中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）

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 7
4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 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 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 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17
7 投资组合报告 36
7.1 期末基金资产组合情况 36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 37
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 38
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 38
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 45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 45
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 47
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 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 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 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 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 53
11.1 备查文件目录 53
11.2 存放地点 54
11.3 查阅方式 54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）
基金简称	中银沪深 300 等权重指数（LOF）
场内简称	沪深 300 等权 LOF
基金主代码	163821
交易代码	163821
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 17 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	17,079,115.99 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 7 月 13 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数型基金，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，实现对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数相似的回报。本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金力求基金净值收益率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	沪深 300 等权重指数收益率×95% +同期银行活期存款利率×5%
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、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中银基金管理有限公司	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	中国证券报
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	2,722,580.22
本期利润	293,644.39
加权平均基金份额本期利润	0.0155
本期加权平均净值利润率	0.72%
本期基金份额净值增长率	0.56%
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	18,782,180.53
期末可供分配基金份额利润	1.0997
期末基金资产净值	35,861,296.52
期末基金份额净值	2.0997
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	109.97%

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

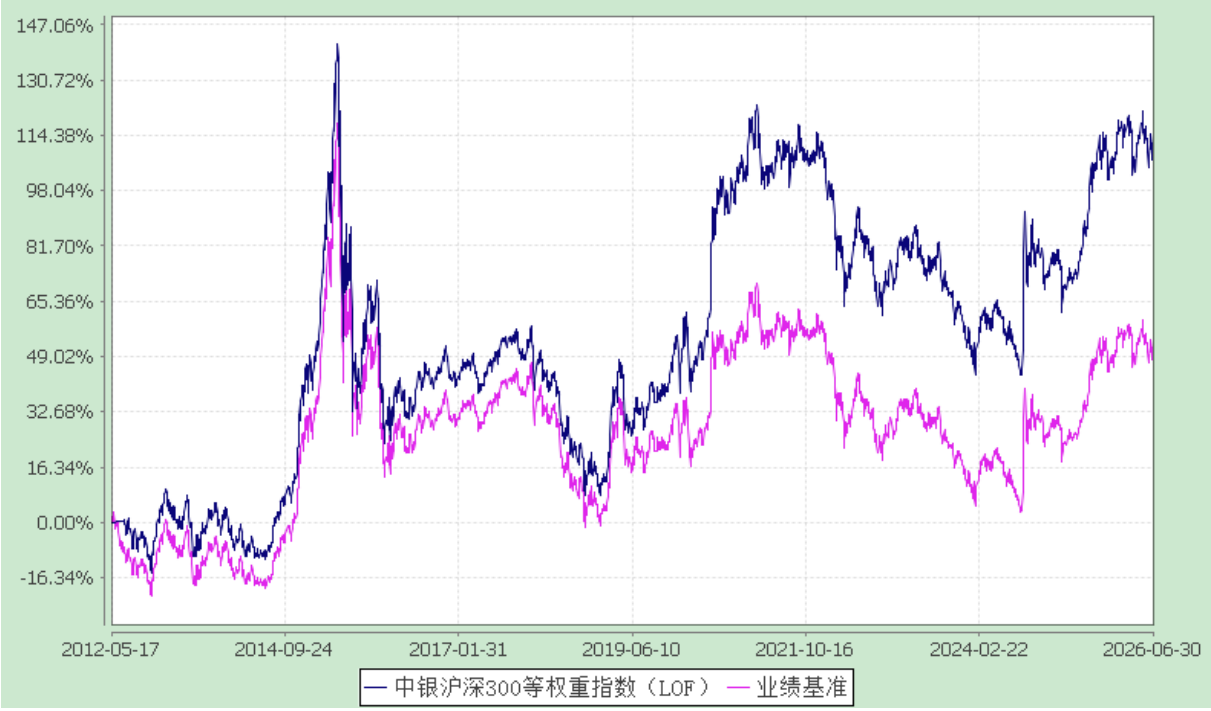
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.98%	1.05%	2.18%	1.06%	0.80%	-0.01%
过去六个月	0.56%	1.01%	-0.05%	1.02%	0.61%	-0.01%
过去一年	18.56%	0.96%	17.29%	0.97%	1.27%	-0.01%
过去三年	19.57%	1.09%	16.01%	1.12%	3.56%	-0.03%
过去五年	-1.14%	1.05%	-6.51%	1.08%	5.37%	-0.03%
过去七年	57.40%	1.09%	23.35%	1.12%	34.05%	-0.03%
过去十年	53.94%	1.08%	20.41%	1.11%	33.53%	-0.03%
自基金合同生效日起	109.97%	1.30%	50.14%	1.32%	59.83%	-0.02%

