75
22	002475	立讯精密	57,200	1,984,268.00	0.75
23	601816	京沪高铁	341,100	1,961,325.00	0.74
24	603259	药明康德	27,600	1,919,580.00	0.72
25	600000	浦发银行	134,500	1,866,860.00	0.70
26	000725	京东方 A	420,700	1,678,593.00	0.63
27	300760	迈瑞医疗	7,100	1,595,725.00	0.60
28	002371	北方华创	3,600	1,591,956.00	0.60
29	601088	中国神华	37,600	1,524,304.00	0.57
30	688041	海光信息	10,600	1,497,674.00	0.56
31	601601	中国太保	39,300	1,474,143.00	0.56
32	300308	中际旭创	9,800	1,429,428.00	0.54
33	300502	新易盛	11,040	1,402,300.80	0.53
34	300124	汇川技术	21,600	1,394,712.00	0.53
35	601728	中国电信	178,700	1,384,925.00	0.52
36	688256	寒武纪	2,300	1,383,450.00	0.52
37	000001	平安银行	114,000	1,375,980.00	0.52
38	600016	民生银行	289,500	1,375,125.00	0.52
39	601668	中国建筑	238,100	1,373,837.00	0.52
40	002352	顺丰控股	27,800	1,355,528.00	0.51
41	002714	牧原股份	31,500	1,323,315.00	0.50
42	002230	科大讯飞	26,400	1,264,032.00	0.48
43	603501	豪威集团	9,800	1,250,970.00	0.47
44	601127	赛力斯	9,300	1,249,176.00	0.47

45	601229	上海银行	115,900	1,229,699.00	0.46
46	600031	三一重工	68,400	1,227,780.00	0.46
47	000063	中兴通讯	37,100	1,205,379.00	0.45
48	601169	北京银行	173,900	1,187,737.00	0.45
49	600309	万华化学	21,800	1,182,868.00	0.45
50	603019	中科曙光	16,800	1,182,720.00	0.45
51	002415	海康威视	42,600	1,181,298.00	0.45
52	600941	中国移动	10,300	1,159,265.00	0.44
53	601857	中国石油	132,000	1,128,600.00	0.43
54	300274	阳光电源	16,300	1,104,651.00	0.42
55	601919	中远海控	72,800	1,094,912.00	0.41
56	600690	海尔智家	43,400	1,075,452.00	0.41
57	688008	澜起科技	13,100	1,074,200.00	0.40
58	002142	宁波银行	38,800	1,061,568.00	0.40
59	600660	福耀玻璃	18,600	1,060,386.00	0.40
60	601688	华泰证券	59,500	1,059,695.00	0.40
61	300498	温氏股份	61,700	1,053,836.00	0.40
62	600406	国电南瑞	46,200	1,035,342.00	0.39
63	601012	隆基绿能	68,400	1,027,368.00	0.39
64	600809	山西汾酒	5,700	1,005,423.00	0.38
65	601766	中国中车	140,600	989,824.00	0.37
66	601138	工业富联	45,800	979,204.00	0.37
67	603986	兆易创新	7,700	974,281.00	0.37
68	000568	泸州老窖	8,500	963,900.00	0.36
69	000338	潍柴动力	62,600	962,788.00	0.36
70	600050	中国联通	178,600	953,724.00	0.36
71	600028	中国石化	168,900	952,596.00	0.36
72	000100	TCL 科技	217,800	943,074.00	0.36
73	601988	中国银行	165,900	932,358.00	0.35
74	601006	大秦铁路	139,200	918,720.00	0.35
75	688012	中微公司	5,000	911,500.00	0.34
76	600926	杭州银行	53,700	903,234.00	0.34
77	601818	光大银行	214,000	888,100.00	0.33
78	601985	中国核电	95,100	886,332.00	0.33
79	601225	陕西煤业	45,100	867,724.00	0.33
80	600104	上汽集团	53,800	863,490.00	0.33
81	002027	分众传媒	116,000	846,800.00	0.32
82	600150	中国船舶	25,300	823,262.00	0.31
83	601628	中国人寿	19,400	799,086.00	0.30
84	601009	南京银行	68,700	798,294.00	0.30
85	600999	招商证券	43,300	761,647.00	0.29
86	688111	金山办公	2,700	756,135.00	0.28
87	605499	东鹏饮料	2,400	753,720.00	0.28
88	603288	海天味业	19,300	750,963.00	0.28

