

**中银国有企业债债券型证券投资基金**  
**2026 年第 2 季度报告**  
**2026 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

## §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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 20 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 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 中银国有企业债                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 基金主代码      | 001235                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 基金合同生效日    | 2015 年 9 月 29 日                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 报告期末基金份额总额 | 18,716,147,238.61 份                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 投资目标       | 本基金主要投资于国有企业债券，在严格控制信用风险和追求本金安全的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。                                                                                                                                                                                                                                       |
| 投资策略       | 本基金将综合运用类属配置策略、期限结构策略、久期配置策略、信用债投资策略等方法。本基金定性和定量地分析不同类属债券类资产的信用风险、流动性风险及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力，通过比较或合理预期不同类属债券类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整不同类属债券类资产间的配置比例，确定最能符合本基金风险收益特征的资产组合。本基金将重点投资信用类债券，以提高组合收益能力。信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源，本基金将在中银基金内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下，积极投资信用债券，获取信用利差带来的高投资收益。 |
| 业绩比较基准     | 中债综合全价（总值）指数                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 风险收益特征     | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。                                                                                                                                                                                                                            |
| 基金管理人      | 中银基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司         |                    |
| 下属两级基金的基金简称     | 中银国有企业债 A          | 中银国有企业债 C          |
| 下属两级基金的交易代码     | 001235             | 006331             |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 9,424,469,713.18 份 | 9,291,677,525.43 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<br>(2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |                   |
|----------------|-----------------------------------------|-------------------|
|                | 中银国有企业债 A                               | 中银国有企业债 C         |
| 1.本期已实现收益      | 86,978,626.97                           | 82,146,229.14     |
| 2.本期利润         | 128,529,266.85                          | 132,660,471.49    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0149                                  | 0.0140            |
| 4.期末基金资产净值     | 12,190,778,282.27                       | 11,584,660,299.64 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.2935                                  | 1.2468            |

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、中银国有企业债 A：

| 阶段            | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|---------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月         | 1.23%      | 0.09%         | 0.62%          | 0.04%                 | 0.61%  | 0.05% |
| 过去六个月         | 2.29%      | 0.10%         | 0.91%          | 0.04%                 | 1.38%  | 0.06% |
| 过去一年          | 4.80%      | 0.10%         | -0.56%         | 0.06%                 | 5.36%  | 0.04% |
| 过去三年          | 16.05%     | 0.12%         | 5.12%          | 0.08%                 | 10.93% | 0.04% |
| 过去五年          | 25.98%     | 0.11%         | 8.48%          | 0.07%                 | 17.50% | 0.04% |
| 过去七年          | 39.85%     | 0.11%         | 10.29%         | 0.07%                 | 29.56% | 0.04% |
| 过去十年          | 55.49%     | 0.10%         | 10.33%         | 0.07%                 | 45.16% | 0.03% |
| 自基金合同<br>生效日起 | 60.31%     | 0.10%         | 12.22%         | 0.07%                 | 48.09% | 0.03% |

##### 2、中银国有企业债 C：

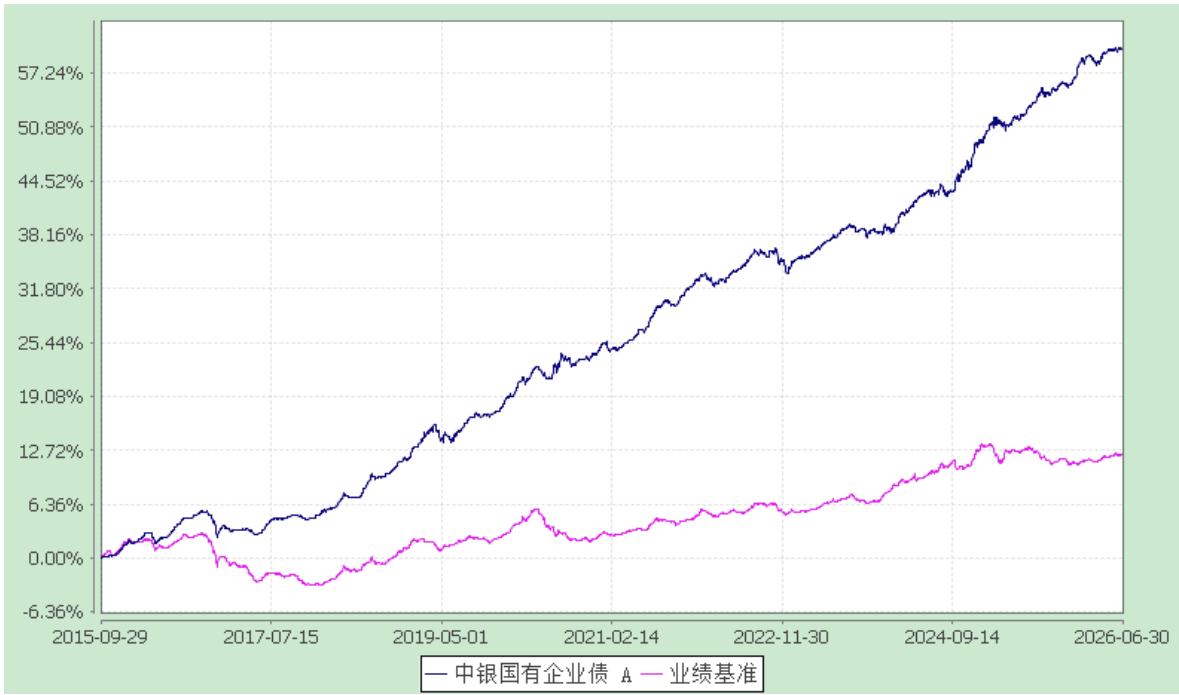
| 阶段 | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标 | ①—③ | ②—④ |
|----|------------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|
|----|------------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|