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

中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）

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

（2012 年 5 月 17 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。
李念	基金经理	2025-03-18	-	9	金融硕士。2018 年加入中银基金管理有限公司，曾任研究员。2025 年 3 月至今任中银中证央企红利 50 基金基金经理，2025 年 3 月至今任中银 300E 基金基金经理，2025 年 8 月至今任中银中证港股通互联网指数基金基金经理，2025 年 8 月至今任国企 ETF 基金基金经理，2026 年 3 月至今任中银创业板 50 基金基金经理，2026 年 4 月至今任中银中证科创创业人工智能指数基金基金经理，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. 宏观经济与市场回顾

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。主要央行货币政策路径分化：美联储谨慎观望，欧央行转向加息，日央行继续加息。

国内宏观方面，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。经济结构方面，AI 等新兴产业对出口、投资、价格等因素的贡献进一步抬升，传统动能在一季度发力后边际有所放缓。价格方面通胀读数呈上升趋势，对名义 GDP 增速的贡献抬升。整体上，中国经济仍然呈现出很强的活力与韧性，科技创新、产业升级与内需潜力释放仍在不断进行和强化过程中。

股票市场方面，2026 年上半年 A 股市场宽幅震荡，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，结构性行情特征明显。创业板指数上涨 35.58%表现亮眼，而上证 50 指数下跌 1.38%。代表大盘股表现的沪深 300 指数上涨 7.55%。沪深 300 等权指数与沪深

300 指数成分一致，相对削弱了大市值股票的主导效应，具备更强的分散化特征。2026 年 6 月指数成分股半年度调样对样本权重进行了再平衡。截至二季度末，相较沪深 300 指数，沪深 300 等权相对低配的前三个行业为电子、通信、银行，相对高配的前三个行业为交通运输、计算机、医药生物。

2. 投资策略和运作情况分析

本基金在报告期内严格遵守基金合同约定，采用完全复制策略跟踪指数，在因基金申赎导致基金资产发生变动时，根据市场的流动性情况采用量化模型优化交易以降低冲击成本和减小跟踪误差。

本报告期内，本基金跟踪误差主要来自于指数样本调整、申购赎回变动等情况导致的变化。报告期内，本基金整体运作平稳，日均跟踪偏离度及年化跟踪误差均控制在合同约定范围内，运作过程未发生风险。

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 0.56%，同期业绩比较基准收益率为-0.05%。

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，全球经济走势的关键变量仍在于中东局势及油价冲击的持续时间。国内方面，在 7 月中共中央政治局会议精神的指导下，财政脉冲有望再度抬升，传统动能增速预计回升。与此同时，新兴产业持续扩张，叠加全球产业链重构催生的产能周期上行，出口与高端制造业投资仍将构成经济的重要支撑力量。综合判断，上半年内外需分化、新旧动能分化的格局，预计下半年将趋于收窄。通胀整体或将维持偏平稳态势。在此背景下，A 股市场有望震荡向上，成长与价值轮动均衡。

沪深 300 等权指数与沪深 300 指数成分一致，主要投资于沪深市场中规模大、流动性好的股票标的，成分股整体经营稳健，汇聚较多行业龙头标的。沪深 300 等权指数采用等权重加权，等权结构天然具备“再平衡”优势，在风格轮动行情中能捕捉中小市值成分股的补涨机会。该指数适合作为宽基底仓，兼顾稳健与弹性，中长期具备配置价值。

本基金将严格按照基金合同规定，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

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年最多进行收益分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。

本报告期期末可供分配利润为 18,782,180.53 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

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

为减轻迷你基金固定费用支出给投资者造成的负担，切实保障基金份额持有人利益，本基金迷你期间由基金管理人承担本基金相关固定费用（包括信息披露费、审计费等）。

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：中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）

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	255,128.86	311,765.24
结算备付金		6,645.07	-
存出保证金		2,794.21	1,998.30
交易性金融资产	6.4.7.2	35,603,657.73	40,636,750.06
其中：股票投资		33,686,159.95	38,420,318.17
基金投资		-	-
债券投资		1,917,497.78	2,216,431.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		174,505.94	-
应收股利		-	-
应收申购款		108,352.64	103,565.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		36,151,084.45	41,054,079.15
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		76,248.26	-
应付赎回款		183,128.84	10,816.57
应付管理人报酬		22,404.79	25,906.32

应付托管费		4,480.95	5,181.27
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		51.74	7.88
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,473.35	2,514.63
负债合计		289,787.93	44,426.67
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	17,079,115.99	19,642,346.37
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	18,782,180.53	21,367,306.11
净资产合计		35,861,296.52	41,009,652.48
负债和净资产总计		36,151,084.45	41,054,079.15

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0997 元，基金份额总额 17,079,115.99 份。

6.2 利润表

会计主体：中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）

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		475,581.44	41,830.45
1.利息收入		650.51	1,064.88
其中：存款利息收入	6.4.7.9	650.51	1,064.88
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）		2,894,302.01	429,751.58
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,588,071.99	-21,486.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	14,568.30	19,303.55
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	291,661.72	431,934.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-2,428,935.83	-393,116.47
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	9,564.75	4,130.46