89	000425	徐工机械	95,400	741,258.00	0.28
90	000792	盐湖股份	43,000	734,440.00	0.28
91	601939	建设银行	77,700	733,488.00	0.28
92	000625	长安汽车	57,200	729,872.00	0.27
93	688271	联影医疗	5,700	728,118.00	0.27
94	600938	中国海油	27,700	723,247.00	0.27
95	600111	北方稀土	28,600	712,140.00	0.27
96	600760	中航沈飞	12,100	709,302.00	0.27
97	600905	三峡能源	165,600	705,456.00	0.27
98	600436	片仔癀	3,500	700,035.00	0.26
99	601658	邮储银行	127,800	699,066.00	0.26
100	600089	特变电工	58,200	694,326.00	0.26
101	601888	中国中免	11,200	682,864.00	0.26
102	300033	同花顺	2,500	682,525.00	0.26
103	603993	洛阳钼业	80,600	678,652.00	0.26
104	002050	三花智控	25,600	675,328.00	0.25
105	600547	山东黄金	21,100	673,723.00	0.25
106	300015	爱尔眼科	53,600	668,928.00	0.25
107	002463	沪电股份	15,700	668,506.00	0.25
108	601390	中国中铁	119,000	667,590.00	0.25
109	600048	保利发展	82,300	666,630.00	0.25
110	600019	宝钢股份	100,700	663,613.00	0.25
111	002241	歌尔股份	28,400	662,288.00	0.25
112	601825	沪农商行	67,400	653,780.00	0.25
113	601600	中国铝业	92,600	651,904.00	0.25
114	600415	小商品城	31,200	645,216.00	0.24
115	300014	亿纬锂能	13,800	632,178.00	0.24
116	000977	浪潮信息	11,900	605,472.00	0.23
117	601916	浙商银行	177,500	601,725.00	0.23
118	600585	海螺水泥	27,800	596,866.00	0.22
119	601989	中国重工	128,500	596,240.00	0.22
120	601838	成都银行	29,600	594,960.00	0.22
121	600570	恒生电子	17,600	590,304.00	0.22
122	603799	华友钴业	15,900	588,618.00	0.22
123	600015	华夏银行	74,400	588,504.00	0.22
124	600958	东方证券	60,700	587,576.00	0.22
125	000776	广发证券	34,700	583,307.00	0.22
126	002179	中航光电	14,400	581,184.00	0.22
127	000538	云南白药	10,300	574,637.00	0.22
128	002311	海大集团	9,700	568,323.00	0.21
129	601336	新华保险	9,700	567,450.00	0.21
130	600893	航发动力	14,600	562,684.00	0.21
131	600584	长电科技	16,500	555,885.00	0.21
132	000938	紫光股份	22,800	546,972.00	0.21

