

中银全球策略证券投资基金（FOF）

2023 年中期报告

2023 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 1 月 1 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 境外投资顾问和境外资产托管人..... | 5 |
| 2.5 信息披露方式..... | 6 |
| 2.6 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 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介..... | 8 |
| 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 8 |
| 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 9 |
| 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 9 |
| 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 11 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 11 |
| 4.9 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..... | 11 |
| 5 托管人报告 | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 11 |
| 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..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表..... | 12 |
| 6.2 利润表..... | 13 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 14 |
| 6.4 报表附注..... | 16 |
| 7 投资组合报告 | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 38 |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布..... | 39 |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合..... | 39 |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细..... | 39 |
| 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 40 |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合..... | 41 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细..... | 41 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细..... | 41 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细..... | 41 |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细..... | 41 |
| 7.11 本报告期投资基金情况..... | 42 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 45 |

| | |
|--|----|
| 8 基金份额持有人信息 | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 46 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| 9 开放式基金份额变动 | 46 |
| 10 重大事件揭示 | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 47 |
| 10.8 其他重大事件..... | 49 |
| 11 备查文件目录 | 50 |
| 11.1 备查文件目录..... | 50 |
| 11.2 存放地点..... | 50 |
| 11.3 查阅方式..... | 50 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 中银全球策略证券投资基金（FOF） |
| 基金简称 | 中银全球策略（QDII-FOF） |
| 基金主代码 | 163813 |
| 交易代码 | 163813 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年3月3日 |
| 基金管理人 | 中银基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 52,663,623.13 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 通过全球化的资产配置和组合管理,实现组合资产的分散化投资,运用“核心-卫星”投资策略,力争实现投资组合的收益最大化,严格遵守投资纪律,追求基金长期资产增值。 |
| 投资策略 | 坚持理性投资、价值投资和长期投资,通过对全球宏观经济、各主要经济体及行业基本面的深入分析,在全球范围有效配置基金资产,应用“核心-卫星”投资策略,构建多元化的投资组合,降低基金资产非系统性风险,提高投资组合风险调整后的收益。此外,本基金通过精选基金、股票和债券,进一步为投资者实现资本稳健、长期增值的目标。 |
| 业绩比较基准 | 60%×MSCI 所有国家世界指数 (MSCI All Country World Index) +40%×美国 3 月政府债券 (US 3-Month T-Bills) 收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为基金中基金,预期风险与收益水平高于债券型基金和货币市场基金,低于全球股票型基金。 |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 欧阳向军 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 021-38848999 | 021-60637103 |
| | 电子邮箱 | clientservice@bocim.com | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 021-38834788 400-888-5566 | 021-60637228 |
| 传真 | | 021-68873488 | 021-60635778 |
| 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25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 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | | 章砚 | 田国立 |

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
|----|--------|---------|
|----|--------|---------|

| | | | |
|------|----|---|----------------------------------|
| 名称 | 英文 | - | Bank of New York Mellon |
| | 中文 | - | 纽约梅隆银行 |
| 注册地址 | - | - | 225 Liberty St, New York, NY USA |
| 办公地址 | - | - | 225 Liberty St, New York, NY USA |
| 邮政编码 | - | - | 10286 |

注：本基金目前不设境外投资顾问。基金管理人有权选择、更换或撤销境外投资顾问，并根据法律法规和《基金合同》的有关规定公告。

2.5 信息披露方式

| | |
|---------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 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号中银大厦26层 |

2.6 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|----------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街17号 |

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（2023年1月1日至2023年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 75,310.27 |
| 本期利润 | 8,023,857.39 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1551 |
| 本期加权平均净值利润率 | 24.46% |
| 本期基金份额净值增长率 | 26.82% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | -17,895,010.12 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.3398 |
| 期末基金资产净值 | 38,607,254.24 |
| 期末基金份额净值 | 0.733 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | -26.70% |

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、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，不是当期发生数）。

3、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 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

| 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 | 7.64% | 0.89% | 3.47% | 0.41% | 4.17% | 0.48% |
| 过去三个月 | 15.43% | 1.02% | 3.66% | 0.42% | 11.77% | 0.60% |
| 过去六个月 | 26.82% | 1.10% | 8.22% | 0.46% | 18.60% | 0.64% |
| 过去一年 | 27.92% | 1.33% | 9.83% | 0.58% | 18.09% | 0.75% |
| 过去三年 | 18.23% | 1.21% | 19.33% | 0.57% | -1.10% | 0.64% |
| 自基金合同生效日起 | -26.70% | 1.12% | 60.55% | 0.58% | -87.25% | 0.54% |

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

中银全球策略证券投资基金（FOF）
 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
 (2011年3月3日至2023年6月30日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2023 年 6 月 30 日,本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等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 | | |
| 夏宜冰 | 基金经理 | 2020-04-02 | - | 20 | 中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP）,应用金融学硕士。曾任三菱日联资管(香港)高级基金经理、平安资管投资经理。2018 年加入中银基金管理有限公司,2020 年 4 月至今任中银全球策略（QDII-FOF）基金基金经理,2021 年 2 月至今任中银港股通优势成长基金基金经理。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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金目前不设境外投资顾问。基金管理人有权选择、更换或撤销境外投资顾问,并根据法律法规和《基金合同》的有关规定公告。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1. 宏观经济分析