减：二、营业总支出		181,937.05	191,360.97
1．管理人报酬	6.4.10.2	150,837.61	158,856.95
2．托管费	6.4.10.2	30,167.48	31,771.40
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	27.62
其中：卖出回购金融资产支出		-	27.62
6. 信用减值损失		-	-
7．税金及附加		24.98	-
8．其他费用	6.4.7.17	906.98	705.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**293,644.39**	**-149,530.52**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**293,644.39**	**-149,530.52**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		293,644.39	-149,530.52

6.3 净资产变动表

会计主体：中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）

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	19,642,346.37	-	21,367,306.11	41,009,652.48
二、本期期初净资产	19,642,346.37	-	21,367,306.11	41,009,652.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,563,230.38	-	-2,585,125.58	-5,148,355.96
（一）、综合收益总额	-	-	293,644.39	293,644.39
（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）	-2,563,230.38	-	-2,878,769.97	-5,442,000.35
其中：1.基金申购	4,181,592.66	-	4,833,005.49	9,014,598.15

款				
2.基金赎回款	-6,744,823.04	-	-7,711,775.46	-14,456,598.50
（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	17,079,115.99	-	18,782,180.53	35,861,296.52
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	25,137,222.95	-	19,540,130.09	44,677,353.04
二、本期期初净资产	25,137,222.95	-	19,540,130.09	44,677,353.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,303,862.80	-	-1,161,404.53	-2,465,267.33
（一）、综合收益总额	-	-	-149,530.52	-149,530.52
（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）	-1,303,862.80	-	-1,011,874.01	-2,315,736.81
其中：1.基金申购款	1,783,744.38	-	1,269,219.14	3,052,963.52
2.基金赎回款	-3,087,607.18	-	-2,281,093.15	-5,368,700.33
（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	23,833,360.15	-	18,378,725.56	42,212,085.71

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

中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）（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[2011]1752 号《关于核准中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）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 2012 年 5 月 17 日正式生效，首次设立募集规模为 1,490,796,733.31 份基金份额。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人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、本基金的每一基金份额享有同等收益分配权；

2、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；

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收益分配基准日可供分配利润的 20%；

4、基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

5、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除息日的基金份额净值自动转为基金份额。

法律、法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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	255,128.86
等于：本金	255,104.00
加：应计利息	24.86
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	255,128.86

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		32,064,780.52	-	33,686,159.95	1,621,379.43
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,900,227.00	16,347.78	1,917,497.78	923.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,900,227.00	16,347.78	1,917,497.78	923.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		33,965,007.52	16,347.78	35,603,657.73	1,622,302.43

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	251.27
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,222.08
其中：交易所市场	3,222.08
银行间市场	-
应付利息	-
合计	3,473.35

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	19,642,346.37	19,642,346.37
本期申购	4,181,592.66	4,181,592.66
本期赎回（以“-”号填列）	-6,744,823.04	-6,744,823.04
本期末	17,079,115.99	17,079,115.99

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	41,292,252.34	-19,924,946.23	21,367,306.11
本期期初	41,292,252.34	-19,924,946.23	21,367,306.11
本期利润	2,722,580.22	-2,428,935.83	293,644.39

本期基金份额交易产生的变动数	-5,493,264.59	2,614,494.62	-2,878,769.97
其中：基金申购款	8,867,036.81	-4,034,031.32	4,833,005.49
基金赎回款	-14,360,301.40	6,648,525.94	-7,711,775.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,521,567.97	-19,739,387.44	18,782,180.53

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	624.03
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	20.86
其他	5.62
合计	650.51

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	15,279,067.27
减：卖出股票成本总额	12,676,941.27
减：交易费用	14,054.01
买卖股票差价收入	2,588,071.99

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	13,958.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	610.00
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	14,568.30

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）成交总额	1,416,888.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,399,514.00
减：应计利息总额	16,764.63
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	610.00

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	291,661.72
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	291,661.72

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	-2,428,935.83
——股票投资	-2,428,680.83
——债券投资	-255.00
——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	-2,428,935.83

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	9,564.75
合计	9,564.75

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	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	906.98
合计	906.98

注：本基金迷你期间由基金管理人承担本基金相关固定费用(包括审计费、信息披露费等)。

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金管理人的控股股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期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	150,837.61	158,856.95
其中：支付销售机构的客户维护费	61,233.07	62,216.46
应支付基金管理人的净管理费	89,604.54	96,640.49

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 0.75%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.75%÷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	30,167.48	31,771.40

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
招商银行股份有限公司	255,128.86	624.03	349,162.25	1,043.78

