# 中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

# 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：招商银行股份有限公司**

**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。

基金托管人招商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 ..... 8
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 ..... 9
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 ..... 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 ..... 13
**5 托管人报告** ..... 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 13
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 ..... 13
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 ..... 13
**6 半年度财务会计报告（未经审计）** ..... 13
6.1 资产负债表 ..... 13
6.2 利润表 ..... 15
6.3 净资产变动表 ..... 16
6.4 报表附注 ..... 17
**7 投资组合报告** ..... 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 ..... 40
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 ..... 45
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 ..... 46
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 ..... 46
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 ..... 46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 46
7.12 投资组合报告附注 ..... 46
**8 基金份额持有人信息** ..... 47

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 47
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 ..... 48
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 ..... 48
**9 开放式基金份额变动** ..... 48
**10 重大事件揭示** ..... 48
10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 48
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 ..... 48
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 ..... 49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 49
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 ..... 49
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 ..... 53
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 | 中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 中银蓝筹混合 |
| 场内简称 | 中银蓝筹精选 |
| 基金主代码 | 163809 |
| 交易代码 | 163809 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010 年 2 月 11 日 |
| 基金管理人 | 中银基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 64,795,581.62 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在优化资产配置的基础上，精选价值相对低估的优质蓝筹上市公司股票，力求获得基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将科学、规范的选股方法与积极、灵活的资产配置相结合，通过精选业绩优良、经营稳定、具备增长潜力、具有行业领先优势的蓝筹上市公司股票，并结合基于“自上而下”的宏观经济研究和宏观经济政策导向分析而确定的积极灵活的类别资产配置策略，以谋求基金资产的长期稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60% + 上证国债指数收益率×40% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 |

## 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 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 陈卫星 | 张姗 |
| | 联系电话 | 021-38848999 | 400-61-95555 |
| | 电子邮箱 | clientservice@bocim.com | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 021-38834788 400-888-5566 | 400-61-95555 |
| 传真 | | 021-68873488 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 上海市银城中路200号中银大厦45层 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 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 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | | 200120 | 518040 |
| 法定代表人 | | 刘信群 | 缪建民 |

### 2.4 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 | 14,253,000.97 |
| 本期利润 | 12,155,255.88 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1765 |
| 本期加权平均净值利润率 | 8.21% |
| 本期基金份额净值增长率 | 8.59% |
| **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 | 80,430,242.49 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.2413 |
| 期末基金资产净值 | 145,225,824.11 |
| 期末基金份额净值 | 2.2413 |
| **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 | 128.13% |

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 | 9.28% | 1.02% | 7.52% | 0.76% | 1.76% | 0.26% |
| 过去六个月 | 8.59% | 1.00% | 5.33% | 0.68% | 3.26% | 0.32% |
| 过去一年 | 26.99% | 0.87% | 16.06% | 0.61% | 10.93% | 0.26% |
| 过去三年 | 17.59% | 0.90% | 23.88% | 0.66% | -6.29% | 0.24% |
| 过去五年 | -28.92% | 1.11% | 7.24% | 0.67% | -36.16% | 0.44% |
| 过去七年 | 68.65% | 1.20% | 34.54% | 0.70% | 34.11% | 0.50% |
| 过去十年 | 80.17% | 1.24% | 58.61% | 0.69% | 21.56% | 0.55% |
| 自基金合同生效日起 | 128.13% | 1.30% | 81.71% | 0.81% | 46.42% | 0.49% |

### 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

中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

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

（2010 年 2 月 11 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 | | |
| 刘腾 | 基金经理 | 2024-03-14 | - | 15 | 中银基金管理有限公司权益投资部助理总经理，金融学硕士。2012 年加入中银基金管理有限公司，曾任研究员、中银资产管理有限公司资产管理部投资经理。2017 年 9 月至今任中银金融地产基金基金经理，2018 年 9 月至今任中银双息回报基金基金经理，2020 年 6 月至今任中银顺兴回报基金基金经理，2020 年 12 月至 2024 年 3 月任中银顺盈回报基金基金经理，2021 年 1 月至 2023 年 5 月任中银顺泽回报基金基金经理，2021 年 11 月至 2023 年 3 月任中银兴利稳健回报基金基金经理，2024 年 3 月至今任中银蓝筹基金基金经理，2024 年 8 月至今任中银价值发现基金基金经理，2025 年 4 月至今任中银价值基金基金经理。具备基金从业资格。 |

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

**4.2 管理人对报告期内本基金运作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。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. 市场回顾

股票市场方面，2026 年上半年 A 股市场宽幅震荡，结构性分化显著。科创 50 指数以 64.25%的涨幅领跑市场，创业板指数上涨 35.58%表现亮眼，而上证指数仅微涨 3.16%，沪深 300 指数上涨 7.55%，上证 50 指数下跌 1.38%。在全球经济“K 型”分化的背景下，上半年市场成长与价值风格的行情存在明显温差。

债券市场方面，2026 年上半年债券收益率整体呈现震荡下行趋势。10 年期国债收益率从 1.85%下行 11.43bps 至 1.73%，10 年期国开债收益率从 2%下行 22.27bps 至 1.78%。资金面先松后紧、风险偏好先升后降、中东冲突的爆发与缓和、国内基本面数据先上后下等均是影响上半年债市走势的核心因素。

信用债方面，2026 年上半年信用债收益率总体震荡下行，1 年期、3 年期和 5 年期 AAA 中短期票据收益率分别下行 21BP、27BP 和 26BP。利差方面，长端信用利差收窄较为明显，银行二永债超额利差持续压缩。上半年高息存款到期后部分资金流向理财、基金和保险等非银资金，非银的配置需求较为旺盛，整体处于流动性宽松、资产荒加剧与信用利差压缩局面。