国外经济方面，上半年全球发达国家在高通胀和金融条件收紧背景下经济边际走弱，不过体现出一定韧性。美国通胀回落，经济有所分化但仍有韧性，就业市场维持偏紧状态，6 月 CPI 较 2022 年 12 月回落 3.5 个百分点至 3.0%，6 月制造业 PMI 较 2022 年 12 月回落 2.4 个百分点至 46.0%，6 月服务业 PMI 较 2022 年 12 月回升 4.7 个百分点至 53.9%，6 月失业率较 2022 年 12 月小幅抬升 0.1 个百分点至 3.6%。美联储 2 月、3 月、5 月各加息 25bps，联邦基金目标利率区间上限升至 5.25%。欧元区经济表现分化，服务业好于制造业，4 月失业率较 2022 年末回落 0.2 个百分点至 6.5%，6 月制造业 PMI 较 2022 年末回落 4.4 个百分点至 43.4%，6 月服务业 PMI 较 2022 年末抬升 2.2 个百分点至 52.0%，欧央行 2 月和 3 月各加息 50bps、5 月和 6 月各加息 25bps。日本央行调整 YCC，维持政策利率不变，但将购债操作利率由 0.5% 上调至 1%，经济边际向好，通胀有所回落，6 月 CPI 同比较 2022 年末回落 0.7 个百分点至 3.3%，6 月制造业 PMI 较 2022 年末回升 0.9 个百分点至 49.8%，6 月服务业 PMI 较 2022 年末抬升 2.9 个百分点至 54.0%。综合来看，全球经济下半年经济下行压力仍存，主要经济体央行货币政策依然处于继续收紧状态，不过可能接近于加息尾声。

国内经济方面，经济依然处于弱复苏状态，经济内生修复动能仍待提振，国内经济数据边际走弱，仍体现结构性分化，基建维持在一定强度，消费增速继续恢复，地产维持负增长，出口走弱，CPI 与 PPI 通胀整体走低。具体来看，上半年领先指标中采制造业 PMI 先上后下，6 月值较 2022 年 12 月值走高 2.0 个百分点至 49.0%，同步指标工业增加值 6 月同比增长 4.4%，较 2022 年 12 月回升

3.1 个百分点。从经济增长动力来看，出口与投资走弱，消费有所恢复：6 月美元计价出口增速较 2022 年 12 月回落 1.0 个百分点至-12.4%，6 月社会消费品零售总额增速较 2022 年 12 月回升 4.9 个百分点至 3.1%，基建投资较强，制造业投资仍在相对低位，房地产投资延续负增长，1-6 月固定资产投资增速较 2022 年末回落 1.3 个百分点至 3.8%的水平。通胀方面，CPI 震荡走低，6 月同比增速从 2022 年 12 月的 1.8%降低 1.8 个百分点至 0.0%，PPI 负值走阔，6 月同比增速从 2022 年 12 月的-0.7%回落 4.7 个百分点至-5.4%。

2. 市场回顾

今年上半年，海外市场虽然仍旧面临俄乌冲突、通货膨胀、并且叠加了诸如硅谷银行事件等新的不确定因素，但是主流市场的总体表现较好。代表美国总体市场情况的标普 500 指数上半年累计上涨 15.91%。日本的日经 225 指数上涨 27.19%。欧洲斯托克 50 指数上涨 15.96%。

受到以 ChatGPT 为代表的人工智能产业突破性发展的影响，拥有人工智能核心标的的纳斯达克市场表现更为强劲，上半年纳斯达克指数累计上涨 31.73%。投资人沿着算力、算法、数据三大要素的线索，不断寻找合适的投资标的。其中，确定性较强的几个龙头公司涨幅较为明显，对于指数的整体贡献也比较显著。

3. 运行分析

今年上半年，ChatGPT 引发全球资本市场对于人工智能产业发展的关注度不断提升，与之相关标的都有相当的涨幅，包括一些我们长期持有的标的。我们认为，人工智能的飞速发展，很有可能成为继计算机、互联网、移动端等产业革新之后，又一次引领全球科技发展的产业革命，并可能延续较长时间。与此相关的投资机会将在未来较长时间内持续成为全球投资人关注的焦点之一。这其中，由于美股的龙头公司先发优势较为明显，因此可能会长期受到资本市场的关注。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 26.82%，同期业绩比较基准收益率为 8.22%。

4.6 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，在美联储七月议息会议上再次加息 25 基点之后，市场目前对于美联储后续进一步调整利率的预期较低，普遍认为本轮加息已经接近尾声。目前美国经济对于高利率的承接能力相对较强。

我们会继续关注全球宏观经济形势的变化，并积极进行应对。同时，我们对于科学技术的发展，尤其是人工智能相关行业的发展，也将继续紧密跟踪。

我们认为，对于一轮有可能持续较长时期的产业发展变革的投资，方向的确性较为重要，而中银全球策略这种以 FoF 为主体形式设计的基金，是一种较好的投资载体。在产业发展的初期乃至