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

本报告期末，本基金持有 17,900 股基金管理人控股股东中国银行股份有限公司的 A 股普通股（2025 年 06 月 30 日：23,900 股），市值占本基金资产净值的比例为 0.29%（2025 年 06 月 30 日：0.32%）；本基金持有 2,800 股基金托管人招商银行股份有限公司的 A 股普通股（2025 年 06 月 30 日：2,900 股），市值占本基金资产净值的比例为 0.28%（2025 年 06 月 30 日：0.32%）。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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	255,128.86	-	-	-	255,128.86
结算备付金	6,645.07	-	-	-	6,645.07
存出保证金	2,794.21	-	-	-	2,794.21
交易性金融资产	1,917,497.78	-	-	33,686,159.95	35,603,657.73
应收清算款	-	-	-	174,505.94	174,505.94
应收申购款	1,300.00	-	-	107,052.64	108,352.64
资产总计	2,183,365.92	-	-	33,967,718.53	36,151,084.45
负债					
应付清算款	-	-	-	76,248.26	76,248.26
应付赎回款	-	-	-	183,128.84	183,128.84
应付管理人报酬	-	-	-	22,404.79	22,404.79
应付托管费	-	-	-	4,480.95	4,480.95
应交税费	-	-	-	51.74	51.74
其他负债	-	-	-	3,473.35	3,473.35
负债总计	-	-	-	289,787.93	289,787.93
利率敏感度缺口	2,183,365.92	-	-	33,677,930.60	35,861,296.52
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	311,765.24	-	-	-	311,765.24
存出保证金	1,998.30	-	-	-	1,998.30
交易性金融资产	2,216,431.89	-	-	38,420,318.17	40,636,750.06
应收申购款	-	-	-	103,565.55	103,565.55
资产总计	2,530,195.43	-	-	38,523,883.72	41,054,079.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,816.57	10,816.57
应付管理人报酬	-	-	-	25,906.32	25,906.32
应付托管费	-	-	-	5,181.27	5,181.27
应交税费	-	-	-	7.88	7.88
其他负债	-	-	-	2,514.63	2,514.63
负债总计	-	-	-	44,426.67	44,426.67
利率敏感度缺口	2,530,195.43	-	-	38,479,457.05	41,009,652.48

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	33,686,159.95	93.93	38,420,318.17	93.69
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	33,686,159.95	93.93	38,420,318.17	93.69

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 178	增加约 203
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 178	减少约 203

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	33,686,159.95	38,132,166.37
第二层次	1,917,497.78	2,504,583.69
第三层次	-	-
合计	35,603,657.73	40,636,750.06

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	33,686,159.95	93.18
	其中：股票	33,686,159.95	93.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,917,497.78	5.30
	其中：债券	1,917,497.78	5.30
	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	261,773.93	0.72
8	其他各项资产	285,652.79	0.79
9	合计	36,151,084.45	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	220,092.32	0.61
B	采矿业	1,190,749.24	3.32
C	制造业	18,766,423.31	52.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,298,646.26	3.62
E	建筑业	927,990.14	2.59
F	批发和零售业	217,790.52	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	1,844,047.10	5.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,348,796.79	6.55
J	金融业	5,836,212.85	16.27
K	房地产业	385,643.76	1.08
L	租赁和商务服务业	302,662.48	0.84
M	科学研究和技术服务业	132,478.64	0.37
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	109,271.54	0.30
R	文化、体育和娱乐业	105,355.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	33,686,159.95	93.93

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	688256	寒武纪	149	237,736.95	0.66
2	600176	中国巨石	3,087	224,980.56	0.63
3	688082	盛美上海	447	193,104.00	0.54
4	688521	芯原股份	515	191,137.10	0.53
5	688012	中微公司	405	189,742.50	0.53
6	600460	士兰微	3,400	185,844.00	0.52
7	002371	北方华创	205	181,334.80	0.51
8	300308	中际旭创	140	177,800.00	0.50
9	688396	华润微	1,753	171,005.15	0.48
10	600584	长电科技	1,600	165,680.00	0.46
11	688126	沪硅产业	4,149	165,503.61	0.46
12	600549	厦门钨业	1,900	161,880.00	0.45
13	300661	圣邦股份	1,122	160,984.56	0.45
14	002916	深南电路	346	158,433.40	0.44
15	688041	海光信息	422	156,266.60	0.44
16	600160	巨化股份	2,900	153,729.00	0.43
17	000657	中钨高新	1,600	153,152.00	0.43
18	301165	锐捷网络	1,900	152,855.00	0.43
19	688981	中芯国际	956	151,831.92	0.42
20	688008	澜起科技	489	151,541.10	0.42
21	000725	京东方 A	17,400	151,032.00	0.42
22	300408	三环集团	900	150,210.00	0.42
23	603260	合盛硅业	3,100	149,606.00	0.42
24	603019	中科曙光	1,380	147,977.40	0.41
25	300316	晶盛机电	2,400	144,960.00	0.40
26	002179	中航光电	3,112	143,774.40	0.40
27	301269	华大九天	1,200	143,304.00	0.40
28	300433	蓝思科技	2,650	142,199.00	0.40
29	301308	江波龙	200	140,760.00	0.39
30	002049	紫光国微	1,580	140,225.00	0.39
31	603986	兆易创新	172	140,180.00	0.39

