中银中证 A100 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 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
1.2 目录 3
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 6
4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12
5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 16
7 投资组合报告 39
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 40
7.3 期末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 41
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 41
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 43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46
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 46
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 47
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 47
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 47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 47

7.12 投资组合报告附注 47
8 基金份额持有人信息 48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48
8.2 盈利投资者数量占比 48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 49
8.4 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 49
9 开放式基金份额变动 49
10 重大事件揭示 49
10.1 基金份额持有人大会决议 49
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 49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 49
10.4 基金投资策略的改变 50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 50
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 50
10.8 其他重大事件 52
11 备查文件目录 52
11.1 备查文件目录 52
11.2 存放地点 53
11.3 查阅方式 53

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银中证 A100 指数增强型证券投资基金
基金简称	中银中证 A100 指数增强
场内简称	中证 A100 指数增强
基金主代码	163808
交易代码	163808
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 4 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	160,348,925.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在被动跟踪标的指数的基础上，加入增强型的积极手段，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现对中证 A100 指数的有效跟踪并力争实现超越，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数化投资作为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在严控偏离风险及力争适度超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离业绩比较基准的风险，本基金力求控制基金份额净值增长率与业绩比较基准间的日跟踪误差不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
业绩比较基准	中证 A100 指数收益率×90%+银行同业存款利率×10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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	陈卫星	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		刘信群	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.bocim.com
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 26 层

2.5 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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	21,944,352.95
本期利润	38,161,713.60
加权平均基金份额本期利润	0.2185
本期加权平均净值利润率	9.54%
本期基金份额净值增长率	9.89%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	229,056,475.46
期末可供分配基金份额利润	1.4285
期末基金资产净值	389,405,401.23
期末基金份额净值	2.4285
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	145.28%

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）。

3.2 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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①－③	②－④

		②		准差④		
过去三个月	13.27%	1.28%	11.15%	1.23%	2.12%	0.05%
过去六个月	9.89%	1.15%	7.69%	1.10%	2.20%	0.05%
过去一年	33.36%	1.04%	27.26%	1.00%	6.10%	0.04%
过去三年	43.78%	1.07%	29.03%	1.04%	14.75%	0.03%
过去五年	9.94%	1.08%	-5.02%	1.05%	14.96%	0.03%
过去七年	67.83%	1.11%	18.18%	1.07%	49.65%	0.04%
过去十年	161.97%	1.09%	59.61%	1.06%	102.36%	0.03%
自基金合同生效日起	145.28%	1.27%	59.58%	1.23%	85.70%	0.04%

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

中银中证 A100 指数增强型证券投资基金

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

（2009 年 9 月 4 日至 2026 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 2026 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 188 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	2015-06-08	-	20	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，2025 年 9 月至今任中银中证全指自由现金流 ETF 联接基金基金经理，2025 年 10 月至今任中银中证机器人基金基金经理，2026 年 5 月至今任中银中证工业有色 ETF 基金基金经理。具备基金、期货从业资格。
王嘉琦	基金经理助理	2025-09-15	-	8	金融硕士。2019 年加入中银基金管理有限公司，曾任研究员。2026 年 3 月至今任中银上证科创板 50ETF 基金、中银沪深 300 指数基金、中银中证港股通高股息基金基金经理。2025 年 9 月至今任国企 ETF 基金、中银黄金基金、中银现金基金、中银上证科创板 50ETF 联接基金、中银上海金 ETF 联接基金、中银中证 A100 基金基金经理助理。2025 年 9 月至 2026 年 3 月任中银上证科创板 50ETF 基金、中银沪深 300 指数基金、中银中证港股通高股息基金基金经理助理。具备基金从业资格。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

全球宏观方面，上半年全球经济运行从年初的温和修复预期快速转向地缘冲击主导下的波动格局。AI 相关投资扩张继续支撑全球总需求，但中东局势升级及霍尔木兹海峡阶段性受阻显著推升能源价格并扰动全球供应链，全球通胀中枢重新抬升，主要经济体货币政策路径也由原先的继续宽松预期转向分化调整。美国经济延续韧性，通胀因油价飙升，但 CPI 同比或已在 5 月达到年内高点，美联储继续按兵不动保持观望。欧元区受能源依赖、内需疲弱及区域分化影响，经济增长进一步承压，欧央行于 6 月加息 25bps，结束此前宽松周期。日本经济保持温和增长，“工资-物价”循环继续改善，日央行 6 月加息 25bps 至 1.0%。