133	000166	申万宏源	104,700	525,594.00	0.20
134	601077	渝农商行	73,200	522,648.00	0.20
135	601998	中信银行	61,200	520,200.00	0.20
136	002028	思源电气	7,100	517,661.00	0.20
137	300433	蓝思科技	23,000	512,900.00	0.19
138	600438	通威股份	30,300	507,525.00	0.19
139	300408	三环集团	15,100	504,340.00	0.19
140	000002	万 科 A	78,400	503,328.00	0.19
141	002049	紫光国微	7,600	500,536.00	0.19
142	601377	兴业证券	80,300	497,057.00	0.19
143	600795	国电电力	101,800	492,712.00	0.19
144	600489	中金黄金	33,500	490,105.00	0.18
145	601669	中国电建	100,200	487,974.00	0.18
146	601995	中金公司	13,600	480,896.00	0.18
147	601689	拓普集团	10,000	472,500.00	0.18
148	002422	科伦药业	12,900	463,368.00	0.17
149	600010	包钢股份	258,100	461,999.00	0.17
150	600009	上海机场	14,400	457,488.00	0.17
151	002304	洋河股份	7,000	451,850.00	0.17
152	002460	赣锋锂业	13,300	449,141.00	0.17
153	601100	恒立液压	6,100	439,200.00	0.17
154	688036	传音控股	5,400	430,380.00	0.16
155	600160	巨化股份	15,000	430,200.00	0.16
156	000768	中航西飞	15,700	429,238.00	0.16
157	601881	中国银河	24,900	427,035.00	0.16
158	601186	中国铁建	53,300	426,933.00	0.16
159	600183	生益科技	14,100	425,115.00	0.16
160	002252	上海莱士	61,400	421,818.00	0.16
161	300394	天孚通信	5,260	419,958.40	0.16
162	000157	中联重科	57,400	415,002.00	0.16
163	600989	宝丰能源	25,600	413,184.00	0.16
164	000963	华东医药	10,200	411,672.00	0.16
165	601788	光大证券	22,700	408,146.00	0.15
166	600886	国投电力	27,600	406,824.00	0.15
167	601360	三六零	39,800	405,960.00	0.15
168	002074	国轩高科	12,500	405,750.00	0.15
169	600115	中国东航	100,400	404,612.00	0.15
170	000408	藏格矿业	9,300	396,831.00	0.15
171	601058	赛轮轮胎	29,900	392,288.00	0.15
172	000807	云铝股份	24,500	391,510.00	0.15
173	002466	天齐锂业	12,200	390,888.00	0.15
174	002736	国信证券	33,500	385,920.00	0.15
175	600066	宇通客车	15,500	385,330.00	0.15
176	300442	润泽科技	7,700	381,381.00	0.14

177	002001	新和成	17,900	380,733.00	0.14
178	688169	石头科技	2,420	378,851.00	0.14
179	601901	方正证券	47,800	378,098.00	0.14
180	600426	华鲁恒升	17,100	370,557.00	0.14
181	600029	南方航空	62,300	367,570.00	0.14
182	601800	中国交建	41,300	367,157.00	0.14
183	000661	长春高新	3,700	366,966.00	0.14
184	600196	复星医药	14,600	366,314.00	0.14
185	000975	山金国际	19,300	365,542.00	0.14
186	001979	招商蛇口	41,400	363,078.00	0.14
187	002236	大华股份	22,800	362,064.00	0.14
188	300661	圣邦股份	4,960	360,939.20	0.14
189	601066	中信建投	15,000	360,750.00	0.14
190	600674	川投能源	22,400	359,296.00	0.14
191	600011	华能国际	50,100	357,714.00	0.13
192	301236	软通动力	6,500	355,160.00	0.13
193	600346	恒力石化	24,700	352,222.00	0.13
194	688126	沪硅产业	18,800	351,936.00	0.13
195	601878	浙商证券	31,900	348,029.00	0.13
196	601111	中国国航	43,900	346,371.00	0.13
197	603369	今世缘	8,700	338,691.00	0.13
198	002648	卫星化学	19,300	334,469.00	0.13
199	601868	中国能建	149,900	334,277.00	0.13
200	002916	深南电路	3,090	333,132.90	0.13
201	600460	士兰微	13,400	332,588.00	0.13
202	003816	中国广核	91,000	331,240.00	0.12
203	600372	中航机载	27,400	330,444.00	0.12
204	300418	昆仑万维	9,800	329,574.00	0.12
205	600741	华域汽车	18,600	328,290.00	0.12
206	002920	德赛西威	3,200	326,816.00	0.12
207	601117	中国化学	42,600	326,742.00	0.12
208	601319	中国人保	37,200	324,012.00	0.12
209	601021	春秋航空	5,700	317,205.00	0.12
210	300896	爱美客	1,800	314,658.00	0.12
211	002601	龙佰集团	19,400	314,474.00	0.12
212	600588	用友网络	23,500	314,195.00	0.12
213	600176	中国巨石	27,500	313,500.00	0.12
214	000786	北新建材	11,800	312,464.00	0.12
215	600219	南山铝业	81,500	312,145.00	0.12
216	601633	长城汽车	14,300	307,164.00	0.12
217	300782	卓胜微	4,300	306,891.00	0.12
218	300347	泰格医药	5,600	298,592.00	0.11
219	301269	华大九天	2,400	297,312.00	0.11
220	600039	四川路桥	30,000	297,000.00	0.11