未来产业继续发展的阶段，都可以较为灵活地顺应趋势进行配置，增加相关个股的总体覆盖度，从而提升捕捉到好的投资标的之概率。我们将继续关注产业的发展方向，充分发挥本基金较为独特的优势特点，努力寻找相关的投资机会，为持有人争取好的投资回报。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 25%。

本报告期末可供分配利润为-17,895,010.12 元。本基金本报告期末未进行利润分配。

4.9 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

截至本报告期末，本基金已连续超过 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，相应解决方案已报送中国证监会。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

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：中银全球策略证券投资基金（FOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 3,558,261.28 | 3,090,877.95 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 35,389,247.27 | 26,985,396.77 |
| 其中：股票投资 | | 5,351,969.64 | 1,972,956.98 |
| 基金投资 | | 30,037,277.63 | 25,012,439.79 |
| 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 | | 28,834.63 | 27,053.78 |
| 应收申购款 | | 203,820.80 | 6,235.69 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 39,180,163.98 | 30,109,564.19 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |

| | | | |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 441,221.13 | 4,497.93 |
| 应付管理人报酬 | | 55,031.91 | 47,246.54 |
| 应付托管费 | | 10,700.65 | 9,186.82 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 65,956.05 | 80,006.50 |
| 负债合计 | | 572,909.74 | 140,937.79 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 52,663,623.13 | 51,846,599.08 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | -14,056,368.89 | -21,877,972.68 |
| 净资产合计 | | 38,607,254.24 | 29,968,626.40 |
| 负债和净资产总计 | | 39,180,163.98 | 30,109,564.19 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.733 元，基金份额总额 52,663,623.13 份。

6.2 利润表

会计主体：中银全球策略证券投资基金（FOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 8,390,109.74 | -7,004,728.12 |
| 1.利息收入 | | 22,562.75 | 3,473.07 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 22,562.75 | 3,473.07 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 352,796.89 | -414,790.07 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -112,333.90 | -735,469.91 |
| 基金投资收益 | | 340,634.77 | 151,633.79 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|---------------------|----------------------|
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | 124,496.02 | 169,046.05 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | 7,948,547.12 | -6,670,302.68 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | 64,702.37 | 75,938.57 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 1,500.61 | 952.99 |
| 减：二、营业总支出 | | 366,252.35 | 397,574.61 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2 | 292,968.17 | 298,978.60 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2 | 56,966.00 | 58,134.74 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 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 | | 1,240.49 | 616.44 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.17 | 15,077.69 | 39,844.83 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 8,023,857.39 | -7,402,302.73 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 8,023,857.39 | -7,402,302.73 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 8,023,857.39 | -7,402,302.73 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中银全球策略证券投资基金（FOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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（基金净值） | 51,846,599.08 | - | -21,877,972.68 | 29,968,626.40 |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 51,846,599.08 | - | -21,877,972.68 | 29,968,626.40 |
| 三、本期增减变动额（减少以 | 817,024.05 | - | 7,821,603.79 | 8,638,627.84 |

| | | | | |
|--|---------------------------------|------------|----------------|---------------|
| “-”号填列) | | | | |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 8,023,857.39 | 8,023,857.39 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 817,024.05 | - | -202,253.60 | 614,770.45 |
| 其中: 1.基金申购款 | 4,594,117.54 | - | -1,510,013.51 | 3,084,104.03 |
| 2.基金赎回款 | -3,777,093.49 | - | 1,307,759.91 | -2,469,333.58 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 52,663,623.13 | - | -14,056,368.89 | 38,607,254.24 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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(基金净值) | 53,670,844.10 | - | -15,423,796.82 | 38,247,047.28 |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 53,670,844.10 | - | -15,423,796.82 | 38,247,047.28 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -1,155,788.99 | - | -6,999,206.49 | -8,154,995.48 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -7,402,302.73 | -7,402,302.73 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -1,155,788.99 | - | 403,096.24 | -752,692.75 |
| 其中: 1.基金申购款 | 1,726,058.93 | - | -660,386.89 | 1,065,672.04 |
| 2.基金赎回款 | -2,881,847.92 | - | 1,063,483.13 | -1,818,364.79 |
| (三)、本期向基 | - | - | - | - |

| | | | | |
|----------------------------------|---------------|---|----------------|---------------|
| 金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | | | | |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 52,515,055.11 | - | -22,423,003.31 | 30,092,051.80 |

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：陈宇，会计机构负责人：乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银全球策略证券投资基金（FOF）（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[2010]1134 号文《关于核准中银全球策略证券投资基金(FOF)募集的批复》的核准，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 2011 年 3 月 3 日正式生效，首次设立募集规模为 1,059,555,414.92 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，基金境外托管人为纽约梅隆银行(Bank of New York Mellon)。

本基金投资于全球证券市场中具有良好流通性的金融工具，包括在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的境外公募基金（包括 ETF），在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场公开发行和挂牌交易的股票，以及债券、现金、货币市场工具、股指期货等用于组合避险或有效管理的金融衍生工具和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：60%×MSCI 所有国家世界指数（MSCI All Country World Index）+40%×美国 3 月政府债券（US 3-Month T-Bills）收益率。