国内宏观方面，上半年面对外部地缘冲击和不确定性加大的形势，国内坚持以我为主，围绕十五五纲要和两会部署，在正确政绩观引导下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，货币政策维持适度宽松。上半年经济增速位于全年目标区间内。结构方面，出口增速明显抬升，对经济形成重要拉动，而消费和投资增速在一季度靠前发力后有所放缓。经济动能方面，AI 等新兴产业对出口、投资和价格的贡献进一步抬升。价格方面，通胀呈上升趋势，名义 GDP 增速改善。整体上，中国经济展现出较强活力与韧性，科技创新与产业升级仍是重要主线。

2、行情回顾

2026 年上半年，中证 A100 指数整体呈现"先抑后扬、震荡上行"的运行格局，收获正收益。年初市场情绪偏暖、指数上行，随后受海外风险扰动进入震荡整理，一度在一季度末探明阶段性低点。此后随着地缘局势与油价—通胀—美联储政策的传导链条逐步缓和，市场情绪修复、指数企稳回升，二季度成为主要上涨阶段并创出上半年高点，5、6 月延续温和上行态势。作为大盘核心资产的代表，中证 A100 指数整体表现稳健。上半年市场呈现明显的"K 型分化"特征，超额收益集中于科技与硬制造赛道，传统经济板块相对承压，全面普涨基础不足，指数更多依靠结构性力量推动上行。

3. 运行分析

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，被动投资为主，主动投资为辅，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术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，本基金份额净值增长率为 9.89%，同期业绩比较基准收益率为 7.69%。

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，A 股整体有望延续震荡上行趋势，对大盘核心资产持中性偏积极态度。中证 A100 指数估值仍相对合理、市场生态由"融资市"向"投资市"转变、居民与险资等增量资金持续入市，以及 AI 产业维持高景气。但需关注海外流动性与美联储政策框架变化带来的不确定性，下半年估值扩张空间有限，行情驱动更多依赖盈利改善。结构上"K 型分化"料将延续，资金聚焦 AI 硬件、先进制造、上游周期与红利资产，对以大盘蓝筹为主的中证 A100 而言，成分中的科技龙头、周期资源及高股息板块有望形成支撑。

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，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，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，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

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 30%。

本报告期期末可供分配利润为 229,056,475.46 元。本基金本报告期未进行利润分配。

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，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遵规守信、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：中银中证 A100 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资　产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,937,429.49	5,985,193.21
结算备付金		34,474.65	-
存出保证金		25,182.34	14,871.09
交易性金融资产	6.4.7.2	387,126,215.61	424,246,434.40
其中：股票投资		366,815,243.03	400,665,180.32
基金投资		-	-
债券投资		20,310,972.58	23,581,254.08
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		88,900.37	116,584.24
应收股利		-	-
应收申购款		156,611.58	115,831.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		390,368,814.04	430,478,914.76
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 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		472,325.42	1,002,547.57
应付管理人报酬		315,276.60	368,163.20
应付托管费		47,291.49	55,224.50
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		720.05	298.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	127,799.25	174,106.58
负债合计		963,412.81	1,600,340.10
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	160,348,925.77	194,066,607.22
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	229,056,475.46	234,811,967.44
净资产合计		389,405,401.23	428,878,574.66
负债和净资产总计		390,368,814.04	430,478,914.76

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.4285 元，基金份额总额 160,348,925.77 份。

6.2 利润表

会计主体：中银中证 A100 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		40,518,720.37	9,597,774.98
1.利息收入		11,411.25	11,080.21
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,411.25	11,080.21
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,226,301.48	3,130,959.22
其中：股票投资收益	6.4.7.10	20,445,332.61	-2,259,812.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	145,692.34	130,825.10
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	3,635,276.53	5,259,946.39
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	16,217,360.65	6,401,747.92
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	63,646.99	53,987.63
减：二、营业总支出		2,357,006.77	2,607,773.50
1．管理人报酬	6.4.10.2	1,984,452.50	2,187,030.00
2．托管费	6.4.10.2	297,667.85	328,054.50
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		297.66	0.02

8．其他费用	6.4.7.17	74,588.76	92,688.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**38,161,713.60**	**6,990,001.48**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**38,161,713.60**	**6,990,001.48**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		38,161,713.60	6,990,001.48

6.3 净资产变动表

会计主体：中银中证 A100 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目		本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	194,066,607.22	-	234,811,967.44	428,878,574.66
二、本期期初净资产	194,066,607.22	-	234,811,967.44	428,878,574.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,717,681.45	-	-5,755,491.98	-39,473,173.43
（一）、综合收益总额	-	-	38,161,713.60	38,161,713.60
（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）	-33,717,681.45	-	-43,917,205.58	-77,634,887.03
其中：1.基金申购款	13,055,438.47	-	17,004,997.31	30,060,435.78
2.基金赎回款	-46,773,119.92	-	-60,922,202.89	-107,695,322.81
（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	160,348,925.77	-	229,056,475.46	389,405,401.23