可转债方面，在 2026 年上半年权益市场波动中上涨的背景下，转债整体表现跟随但弱于权益，溢价率中枢持续维持高位，上半年中证转债指数上涨 2.51%。

3. 运行分析

2026 年上半年股票市场总体收涨，债券市场总体收涨。我们看好 A 股市场的整体表现，因此策略上本基金保持稳定的股票仓位。一季度在地缘冲突事件之后，我们对组合进行了一定的调整。我们增加了银行、公用事业、石油、煤炭等板块的配置比例，但从二季度的股价表现看，以上板块并没有很好的股价表现。二季度的市场风格进一步向 AI 产业链收敛，而能源、有色、金融等行业反而出现了较为明显的下跌，对组合造成了一定的拖累。当前时点，我们维持看好煤炭、石油化工、有色、建材等行业。我们认为虽然美伊冲突得到了缓和，但能源价格中枢大概率会出现抬升，特别是

中长期供给端并没有大幅扩张的风险。因此以上行业在二季度股价大幅下跌后，当前的估值是非常具备性价比和配置价值的。对于 AI 相关行业，我们认为二季度的加速上涨与行业的高景气状态是匹配的。后续股价的变化还取决于下游资本开支的增速和供给扩张的速度。此外，我们认为 2026 年国内宏观经济延续高质量发展，但内需相关的行业的股价表现平平。我们看到消费行业内的部分龙头企业有明显的竞争优势，业绩稳定性强，估值处于历史低位，因此我们看好医药、食品饮料、家电等行业中估值较低、具备高壁垒、行业地位稳固、盈利能力强的优质标的。

#### 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 8.59%，同期业绩比较基准收益率为 5.33%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球宏观方面，下半年全球经济走势的关键变量仍在于中东局势及 AI 行业发展趋势：若能源供给扰动较快消退，全球经济有望延续温和增长，主要央行也可保留一定政策灵活性；若能源价格长期高企，则滞胀风险和货币政策约束均将明显上升。此外，AI 行业快速发展伴随着对基础设施和硬件领域的大量投资，带动着相关产业的发展，进而拉动经济增速提升。未来 AI 产业的发展趋势如何将边际决定着固定资产投资和工业产值变化。在此背景下，若能源价格逐步回落、美国就业和通胀温和降温，美联储仍存在重启降息的可能；但若油价维持高位、AI 投资继续高增，可能将推动通胀预期重新上行，美联储面临的紧缩压力或进一步上升。欧央行同样需要在增长偏弱与输入性通胀回升之间进行权衡，但进一步加息的门槛有所提高。日本方面，在工资增长、价格传导和日元贬值压力下，预计日央行将继续推进政策正常化，但加息节奏或保持审慎。

国内宏观方面，在 7 月中共中央政治局会议精神的指导下，或将充分发挥各项存量政策效能，加快财政支出和债券资金使用进度，推进“两重”建设和“两新”工作，综合运用并适时调整货币政策工具。财政脉冲有望再度抬升，叠加低基数的影响，传统动能增速预计回升。而在新兴产业蓬勃发展和全球产业链重构推动的产能周期上行背景下，出口和高端制造业投资预计仍将对经济形成重要支撑。预计全年将顺利实现经济增速目标，结构上，上半年经济展现的内外需分化、新旧动能分化的特征，或在下半年边际走向收敛。价格方面，下半年 PPI 或触顶后温和回落，通胀整体或将维持偏平稳态势。

权益方面，在中美流动性宽松的共同驱动下，流动性预期修复是下半年大类资产由极致分化转向均衡收敛的核心驱动力，同时对非科技板块估值形成更强支撑。首先，三季度“K 型”行情的下沿存在修复契机。一是随着油价的回落，宏观流动性预期有望改善，为非 AI 资产的修复提供土壤。二是国内存量财政工具有望加速落地，三季度国内固投景气有望边际改善。其次，市场有望重回增量资金环境，赚钱效应带来的正循环之下主动权益基金有望扩容，同时 ETF 资金流出有望明显放缓，

外汇结汇或继续支撑市场流动性。此外，市场风险偏好有望逐步回升。7 月至 8 月业绩披露期，预计海外 AI 产业链的高景气仍将对市场形成支撑。进入 9 月后，国内外重要事件密集落地，是市场风偏回升的有利窗口期。

具体到股票的行业选择，我们仍看好金融行业的未来表现。在监管呵护净息差、存款成本大幅下降的背景下，我们看到财报数据显示部分银行今年一季度的净息差已企稳回升，预计未来净息差下行压力将明显缓解。资产质量方面，对上市银行财报数据的分析显示，对公贷款的不良率较为平稳，地产风险已高位回落，消费贷款的信用风险也有高位趋稳的迹象。因此，银行业整体的营收和利润保持稳定的概率较大。无论是从股息率配置的角度，还是看好银行业的经营趋势（净息差和不良率可能出现拐点），当前银行板块均具有较好的配置价值。非银金融方面，虽然资本市场有所波动，但中长期健康发展的大趋势不会变。因此，无论是保险业还是证券业均会受益于中国资本市场的长期健康发展。此外，具备全球竞争力的生物医药、动力电池、储能、工程机械、船舶等高端制造业龙头企业目前估值较为合理，也是我们所看好的。对于人工智能产业，行业发展趋势并未出现逆转，海外算力资本开支增长的持续性较强，而且国内算力投资也有望在供给约束打开后迎来快速增长，因此我们看好受益于算力投资增长的电子、通信、计算机行业中的相关公司。同时，周期性行业中我们看好煤炭、有色、化工等呈现供给收缩、价格修复变化的行业。

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，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 80,430,242.49 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**

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

**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**

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

**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**

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 7,604,243.14 | 10,261,684.80 |
| 结算备付金 | | 361,825.33 | 203,768.43 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 存出保证金 | | 30,753.05 | 32,731.68 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 136,291,723.94 | 141,731,456.03 |
| 其中：股票投资 | | 114,664,771.03 | 118,284,154.01 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 21,626,952.91 | 23,447,302.02 |
| 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 | | 1,333,970.16 | 2,645,204.65 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 5,613.86 | 3,328.88 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 145,628,129.48 | 154,878,174.47 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>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 | | - | 5,493,007.45 |
| 应付赎回款 | | 38,153.52 | 61,393.22 |
| 应付管理人报酬 | | 140,014.71 | 150,898.42 |
| 应付托管费 | | 23,335.79 | 25,149.74 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 283.46 | 119.99 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 200,517.89 | 227,366.71 |
| 负债合计 | | 402,305.37 | 5,957,935.53 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 64,795,581.62 | 72,137,378.50 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 80,430,242.49 | 76,782,860.44 |
| 净资产合计 | | 145,225,824.11 | 148,920,238.94 |
| 负债和净资产总计 | | 145,628,129.48 | 154,878,174.47 |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.2413 元，基金份额总额 64,795,581.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