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 2023 年 8 月 29 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

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本期财务报表的实际编制期间系自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

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

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

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

6.4.4.10 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) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例

不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 25%；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，红利再投资方式免收再投资的费用；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日；

(7) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需进行分部报告的披露。

6.4.4.14 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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本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。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 3,558,261.28 |
| 等于：本金 | 3,557,950.67 |
| 加：应计利息 | 310.61 |
| 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 | 3,558,261.28 |

注：于 2023 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 126,922.95 元(折合人民币 917,119.85 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|------------------------|------|--------------|--------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 4,304,606.54 | - | 5,351,969.64 | 1,047,363.10 |
| 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 | | 24,488,423.18 | - | 30,037,277.63 | 5,548,854.45 |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 28,793,029.72 | - | 35,389,247.27 | 6,596,217.55 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 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 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 1,079.66 |
| 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 | - |
| 应付信息披露费 | 50,000.00 |
| 应付审计费 | 14,876.39 |
| 合计 | 65,956.05 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 51,846,599.08 | 51,846,599.08 |
| 本期申购 | 4,594,117.54 | 4,594,117.54 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,777,093.49 | -3,777,093.49 |
| 本期末 | 52,663,623.13 | 52,663,623.13 |

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

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 | -17,694,571.33 | -4,183,401.35 | -21,877,972.68 |
| 本期利润 | 75,310.27 | 7,948,547.12 | 8,023,857.39 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -275,749.06 | 73,495.46 | -202,253.60 |
| 其中：基金申购款 | -1,562,124.91 | 52,111.40 | -1,510,013.51 |
| 基金赎回款 | 1,286,375.85 | 21,384.06 | 1,307,759.91 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -17,895,010.12 | 3,838,641.23 | -14,056,368.89 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 22,562.00 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | 0.75 |
| 合计 | 22,562.75 |

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 157,740.47 |
| 减：卖出股票成本总额 | 268,784.35 |
| 减：交易费用 | 1,290.02 |
| 买卖股票差价收入 | -112,333.90 |

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额 | 6,520,511.89 |

| | |
|-------------------|--------------|
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 6,166,622.31 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 10,337.43 |
| 减：交易费用 | 2,917.38 |
| 基金投资收益 | 340,634.77 |

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 11,873.47 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | 112,622.55 |
| 合计 | 124,496.02 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 7,948,547.12 |
| ——股票投资 | 1,503,423.32 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | 6,445,123.80 |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税 | - |
| 合计 | 7,948,547.12 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----|----------------------------|
| | |

| | |
|---------|----------|
| 基金赎回费收入 | 1,500.61 |
| 合计 | 1,500.61 |

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 14,876.39 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 115.00 |
| 其他 | 86.30 |
| 合计 | 15,077.69 |

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 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|--------------|
| 中银基金管理有限公司(“中银基金公司”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“建设银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 纽约梅隆银行有限公司(“纽约梅隆”) | 境外资产托管人 |

注：下述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

本基金本报告期及上年度可比期间均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 2023年1月1日至2023年6月 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 |
|----|-------------------------|------------------------------|
| | | |

| | 30日 | 月30日 |
|-----------------|------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 292,968.17 | 298,978.60 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 129,199.17 | 132,357.08 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.80%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 56,966.00 | 58,134.74 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.35%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

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

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

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

6.4.10.5 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及上年度可比期间均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及上年度末均未投资本基金。

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 | | 上年度可比期间 | |
|--------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 2,641,185.29 | 2,777.32 | 1,610,681.83 | 2,854.87 |
| 纽约梅隆 | 917,075.99 | 19,784.68 | 1,176,126.61 | 618.07 |

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人纽约梅隆银行有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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，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，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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注“期末本基金持有的流通受限证券”列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 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 2023 年 6 月 30 日 | 1 个月以 内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------------|------------|--------|-------------|-------|-------|-------|-----|----|

| | | | | | | | | |
|-----------|---|---|---|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | | | | |
| 银行存款 | - | - | - | 3,558,261.28 | - | - | - | 3,558,261.28 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | - | 35,389,247.27 | 35,389,247.27 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | 28,834.63 | 28,834.63 |
| 应收申购款 | - | - | - | 0.20 | - | - | 203,820.60 | 203,820.80 |
| 资产总计 | - | - | - | 3,558,261.48 | - | - | 35,621,902.50 | 39,180,163.98 |
| 负债 | | | | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - | 441,221.13 | 441,221.13 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | - | 55,031.91 | 55,031.91 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | - | 10,700.65 | 10,700.65 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | - | 65,956.05 | 65,956.05 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | - | 572,909.74 | 572,909.74 |