项目		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 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	255,563,544.33	-	202,261,979.51	457,825,523.84
二、本期期初净资产	255,563,544.33	-	202,261,979.51	457,825,523.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,773,827.84	-	-6,287,905.17	-23,061,733.01
（一）、综合收益总额	-	-	6,990,001.48	6,990,001.48
（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）	-16,773,827.84	-	-13,277,906.65	-30,051,734.49
其中：1.基金申购款	18,287,614.81	-	14,319,521.61	32,607,136.42
2.基金赎回款	-35,061,442.65	-	-27,597,428.26	-62,658,870.91
（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	238,789,716.49	-	195,974,074.34	434,763,790.83

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：陈卫星，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

中银中证 100 指数增强型证券投资基金（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[2009]651 号文《关于核准中银中证 100 指数增强型证券投资基金募集的批复》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 2009 年 9 月 4 日正式生效，首次设立募集规模为 3,557,745,752.38 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及本基金基金合同的有关规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，本基金自 2024 年 10 月 28 日起，将中银中证 100 指数增强型证券投资基金的基金名称变更为中银中证 A100 指数增强型证券投资基金，并修改相关法律文件，更新标的指数名称和业绩比较基准指数名称。

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 2026 年 8 月 28 日批准。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部 (以下简称“财政部”) 颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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

本期财务报表的实际编制期间系自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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) 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 30%；

(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；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（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

(7) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即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 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

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税 [2015] 101 号《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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，

免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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，股票的股息、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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 2026 年 6 月 30 日

活期存款	2,937,429.49
等于：本金	2,937,166.51
加：应计利息	262.98
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	2,937,429.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		281,098,826.54	-	366,815,243.03	85,716,416.49
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	20,112,683.00	197,142.58	20,310,972.58	1,147.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	20,112,683.00	197,142.58	20,310,972.58	1,147.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		301,211,509.54	197,142.58	387,126,215.61	85,717,563.49

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	494.46
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	17,921.03
其中：交易所市场	17,921.03
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	59,507.37
应付审计费	49,876.39
合计	127,799.25

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	194,066,607.22	194,066,607.22
本期申购	13,055,438.47	13,055,438.47
本期赎回（以“-”号填列）	-46,773,119.92	-46,773,119.92
本期末	160,348,925.77	160,348,925.77

注：申购含红利再投、转换转入份额，赎回含转换转出份额。

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	254,300,158.03	-19,488,190.59	234,811,967.44
本期期初	254,300,158.03	-19,488,190.59	234,811,967.44
本期利润	21,944,352.95	16,217,360.65	38,161,713.60
本期基金份额交易产生的变动数	-45,927,589.22	2,010,383.64	-43,917,205.58
其中：基金申购款	17,898,747.06	-893,749.75	17,004,997.31

基金赎回款	-63,826,336.28	2,904,133.39	-60,922,202.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	230,316,921.76	-1,260,446.30	229,056,475.46

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,269.70
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	81.37
其他	60.18
合计	11,411.25

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	107,279,179.82
减：卖出股票成本总额	86,744,708.75
减：交易费用	89,138.46
买卖股票差价收入	20,445,332.61

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	142,431.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,261.00
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	145,692.34

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	16,714,282.40

交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,498,014.00
减：应计利息总额	213,007.40
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	3,261.00

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,635,276.53
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	3,635,276.53

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	16,217,360.65
——股票投资	16,229,353.65
——债券投资	-11,993.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——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	16,217,360.65

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日

基金赎回费收入	61,954.63
基金转换费收入	1,692.36
合计	63,646.99

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	205.00
合计	74,588.76

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、关联关系

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

本基金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	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

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,984,452.50	2,187,030.00

其中：支付销售机构的客户维护费	815,153.84	859,321.31
应支付基金管理人的净管理费	1,169,298.66	1,327,708.69

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 1.00%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.00%÷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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	297,667.85	328,054.50

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 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.15%÷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未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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	2,937,429.49	11,269.70	9,030,497.41	10,911.74

注：本基金的活期银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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
688795	摩尔线程	2025-11-26	6 个月以上	新股锁定期内	114.28	676.94	1,526	174,391.28	1,033,010.44	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	6 个月以上	新股锁定期内	104.66	768.89	1,165	121,928.90	895,756.85	-
301666	大普微	2026-04-08	1-6 个月（含）	新股锁定期内	46.08	463.33	566	26,081.28	262,244.78	-
001248	华润新能	2026-06-24	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	16,708	168,917.88	168,917.88	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	6 个月以上	新股锁定期内	83.06	126.45	1,247	103,575.82	157,683.15	-