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<br>2026 年 1 月 1 日至<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至<br>2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 13,272,455.88 | -292,649.57 |
| 1.利息收入 | | 19,207.39 | 27,424.37 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 19,207.39 | 11,997.14 |
| 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 | | - | 15,427.23 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 15,346,896.37 | 2,641,051.65 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | 14,020,326.94 | 181,370.85 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 323,800.19 | 1,135,858.71 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | 1,002,769.24 | 1,323,822.09 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | -2,097,745.09 | -2,962,232.96 |
| 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 | 4,097.21 | 1,107.37 |
| **减：二、营业总支出** | | 1,117,200.00 | 1,087,809.02 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2 | 880,580.33 | 849,026.15 |
| 2．托管费 | | 146,763.36 | 141,504.35 |
| 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 | | 182.26 | 151.89 |
| 8．其他费用 | 6.4.7.17 | 89,674.05 | 97,126.63 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | **12,155,255.88** | **-1,380,458.59** |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | **12,155,255.88** | **-1,380,458.59** |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | 12,155,255.88 | -1,380,458.59 |

**6.3 净资产变动表**

会计主体：中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

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<br>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 | 72,137,378.50 | - | 76,782,860.44 | 148,920,238.94 |
| 二、本期期初净资产 | 72,137,378.50 | - | 76,782,860.44 | 148,920,238.94 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -7,341,796.88 | - | 3,647,382.05 | -3,694,414.83 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 12,155,255.88 | 12,155,255.88 |
| （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） | -7,341,796.88 | - | -8,507,873.83 | -15,849,670.71 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,343,451.34 | - | 1,559,245.10 | 2,902,696.44 |
| 2.基金赎回款 | -8,685,248.22 | - | -10,067,118.93 | -18,752,367.15 |
| （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 | 64,795,581.62 | - | 80,430,242.49 | 145,225,824.11 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>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 | 85,694,300.04 | - | 66,775,810.06 | 152,470,110.10 |
| 二、本期期初净资产 | 85,694,300.04 | - | 66,775,810.06 | 152,470,110.10 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -6,556,749.59 | - | -6,209,917.21 | -12,766,666.80 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -1,380,458.59 | -1,380,458.59 |
| （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） | -6,556,749.59 | - | -4,829,458.62 | -11,386,208.21 |
| 其中：1.基金申购款 | 414,432.95 | - | 302,729.60 | 717,162.55 |
| 2.基金赎回款 | -6,971,182.54 | - | -5,132,188.22 | -12,103,370.76 |
| （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 | 79,137,550.45 | - | 60,565,892.85 | 139,703,443.30 |

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

中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金（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]1425 号文《关于核准中银蓝筹精选灵活配置混合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 2010 年 2 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为 6,183,631,055.91 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本财务报表由本基金的基金管理人中银基金管理有限公司于 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；场内投资人只能选择现金分红；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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 7,604,243.14 |
| 等于：本金 | 7,603,469.41 |
| 加：应计利息 | 773.73 |
| 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 | 7,604,243.14 |

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 113,207,811.15 | - | 114,664,771.03 | 1,456,959.88 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 21,742,958.69 | 197,002.71 | 21,626,952.91 | -313,008.49 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 21,742,958.69 | 197,002.71 | 21,626,952.91 | -313,008.49 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 134,950,769.84 | 197,002.71 | 136,291,723.94 | 1,143,951.39 |

### 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 2.55 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 96,790.98 |

| | |
|---|---|
| 其中：交易所市场 | 96,790.98 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付账户维护费 | 9,000.00 |
| 应付信息披露费 | 59,507.37 |
| 应付审计费 | 34,916.99 |
| 预提上清所查询服务费 | 300.00 |
| 合计 | 200,517.89 |

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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 | 72,137,378.50 | 72,137,378.50 |
| 本期申购 | 1,343,451.34 | 1,343,451.34 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -8,685,248.22 | -8,685,248.22 |
| 本期末 | 64,795,581.62 | 64,795,581.62 |

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 | 123,662,331.18 | -46,879,470.74 | 76,782,860.44 |
| 本期期初 | 123,662,331.18 | -46,879,470.74 | 76,782,860.44 |
| 本期利润 | 14,253,000.97 | -2,097,745.09 | 12,155,255.88 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -13,424,131.62 | 4,916,257.79 | -8,507,873.83 |
| 其中：基金申购款 | 2,407,687.82 | -848,442.72 | 1,559,245.10 |
| 基金赎回款 | -15,831,819.44 | 5,764,700.51 | -10,067,118.93 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 124,491,200.53 | -44,060,958.04 | 80,430,242.49 |

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 18,752.14 |
| 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 | 397.47 |
| 其他 | 57.78 |

| | |
|---|---|
| 合计 | 19,207.39 |

**6.4.7.10 股票投资收益**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 200,505,936.83 |
| 减：卖出股票成本总额 | 186,193,297.27 |
| 减：交易费用 | 292,312.62 |
| 买卖股票差价收入 | 14,020,326.94 |

**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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 债券投资收益——利息收入 | 164,258.25 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 159,541.94 |
| 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 | 323,800.19 |

**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<br>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）成交总额 | 6,453,486.48 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 6,248,179.80 |
| 减：应计利息总额 | 45,508.15 |
| 减：交易费用 | 256.59 |
| 买卖债券差价收入 | 159,541.94 |

**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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
| --- | --- |
| 股票投资产生的股利收益 | 1,002,769.24 |
| 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 | 1,002,769.24 |

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
| --- | --- |
| 1.交易性金融资产 | -2,097,745.09 |
| ——股票投资 | -1,497,462.52 |
| ——债券投资 | -600,282.57 |
| ——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 | -2,097,745.09 |

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
| --- | --- |
| 基金赎回费收入 | 3,846.30 |
| 基金转换费收入 | 250.91 |
| 合计 | 4,097.21 |