| | | | | | | | | |
|-----------------------------|------------|--------|-------------|------------------|-------|-------|-------------------|-------------------|
| 利率敏感 度缺口 | - | - | - | 3,558,261. 48 | - | - | 35,048,99 2.76 | 38,607,25 4.24 |
| 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | 1 个月以 内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | | |
| 银行存款 | - | - | - | 3,090,877. 95 | - | - | - | 3,090,877. 95 |
| 交易性金 融资产 | - | - | - | - | - | - | 26,985,39 6.77 | 26,985,39 6.77 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | 27,053.78 | 27,053.78 |
| 应收申购 款 | - | - | - | - | - | - | 6,235.69 | 6,235.69 |
| 资产总计 | - | - | - | 3,090,877. 95 | - | - | 27,018,68 6.24 | 30,109,56 4.19 |
| 负债 | | | | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金 融负债 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 衍生金融 负债 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购 金融资产 款 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付证券 清算款 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回 款 | - | - | - | - | - | - | 4,497.93 | 4,497.93 |
| 应付管理 人报酬 | - | - | - | - | - | - | 47,246.54 | 47,246.54 |
| 应付托管 费 | - | - | - | - | - | - | 9,186.82 | 9,186.82 |
| 应付销售 服务费 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易 费用 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|-------------|---|---|---|------------------|---|---|-------------------|-------------------|
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 递延所得 税负债 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | - | 80,006.50 | 80,006.50 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | - | 140,937.7 9 | 140,937.7 9 |
| 利率敏感 度缺口 | - | - | - | 3,090,877. 95 | - | - | 26,877,74 8.45 | 29,968,62 6.40 |

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（上年度末：同）。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 | | | |
|-----------------------|-------------------|-------------|---------------|---------------|
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的 资产 | | | | |
| 银行存款 | 917,119.85 | - | - | 917,119.85 |
| 交易性金融资 产 | 34,514,609.58 | 700,853.99 | 173,783.70 | 35,389,247.27 |
| 应收股利 | 28,834.63 | 0.00 | - | 28,834.63 |
| 资产合计 | 35,460,564.06 | 700,853.99 | 173,783.70 | 36,335,201.75 |
| 以外币计价的 负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外 汇风险敞口净 额 | 35,460,564.06 | 700,853.99 | 173,783.70 | 36,335,201.75 |
| 项目 | 上年度末 | | | |

| | 2022年12月31日 | | |
|-------------------|---------------|-------------|---------------|
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | |
| 银行存款 | 1,616,723.04 | - | 1,616,723.04 |
| 交易性金融资产 | 26,278,028.47 | 707,368.30 | 26,985,396.77 |
| 应收股利 | 27,053.78 | 0.00 | 27,053.78 |
| 资产合计 | 27,921,805.29 | 707,368.30 | 28,629,173.59 |
| 以外币计价的负债 | | | |
| 负债合计 | - | - | - |
| 资产负债表外 汇风险敞口净额 | 27,921,805.29 | 707,368.30 | 28,629,173.59 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率外其他市场变量保持不变 | | |
|----|----------------|----------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元） | |
| | | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 美元相对人民币升值 5% | 增加约 177 | 增加约 140 |
| | 美元相对人民币贬值 5% | 减少约 177 | 减少约 140 |
| | 港币相对人民币升值 5% | 增加约 4 | 增加约 4 |
| | 港币相对人民币贬值 5% | 减少约 4 | 减少约 4 |
| | 其他币种相对人民币升值 5% | 增加约 1 | - |
| | 其他币种相对人民币贬值 5% | 减少约 1 | - |

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。本基金主要投资于境内外证券市场公开发行和挂牌交易的证券，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 2023年6月30日 | | 上年度末 2022年12月31日 | |
|----|-------------------|---------------|---------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 |
| | | | | |

| | | (%) | | (%) |
|--------------|---------------|-------|---------------|-------|
| 交易性金融资产—股票投资 | 5,351,969.64 | 13.86 | 1,972,956.98 | 6.58 |
| 交易性金融资产—基金投资 | 30,037,277.63 | 77.80 | 25,012,439.79 | 83.46 |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 35,389,247.27 | 91.66 | 26,985,396.77 | 90.05 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。 | | |
|----|--|------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元） | |
| | | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 1. 业绩比较基准上升5% | 增加约 397 | 增加约 295 |
| | 2. 业绩比较基准下降5% | 减少约 397 | 减少约 295 |

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 35,389,247.27 | 26,985,396.77 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 35,389,247.27 | 26,985,396.77 |

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 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 | 5,351,969.64 | 13.66 |
| | 其中：普通股 | 4,847,095.78 | 12.37 |
| | 存托凭证 | 504,873.86 | 1.29 |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 30,037,277.63 | 76.66 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 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 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 3,558,261.28 | 9.08 |
| 8 | 其他各项资产 | 232,655.43 | 0.59 |
| 9 | 合计 | 39,180,163.98 | 100.00 |

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|--------------|--------------|
| 美国 | 4,739,681.85 | 12.28 |
| 香港 | 612,287.79 | 1.59 |
| 合计 | 5,351,969.64 | 13.86 |

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|--------------|--------------|
| 通讯 | 769,042.76 | 1.99 |
| 非必需消费品 | 558,920.77 | 1.45 |
| 科技 | 4,024,006.11 | 10.42 |
| 合计 | 5,351,969.64 | 13.86 |