688808	联讯仪器	2026-04-16	1-6 个月（含）	新股锁定期内	81.88	1,584.33	96	7,860.48	152,095.68	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6 个月以上	新股锁定期内	22.68	42.16	3,553	80,582.04	149,794.48	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	1-6 个月（含）	新股锁定期内	9.47	70.14	1,156	10,947.32	81,081.84	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	1-6 个月（含）	新股锁定期内	19.68	141.49	543	10,686.24	76,829.07	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	1-6 个月（含）	新股锁定期内	44.56	468.67	144	6,416.64	67,488.48	-
301682	宏明电子	2026-03-18	1-6 个月（含）	新股锁定期内	69.66	160.06	360	25,077.60	57,621.60	-
688712	北芯生命	2026-01-28	1-6 个月（含）	新股锁定期内	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
001399	惠科股份	2026-06-16	1-6 个月（含）	新股锁定期内	10.12	27.73	1,927	19,501.24	53,435.71	-
688785	恒运昌	2026-01-20	1-6 个月（含）	新股锁定期内	92.18	463.15	103	9,494.54	47,704.45	-
688635	长进光子	2026-05-20	1-6 个月（含）	新股锁定期内	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	1-6 个月（含）	新股锁定期内	7.82	20.74	1,568	12,261.76	32,520.32	-
603459	红板科技	2026-03-31	1-6 个月（含）	新股锁定期内	17.70	84.32	254	4,495.80	21,417.28	-
688811	有研复材	2026-04-01	1-6 个月（含）	新股锁定期内	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	1-6 个月（含）	新股锁定期内	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
301669	高特电子	2026-06-02	1-6 个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-

			（含）	期内						
301687	新广益	2025-12-24	1-6 个月（含）	新股锁定期内	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301531	春光集团	2026-04-28	1-6 个月（含）	新股锁定期内	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	1-6 个月（含）	新股锁定期内	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026-02-27	1-6 个月（含）	新股锁定期内	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
001365	天海电子	2026-05-11	1-6 个月（含）	新股锁定期内	27.19	31.31	392	10,658.48	12,273.52	-
001393	维通利	2026-05-08	1-6 个月（含）	新股锁定期内	30.38	38.99	284	8,627.92	11,073.16	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	1-6 个月（含）	新股锁定期内	78.38	121.77	88	6,897.44	10,715.76	-
603407	长裕集团	2026-04-29	1-6 个月（含）	新股锁定期内	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
688816	易思维	2026-02-04	1-6 个月（含）	新股锁定期内	55.95	57.10	172	9,623.40	9,821.20	-
001237	惠康科技	2026-05-15	1-6 个月（含）	新股锁定期内	53.26	58.74	163	8,681.38	9,574.62	-
301513	尚水智能	2026-04-10	1-6 个月（含）	新股锁定期内	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
601112	振石股份	2026-01-21	1-6 个月（含）	新股锁定期内	11.18	17.59	397	4,438.46	6,983.23	-
603435	嘉德利	2026-05-15	1-6 个月（含）	新股锁定期内	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	1-6 个月（含）	新股锁定期内	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
60329	埃泰	2026-0	1-6 个	新股	33.49	33.93	69	2,310.	2,341.	-

3	克	4-09	月（含）	锁定期内				81	17	
001312	福恩股份	2026-04-14	1-6 个月（含）	新股锁定期内	18.38	16.78	133	2,444.54	2,231.74	-
603284	林平发展	2026-02-03	1-6 个月（含）	新股锁定期内	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	1-6 个月（含）	新股锁定期内	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

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 2026 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 2026 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。