**6.4.7.17 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
| --- | --- |
| 审计费用 | 9,916.99 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 1,638.83 |
| 其他 | 610.86 |

| | |
|---|---|
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 合计 | 89,674.05 |

**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 |
| 招商银行股份有限公司(“招商银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本报告期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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 880,580.33 | 849,026.15 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 353,577.84 | 336,861.10 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 527,002.49 | 512,165.05 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.2%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 146,763.36 | 141,504.35 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

**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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | | 上年度可比期间<br>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 |
| 招商银行股份有限公司 | 7,604,243.14 | 18,752.14 | 2,213,013.19 | 11,351.14 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，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 |
| 688783 | 西安奕材 | 2025-10-20 | 6 个月以上 | 新股锁定期内 | 8.62 | 57.42 | 6,573 | 56,659.26 | 377,421.66 | - |
| 688795 | 摩尔线程 | 2025-11-26 | 6 个月以上 | 新股锁定期内 | 114.28 | 676.94 | 493 | 56,340.04 | 333,731.42 | - |
| 688802 | 沐曦股份 | 2025-12-09 | 6 个月以上 | 新股锁定期内 | 104.66 | 768.89 | 366 | 38,305.56 | 281,413.74 | - |
| 688781 | 视涯科技 | 2026-03-18 | 6 个月以上 | 新股锁定期内 | 22.68 | 42.16 | 1,358 | 30,799.44 | 57,253.28 | - |
| 688808 | 联讯仪器 | 2026-04-16 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 81.88 | 1,584.33 | 35 | 2,865.80 | 55,451.55 | - |
| 688790 | 昂瑞微 | 2025-12-09 | 6 个月以上 | 新股锁定期内 | 83.06 | 126.45 | 406 | 33,722.36 | 51,338.70 | - |
| 688820 | 盛合晶微 | 2026-04-13 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 19.68 | 141.49 | 209 | 4,113.12 | 29,571.41 | - |
| 688818 | 电科蓝天 | 2026-02-03 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 9.47 | 70.14 | 417 | 3,948.99 | 29,248.38 | - |
| 688797 | 臻宝科技 | 2026-06-16 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 44.56 | 468.67 | 54 | 2,406.24 | 25,308.18 | - |
| 68871 | 北芯 | 2026-0 | 1-6 个 | 新股 | 17.52 | 35.92 | 617 | 10,809 | 22,162 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2 | 生命 | 1-28 | 月（含） | 锁定期内 | | | | .84 | .64 | |
| 688635 | 长进光子 | 2026-05-20 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 40.98 | 308.19 | 63 | 2,581.74 | 19,415.97 | - |
| 688785 | 恒运昌 | 2026-01-20 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 92.18 | 463.15 | 36 | 3,318.48 | 16,673.40 | - |
| 688811 | 有研复材 | 2026-04-01 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 6.41 | 24.13 | 408 | 2,615.28 | 9,845.04 | - |
| 603459 | 红板科技 | 2026-03-31 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 17.70 | 84.32 | 95 | 1,681.50 | 8,010.40 | - |
| 603407 | 长裕集团 | 2026-04-29 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 13.86 | 73.46 | 95 | 1,316.70 | 6,978.70 | - |
| 688816 | 易思维 | 2026-02-04 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 55.95 | 57.10 | 61 | 3,412.95 | 3,483.10 | - |
| 603435 | 嘉德利 | 2026-05-15 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 15.76 | 46.71 | 67 | 1,055.92 | 3,129.57 | - |
| 601112 | 振石股份 | 2026-01-21 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 11.18 | 17.59 | 141 | 1,576.38 | 2,480.19 | - |
| 603352 | 至信股份 | 2026-01-08 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 21.88 | 25.52 | 50 | 1,094.00 | 1,276.00 | - |
| 603284 | 林平发展 | 2026-02-03 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 37.88 | 34.87 | 29 | 1,098.52 | 1,011.23 | - |
| 603293 | 埃泰克 | 2026-04-09 | 1-6 个月（含） | 新股锁定期内 | 33.49 | 33.93 | 27 | 904.23 | 916.11 | - |
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 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：张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 118071 | 华峰转债 | 2026-06-24 | 1 个月内（含） | 配债未上市 | 100.00 | 100.00 | 70 | 7,000.00 | 7,000.12 | - |

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 688072 | 拓荆科技 | 2026-06-29 | 重大事项停牌 | 832.00 | 2026-07-13 | 890.99 | 582 | 359,322.79 | 484,224.00 | - |

**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 | 7,604,243.14 | - | - | - | 7,604,243.14 |
| 结算备付金 | 361,825.33 | - | - | - | 361,825.33 |
| 存出保证金 | 30,753.05 | - | - | - | 30,753.05 |
| 交易性金融资产 | 13,305,216.87 | 7,012,527.34 | 1,309,208.70 | 114,664,771.03 | 136,291,723.94 |
| 应收清算款 | - | - | - | 1,333,970.16 | 1,333,970.16 |
| 应收申购款 | - | - | - | 5,613.86 | 5,613.86 |
| 资产总计 | 21,302,038.39 | 7,012,527.34 | 1,309,208.70 | 116,004,355.05 | 145,628,129.48 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 38,153.52 | 38,153.52 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 140,014.71 | 140,014.71 |
| 应付托管费 | - | - | - | 23,335.79 | 23,335.79 |
| 应交税费 | - | - | - | 283.46 | 283.46 |
| 其他负债 | - | - | - | 200,517.89 | 200,517.89 |
| 负债总计 | - | - | - | 402,305.37 | 402,305.37 |
| 利率敏感度缺口 | 21,302,038.39 | 7,012,527.34 | 1,309,208.70 | 115,602,049.68 | 145,225,824.11 |
| 上年度末 2025 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 10,261,684.80 | - | - | - | 10,261,684.80 |
| 结算备付金 | 203,768.43 | - | - | - | 203,768.43 |
| 存出保证金 | 32,731.68 | - | - | - | 32,731.68 |
| 交易性金融资产 | 11,678,277.84 | 10,486,923.58 | 1,282,100.60 | 118,284,154.01 | 141,731,456.03 |
| 应收清算款 | - | - | - | 2,645,204.65 | 2,645,204.65 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 应收申购款 | 299.96 | - | - | 3,028.92 | 3,328.88 |
| 资产总计 | 22,176,762.71 | 10,486,923.58 | 1,282,100.60 | 120,932,387.58 | 154,878,174.47 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 5,493,007.45 | 5,493,007.45 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 61,393.22 | 61,393.22 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 150,898.42 | 150,898.42 |
| 应付托管费 | - | - | - | 25,149.74 | 25,149.74 |
| 应交税费 | - | - | - | 119.99 | 119.99 |
| 其他负债 | - | - | - | 227,366.71 | 227,366.71 |
| 负债总计 | - | - | - | 5,957,935.53 | 5,957,935.53 |
| 利率敏感度缺口 | 22,176,762.71 | 10,486,923.58 | 1,282,100.60 | 114,974,452.05 | 148,920,238.94 |