注：由管理人与托管人协商确认，采用国际通用的具有权威性的行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称 (英文) | 公司名称 (中文) | 证券代码 | 所在证 券市场 | 所属国家 (地区) | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例（%） |
|----|----------------------------------|--------------|---------|-----------------|--------------|-------|--------------|----------------------|
| 1 | NVIDIA CORP | 英伟达 | NVDA US | 纳斯达 克交易 所 | 美国 | 550 | 1,681,161.85 | 4.35 |
| 2 | MICROS OFT CORP | 微软公司 | MSFT US | 纳斯达 克交易 所 | 美国 | 450 | 1,107,303.27 | 2.87 |
| 3 | APPLE INC | 苹果公司 | AAPL US | 纳斯达 克交易 所 | 美国 | 530 | 742,841.87 | 1.92 |
| 4 | ADVANC ED MICRO DEVICES | AMD 公司 | AMD US | 纳斯达 克交易 所 | 美国 | 510 | 419,776.35 | 1.09 |
| 5 | BAIDU INC - SPON ADR | 百度 | BIDU US | 纳斯达 克交易 所 | 美国 | 300 | 296,785.28 | 0.77 |
| 6 | TESLA INC | 特斯拉公 司 | TSLA US | 纳斯达 克交易 所 | 美国 | 150 | 283,724.65 | 0.73 |
| 7 | NETEAS E INC | 网易 | 9999 HK | 香港证 券交易 | 香港 | 1,300 | 182,923.09 | 0.47 |

| | | | | | | | | |
|----|-----------------------------|------|---------|---------|----|-------|------------|------|
| | | | | 所 | | | | |
| 8 | TENCENT HOLDINGS LTD | 腾讯控股 | 700 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 500 | 152,881.58 | 0.40 |
| 9 | JD.COM INC - CLASS A | 京东集团 | 9618 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 1,147 | 140,030.31 | 0.36 |
| 10 | MEITUAN-N-CLASS B | 美团-W | 3690 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 1,210 | 136,452.81 | 0.35 |
| 11 | PINGDUODUO ADR | 拼多多 | PDD US | 纳斯达克交易所 | 美国 | 150 | 74,938.77 | 0.19 |
| 12 | TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR | 台积电 | TSM US | 纽约证券交易所 | 美国 | 100 | 72,922.77 | 0.19 |
| 13 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 阿里巴巴 | BABA US | 纽约证券交易所 | 美国 | 100 | 60,227.04 | 0.16 |

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|------------------------|---------|------------|----------------|
| 1 | APPLE INC | AAPL US | 520,734.54 | 1.74 |
| 2 | ADVANCED MICRO DEVICES | AMD US | 414,756.94 | 1.38 |
| 3 | BAIDU INC - SPON ADR | BIDU US | 316,735.27 | 1.06 |
| 4 | MICROSOFT CORP | MSFT US | 290,675.27 | 0.97 |
| 5 | NVIDIA CORP | NVDA US | 233,047.76 | 0.78 |
| 6 | TENCENT HOLDINGS LTD | 700 HK | 129,667.26 | 0.43 |
| 7 | MEITUAN-CLASS B | 3690 HK | 106,873.48 | 0.36 |
| 8 | TESLA INC | TSLA US | 87,909.95 | 0.29 |
| 9 | NETEASE INC | 9999 HK | 42,289.22 | 0.14 |

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|------------------------------|---------|-----------|----------------|
| 1 | GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 175 HK | 80,547.69 | 0.27 |
| 2 | JD.COM INC - CLA | 9618 HK | 77,192.78 | 0.26 |

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

| | |
|------------|--------------|
| 买入成本（成交）总额 | 2,142,689.69 |
| 卖出收入（成交）总额 | 157,740.47 |

注：“买入成本”、“卖出收入”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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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 | POWERS HARES QQQ NASDAQ 100 | ETF 基金 | 契约型开放式 | Invesco Capital Management LLC | 7,580,968.30 | 19.64 |
| 2 | SPDR S&P 500 ETF TRUST | ETF 基金 | 契约型开放式 | SSgA Funds Management Inc | 4,964,731.57 | 12.86 |
| 3 | VANGUARD TOT WORLD STK ETF | ETF 基金 | 契约型开放式 | SSgA Funds Management Inc | 2,032,198.44 | 5.26 |

| | | | | | | |
|----|-------------------------------|--------|--------|---------------------------------------|--------------|------|
| 4 | FIRST TRUST NASDQ 100 TECH I | ETF 基金 | 契约型开放式 | Vanguard Group Inc/The | 1,967,195.15 | 5.10 |
| 5 | TECHNOLOGY SELECT SECT SPDR | ETF 基金 | 契约型开放式 | Vanguard Group Inc/The | 1,884,416.38 | 4.88 |
| 6 | FIRST TRUST TECHNOLOGY ALPHA | ETF 基金 | 契约型开放式 | State Street Global Advisors Inc | 1,828,763.27 | 4.74 |
| 7 | VANGUARD INFO TECH ETF | ETF 基金 | 契约型开放式 | SSgA Funds Management Inc | 1,821,127.04 | 4.72 |
| 8 | PWR S&P 500 EQ WGT TECH | ETF 基金 | 契约型开放式 | State Street Global Advisors Inc | 1,806,280.19 | 4.68 |
| 9 | VANECK VECTORS SEMICONDUCTOR | ETF 基金 | 契约型开放式 | Van Eck Absolute Return Advisers Corp | 1,551,180.55 | 4.02 |
| 10 | INVESCO DYNAMIC SEMICONDUCTOR | ETF 基金 | 契约型开放式 | Invesco Capital Management LLC | 1,037,838.04 | 2.69 |