32	000100	TCL 科技	23,965	139,476.30	0.39
33	688047	龙芯中科	900	139,203.00	0.39
34	600183	生益科技	800	138,720.00	0.39
35	000776	广发证券	5,912	138,340.80	0.39
36	600999	招商证券	6,523	137,635.30	0.38
37	601872	招商轮船	7,800	137,046.00	0.38
38	002837	英维克	1,700	135,252.00	0.38
39	601111	中国国航	22,100	133,705.00	0.37
40	300750	宁德时代	340	133,623.40	0.37
41	600522	中天科技	2,200	133,496.00	0.37
42	000977	浪潮信息	1,900	133,000.00	0.37
43	603259	药明康德	1,064	132,478.64	0.37
44	603893	瑞芯微	700	131,852.00	0.37
45	002600	领益智造	7,600	131,784.00	0.37
46	002384	东山精密	500	131,175.00	0.37
47	601066	中信建投	4,500	130,815.00	0.36
48	300014	亿纬锂能	2,000	130,060.00	0.36
49	300394	天孚通信	428	129,547.04	0.36
50	688183	生益电子	978	129,487.20	0.36
51	000988	华工科技	700	129,227.00	0.36
52	300803	指南针	1,400	128,338.00	0.36
53	600030	中信证券	4,430	127,273.90	0.35
54	600276	恒瑞医药	2,445	127,237.80	0.35
55	300059	东方财富	6,205	126,457.90	0.35
56	300442	润泽科技	1,500	124,605.00	0.35
57	002422	科伦药业	3,200	123,264.00	0.34
58	601901	方正证券	17,100	123,120.00	0.34
59	002415	海康威视	3,584	122,572.80	0.34
60	002463	沪电股份	800	122,240.00	0.34
61	601211	国泰海通	6,699	121,921.80	0.34
62	000938	紫光股份	4,224	121,904.64	0.34
63	002475	立讯精密	1,730	121,792.00	0.34
64	002558	巨人网络	4,400	121,264.00	0.34
65	601336	新华保险	2,023	120,692.18	0.34
66	002202	金风科技	5,000	119,500.00	0.33
67	601995	中金公司	3,300	119,295.00	0.33
68	601688	华泰证券	5,750	118,565.00	0.33
69	002709	天赐材料	2,300	118,289.00	0.33
70	605117	德业股份	1,114	118,284.52	0.33
71	000792	盐湖股份	3,900	117,741.00	0.33
72	000630	铜陵有色	18,500	117,660.00	0.33
73	688506	百利天恒	400	117,612.00	0.33
74	600362	江西铜业	2,700	116,910.00	0.33
75	601788	光大证券	8,100	116,883.00	0.33

76	601628	中国人寿	3,300	116,655.00	0.33
77	600958	东方证券	12,356	116,640.64	0.33
78	600026	中远海能	6,500	116,610.00	0.33
79	300502	新易盛	192	116,544.00	0.32
80	600346	恒力石化	6,580	116,531.80	0.32
81	002466	天齐锂业	1,900	116,508.00	0.32
82	603501	豪威集团	1,225	116,191.25	0.32
83	600061	国投资本	17,720	116,066.00	0.32
84	601878	浙商证券	12,200	115,900.00	0.32
85	601012	隆基绿能	8,817	115,679.04	0.32
86	601881	中国银河	9,200	115,644.00	0.32
87	601138	工业富联	1,600	115,440.00	0.32
88	603296	华勤技术	1,540	114,375.80	0.32
89	601377	兴业证券	18,936	114,373.44	0.32
90	600196	复星医药	5,079	114,125.13	0.32
91	603993	洛阳钼业	6,500	114,075.00	0.32
92	601021	春秋航空	2,500	113,950.00	0.32
93	688036	传音控股	1,932	113,891.40	0.32
94	002460	赣锋锂业	1,740	113,796.00	0.32
95	002714	牧原股份	3,248	113,647.52	0.32
96	601319	中国人保	16,800	113,568.00	0.32
97	000166	申万宏源	25,720	113,168.00	0.32
98	000963	华东医药	4,021	113,070.52	0.32
99	300418	昆仑万维	2,800	113,008.00	0.32
100	600029	南方航空	21,700	112,406.00	0.31
101	601456	国联民生	12,700	112,268.00	0.31
102	600918	中泰证券	21,100	112,252.00	0.31
103	600309	万华化学	1,640	112,192.40	0.31
104	002736	国信证券	11,200	111,888.00	0.31
105	600760	中航沈飞	2,720	111,792.00	0.31
106	601117	中国化学	15,200	111,720.00	0.31
107	601059	信达证券	6,900	111,711.00	0.31
108	601136	首创证券	8,000	111,600.00	0.31
109	002311	海大集团	2,500	111,525.00	0.31
110	600115	中国东航	29,200	111,252.00	0.31
111	600690	海尔智家	5,434	110,907.94	0.31
112	300033	同花顺	460	110,860.00	0.31
113	002236	大华股份	6,720	110,812.80	0.31
114	302132	中航成飞	1,900	110,808.00	0.31
115	601985	中国核电	12,250	110,617.50	0.31
116	600009	上海机场	4,762	110,002.20	0.31
117	000768	中航西飞	5,371	109,998.08	0.31
118	603288	海天味业	3,315	109,925.40	0.31
119	000301	东方盛虹	9,600	109,920.00	0.31