|               |        |       |        | 准差④   |        |       |
|---------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三个月         | 1.16%  | 0.09% | 0.62%  | 0.04% | 0.54%  | 0.05% |
| 过去六个月         | 2.14%  | 0.10% | 0.91%  | 0.04% | 1.23%  | 0.06% |
| 过去一年          | 4.48%  | 0.10% | -0.56% | 0.06% | 5.04%  | 0.04% |
| 过去三年          | 15.02% | 0.12% | 5.12%  | 0.08% | 9.90%  | 0.04% |
| 过去五年          | 24.10% | 0.11% | 8.48%  | 0.07% | 15.62% | 0.04% |
| 过去七年          | 34.52% | 0.11% | 10.29% | 0.07% | 24.23% | 0.04% |
| 自基金合同<br>生效日起 | 40.80% | 0.11% | 12.88% | 0.07% | 27.92% | 0.04% |

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

中银国有企业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  
(2015 年 9 月 29 日至 2026 年 6 月 30 日)

1. 中银国有企业债 A:



2. 中银国有企业债 C:

§4 管理人报告

| 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 |        |                                                                                                                                                                                        |
| 王晓彦 | 基金经理 | 2021-05-11  | -    | 15     | 金融学经济学双硕士。曾任申银万国证券研究所分析师，上海浦东发展银行资产管理部投资组合经理。2015年加入中银基金管理有限公司，曾任研究员、专户投资经理助理、专户投资经理。2021年5月至今任中银国有企业债基金基金经理，2021年5月至2025年11月任中银泰享基金基金经理，2021年5月至2023年1月任中银恒裕9个月基金基金经理，2021年5月至今任中银同享基 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                    |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 金基金经理，2022 年 5 月至今中银富享基金基金经理，2022 年 11 月至今任中银增利基金基金经理，2023 年 12 月至 2025 年 3 月任中银荣享基金基金经理，2024 年 4 月至今任中银信享基金基金经理，2025 年 3 月至 2026 年 7 月任中银互利基金基金经理。具备基金、银行间本币市场交易员、银行间外汇市场交易员从业资格。 |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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 报告期内基金投资策略和运作分析

#### 1. 宏观经济分析

全球宏观方面，二季度地缘冲突的影响边际有所钝化，资产价格波动更多由各国经济数据的相对强弱驱动。主要央行货币政策路径分化：美联储谨慎观望，欧央行转向加息，日央行继续加息。美国方面，经济韧性超预期与通胀粘性反复拉锯，美联储维持利率不变但表态偏鹰，市场转向加息预期，交易逻辑在“软着陆”与“不着陆”之间反复摇摆。欧元区受能源价格普遍性上涨及贸易格局重构的影响，复苏动能进一步弱化。日本方面，经济增长保持良好的势头，但日元贬值压力与输入性通胀持续压制实际购买力，消费修复仍显脆弱。