7.11 本报告期投资基金情况

7.11.1 投资政策及风险说明

在核心组合中，本基金将主要投资于跟踪全球主要市场指数低成本的 ETF 等指数化投资工具，以获得所投资市场和行业平均收益。

1). 实现核心投资策略具体步骤：

(1) 根据各主要资本市场和行业在基金业绩比较基准指数中的占比和权重，初步设定本基金“核心”组合在各主要资本市场和行业的投资比例；

(2) 根据基金管理人对全球各区域及产业短、中、长期发展走势的分析和预期，调整“核心”

组合在各主要资本市场和行业的投资比例；

(3) 基金管理人在前述配置比例基础上，从投资品种库中选择代表性强、跟踪质量好、流动性高和低费率 ETF 或指数型基金实现“核心”配置。

2). 精选指数型基金（包含 ETF）保证核心投资策略的实现：本基金根据以下指标精选指数型基金：

- (1) 基金的长期表现和跟踪效率；
- (2) 基金所跟踪指数和市场的代表性；
- (3) 基金的流动性；
- (4) 基金的费率；
- (5) 基金管理团队的经验、长期表现和稳定性。

7.11.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额 (份) | 公允价值 (元) | 占基金资产 净值比 例(%) | 是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金 |
|----|---------|---|------|-------------|------------------|----------------------|------------------------------------|
| 1 | QQQ US | POWERS HARES QQQ NASDAQ 100 | 开放式 | 2,840.00 | 7,580,968. 30 | 19.64% | 否 |
| 2 | SPY US | SPDR S&P 500 ETF TRUST | 开放式 | 1,550.00 | 4,964,731. 57 | 12.86% | 否 |
| 3 | VT US | VANGUA RD TOT WORLD STK ETF | 开放式 | 2,900.00 | 2,032,198. 44 | 5.26% | 否 |
| 4 | QTEC US | FIRST TRUST NASDAQ 100 TECH I | 开放式 | 1,850.00 | 1,967,195. 15 | 5.10% | 否 |
| 5 | XLK US | TECHNO LOGY SELECT SECT SPDR | 开放式 | 1,500.00 | 1,884,416. 38 | 4.88% | 否 |

| | | | | | | | |
|----|---------|------------------------------|-----|----------|--------------|-------|---|
| 6 | FXL US | FIRST TRUST TECHNOLOGY ALPHA | 开放式 | 2,200.00 | 1,828,763.27 | 4.74% | 否 |
| 7 | VGT US | VANGUARD INFO TECH ETF | 开放式 | 570.00 | 1,821,127.04 | 4.72% | 否 |
| 8 | RSPT US | PWR S&P 500 EQ WGT TECH | 开放式 | 850.00 | 1,806,280.19 | 4.68% | 否 |
| 9 | SMH US | VANECK VECTORS SEMICONDUCTOR | 开放式 | 1,410.00 | 1,551,180.55 | 4.02% | 否 |
| 10 | PSI US | INVESCO DYNAMIC SEMICONDUCTO | 开放式 | 1,050.00 | 1,037,838.04 | 2.69% | 否 |
| 11 | XBI US | SPDR S&P BIOTECH ETF | 开放式 | 1,500.00 | 901,779.84 | 2.34% | 否 |
| 12 | VTWO US | VANGUARD RUSSELL 2000 ETF | 开放式 | 1,000.00 | 546,415.00 | 1.42% | 否 |
| 13 | XLY US | CONSUMER DISCRETIONARY SELT | 开放式 | 350.00 | 429,454.58 | 1.11% | 否 |
| 14 | ARKG US | ARK GENOMIC REVOLUTION ETF | 开放式 | 1,500.00 | 369,491.28 | 0.96% | 否 |
| 15 | XLE US | ENERGY SELECT | 开放式 | 400.00 | 234,607.27 | 0.61% | 否 |

| | | SECTOR SPDR | | | | | |
|----|---------|--|-----|-----------|----------------|-------|---|
| 16 | XLB US | MATERI ALS SELECT SECTOR | 开放式 | 300.00 | 179,640.6 1 | 0.47% | 否 |
| 17 | 1330 JP | NIKKO ETF - NKY 225 | 开放式 | 100.00 | 173,783.7 0 | 0.45% | 否 |
| 18 | XLP US | MARKET VECTOR S GOLD MINERS | 开放式 | 300.00 | 160,781.2 8 | 0.42% | 否 |
| 19 | XLI US | INDUSTR IAL SELECT SECT | 开放式 | 200.00 | 155,094.5 7 | 0.40% | 否 |
| 20 | XLV US | HEALTH CARE SELECT SECTOR | 开放式 | 150.00 | 143,862.0 7 | 0.37% | 否 |
| 21 | DIA US | SPDR DJIA TRUST | 开放式 | 50.00 | 124,229.5 7 | 0.32% | 否 |
| 22 | 3033 HK | CSOP HANG SENG TECH INDE-HK D | 开放式 | 25,000.00 | 88,566.20 | 0.23% | 否 |
| 23 | SKYY US | FIRST TRUST CLOUD COMPUT ING | 开放式 | 100.00 | 54,872.73 | 0.14% | 否 |