221	688506	百利天恒	1,000	296,120.00	0.11
222	000895	双汇发展	12,100	295,361.00	0.11
223	600482	中国动力	12,800	295,296.00	0.11
224	000630	铜陵有色	88,200	294,588.00	0.11
225	002493	荣盛石化	35,200	291,456.00	0.11
226	688396	华润微	6,100	287,676.00	0.11
227	600362	江西铜业	12,200	285,846.00	0.11
228	600085	同仁堂	7,900	284,874.00	0.11
229	600600	青岛啤酒	4,100	284,786.00	0.11
230	001965	招商公路	23,600	283,200.00	0.11
231	002129	TCL 中环	36,700	281,856.00	0.11
232	302132	中航成飞	3,200	281,408.00	0.11
233	601877	正泰电器	12,400	281,108.00	0.11
234	002709	天赐材料	15,500	280,860.00	0.11
235	002600	领益智造	32,200	276,598.00	0.10
236	603392	万泰生物	4,400	268,400.00	0.10
237	300122	智飞生物	13,700	268,383.00	0.10
238	603296	华勤技术	3,300	266,244.00	0.10
239	600161	天坛生物	13,700	262,903.00	0.10
240	002938	鹏鼎控股	8,200	262,646.00	0.10
241	000301	东方盛虹	31,500	262,395.00	0.10
242	002180	纳思达	11,400	261,516.00	0.10
243	600233	圆通速递	20,100	259,089.00	0.10
244	300832	新产业	4,500	255,240.00	0.10
245	000596	古井贡酒	1,900	252,985.00	0.10
246	600188	兖矿能源	20,700	251,919.00	0.09
247	600023	浙能电力	46,600	246,980.00	0.09
248	000876	新希望	26,300	246,694.00	0.09
249	601618	中国中冶	82,700	246,446.00	0.09
250	300759	康龙化成	10,000	245,400.00	0.09
251	000999	华润三九	7,760	242,732.80	0.09
252	688223	晶科能源	45,600	236,664.00	0.09
253	600875	东方电气	14,000	234,360.00	0.09
254	600845	宝信软件	9,900	233,838.00	0.09
255	601872	招商轮船	37,300	233,498.00	0.09
256	600515	海南机场	65,500	231,870.00	0.09
257	601898	中煤能源	21,000	229,740.00	0.09
258	002459	晶澳科技	22,600	225,548.00	0.08
259	600061	国投资本	29,600	222,592.00	0.08
260	600027	华电国际	40,400	220,988.00	0.08
261	688599	天合光能	15,100	219,403.00	0.08
262	605117	德业股份	4,140	218,012.40	0.08
263	000983	山西焦煤	33,900	216,960.00	0.08
264	600332	白云山	8,100	213,516.00	0.08