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**

| 假设 | 除市场利率以外的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<br>影响金额（单位：人民币万元） | |
| | | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | 减少约 6 | 减少约 5 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 增加约 6 | 增加约 5 |

**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<br>2026 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 |

| | | 例（%） | | （%） |
|---|---|---|---|---|
| 交易性金融资产－股票投资 | 114,664,771.03 | 78.96 | 118,284,154.01 | 79.43 |
| 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 | 114,664,771.03 | 78.96 | 118,284,154.01 | 79.43 |

**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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
| | 1. 业绩比较基准上升 5% | 增加约 966 | 增加约 1,000 |
| | 2. 业绩比较基准下降 5% | 减少约 966 | 减少约 1,000 |

**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<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 122,118,785.34 | 125,586,009.95 |
| 第二层次 | 12,836,817.93 | 15,361,959.66 |
| 第三层次 | 1,336,120.67 | 783,486.42 |
| 合计 | 136,291,723.94 | 141,731,456.03 |

**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 | 114,664,771.03 | 78.74 |
| | 其中：股票 | 114,664,771.03 | 78.74 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 21,626,952.91 | 14.85 |
| | 其中：债券 | 21,626,952.91 | 14.85 |
| | 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 | 7,966,068.47 | 5.47 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,370,337.07 | 0.94 |
| 9 | 合计 | 145,628,129.48 | 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 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 11,059,251.00 | 7.62 |
| C | 制造业 | 76,836,821.10 | 52.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,048,697.00 | 1.41 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,714,546.00 | 1.87 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 982,950.93 | 0.68 |
| J | 金融业 | 18,568,987.00 | 12.79 |
| K | 房地产业 | 1,418,236.00 | 0.98 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 796,864.00 | 0.55 |
| 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 | 238,418.00 | 0.16 |
|  | 合计 | 114,664,771.03 | 78.96 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 688981 | 中芯国际 | 28,076 | 4,459,030.32 | 3.07 |
| 2 | 300274 | 阳光电源 | 20,400 | 3,244,008.00 | 2.23 |
| 3 | 601898 | 中煤能源 | 250,400 | 3,049,872.00 | 2.10 |
| 4 | 688041 | 海光信息 | 7,673 | 2,841,311.90 | 1.96 |
| 5 | 002142 | 宁波银行 | 90,400 | 2,683,976.00 | 1.85 |
| 6 | 300308 | 中际旭创 | 2,000 | 2,540,000.00 | 1.75 |
| 7 | 600549 | 厦门钨业 | 28,600 | 2,436,720.00 | 1.68 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 2,000 | 2,370,980.00 | 1.63 |
| 9 | 002371 | 北方华创 | 2,600 | 2,299,856.00 | 1.58 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 73,500 | 2,111,655.00 | 1.45 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 11 | 600919 | 江苏银行 | 192,000 | 2,069,760.00 | 1.43 |
| 12 | 000425 | 徐工机械 | 253,800 | 2,053,242.00 | 1.41 |
| 13 | 002475 | 立讯精密 | 28,000 | 1,971,200.00 | 1.36 |
| 14 | 000100 | TCL 科技 | 330,300 | 1,922,346.00 | 1.32 |
| 15 | 601009 | 南京银行 | 185,300 | 1,832,617.00 | 1.26 |
| 16 | 601377 | 兴业证券 | 294,200 | 1,776,968.00 | 1.22 |
| 17 | 300502 | 新易盛 | 2,820 | 1,711,740.00 | 1.18 |
| 18 | 300059 | 东方财富 | 82,900 | 1,689,502.00 | 1.16 |
| 19 | 601857 | 中国石油 | 190,100 | 1,650,068.00 | 1.14 |
| 20 | 002648 | 卫星化学 | 69,900 | 1,641,951.00 | 1.13 |
| 21 | 603288 | 海天味业 | 47,600 | 1,578,416.00 | 1.09 |
| 22 | 603986 | 兆易创新 | 1,900 | 1,548,500.00 | 1.07 |
| 23 | 600276 | 恒瑞医药 | 28,400 | 1,477,936.00 | 1.02 |
| 24 | 600938 | 中国海油 | 54,200 | 1,471,530.00 | 1.01 |
| 25 | 601318 | 中国平安 | 29,900 | 1,427,426.00 | 0.98 |
| 26 | 601336 | 新华保险 | 23,300 | 1,390,078.00 | 0.96 |
| 27 | 601138 | 工业富联 | 19,100 | 1,378,065.00 | 0.95 |
| 28 | 300868 | 杰美特 | 9,300 | 1,364,403.00 | 0.94 |
| 29 | 300750 | 宁德时代 | 3,400 | 1,336,234.00 | 0.92 |
| 30 | 300765 | 石药创新 | 48,600 | 1,323,378.00 | 0.91 |
| 31 | 688008 | 澜起科技 | 4,148 | 1,285,465.20 | 0.89 |
| 32 | 600026 | 中远海能 | 70,900 | 1,271,946.00 | 0.88 |
| 33 | 600183 | 生益科技 | 7,200 | 1,248,480.00 | 0.86 |
| 34 | 605376 | 博迁新材 | 4,600 | 1,247,980.00 | 0.86 |
| 35 | 002756 | 永兴材料 | 20,600 | 1,166,784.00 | 0.80 |
| 36 | 001979 | 招商蛇口 | 178,600 | 1,148,398.00 | 0.79 |
| 37 | 688630 | 芯碁微装 | 2,065 | 1,134,490.35 | 0.78 |
| 38 | 688387 | 信科移动 | 56,647 | 1,123,876.48 | 0.77 |
| 39 | 002179 | 中航光电 | 24,300 | 1,122,660.00 | 0.77 |
| 40 | 688362 | 甬矽电子 | 11,176 | 1,077,366.40 | 0.74 |
| 41 | 601899 | 紫金矿业 | 41,500 | 1,043,310.00 | 0.72 |
| 42 | 688200 | 华峰测控 | 1,967 | 1,032,871.70 | 0.71 |
| 43 | 601001 | 晋控煤业 | 57,500 | 999,925.00 | 0.69 |
| 44 | 688361 | 中科飞测 | 2,315 | 995,450.00 | 0.69 |
| 45 | 688120 | 华海清科 | 2,961 | 953,974.98 | 0.66 |
| 46 | 300223 | 北京君正 | 3,300 | 821,370.00 | 0.57 |
| 47 | 600150 | 中国船舶 | 24,300 | 821,097.00 | 0.57 |
| 48 | 601225 | 陕西煤业 | 40,300 | 820,105.00 | 0.56 |
| 49 | 605117 | 德业股份 | 7,700 | 817,586.00 | 0.56 |
| 50 | 603259 | 药明康德 | 6,400 | 796,864.00 | 0.55 |
| 51 | 600011 | 华能国际 | 104,700 | 794,673.00 | 0.55 |
| 52 | 002415 | 海康威视 | 21,600 | 738,720.00 | 0.51 |
| 53 | 601918 | 新集能源 | 85,800 | 737,022.00 | 0.51 |
| 54 | 301345 | 涛涛车业 | 3,100 | 716,100.00 | 0.49 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 55 | 600926 | 杭州银行 | 49,200 | 710,940.00 | 0.49 |
| 56 | 601211 | 国泰海通 | 38,700 | 704,340.00 | 0.48 |
| 57 | 300751 | 迈为股份 | 2,400 | 677,904.00 | 0.47 |
| 58 | 688456 | 有研粉材 | 4,810 | 671,476.00 | 0.46 |
| 59 | 601077 | 渝农商行 | 108,600 | 663,546.00 | 0.46 |
| 60 | 600886 | 国投电力 | 49,200 | 654,852.00 | 0.45 |
| 61 | 601398 | 工商银行 | 92,300 | 652,561.00 | 0.45 |
| 62 | 300124 | 汇川技术 | 9,700 | 643,401.00 | 0.44 |