6.4.12.4 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 2026 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	2,937,429.49	-	-	-	2,937,429.49
结算备付金	34,474.65	-	-	-	34,474.65
存出保证金	25,182.34	-	-	-	25,182.34
交易性金融资产	20,310,972.58	-	-	366,815,243.03	387,126,215.61
应收清算款	-	-	-	88,900.37	88,900.37
应收申购款	3,243.00	-	-	153,368.58	156,611.58
资产总计	23,311,302.06	-	-	367,057,511.98	390,368,814.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	472,325.42	472,325.42
应付管理人报酬	-	-	-	315,276.60	315,276.60
应付托管费	-	-	-	47,291.49	47,291.49
应交税费	-	-	-	720.05	720.05
其他负债	-	-	-	127,799.25	127,799.25
负债总计	-	-	-	963,412.81	963,412.81
利率敏感度缺口	23,311,302.06	-	-	366,094,099.17	389,405,401.23
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	5,985,193.21	-	-	-	5,985,193.21
存出保证金	14,871.09	-	-	-	14,871.09
交易性金融资产	23,581,254.08	-	-	400,665,180.32	424,246,434.40
应收清算款	-	-	-	116,584.24	116,584.24
应收申购款	912.86	-	-	114,918.96	115,831.82
资产总计	29,582,231.24	-	-	400,896,683.52	430,478,914.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,002,547.57	1,002,547.57
应付管理人报酬	-	-	-	368,163.20	368,163.20
应付托管费	-	-	-	55,224.50	55,224.50
应交税费	-	-	-	298.25	298.25
其他负债	-	-	-	174,106.58	174,106.58
负债总计	-	-	-	1,600,340.10	1,600,340.10
利率敏感度缺口	29,582,231.24	-	-	399,296,343.42	428,878,574.66

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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	366,815,243.03	94.20	400,665,180.32	93.42
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	366,815,243.03	94.20	400,665,180.32	93.42

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 2,036	增加约 2,259
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 2,036	减少约 2,259

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	363,259,616.89	395,476,591.74
第二层次	20,479,890.46	26,772,078.08
第三层次	3,386,708.26	1,997,764.58
合计	387,126,215.61	424,246,434.40

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	366,815,243.03	93.97
	其中：股票	366,815,243.03	93.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,310,972.58	5.20
	其中：债券	20,310,972.58	5.20
	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	2,971,904.14	0.76
8	其他各项资产	270,694.29	0.07
9	合计	390,368,814.04	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	2,055,522.54	0.53
B	采矿业	20,493,131.72	5.26
C	制造业	258,992,808.43	66.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,462,818.27	2.17
E	建筑业	3,703,402.62	0.95
F	批发和零售业	528,656.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	7,464,910.00	1.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,938,451.85	4.86
J	金融业	30,801,128.76	7.91
K	房地产业	2,397,625.57	0.62
L	租赁和商务服务业	1,138,652.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	6,589,816.26	1.69
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	826,437.78	0.21
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	362,393,361.80	93.06

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	136,772.42	0.04
C	制造业	4,114,607.47	1.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	168,917.88	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
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	4,421,881.23	1.14

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所有股票投资明细

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	300308	中际旭创	24,140	30,657,800.00	7.87
2	300750	宁德时代	55,820	21,937,818.20	5.63
3	300502	新易盛	30,700	18,634,900.00	4.79
4	600519	贵州茅台	13,401	15,886,751.49	4.08
5	603986	兆易创新	14,100	11,491,500.00	2.95
6	601318	中国平安	228,124	10,890,639.76	2.80
7	688256	寒武纪	6,801	10,851,335.55	2.79
8	600036	招商银行	265,703	9,432,456.50	2.42
9	601899	紫金矿业	353,216	8,879,850.24	2.28
10	002371	北方华创	9,175	8,115,838.00	2.08
11	000333	美的集团	104,641	7,903,534.73	2.03
12	002475	立讯精密	111,195	7,828,128.00	2.01
13	688008	澜起科技	24,400	7,561,560.00	1.94
14	688012	中微公司	15,845	7,423,382.50	1.91
15	688041	海光信息	19,900	7,368,970.00	1.89
16	600900	长江电力	259,741	6,875,344.27	1.77
17	688981	中芯国际	42,600	6,765,732.00	1.74
18	603259	药明康德	52,926	6,589,816.26	1.69
19	000725	京东方 A	758,100	6,580,308.00	1.69
20	300059	东方财富	271,800	5,539,284.00	1.42