国内宏观方面，围绕十五五纲要规划和两会部署，坚持正确政绩观的引导，有序推进经济高质量发展。宏观调控政策保持连续稳定，财政政策强调固本增效，货币政策保持适度宽松。经济结构方面，AI 等新兴产业对出口、投资、价格等因素的贡献进一步抬升，传统动能在一季度发力后边际有所放缓。价格方面通胀读数呈上升趋势，对名义 GDP 增速的贡献抬升。整体上，中国经济仍然呈现出很强的活力与韧性，科技创新、产业升级与内需潜力释放仍在不断进行和强化过程中。

#### 2. 市场回顾

股票市场方面，在中东局势趋向缓和、全球 AI 产业蓬勃发展的背景下，2026 年二季度 A 股市场震荡回升，结构性行情特征明显。从主要宽基指数来看，科创板综合指数和创业板综合指数大幅领涨，二季度分别上涨 55.71%和 36.35%。上证综合指数先扬后抑，在创近年新高后震荡回落，二季度上涨 5.20%。代表大盘股表现的沪深 300 指数上涨 11.90%，中证 A500 指数上涨 14.26%，中小板综合指数上涨 8.90%。

债券市场方面，二季度债市整体上涨，结构上利率债表现好于信用债。其中，中债总财富指数上涨 1.17%，中债银行间国债财富指数上涨 1.18%，中债企业债总财富指数上涨 0.74%。在收益率曲线方面，10 年国债收益率从 1.82%下行 8.41bps 至 1.73%，10 年国开债收益率从 1.95%下行 16.75bps 至 1.78%。10 年国债与 1 年国债期限利差从 59.59bps 走扩 1.54bps 至 61.13bps，30 年国债与 10 年国债期限利差从 53.50bps 收窄 3.20bps 至 50.30bps。

可转债方面，二季度中证转债指数上涨 3.70%。

3.运行分析

二季度债券市场收涨。纯债策略上，产品保持适度久期和杠杆比例，重视中短端利率债、信用债的票息及套息策略，积极参与长端利率债和二级资本债波段投资机会，优化配置结构。转债策略上，二季度转债市场结构分化明显，组合立足产品策略定位和波动承受能力，对于平衡型品种重视估值调整后的配置价值；高价股性品种关注产业趋势和景气度；债性品种结合债底保护和剩余期限波段交易。通过整体仓位和双高因子的风险暴露管控回撤。后续产品将继续立足大类资产研究框架，持续优化组合持仓和期限结构，努力为投资人创造较好的回报。

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 1.23%，同期业绩比较基准收益率为 0.62%。

报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 1.16%，同期业绩比较基准收益率为 0.62%。

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   | 25,610,238,901.35 | 99.14        |
|    | 其中：债券    | 25,610,238,901.35 | 99.14        |
|    | 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 | -                 | -            |

|   |                   |                   |        |
|---|-------------------|-------------------|--------|
|   | 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      | 143,350,755.16    | 0.55   |
| 7 | 其他各项资产            | 77,796,302.68     | 0.30   |
| 8 | 合计                | 25,831,385,959.19 | 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      | 387,385,136.51    | 1.63         |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 11,710,547,947.56 | 49.25        |
|    | 其中：政策性金融债 | 4,186,767,389.49  | 17.61        |
| 4  | 企业债券      | 7,859,949,456.47  | 33.06        |
| 5  | 企业短期融资券   | 30,667,728.77     | 0.13         |
| 6  | 中期票据      | 1,283,078,930.79  | 5.40         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 2,064,679,529.81  | 8.68         |
| 8  | 同业存单      | 2,273,283,162.23  | 9.56         |
| 9  | 其他        | 647,009.21        | 0.00         |
| 10 | 合计        | 25,610,238,901.35 | 107.72       |

## 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  | 250361    | 25 进出 61        | 7,100,000 | 711,113,426.63 | 2.99         |
| 2  | 240203    | 24 国开 03        | 6,300,000 | 649,548,123.29 | 2.73         |
| 3  | 232580022 | 25 工行二级资本债 03BC | 5,300,000 | 542,086,294.25 | 2.28         |

|   |           |                          |           |                |      |
|---|-----------|--------------------------|-----------|----------------|------|
| 4 | 250215    | 25 国开 15                 | 5,400,000 | 534,863,342.47 | 2.25 |
| 5 | 232580056 | 25 广发银行<br>二级资本债<br>01BC | 4,500,000 | 462,178,972.60 | 1.94 |

#### 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，无相关投资政策。

#### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体国开行、进出口行、工商银行、建设银行、农业银行、广发银行、中信银行、国泰海通证券在报告编制日前一年内受到监管机构的行政处罚。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。其他前十名证券的发行主体无