| 63 | 601998 | 中信银行 | 92,600 | 641,718.00 | 0.44 |
| 64 | 688608 | 恒玄科技 | 3,730 | 623,618.70 | 0.43 |
| 65 | 603993 | 洛阳钼业 | 34,900 | 612,495.00 | 0.42 |
| 66 | 600483 | 福能股份 | 58,800 | 599,172.00 | 0.41 |
| 67 | 688233 | 神工股份 | 2,704 | 579,791.68 | 0.40 |
| 68 | 688502 | 茂莱光学 | 817 | 566,671.20 | 0.39 |
| 69 | 600941 | 中国移动 | 6,400 | 551,232.00 | 0.38 |
| 70 | 603308 | 应流股份 | 8,800 | 531,520.00 | 0.37 |
| 71 | 688261 | 东微半导 | 5,058 | 530,735.94 | 0.37 |
| 72 | 600309 | 万华化学 | 7,700 | 526,757.00 | 0.36 |
| 73 | 600546 | 山煤国际 | 48,000 | 524,640.00 | 0.36 |
| 74 | 601600 | 中国铝业 | 62,000 | 509,640.00 | 0.35 |
| 75 | 688375 | 国博电子 | 4,830 | 503,769.00 | 0.35 |
| 76 | 688072 | 拓荆科技 | 582 | 484,224.00 | 0.33 |
| 77 | 002008 | 大族激光 | 3,200 | 480,352.00 | 0.33 |
| 78 | 603078 | 江化微 | 9,700 | 479,374.00 | 0.33 |
| 79 | 688313 | 仕佳光子 | 2,531 | 467,349.15 | 0.32 |
| 80 | 688337 | 普源精电 | 6,178 | 462,917.54 | 0.32 |
| 81 | 688172 | 燕东微 | 5,486 | 458,958.76 | 0.32 |
| 82 | 600563 | 法拉电子 | 2,400 | 457,920.00 | 0.32 |
| 83 | 688385 | 复旦微电 | 6,111 | 435,653.19 | 0.30 |
| 84 | 688249 | 晶合集成 | 7,334 | 432,926.02 | 0.30 |
| 85 | 601872 | 招商轮船 | 24,600 | 432,222.00 | 0.30 |
| 86 | 688702 | 盛科通信 | 1,107 | 431,718.93 | 0.30 |
| 87 | 301629 | 矽电股份 | 1,000 | 430,400.00 | 0.30 |
| 88 | 000933 | 神火股份 | 20,300 | 430,360.00 | 0.30 |
| 89 | 002539 | 云图控股 | 37,700 | 426,764.00 | 0.29 |
| 90 | 000786 | 北新建材 | 23,500 | 425,115.00 | 0.29 |
| 91 | 601333 | 广深铁路 | 145,000 | 398,750.00 | 0.27 |
| 92 | 002353 | 杰瑞股份 | 2,500 | 381,250.00 | 0.26 |
| 93 | 688783 | 西安奕材 | 6,573 | 377,421.66 | 0.26 |
| 94 | 600352 | 浙江龙盛 | 30,500 | 369,355.00 | 0.25 |
| 95 | 002352 | 顺丰控股 | 10,900 | 340,734.00 | 0.23 |
| 96 | 600141 | 兴发集团 | 7,200 | 338,184.00 | 0.23 |
| 97 | 688610 | 埃科光电 | 1,283 | 337,942.20 | 0.23 |
| 98 | 002738 | 中矿资源 | 5,700 | 336,243.00 | 0.23 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 99 | 688795 | 摩尔线程 | 493 | 333,731.42 | 0.23 |
| 100 | 605358 | 立昂微 | 4,300 | 333,680.00 | 0.23 |
| 101 | 600801 | 华新建材 | 20,200 | 315,120.00 | 0.22 |
| 102 | 300316 | 晶盛机电 | 5,100 | 308,040.00 | 0.21 |
| 103 | 000977 | 浪潮信息 | 4,300 | 301,000.00 | 0.21 |
| 104 | 688717 | 艾罗能源 | 3,574 | 295,105.18 | 0.20 |
| 105 | 688802 | 沐曦股份 | 366 | 281,413.74 | 0.19 |
| 106 | 601816 | 京沪高铁 | 59,800 | 270,894.00 | 0.19 |
| 107 | 601155 | 新城控股 | 26,300 | 269,838.00 | 0.19 |
| 108 | 002938 | 鹏鼎控股 | 2,500 | 263,450.00 | 0.18 |
| 109 | 002484 | 江海股份 | 2,500 | 262,500.00 | 0.18 |
| 110 | 688510 | 航亚科技 | 10,840 | 258,859.20 | 0.18 |
| 111 | 000938 | 紫光股份 | 8,900 | 256,854.00 | 0.18 |
| 112 | 600346 | 恒力石化 | 14,100 | 249,711.00 | 0.17 |
| 113 | 000333 | 美的集团 | 3,200 | 241,696.00 | 0.17 |
| 114 | 000792 | 盐湖股份 | 8,000 | 241,520.00 | 0.17 |
| 115 | 600673 | 东阳光 | 7,100 | 238,418.00 | 0.16 |
| 116 | 688012 | 中微公司 | 484 | 226,754.00 | 0.16 |
| 117 | 601601 | 中国太保 | 7,500 | 213,900.00 | 0.15 |
| 118 | 002364 | 中恒电气 | 3,900 | 209,820.00 | 0.14 |
| 119 | 600176 | 中国巨石 | 2,800 | 204,064.00 | 0.14 |
| 120 | 002865 | 钧达股份 | 3,000 | 179,040.00 | 0.12 |
| 121 | 688551 | 科威尔 | 2,534 | 178,064.18 | 0.12 |
| 122 | 688785 | 恒运昌 | 359 | 173,015.09 | 0.12 |
| 123 | 688700 | 东威科技 | 1,668 | 149,119.20 | 0.10 |
| 124 | 688663 | 新风光 | 1,647 | 145,693.62 | 0.10 |
| 125 | 003031 | 中瓷电子 | 800 | 144,240.00 | 0.10 |
| 126 | 002594 | 比亚迪 | 1,800 | 143,460.00 | 0.10 |
| 127 | 600301 | 华锡有色 | 2,300 | 141,036.00 | 0.10 |
| 128 | 301205 | 联特科技 | 400 | 133,640.00 | 0.09 |
| 129 | 603337 | 杰克科技 | 3,100 | 112,313.00 | 0.08 |
| 130 | 603459 | 红板科技 | 950 | 103,949.95 | 0.07 |
| 131 | 600328 | 中盐化工 | 15,000 | 90,000.00 | 0.06 |
| 132 | 689009 | 九号公司 | 2,206 | 84,158.90 | 0.06 |
| 133 | 601877 | 正泰电器 | 2,600 | 65,182.00 | 0.04 |
| 134 | 688781 | 视涯科技 | 1,358 | 57,253.28 | 0.04 |
| 135 | 688808 | 联讯仪器 | 35 | 55,451.55 | 0.04 |
| 136 | 688790 | 昂瑞微 | 406 | 51,338.70 | 0.04 |
| 137 | 688820 | 盛合晶微 | 209 | 29,571.41 | 0.02 |
| 138 | 688818 | 电科蓝天 | 417 | 29,248.38 | 0.02 |
| 139 | 688809 | 强一股份 | 43 | 26,789.00 | 0.02 |
| 140 | 688797 | 臻宝科技 | 54 | 25,308.18 | 0.02 |
| 141 | 688759 | 必贝特 | 726 | 23,217.48 | 0.02 |
| 142 | 688712 | 北芯生命 | 617 | 22,162.64 | 0.02 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 143 | 688635 | 长进光子 | 63 | 19,415.97 | 0.01 |
| 144 | 688811 | 有研复材 | 408 | 9,845.04 | 0.01 |
| 145 | 002128 | 电投能源 | 400 | 9,248.00 | 0.01 |
| 146 | 603407 | 长裕集团 | 95 | 6,978.70 | 0.00 |
| 147 | 601112 | 振石股份 | 205 | 3,646.91 | 0.00 |
| 148 | 688816 | 易思维 | 61 | 3,483.10 | 0.00 |
| 149 | 603435 | 嘉德利 | 67 | 3,129.57 | 0.00 |
| 150 | 603352 | 至信股份 | 50 | 1,276.00 | 0.00 |
| 151 | 603284 | 林平发展 | 29 | 1,011.23 | 0.00 |
| 152 | 603293 | 埃泰克 | 27 | 916.11 | 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 | 688981 | 中芯国际 | 4,301,495.21 | 2.89 |
| 2 | 601898 | 中煤能源 | 4,095,090.00 | 2.75 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 3,774,790.00 | 2.53 |
| 4 | 300274 | 阳光电源 | 3,026,000.40 | 2.03 |
| 5 | 300502 | 新易盛 | 2,887,753.00 | 1.94 |
| 6 | 688008 | 澜起科技 | 2,874,042.45 | 1.93 |
| 7 | 601138 | 工业富联 | 2,873,064.00 | 1.93 |
| 8 | 002142 | 宁波银行 | 2,819,723.85 | 1.89 |
| 9 | 601009 | 南京银行 | 2,804,557.00 | 1.88 |
| 10 | 601985 | 中国核电 | 2,594,588.00 | 1.74 |
| 11 | 688041 | 海光信息 | 2,590,654.97 | 1.74 |
| 12 | 300751 | 迈为股份 | 2,317,105.00 | 1.56 |
| 13 | 002648 | 卫星化学 | 2,309,223.00 | 1.55 |
| 14 | 600276 | 恒瑞医药 | 2,200,898.00 | 1.48 |
| 15 | 300033 | 同花顺 | 2,187,412.00 | 1.47 |
| 16 | 600938 | 中国海油 | 2,168,388.00 | 1.46 |
| 17 | 603288 | 海天味业 | 2,156,575.00 | 1.45 |
| 18 | 688702 | 盛科通信 | 2,136,499.51 | 1.43 |
| 19 | 601225 | 陕西煤业 | 2,128,820.00 | 1.43 |
| 20 | 688336 | 三生国健 | 2,124,644.85 | 1.43 |