120	600372	中航机载	10,100	109,585.00	0.31
121	600406	国电南瑞	4,784	109,314.40	0.30
122	300015	爱尔眼科	13,229	109,271.54	0.30
123	002648	卫星化学	4,640	108,993.60	0.30
124	603799	华友钴业	2,255	108,826.30	0.30
125	300760	迈瑞医疗	800	108,664.00	0.30
126	601658	邮储银行	22,000	108,460.00	0.30
127	600886	国投电力	8,140	108,343.40	0.30
128	688472	阿特斯	9,999	108,189.18	0.30
129	300122	智飞生物	9,250	108,132.50	0.30
130	600111	北方稀土	2,250	108,112.50	0.30
131	000651	格力电器	2,882	108,075.00	0.30
132	601877	正泰电器	4,300	107,801.00	0.30
133	600893	航发动力	2,800	107,352.00	0.30
134	000063	中兴通讯	2,960	107,122.40	0.30
135	688271	联影医疗	1,055	106,797.65	0.30
136	002353	杰瑞股份	700	106,750.00	0.30
137	001280	中国铀业	1,600	106,720.00	0.30
138	600118	中国卫星	1,300	106,665.00	0.30
139	688111	金山办公	500	106,525.00	0.30
140	300498	温氏股份	8,640	106,444.80	0.30
141	300628	亿联网络	3,140	106,194.80	0.30
142	301236	软通动力	2,500	106,125.00	0.30
143	600019	宝钢股份	19,498	105,874.14	0.30
144	002602	世纪华通	7,500	105,750.00	0.29
145	600900	长江电力	3,988	105,562.36	0.29
146	600570	恒生电子	4,974	105,399.06	0.29
147	002938	鹏鼎控股	1,000	105,380.00	0.29
148	300251	光线传媒	9,500	105,355.00	0.29
149	001965	招商公路	11,500	105,340.00	0.29
150	002142	宁波银行	3,546	105,280.74	0.29
151	002241	歌尔股份	4,672	105,260.16	0.29
152	600660	福耀玻璃	2,081	104,965.64	0.29
153	300274	阳光电源	660	104,953.20	0.29
154	600010	包钢股份	47,040	104,899.20	0.29
155	601018	宁波港	33,300	104,895.00	0.29
156	600018	上港集团	22,200	104,784.00	0.29
157	601607	上海医药	6,800	104,720.00	0.29
158	601169	北京银行	21,367	104,698.30	0.29
159	002074	国轩高科	3,800	104,538.00	0.29
160	300866	安克创新	1,000	104,500.00	0.29
161	601868	中国能建	39,100	104,397.00	0.29
162	601229	上海银行	12,018	104,316.24	0.29
163	601186	中国铁建	17,500	104,125.00	0.29

164	000999	华润三九	4,626	104,038.74	0.29
165	000408	藏格矿业	1,500	103,980.00	0.29
166	300476	胜宏科技	300	103,929.00	0.29
167	600015	华夏银行	16,249	103,831.11	0.29
168	000001	平安银行	10,331	103,826.55	0.29
169	002028	思源电气	600	103,800.00	0.29
170	000538	云南白药	2,190	103,740.30	0.29
171	000596	古井贡酒	1,300	103,740.00	0.29
172	002493	荣盛石化	9,650	103,737.50	0.29
173	601727	上海电气	14,800	103,600.00	0.29
174	000858	五粮液	1,400	103,600.00	0.29
175	601398	工商银行	14,650	103,575.50	0.29
176	600150	中国船舶	3,064	103,532.56	0.29
177	000708	中信特钢	8,200	103,484.00	0.29
178	600674	川投能源	7,300	103,441.00	0.29
179	688009	中国通号	21,721	103,391.96	0.29
180	000002	万 科 A	34,900	103,304.00	0.29
181	600887	伊利股份	4,308	103,219.68	0.29
182	600919	江苏银行	9,570	103,164.60	0.29
183	600085	同仁堂	4,456	102,978.16	0.29
184	600438	通威股份	8,500	102,935.00	0.29
185	601328	交通银行	16,004	102,905.72	0.29
186	603369	今世缘	4,337	102,830.27	0.29
187	600089	特变电工	4,570	102,825.00	0.29
188	688223	晶科能源	21,635	102,766.25	0.29
189	600221	海航控股	76,100	102,735.00	0.29
190	601888	中国中免	1,912	102,693.52	0.29
191	300124	汇川技术	1,548	102,678.84	0.29
192	601838	成都银行	5,800	102,660.00	0.29
193	601766	中国中车	19,715	102,518.00	0.29
194	601669	中国电建	21,799	102,455.30	0.29
195	601988	中国银行	17,900	102,388.00	0.29
196	600233	圆通速递	6,500	102,375.00	0.29
197	300999	金龙鱼	4,400	102,344.00	0.29
198	601698	中国卫通	3,381	102,275.25	0.29
199	600795	国电电力	21,900	102,273.00	0.29
200	601800	中国交建	17,900	102,209.00	0.29
201	000895	双汇发展	4,549	101,897.60	0.28
202	600039	四川路桥	13,020	101,816.40	0.28
203	300450	先导智能	2,500	101,800.00	0.28
204	605499	东鹏饮料	824	101,706.32	0.28
205	600482	中国动力	3,100	101,680.00	0.28
206	601360	三六零	11,700	101,673.00	0.28
207	601288	农业银行	16,750	101,672.50	0.28