21	600276	恒瑞医药	95,193	4,953,843.72	1.27
22	601398	工商银行	698,550	4,938,748.50	1.27
23	002594	比亚迪	58,331	4,648,980.70	1.19
24	300476	胜宏科技	13,300	4,607,519.00	1.18
25	002463	沪电股份	29,500	4,507,600.00	1.16
26	300274	阳光电源	28,260	4,493,905.20	1.15
27	000651	格力电器	95,510	3,581,625.00	0.92
28	603019	中科曙光	31,600	3,388,468.00	0.87
29	600150	中国船舶	97,090	3,280,671.10	0.84
30	603993	洛阳钼业	182,700	3,206,385.00	0.82
31	000338	潍柴动力	111,800	3,046,550.00	0.78
32	601816	京沪高铁	633,900	2,871,567.00	0.74
33	300124	汇川技术	41,300	2,739,429.00	0.70
34	002415	海康威视	78,850	2,696,670.00	0.69
35	600309	万华化学	38,600	2,640,626.00	0.68
36	000100	TCL 科技	446,340	2,597,698.80	0.67
37	600111	北方稀土	53,100	2,551,455.00	0.66
38	000063	中兴通讯	68,938	2,494,866.22	0.64
39	600089	特变电工	107,980	2,429,550.00	0.62
40	601857	中国石油	274,832	2,385,541.76	0.61
41	601088	中国神华	59,143	2,308,942.72	0.59
42	002028	思源电气	12,900	2,231,700.00	0.57
43	600031	三一重工	126,600	2,187,648.00	0.56
44	002714	牧原股份	58,746	2,055,522.54	0.53
45	300014	亿纬锂能	31,500	2,048,445.00	0.53
46	000792	盐湖股份	66,000	1,992,540.00	0.51
47	600406	国电南瑞	86,078	1,966,882.30	0.51
48	601668	中国建筑	444,293	1,928,231.62	0.50
49	601919	中远海控	134,600	1,784,796.00	0.46
50	601728	中国电信	335,000	1,738,650.00	0.45
51	300760	迈瑞医疗	12,800	1,738,624.00	0.45
52	600660	福耀玻璃	34,400	1,735,136.00	0.45
53	603501	豪威集团	18,120	1,718,682.00	0.44
54	601012	隆基绿能	130,772	1,715,728.64	0.44
55	601225	陕西煤业	83,500	1,699,225.00	0.44
56	600941	中国移动	19,500	1,679,535.00	0.43
57	002230	科大讯飞	40,600	1,658,104.00	0.43
58	600690	海尔智家	79,668	1,626,023.88	0.42
59	002352	顺丰控股	51,900	1,622,394.00	0.42
60	601985	中国核电	175,800	1,587,474.00	0.41
61	002460	赣锋锂业	23,900	1,563,060.00	0.40
62	603799	华友钴业	32,370	1,562,176.20	0.40
63	600160	巨化股份	28,100	1,489,581.00	0.38
64	000425	徐工机械	175,300	1,418,177.00	0.36

65	601600	中国铝业	167,700	1,378,494.00	0.35
66	601766	中国中车	260,226	1,353,175.20	0.35
67	002466	天齐锂业	21,800	1,336,776.00	0.34
68	601100	恒立液压	11,500	1,236,940.00	0.32
69	002179	中航光电	26,700	1,233,540.00	0.32
70	601006	大秦铁路	257,300	1,186,153.00	0.30
71	601888	中国中免	21,200	1,138,652.00	0.29
72	600489	中金黄金	61,900	1,117,295.00	0.29
73	002625	光启技术	36,800	1,115,776.00	0.29
74	600010	包钢股份	480,000	1,070,400.00	0.27
75	688271	联影医疗	10,500	1,062,915.00	0.27
76	601127	赛力斯	17,300	1,059,625.00	0.27
77	600893	航发动力	27,400	1,050,516.00	0.27
78	688111	金山办公	4,900	1,043,945.00	0.27
79	600760	中航沈飞	24,400	1,002,840.00	0.26
80	600019	宝钢股份	184,165	1,000,015.95	0.26
81	000807	云铝股份	44,000	974,160.00	0.25
82	600989	宝丰能源	47,400	963,642.00	0.25
83	601727	上海电气	134,500	941,500.00	0.24
84	002001	新和成	32,600	926,492.00	0.24
85	002422	科伦药业	23,900	920,628.00	0.24
86	601390	中国中铁	217,300	906,141.00	0.23
87	000538	云南白药	19,000	900,030.00	0.23
88	600547	山东黄金	38,800	895,892.00	0.23
89	600585	海螺水泥	51,442	871,941.90	0.22
90	601669	中国电建	184,900	869,030.00	0.22
91	300015	爱尔眼科	100,053	826,437.78	0.21
92	600895	张江高科	20,200	752,450.00	0.19
93	600426	华鲁恒升	31,300	748,696.00	0.19
94	600048	保利发展	154,795	716,700.85	0.18
95	600438	通威股份	57,400	695,114.00	0.18
96	600436	片仔癀	6,300	688,464.00	0.18
97	600196	复星医药	27,500	617,925.00	0.16
98	000963	华东医药	18,800	528,656.00	0.14
99	001979	招商蛇口	77,000	495,110.00	0.13
100	000002	万科 A	146,407	433,364.72	0.11