受到公开谴责、处罚的情况。

报告期内，本基金投资的前十名证券发行主体没有被监管部门立案调查。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 194,393.93    |
| 2  | 应收证券清算款 | 24,750,430.86 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 52,851,477.89 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 77,796,302.68 |

### 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    | 116,929,046.14 | 0.49         |
| 2  | 118034 | 晶能转债    | 85,895,034.25  | 0.36         |
| 3  | 110086 | 精工转债    | 75,519,905.13  | 0.32         |
| 4  | 113054 | 绿动转债    | 53,863,444.82  | 0.23         |
| 5  | 127108 | 太能转债    | 50,148,748.42  | 0.21         |
| 6  | 127082 | 亚科转债    | 49,841,775.81  | 0.21         |
| 7  | 123176 | 精测转 2   | 48,838,552.77  | 0.21         |
| 8  | 118022 | 锂科转债    | 48,485,946.84  | 0.20         |
| 9  | 123216 | 科顺转债    | 47,806,928.07  | 0.20         |
| 10 | 118031 | 天 23 转债 | 46,216,005.81  | 0.19         |
| 11 | 110073 | 国投转债    | 45,553,029.83  | 0.19         |
| 12 | 123225 | 翔丰转债    | 45,246,343.56  | 0.19         |
| 13 | 123257 | 安克转债    | 45,155,971.87  | 0.19         |
| 14 | 123253 | 永贵转债    | 43,666,313.27  | 0.18         |
| 15 | 123252 | 银邦转债    | 41,397,193.45  | 0.17         |
| 16 | 118060 | 瑞可转债    | 40,705,006.53  | 0.17         |
| 17 | 118058 | 微导转债    | 35,930,859.48  | 0.15         |
| 18 | 113696 | 伯 25 转债 | 35,118,200.00  | 0.15         |
| 19 | 113058 | 友发转债    | 33,326,612.34  | 0.14         |
| 20 | 127056 | 中特转债    | 33,167,049.50  | 0.14         |
| 21 | 118050 | 航宇转债    | 30,703,528.77  | 0.13         |
| 22 | 118030 | 睿创转债    | 29,552,255.34  | 0.12         |
| 23 | 113652 | 伟 22 转债 | 29,510,339.16  | 0.12         |
| 24 | 127110 | 广核转债    | 28,973,228.49  | 0.12         |