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有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 | - |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 28,834.63 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 203,820.80 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 232,655.43 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

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

| 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 |
| 3,708 | 14,202.70 | 2,345,361.85 | 4.4535% | 50,318,261.28 | 95.5465% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 549,700.90 | 1.0438% |

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 | 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 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 10~50 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2011年3月3日）基金份额总额 | 1,059,555,414.92 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 51,846,599.08 |

| | |
|---------------|---------------|
| 本报告期基金总申购份额 | 4,594,117.54 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 3,777,093.49 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 52,663,623.13 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转出份额。

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，公司原董事曾仲诚（Paul Chung Shing Tsang）先生辞去公司董事。经 2023 年第一次股东会审议通过，同意金贤泽（Hyun Taek Kim）先生担任公司董事。

经董事会决议通过，奚鹏洲先生不再担任投资总监（固定收益），详情请参见基金管理人 2023 年 1 月 5 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》。

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 | 佣金 | 占当期佣金总量的 | |
| | | | | | | |

| | | | 额的比例 | | 比例 | |
|--------------------------------|---|--------------|--------|----------|--------|---|
| Morgan Stanley | - | 1,439,554.37 | 62.58% | 434.34 | 12.34% | - |
| Goldman Sachs And Co. LLC. | - | 625,433.97 | 27.19% | 1,800.10 | 51.16% | - |
| Credit Suisse Hong Kong Ltd | - | 235,441.81 | 10.23% | 1,284.20 | 36.50% | - |

注：1、本公司从事境外投资业务时，将需要委托境外券商代理或协助进行交易操作，本报告期内没有新增券商。公司作为基金管理人将勤勉尽责地承担受信责任，挑选、委托合适的境外券商以取得有益于基金持有人利益的最佳执行；

2、根据相关法规与基金管理人的制度，基金管理人 QDII 业务团队按照以下标准，对 QDII 投资交易单元进行选择：（一）交易执行能力。主要指境外券商是否对交易指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量交易执行能力的指标主要有：下单及成交回报的准确性和及时性、券款划拨的准确性和及时性、交易保密能力等；（二）研究团队的实力和水平。衡量境外券商的研究能力的指标主要有：宏观经济研究、行业研究、市场走向分析、专题研究报告的水平，以及推荐投资工具的有效性等；（三）服务水平。主要指是否与基金管理人有较强的长期合作意愿并积极提供个性化服务；（四）交易成本。主要指费用是否总体可控，交易佣金相较于交易执行水平以及投研支持服务而言是否合理、优惠。符合上述条件的境外券商是 QDII 业务团队考虑长期合作的对象，可成为备选券商，经 QDII 投资决策委员会审核批准，由交易部相关人员与其开设证券账户；

3、本基金本报告年度无新增交易单元。

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 | | 基金交易 | |
|---|------|--------------|------|--------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| Guosen Securities HK Financial Holding CO LTD | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CICC | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|-----------------------------|---|---|---|---|---|---|--------------|--------|
| HK | | | | | | | | |
| Morgan Stanley | - | - | - | - | - | - | 2,618,583.78 | 23.24% |
| Goldman Sachs And Co. LLC. | - | - | - | - | - | - | 4,993,712.38 | 44.32% |
| Credit Suisse Hong Kong Ltd | - | - | - | - | - | - | 3,654,552.11 | 32.44% |

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 | 2023-01-05 |
| 2 | 中银全球策略证券投资基金（FOF）2022 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-01-20 |
| 3 | 中银基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-02-28 |
| 4 | 中银基金管理有限公司关于新增中国银河证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-02-28 |
| 5 | 中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加杭州银行股份有限公司杭 E 家同业平台为销售机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-03 |
| 6 | 中银基金管理有限公司关于新增兴业证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-08 |
| 7 | 中银基金管理有限公司关于新增泛华普益基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-20 |
| 8 | 中银基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-21 |
| 9 | 中银全球策略证券投资基金（FOF）2022 年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-30 |
| 10 | 中银全球策略证券投资基金（FOF）2023 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-21 |

| | | | |
|----|---------------------------------------|-----------|------------|
| 11 | 中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-28 |
| 12 | 关于中银全球策略证券投资基金（FOF）恢复大额申购及定期定额投资业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-29 |

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中银全球策略证券投资基金（FOF）募集的文件；
- 2、《中银全球策略证券投资基金（FOF）基金合同》；
- 3、《中银全球策略证券投资基金（FOF）托管协议》；
- 4、《中银全球策略证券投资基金（FOF）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。

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人互联网站。

11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

中银基金管理有限公司
二〇二三年八月三十日