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	占基金资产净值比例(%)
1	688795	摩尔线程	1,526	1,033,010.44	0.27
2	688802	沐曦股份	1,165	895,756.85	0.23
3	688783	西安奕材	6,669	412,944.48	0.11

4	301666	大普微	566	262,244.78	0.07
5	001248	华润新能源	16,708	168,917.88	0.04
6	001399	惠科股份	4,816	163,737.73	0.04
7	688790	昂瑞微	1,247	157,683.15	0.04
8	688808	联讯仪器	96	152,095.68	0.04
9	688781	视涯科技	3,553	149,794.48	0.04
10	001280	中国铀业	1,563	104,252.10	0.03
11	688765	禾元生物	1,680	85,680.00	0.02
12	688818	电科蓝天	1,156	81,081.84	0.02
13	688820	盛合晶微	543	76,829.07	0.02
14	688759	必贝特	2,227	71,219.46	0.02
15	688797	臻宝科技	144	67,488.48	0.02
16	301682	宏明电子	360	57,621.60	0.01
17	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
18	688726	拉普拉斯	979	51,740.15	0.01
19	688785	恒运昌	103	47,704.45	0.01
20	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
21	001257	盛龙股份	1,568	32,520.32	0.01
22	301678	新恒汇	382	30,116.88	0.01
23	603459	红板科技	254	21,417.28	0.01
24	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
25	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
26	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
27	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
28	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
29	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
30	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
31	001365	天海电子	392	12,273.52	0.00
32	001393	维通利	284	11,073.16	0.00
33	301683	慧谷新材	88	10,715.76	0.00
34	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
35	688816	易思维	172	9,821.20	0.00
36	001237	惠康科技	163	9,574.62	0.00
37	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
38	601112	振石股份	397	6,983.23	0.00
39	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
40	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
41	603293	埃泰克	69	2,341.17	0.00
42	001312	福恩股份	133	2,231.74	0.00
43	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
44	001220	世盟股份	57	1,583.46	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初基金资产净值 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**期初**基金资产净值比例（%）
1	300502	新易盛	16,300,969.00	3.80
2	601225	陕西煤业	2,251,677.00	0.53
3	002422	科伦药业	1,907,493.00	0.44
4	600660	福耀玻璃	1,806,282.00	0.42
5	601100	恒立液压	1,412,497.00	0.33
6	000807	云铝股份	1,202,125.00	0.28
7	601727	上海电气	950,886.00	0.22
8	688041	海光信息	828,855.49	0.19
9	603986	兆易创新	756,866.00	0.18
10	600895	张江高科	656,233.00	0.15
11	600196	复星医药	599,853.00	0.14
12	000963	华东医药	543,830.00	0.13
13	688008	澜起科技	542,644.27	0.13
14	002475	立讯精密	493,892.00	0.12
15	688012	中微公司	490,300.00	0.11
16	002371	北方华创	403,339.00	0.09
17	603730	岱美股份	399,259.00	0.09
18	603019	中科曙光	259,084.00	0.06
19	688981	中芯国际	254,830.00	0.06
20	603993	洛阳钼业	227,544.00	0.05

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初基金资产净值 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**期初**基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	5,780,058.00	1.35
2	600519	贵州茅台	4,651,396.00	1.08
3	300308	中际旭创	4,158,826.00	0.97
4	601318	中国平安	3,531,724.00	0.82
5	601899	紫金矿业	3,156,356.00	0.74
6	600036	招商银行	2,608,237.70	0.61
7	688041	海光信息	2,165,253.36	0.50
8	000333	美的集团	2,162,070.80	0.50
9	002422	科伦药业	2,122,869.00	0.49
10	603986	兆易创新	1,987,379.00	0.46
11	600028	中国石化	1,977,930.34	0.46
12	002475	立讯精密	1,928,132.00	0.45

13	600050	中国联通	1,903,667.60	0.44
14	300274	阳光电源	1,724,448.00	0.40
15	002371	北方华创	1,684,750.00	0.39
16	688256	寒武纪	1,612,606.20	0.38
17	688981	中芯国际	1,590,456.40	0.37
18	002241	歌尔股份	1,566,543.00	0.37
19	002027	分众传媒	1,518,513.80	0.35
20	688008	澜起科技	1,503,129.68	0.35

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	36,665,417.81
卖出股票的收入（成交）总额	107,279,179.82

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	20,310,972.58	5.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,310,972.58	5.22

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019792	25 国债 19	192,000	19,401,452.71	4.98
2	019785	25 国债 13	6,000	607,575.29	0.16
3	019827	26 国债 01	3,000	301,944.58	0.08