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 | 300502 | 新易盛 | 3,907,143.00 | 2.62 |
| 2 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,588,636.40 | 2.41 |
| 3 | 601138 | 工业富联 | 3,428,766.00 | 2.30 |
| 4 | 003031 | 中瓷电子 | 3,322,270.00 | 2.23 |
| 5 | 600489 | 中金黄金 | 2,839,313.00 | 1.91 |
| 6 | 688336 | 三生国健 | 2,808,429.72 | 1.89 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 2,644,494.00 | 1.78 |
| 8 | 002475 | 立讯精密 | 2,643,321.00 | 1.77 |
| 9 | 600584 | 长电科技 | 2,638,906.00 | 1.77 |
| 10 | 601077 | 渝农商行 | 2,575,886.00 | 1.73 |
| 11 | 601985 | 中国核电 | 2,569,600.00 | 1.73 |
| 12 | 600673 | 东阳光 | 2,518,686.00 | 1.69 |
| 13 | 601166 | 兴业银行 | 2,506,555.00 | 1.68 |
| 14 | 600482 | 中国动力 | 2,471,928.00 | 1.66 |
| 15 | 300870 | 欧陆通 | 2,354,404.00 | 1.58 |
| 16 | 002142 | 宁波银行 | 2,282,316.00 | 1.53 |
| 17 | 601600 | 中国铝业 | 2,241,612.00 | 1.51 |
| 18 | 688256 | 寒武纪 | 2,220,324.28 | 1.49 |
| 19 | 601001 | 晋控煤业 | 2,205,191.00 | 1.48 |
| 20 | 600309 | 万华化学 | 2,067,659.00 | 1.39 |