265	688047	龙芯中科	1,600	213,424.00	0.08
266	000617	中油资本	29,100	212,430.00	0.08
267	600918	中泰证券	32,000	205,760.00	0.08
268	300316	晶盛机电	7,500	203,625.00	0.08
269	300628	亿联网络	5,800	201,608.00	0.08
270	300999	金龙鱼	6,800	200,804.00	0.08
271	600803	新奥股份	10,600	200,340.00	0.08
272	601799	星宇股份	1,600	200,000.00	0.08
273	600025	华能水电	20,700	197,685.00	0.07
274	601238	广汽集团	26,200	196,238.00	0.07
275	601698	中国卫通	9,500	194,465.00	0.07
276	603260	合盛硅业	4,100	194,340.00	0.07
277	601059	信达证券	11,100	189,810.00	0.07
278	300413	芒果超媒	8,500	185,470.00	0.07
279	600018	上港集团	32,300	184,433.00	0.07
280	601607	上海医药	9,600	171,648.00	0.06
281	600026	中远海能	16,100	166,313.00	0.06
282	603195	公牛集团	3,240	156,330.00	0.06
283	603806	福斯特	12,000	155,520.00	0.06
284	688009	中国通号	29,900	153,686.00	0.06
285	688303	大全能源	7,200	153,504.00	0.06
286	688472	阿特斯	16,600	151,890.00	0.06
287	601699	潞安环能	14,300	150,865.00	0.06
288	601236	红塔证券	16,900	143,143.00	0.05
289	601865	福莱特	9,000	136,890.00	0.05
290	000708	中信特钢	11,500	135,240.00	0.05
291	688187	时代电气	3,100	132,215.00	0.05
292	601136	首创证券	6,500	129,220.00	0.05
293	603833	欧派家居	2,100	118,545.00	0.04
294	688082	盛美上海	1,005	114,509.70	0.04
295	601808	中海油服	6,800	93,568.00	0.04
296	600377	宁沪高速	5,900	90,506.00	0.03
297	300979	华利集团	1,700	89,369.00	0.03
298	000800	一汽解放	11,700	80,262.00	0.03
299	001289	龙源电力	1,800	29,124.00	0.01

7.3.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688775	影石创新	265	32,902.40	0.01
2	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.01
3	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
4	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00

5	603014	威高血净	158	5,163.44	0.00
6	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
7	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
8	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	23,921,131.00	9.01
2	300750	宁德时代	17,968,304.92	6.77
3	601318	中国平安	14,331,481.44	5.40
4	600036	招商银行	13,656,220.01	5.14
5	000333	美的集团	9,458,250.00	3.56
6	600900	长江电力	9,128,384.00	3.44
7	601166	兴业银行	8,814,537.00	3.32
8	002594	比亚迪	7,837,616.00	2.95
9	300059	东方财富	7,765,727.00	2.93
10	601899	紫金矿业	7,259,325.00	2.73
11	600030	中信证券	7,069,504.00	2.66
12	000858	五粮液	6,583,155.00	2.48
13	601398	工商银行	6,342,757.00	2.39
14	002475	立讯精密	5,601,432.00	2.11
15	600276	恒瑞医药	5,335,908.20	2.01
16	688981	中芯国际	5,284,738.49	1.99
17	000651	格力电器	5,146,065.00	1.94
18	600887	伊利股份	4,648,494.00	1.75
19	601328	交通银行	4,530,933.00	1.71
20	601816	京沪高铁	4,371,736.00	1.65

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。

7.4.2 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	600519	贵州茅台	14,213,793.00	5.35
2	300750	宁德时代	9,933,035.00	3.74
3	601318	中国平安	8,473,838.00	3.19
4	600036	招商银行	8,376,751.00	3.16
5	000333	美的集团	5,462,777.00	2.06

6	600900	长江电力	5,265,146.00	1.98
7	601166	兴业银行	5,077,455.00	1.91
8	002594	比亚迪	4,866,267.00	1.83
9	601899	紫金矿业	4,455,476.00	1.68
10	300059	东方财富	4,267,347.00	1.61
11	600030	中信证券	3,940,842.57	1.48
12	000858	五粮液	3,746,349.00	1.41
13	601398	工商银行	3,710,403.00	1.40
14	600276	恒瑞医药	3,148,337.80	1.19
15	002475	立讯精密	2,943,340.00	1.11
16	000651	格力电器	2,928,035.00	1.10
17	688981	中芯国际	2,785,646.17	1.05
18	600887	伊利股份	2,729,360.00	1.03
19	601288	农业银行	2,571,097.00	0.97
20	603259	药明康德	2,504,154.00	0.94

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。

7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	542,141,525.55
卖出股票的收入（成交）总额	310,654,663.89