208	600741	华域汽车	6,550	101,656.00	0.28
209	600050	中国联通	25,400	101,600.00	0.28
210	601939	建设银行	10,550	101,596.50	0.28
211	601818	光大银行	35,150	101,583.50	0.28
212	601058	赛轮轮胎	8,800	101,464.00	0.28
213	000625	长安汽车	14,150	101,455.50	0.28
214	601166	兴业银行	6,125	101,430.00	0.28
215	002001	新和成	3,564	101,288.88	0.28
216	601998	中信银行	14,600	101,178.00	0.28
217	300896	爱美客	1,160	101,152.00	0.28
218	601816	京沪高铁	22,300	101,019.00	0.28
219	601668	中国建筑	23,266	100,974.44	0.28
220	002230	科大讯飞	2,472	100,956.48	0.28
221	300832	新产业	2,400	100,800.00	0.28
222	600875	东方电气	3,500	100,695.00	0.28
223	601633	长城汽车	6,672	100,680.48	0.28
224	601390	中国中铁	24,100	100,497.00	0.28
225	600025	华能水电	11,300	100,457.00	0.28
226	600000	浦发银行	11,666	100,444.26	0.28
227	002027	分众传媒	20,744	100,400.96	0.28
228	600515	海南机场	36,600	100,284.00	0.28
229	601318	中国平安	2,100	100,254.00	0.28
230	003816	中国广核	25,600	100,096.00	0.28
231	002352	顺丰控股	3,200	100,032.00	0.28
232	601006	大秦铁路	21,650	99,806.50	0.28
233	601618	中国中冶	40,900	99,796.00	0.28
234	601077	渝农商行	16,300	99,593.00	0.28
235	600415	小商品城	9,800	99,568.00	0.28
236	600016	民生银行	30,912	99,536.64	0.28
237	000617	中油资本	15,100	99,509.00	0.28
238	600036	招商银行	2,800	99,400.00	0.28
239	300413	芒果超媒	6,790	99,337.70	0.28
240	600028	中国石化	22,257	99,266.22	0.28
241	002050	三花智控	2,262	99,143.46	0.28
242	000333	美的集团	1,311	99,019.83	0.28
243	000338	潍柴动力	3,632	98,972.00	0.28
244	002304	洋河股份	2,587	98,694.05	0.28
245	600905	三峡能源	26,600	98,686.00	0.28
246	601601	中国太保	3,460	98,679.20	0.28
247	600011	华能国际	13,000	98,670.00	0.28
248	000157	中联重科	14,150	98,625.50	0.28
249	600926	杭州银行	6,820	98,549.00	0.27
250	600436	片仔癀	900	98,352.00	0.27
251	600426	华鲁恒升	4,100	98,072.00	0.27

252	000568	泸州老窖	1,265	98,062.80	0.27
253	601899	紫金矿业	3,900	98,046.00	0.27
254	002920	德赛西威	1,200	97,800.00	0.27
255	601919	中远海控	7,340	97,328.40	0.27
256	601100	恒立液压	904	97,234.24	0.27
257	600585	海螺水泥	5,710	96,784.50	0.27
258	600023	浙能电力	18,400	96,784.00	0.27
259	600031	三一重工	5,600	96,768.00	0.27
260	601009	南京银行	9,777	96,694.53	0.27
261	600066	宇通客车	3,600	96,516.00	0.27
262	600048	保利发展	20,785	96,234.55	0.27
263	600845	宝信软件	5,781	96,138.03	0.27
264	600489	中金黄金	5,300	95,665.00	0.27
265	600588	用友网络	10,349	95,003.82	0.26
266	600219	南山铝业	23,800	94,962.00	0.26
267	600027	华电国际	21,300	94,785.00	0.26
268	600941	中国移动	1,100	94,743.00	0.26
269	601916	浙商银行	36,000	94,680.00	0.26
270	600547	山东黄金	4,088	94,391.92	0.26
271	601825	沪农商行	12,600	94,374.00	0.26
272	601238	广汽集团	18,540	94,183.20	0.26
273	600809	山西汾酒	860	94,058.20	0.26
274	600600	青岛啤酒	1,800	94,014.00	0.26
275	002625	光启技术	3,100	93,992.00	0.26
276	600989	宝丰能源	4,600	93,518.00	0.26
277	600104	上汽集团	9,578	93,481.28	0.26
278	601728	中国电信	17,900	92,901.00	0.26
279	601689	拓普集团	1,645	92,810.90	0.26
280	002594	比亚迪	1,162	92,611.40	0.26
281	601127	赛力斯	1,500	91,875.00	0.26
282	000975	山金国际	5,400	91,800.00	0.26
283	600803	新奥股份	5,800	91,640.00	0.26
284	688303	大全能源	5,253	91,559.79	0.26
285	603392	万泰生物	3,381	91,185.57	0.25
286	000807	云铝股份	4,100	90,774.00	0.25
287	001391	国货航	22,300	90,761.00	0.25
288	601600	中国铝业	11,022	90,600.84	0.25
289	002532	天山铝业	8,300	89,059.00	0.25
290	000425	徐工机械	10,960	88,666.40	0.25
291	601088	中国神华	2,250	87,840.00	0.24
292	600930	华电新能	18,300	87,291.00	0.24
293	601857	中国石油	10,050	87,234.00	0.24
294	001979	招商蛇口	13,347	85,821.21	0.24
295	600519	贵州茅台	70	82,984.30	0.23