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

本基金投资范围未包括股指期货，无相关投资政策。

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

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

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。

7.12.2 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。

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	25,182.34
2	应收清算款	88,900.37
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	156,611.58
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	270,694.29

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	1,033,010.44	0.27	新股锁定期内
2	688802	沐曦股份	895,756.85	0.23	新股锁定期内
3	301666	大普微	262,244.78	0.07	新股锁定期内
4	001248	华润新能源	168,917.88	0.04	新股未上市

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

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
38,403	4,175.43	4,251,675.42	2.6515%	156,097,250.35	97.3485%

8.2 盈利投资者数量占比

本基金不适用相关披露要求。

8.3 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	271,467.37	0.1693%

8.4 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	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 9 月 4 日）基金份额总额	3,557,745,752.38
本报告期期初基金份额总额	194,066,607.22
本报告期基金总申购份额	13,055,438.47
减：本报告期基金总赎回份额	46,773,119.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	160,348,925.77

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，邢科先生不再担任公司联席投资总监（固定收益），详情请参见基金管理人 2026 年 1 月 15 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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人没有受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员没有受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，未发生托管人受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，未发生托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	95,091,018.74	66.97%	17,677.06	66.97%	-
申万宏源证券	1	46,894,298.84	33.03%	8,717.15	33.03%	-

注：1、研究部根据相关标准，遴选符合条件的证券公司，详细说明评价依据及入库理由后提出建议，报公司投资决策委员会审议同意，形成公司合作券商库；选择合作券商的标准如下：（1）能全面贯彻落实中央金融工作会议精神和国务院发布的《关于加强监管防范风险推动资本市场高质量发展的若干意见》（国发<2024>10 号），坚守资本市场工作的政治性和人民性，在服务国家重大战略和推动经济社会高质量发展中实现资本市场稳定健康发展；（2）严格遵守国家法律法规和监管规定，建立完善的内控管理体系和有效的风险隔离制度，合法合规经营；（3）公司财务状况良好；（4）

上市证券公司优先；（5）最近一年未受到暂停开展证券投资咨询业务的监管处罚；（6）应有专门的对买方机构提供研究服务的研究部门，研究领域全面，研究实力行业排名前列，研究工作流程规范，研究服务意识强，有专门的交易单元；（7）证券交易服务能力强，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务。

2、合作券商库形成后，应保持动态维护：（1）定期调整。每年应至少重检一次，研究部负责全面重新评估本年度合作券商库，根据以上标准进行评估，并报公司投资决策委员会审议同意。（2）不定期调整。年内如库中证券公司发生不宜合作的重大事件（如重大合规风险事件或重大经营变化、重大人员调整），研究部应及时报公司投资决策委员会审议同意后将该券商剔除出库；年内确有必要在库中调整合作券商的，研究部亦需详细说明理由，报公司投资决策委员会审议同意后方可入库。

3、证券交易单元的租用及变更：所有新租用的交易单元必须从合作券商库中选择；当需要租用新交易单元时，交易部负责发起申请，经相关部门及领导审批同意方可执行，需详细说明新增交易单元的理由，申请通过后，由交易部牵头与证券公司签署《交易单元租用协议》，首次签约的证券公司还须同时签订《研究服务协议》。研究部等投研相关部门可根据证券公司对公司投资研究的服务情况和合作意向，发起交易单元增加、更换或终止的申请；交易部可根据每季度证券公司交易单元实际交易量，发起交易单元的增加、更换或终止的申请；经相关部门及领导审批同意后，由交易部牵头办理交易单元增加、更换或终止的相关手续，并及时通知基金运营部。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.7.2 基金租用或者通过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
长江证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	14,718,392.00	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	2026-01-15
2	中银中证 A100 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
3	中银基金管理有限公司关于旗下产品信息服务方式的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-18
4	中银中证 A100 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
5	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（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-31
6	中银中证 A100 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
7	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026-04-29
8	中银基金管理有限公司关于开展电子直销平台费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-06
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	2026-05-06
10	中银中证 A100 指数增强型证券投资基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026-05-20
11	中银中证 A100 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2026-05-20
12	中银中证 A100 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2026-05-20
13	中银中证 A100 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2026 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2026-05-20
14	关于中银基金管理有限公司旗下部分基金调整基金份额净值估值精度并修订基金合同及托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-20
15	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	2026-06-19
16	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	2026-06-24

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中证 100 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；

2、《中银中证 100 指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《中银中证 100 指数增强型证券投资基金托管协议》；

4、《中银中证 100 指数增强型证券投资基金招募说明书》；

5、法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照；

8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

9、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地，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

二〇二六年八月三十一日