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体招商银行、兴业银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局公开处罚。招商银行、兴业银行在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会公开处罚。招商银行、兴业银行在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局公开处罚。兴业银行在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会责令改正的行政监督管理措施。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。其他前十名证券的发行主体无受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	979,524.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,467.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	997,991.56

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.1 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	688775	影石创新	32,902.40	0.01	新股锁定期 内
2	301678	新恒汇	17,014.28	0.01	新股锁定期 内
3	001388	信通电子	15,385.54	0.01	新股未上市
4	301590	优优绿能	10,182.04	0.00	新股锁定期 内
5	603014	威高血净	5,163.44	0.00	新股锁定期 内

7.12.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
中银沪深 300 指 数 A	1,647	153,507.14	13,284,619.32	5.2544%	239,541,634.13	94.7456 %
中银沪深 300 指 数 C	1,124	8,016.66	-	-	9,010,721.58	100.000 0%
合计	2,771	94,491.87	13,284,619.32	5.0736%	248,552,355.71	94.9264 %

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 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 A	10,002.00	0.0040%
	中银沪深 300 指数 C	-	-
	合计	10,002.00	0.0038%

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）。

8.3 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 A	0
	中银沪深 300 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中银沪深 300 指数 A	0
	中银沪深 300 指数 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中银沪深 300 指数 A	中银沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2025 年 1 月 7 日）基金份额总额	912,468,242.99	9,918,974.21
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	19,479,998.96	11,092,885.83
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	679,121,988.50	12,001,138.46
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	252,826,253.45	9,010,721.58

注：本基金合同生效日为 2025 年 1 月 7 日。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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，经董事会决议通过，自 2025 年 2 月 17 日起，执行总裁张家文先生不再代为履行督察长职责，由副执行总裁陈卫星先生担任督察长，详情请参见基金管理人 2025 年 2 月 17 日刊登的《中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》；自 2025 年 2 月 17 日起，宁瑞洁女士担任公司副执行总裁，详情请参见基金管理人 2025 年 2 月 18 日刊登的《中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》；自 2025 年 6 月 16 日起，章砚女士不再担任公司董事长及法定代表人，由执行总裁张家文先生代为履职董事长、法定代表人职责，详情请参见基金管理人 2025 年 6 月 17 日刊登的《中银基金管理有限公司关于董事长变更及总经理代为履行董事长职务的公告》。

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

本报告期内基金投资策略未发生改变。

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

本报告期内，托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中邮证券	2	852,455,236.52	100.00%	210,686.71	100.00%	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中邮证券	53,496.80	100.00%	1,680,000,000.00	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	中银沪深 300 指数型证券投资基金提前结束募集公告	中国证监会规定媒介	2025-01-03
2	中银沪深 300 指数型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2025-01-08
3	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2025-02-17
4	中银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2025-02-18
5	中银沪深 300 指数型证券投资基金基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2025-02-24
6	中银基金管理有限公司澄清公告	中国证监会规定媒介	2025-02-25
7	中银沪深 300 指数型证券投资基金基金开放日常转换转入及转换转出业务公告	中国证监会规定媒介	2025-02-27
8	中银基金管理有限公司澄清公告	中国证监会规定媒介	2025-03-21
9	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	2025-03-21
10	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-03-31
11	中银基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会规定媒介	2025-03-31
12	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金估值变更的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-04-08
13	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	2025-04-17
14	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	2025-04-18
15	中银沪深 300 指数型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-22
16	中银基金管理有限公司关于调整旗下公募基金对账单服务形式的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-10
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	2025-06-12
18	中银基金管理有限公司关于董事长变更及总经理代为履行董事长职务的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-17
19	中银沪深 300 指数型证券投资基金(中银沪深 300 指数 A) 产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-06-26
20	中银沪深 300 指数型证券投资基金(中银沪深 300 指数 C) 产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-06-26
21	中银沪深 300 指数型证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025-06-26

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中银沪深 300 指数型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中银沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银沪深 300 指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集中银沪深 300 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。

11.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人处，供公众查阅。

11.3 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
二〇二五年八月二十九日