296	600938	中国海油	3,000	81,450.00	0.23
297	601225	陕西煤业	3,900	79,365.00	0.22
298	601898	中煤能源	6,400	77,952.00	0.22
299	600188	兖矿能源	4,330	76,944.10	0.21

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	301308	江波龙	153,473.00	0.37
2	600549	厦门钨业	128,339.00	0.31
3	000657	中钨高新	125,525.00	0.31
4	688521	芯原股份	118,872.75	0.29
5	688183	生益电子	115,815.72	0.28
6	002837	英维克	114,922.00	0.28
7	600221	海航控股	114,538.00	0.28
8	002532	天山铝业	113,274.00	0.28
9	001280	中国铀业	113,117.00	0.28
10	002602	世纪华通	112,886.00	0.28
11	603986	兆易创新	110,063.00	0.27
12	002202	金风科技	108,612.00	0.26
13	301165	锐捷网络	107,910.00	0.26
14	601727	上海电气	105,907.00	0.26
15	000988	华工科技	104,960.00	0.26
16	300450	先导智能	104,934.00	0.26
17	002558	巨人网络	104,434.00	0.25
18	002353	杰瑞股份	102,605.00	0.25
19	600118	中国卫星	101,960.00	0.25
20	601111	中国国航	70,471.00	0.17

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	603986	兆易创新	312,787.00	0.76
2	600522	中天科技	272,042.00	0.66

3	002384	东山精密	257,745.00	0.63
4	300408	三环集团	256,887.80	0.63
5	600176	中国巨石	226,956.00	0.55
6	600183	生益科技	204,920.00	0.50
7	300782	卓胜微	195,238.60	0.48
8	002938	鹏鼎控股	177,200.00	0.43
9	688012	中微公司	172,676.02	0.42
10	688187	时代电气	151,865.83	0.37
11	601298	青岛港	151,804.00	0.37
12	300394	天孚通信	150,946.00	0.37
13	000983	山西焦煤	150,519.00	0.37
14	600584	长电科技	145,738.00	0.36
15	688008	澜起科技	144,933.72	0.35
16	002916	深南电路	141,309.00	0.34
17	600377	宁沪高速	141,157.00	0.34
18	603195	公牛集团	140,866.60	0.34
19	002463	沪电股份	139,537.00	0.34
20	601872	招商轮船	139,264.00	0.34

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	10,371,463.88
卖出股票的收入（成交）总额	15,279,067.27

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	1,917,497.78	5.35
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	1,917,497.78	5.35

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	8,000	808,393.86	2.25
2	019827	26 国债 01	6,000	603,889.15	1.68
3	019785	25 国债 13	4,000	405,050.19	1.13
4	019835	26 国债 09	1,000	100,164.58	0.28

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 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	2,794.21
2	应收清算款	174,505.94

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	108,352.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	285,652.79

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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
1,424	11,993.76	22,230.78	0.1302%	17,056,885.21	99.8698%

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	29,663.29	0.1737%

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 5 月 17 日）基金份额总额	1,490,796,733.31
本报告期期初基金份额总额	19,642,346.37
本报告期基金总申购份额	4,181,592.66
减：本报告期基金总赎回份额	6,744,823.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,079,115.99

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	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中银证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

国海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	25,650,531.15	100.00%	4,768.33	100.00%	-

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	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2,000,523.00	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	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）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	中国证监会规定媒介	2026-03-18

	务方式的公告		
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	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
6	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）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	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026-05-20
10	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）基金合同	中国证监会规定媒介	2026-05-20
11	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）托管协议	中国证监会规定媒介	2026-05-20
12	中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2026 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2026-05-20
13	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
14	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
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	2026-06-24

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证监会批准中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）募集的文件；

2、《中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、《中银沪深 300 等权重指数证券投资基金（LOF）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