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 | 184,071,376.81 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 200,505,936.83 |

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 | 12,345,593.81 | 8.50 |
| 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） | 9,281,359.10 | 6.39 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 21,626,952.91 | 14.89 |

**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 | 019785 | 25 国债 13 | 45,000 | 4,556,814.66 | 3.14 |
| 2 | 019792 | 25 国债 19 | 44,000 | 4,446,166.25 | 3.06 |
| 3 | 113042 | 上银转债 | 23,840 | 2,754,150.29 | 1.90 |
| 4 | 127049 | 希望转 2 | 15,950 | 1,732,092.65 | 1.19 |
| 5 | 019757 | 24 国债 20 | 13,000 | 1,332,690.90 | 0.92 |

**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投资。

**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中中信证券、贵州茅台、宁波银行、上海银行、立讯精密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 | 30,753.05 |
| 2 | 应收清算款 | 1,333,970.16 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 5,613.86 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,370,337.07 |

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113042 | 上银转债 | 2,754,150.29 | 1.90 |
| 2 | 127049 | 希望转 2 | 1,732,092.65 | 1.19 |
| 3 | 128136 | 立讯转债 | 840,372.25 | 0.58 |
| 4 | 111021 | 奥锐转债 | 828,129.58 | 0.57 |
| 5 | 113661 | 福 22 转债 | 766,578.43 | 0.53 |
| 6 | 113062 | 常银转债 | 744,336.10 | 0.51 |
| 7 | 127089 | 晶澳转债 | 708,922.51 | 0.49 |
| 8 | 123225 | 翔丰转债 | 491,045.59 | 0.34 |
| 9 | 127108 | 太能转债 | 408,731.58 | 0.28 |

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

**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 |
| 4,154 | 15,598.36 | 2,779,186.21 | 4.2892% | 62,016,395.41 | 95.7108% |

**8.2 盈利投资者数量占比**

| 项目 | 过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日) |
|---|---|
| 盈利投资者数量占比 | 98.59% |

**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 | 139,670.44 | 0.2156% |

**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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2010 年 2 月 11 日）基金份额总额 | 6,183,631,055.91 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 72,137,378.50 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,343,451.34 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 8,685,248.22 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 64,795,581.62 |

## 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，基金托管人无重大人事变动。

**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**

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

**10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况**

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

**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 | |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | 183,118,874.36 | 47.67% | 79,821.76 | 47.68% | - |
| 华泰证券 | 1 | 143,310,614.03 | 37.31% | 62,469.12 | 37.31% | - |
| 天风证券 | 2 | 31,471,030.21 | 8.19% | 13,717.65 | 8.19% | - |
| 招商证券 | 1 | 10,110,122.57 | 2.63% | 4,406.64 | 2.63% | - |
| 民生证券 | 1 | 7,777,144.68 | 2.02% | 3,389.88 | 2.02% | - |
| 国海证券 | 1 | 4,580,441.70 | 1.19% | 1,996.57 | 1.19% | - |
| 兴业证券 | 1 | 3,547,022.40 | 0.92% | 1,546.19 | 0.92% | - |
| 长江证券 | 1 | 190,122.09 | 0.05% | 69.40 | 0.04% | - |

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 |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 中银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国联民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1,221,294.81 | 15.44% | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 4,420,434.50 | 55.88% | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2,268,324.23 | 28.68% | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |

**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 | 中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金 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 |
| 5 | 中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2026-03-31 |
| 6 | 中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金 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 | 中银蓝筹精选灵活配置混合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 | 中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同 | 中国证监会规定媒介 | 2026-05-20 |
| 12 | 中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议 | 中国证监会规定媒介 | 2026-05-20 |
| 13 | 中银蓝筹精选灵活配置混合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蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；

2、《中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

4、《中银蓝筹精选灵活配置混合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