|    |        |         |               |      |
|----|--------|---------|---------------|------|
| 25 | 110090 | 爱迪转债    | 28,936,101.99 | 0.12 |
| 26 | 123255 | 鼎龙转债    | 27,916,945.21 | 0.12 |
| 27 | 113666 | 爱玛转债    | 27,304,186.88 | 0.11 |
| 28 | 113661 | 福 22 转债 | 25,838,449.33 | 0.11 |
| 29 | 110087 | 天业转债    | 25,197,477.05 | 0.11 |
| 30 | 113688 | 国检转债    | 23,470,472.37 | 0.10 |
| 31 | 113694 | 清源转债    | 22,114,937.85 | 0.09 |
| 32 | 118024 | 冠宇转债    | 21,636,829.91 | 0.09 |
| 33 | 127046 | 百润转债    | 21,522,272.33 | 0.09 |
| 34 | 113692 | 保隆转债    | 21,403,708.56 | 0.09 |
| 35 | 123150 | 九强转债    | 20,944,801.02 | 0.09 |
| 36 | 118035 | 国力转债    | 20,249,784.22 | 0.09 |
| 37 | 127105 | 龙星转债    | 19,400,497.48 | 0.08 |
| 38 | 123258 | 胜蓝转 02  | 19,338,796.78 | 0.08 |
| 39 | 113678 | 中贝转债    | 18,840,817.15 | 0.08 |
| 40 | 113691 | 和邦转债    | 17,901,418.14 | 0.08 |
| 41 | 127068 | 顺博转债    | 17,501,410.18 | 0.07 |
| 42 | 127102 | 浙建转债    | 17,340,327.80 | 0.07 |
| 43 | 113056 | 重银转债    | 16,810,444.21 | 0.07 |
| 44 | 113699 | 金 25 转债 | 16,400,093.15 | 0.07 |
| 45 | 113655 | 欧 22 转债 | 16,277,667.41 | 0.07 |
| 46 | 118056 | 路维转债    | 16,044,312.12 | 0.07 |
| 47 | 113648 | 巨星转债    | 15,362,271.88 | 0.06 |
| 48 | 111018 | 华康转债    | 14,810,199.97 | 0.06 |
| 49 | 127103 | 东南转债    | 14,033,111.45 | 0.06 |
| 50 | 123107 | 温氏转债    | 13,812,253.84 | 0.06 |
| 51 | 110097 | 天润转债    | 12,711,977.75 | 0.05 |
| 52 | 113067 | 燃 23 转债 | 12,054,451.86 | 0.05 |
| 53 | 118061 | 茂莱转债    | 11,873,129.18 | 0.05 |
| 54 | 127084 | 柳工转 2   | 11,817,232.68 | 0.05 |
| 55 | 111020 | 合顺转债    | 10,526,547.74 | 0.04 |
| 56 | 113605 | 大参转债    | 9,730,844.57  | 0.04 |
| 57 | 123149 | 通裕转债    | 9,706,600.31  | 0.04 |
| 58 | 113667 | 春 23 转债 | 8,075,212.33  | 0.03 |
| 59 | 111024 | 澳弘转债    | 7,615,983.37  | 0.03 |
| 60 | 113070 | 渝水转债    | 7,186,687.01  | 0.03 |
| 61 | 113066 | 平煤转债    | 7,067,071.23  | 0.03 |
| 62 | 127049 | 希望转 2   | 6,584,123.99  | 0.03 |
| 63 | 123195 | 蓝晓转 02  | 6,065,835.62  | 0.03 |
| 64 | 127064 | 杭氧转债    | 5,974,322.73  | 0.03 |
| 65 | 127089 | 晶澳转债    | 5,800,718.79  | 0.02 |
| 66 | 111022 | 锡振转债    | 5,667,130.58  | 0.02 |
| 67 | 123222 | 博俊转债    | 4,989,767.00  | 0.02 |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 68 | 113656 | 嘉诚转债   | 4,635,846.58 | 0.02 |
| 69 | 127067 | 恒逸转 2  | 4,336,627.40 | 0.02 |
| 70 | 123262 | 神宇转债   | 4,209,256.44 | 0.02 |
| 71 | 118051 | 皓元转债   | 3,511,181.92 | 0.01 |
| 72 | 123114 | 三角转债   | 3,495,429.16 | 0.01 |
| 73 | 113636 | 甬金转债   | 3,379,701.38 | 0.01 |
| 74 | 123158 | 宙邦转债   | 2,979,939.73 | 0.01 |
| 75 | 118012 | 微芯转债   | 2,893,084.38 | 0.01 |
| 76 | 123224 | 宇邦转债   | 2,629,695.89 | 0.01 |
| 77 | 127031 | 洋丰转债   | 2,625,862.24 | 0.01 |
| 78 | 127027 | 能化转债   | 2,226,997.26 | 0.01 |
| 79 | 123259 | 锦浪转 02 | 1,870,026.58 | 0.01 |
| 80 | 118013 | 道通转债   | 1,653,669.86 | 0.01 |
| 81 | 118062 | 天准转债   | 1,560,090.55 | 0.01 |
| 82 | 118052 | 浩瀚转债   | 1,363,864.38 | 0.01 |
| 83 | 113697 | 应流转债   | 1,324,762.33 | 0.01 |
| 84 | 127040 | 国泰转债   | 1,222,063.29 | 0.01 |
| 85 | 128142 | 新乳转债   | 1,220,832.33 | 0.01 |
| 86 | 113042 | 上银转债   | 1,155,264.38 | 0.00 |
| 87 | 127083 | 山路转债   | 1,149,954.79 | 0.00 |
| 88 | 127095 | 广泰转债   | 881,400.97   | 0.00 |
| 89 | 113037 | 紫银转债   | 549,197.26   | 0.00 |

#### 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            | 中银国有企业债 A        | 中银国有企业债 C        |
|---------------|------------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 7,574,691,391.23 | 9,482,616,385.22 |
| 本报告期基金总申购份额   | 2,436,292,285.62 | 2,524,699,652.73 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 586,513,963.67   | 2,715,638,512.52 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                | -                |
| 本报告期末基金份额总额   | 9,424,469,713.18 | 9,291,677,525.43 |

### §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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

#### 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。

## **§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国有企业债债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中银国有企业债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银国有企业债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《中银国有企业债债券型证券投资基金托管协议》；
- 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  
二〇二六年七月二十一日